

【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29年9月15日

【計算期間】 第24特定期間（自平成28年12月21日 至平成29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】 03-6703-4930

【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まます。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



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

<p>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。</p>
<p>■柔軟性の高い運用</p> <ul style="list-style-type: none"> セクター間の相関や各市場に対する運動性に配慮し、価格変動を抑え、魅力的な収益率やインカム収入の確保を目指します。 償還年限、セクター、地域配分、通貨配分等に制約を設けず、運用チームの判断による柔軟な運用を目指します。
<p>■リスクコントロール</p> <ul style="list-style-type: none"> 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。

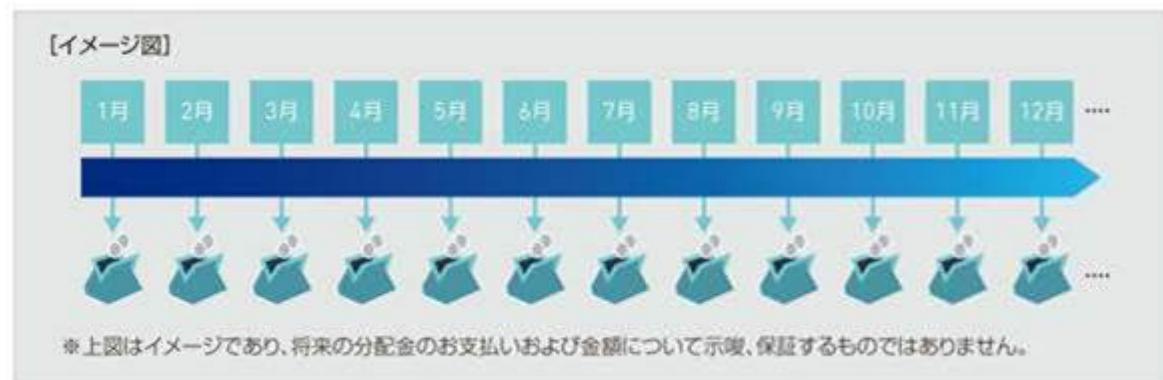
- b. 投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。
- ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券（ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。）
 - ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券（ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。）
- 投資対象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

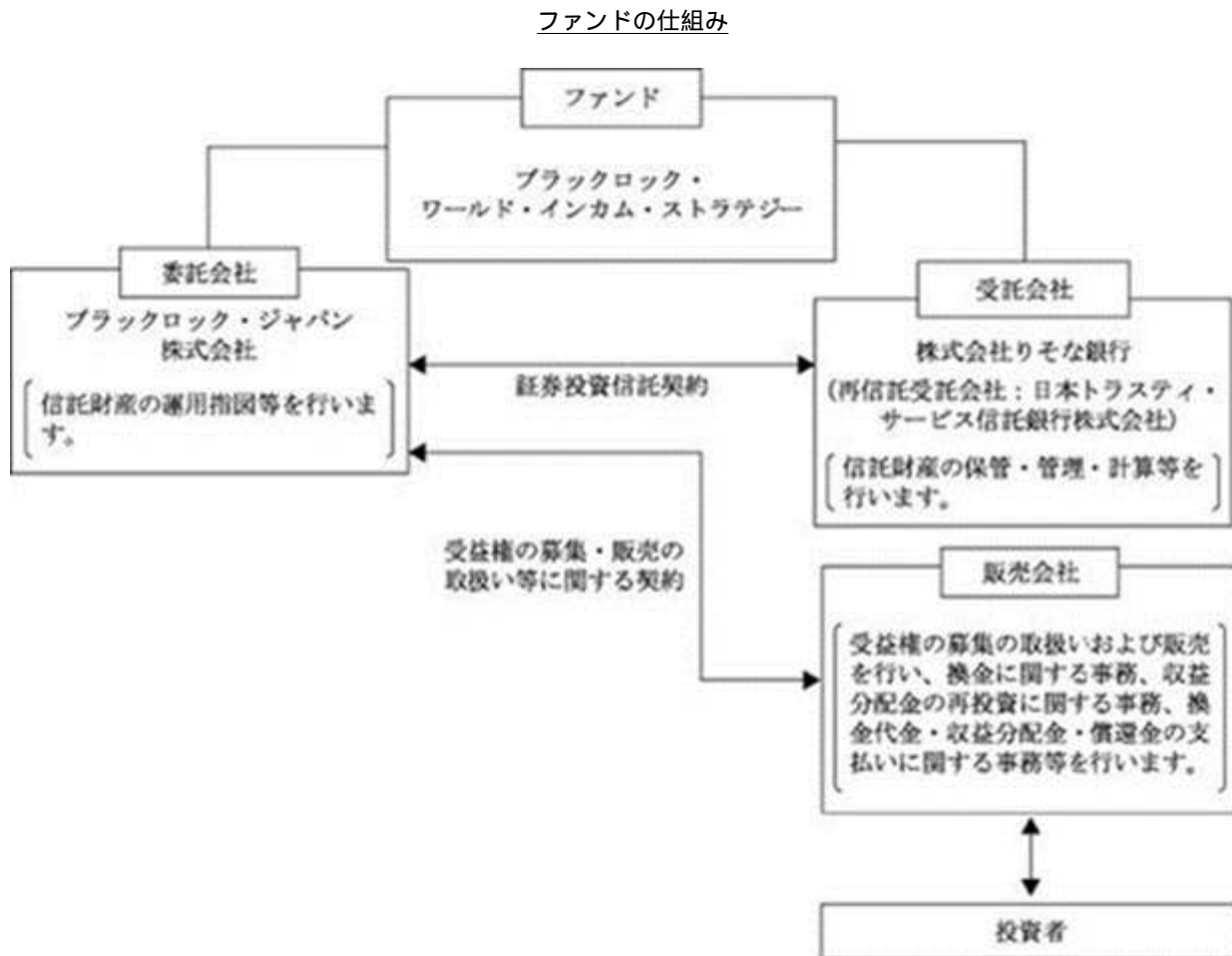


e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2)【ファンドの沿革】

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

(3)【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

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

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2017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があります。

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

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

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

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

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

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

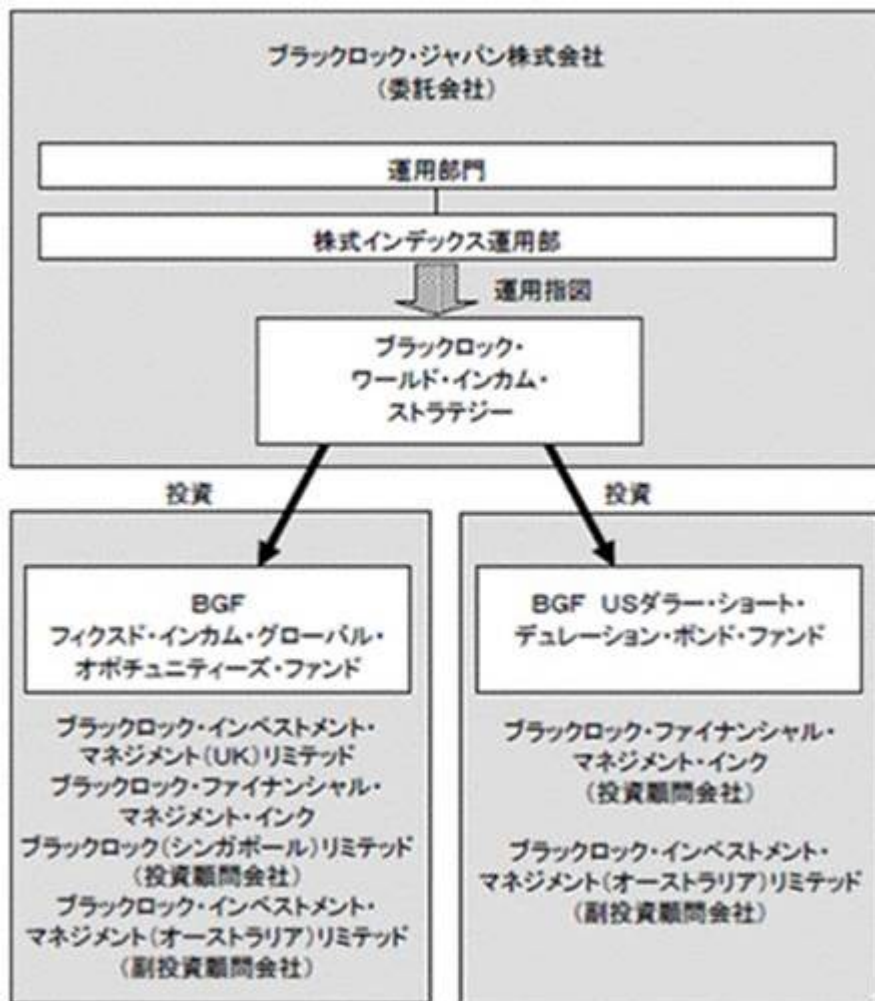
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

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：6名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

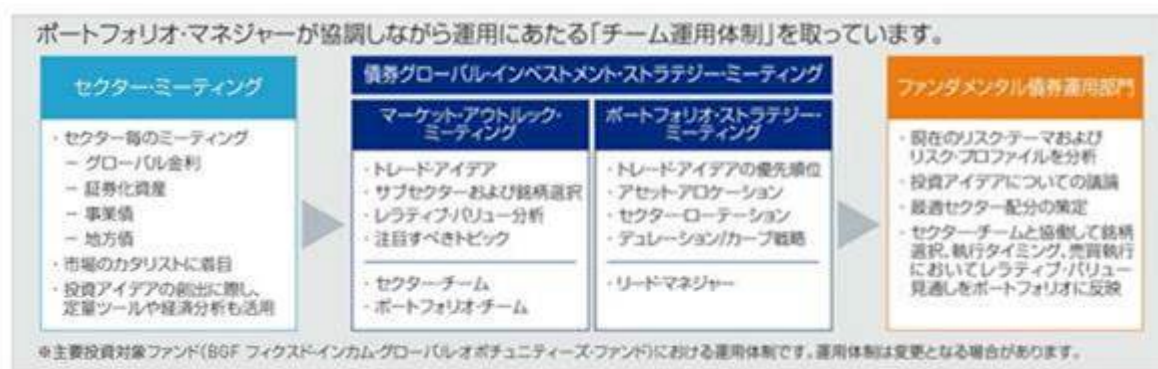
ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

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

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

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

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



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5.42兆ドル^{*}（約604兆円）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。

* 2017年3月末現在。（円換算レートは1ドル=111.43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) 配当金、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、諸費用(消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額(以下「消費税等相当額」といいます。))を含みます。以下同じ。)、信託報酬(消費税等相当額を含みます。以下同じ。)を控除した後、その残額を投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

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

b. 時効

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

収益分配金に関する留意事項

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



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

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



(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、配分方針に基づき、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率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(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】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

基準価額の変動要因

a. 金利変動リスク

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

b. 信用リスク

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

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

c. 期限前償還リスク

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

d. 為替変動リスク

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

e. カントリー・リスク

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

f. デリバティブ取引のリスク

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

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

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

b. ファンドの繰上償還

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

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

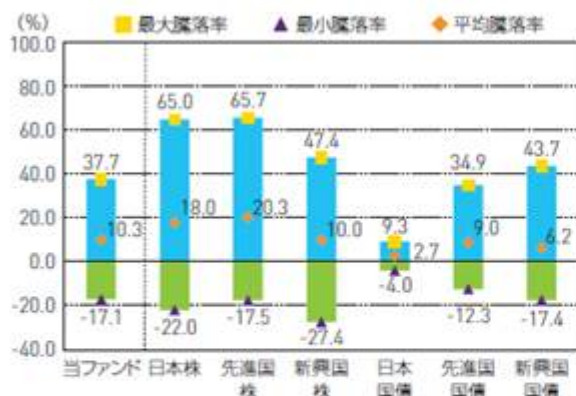
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

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

(2012年7月～2017年6月)



※上記グラフは、2012年7月～2017年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…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・ディバーシファイド(円ベース)

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2012年7月～2017年6月)



※上記グラフは、2012年7月～2017年6月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

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

<各指数について>

東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所((株)東京証券取引所)の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行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・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額の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%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

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

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

委託会社は、年0.108%（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ます。

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

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

換金時および償還時の課税について

a．個人の投資者の場合

換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。

b．法人の投資者の場合

換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」がご利用になれます。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2017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29年6月末現在)

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,786,544,690	97.02
内 ルクセンブルグ	1,786,544,690	97.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	54,798,820	2.98
純資産総額	1,841,343,510	100.00

(2)【投資資産】(平成29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	1,559,218	1,131.19	1,763,788,136	1,133.43	1,767,280,785	95.98
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	11,927	1,612.79	19,237,187	1,615.03	19,263,905	1.05

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.02

(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29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
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

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
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

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
第23特定期間	第130期(平成28年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(平成28年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(平成28年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(平成28年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(平成28年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(平成28年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(平成29年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(平成29年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(平成29年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(平成29年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(平成29年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(平成29年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
	平成28年6月末現在	2,233,007,331		0.8965	
	平成28年7月末現在	2,278,968,050		0.9182	
	平成28年8月末現在	2,237,108,011		0.9086	
	平成28年9月末現在	2,192,670,993		0.8907	
	平成28年10月末現在	2,250,366,738		0.9220	
	平成28年11月末現在	2,302,159,944		0.9815	
	平成28年12月末現在	2,363,436,597		1.0212	
	平成29年1月末現在	2,322,519,546		1.0025	
	平成29年2月末現在	2,211,948,762		0.9951	
	平成29年3月末現在	2,180,415,638		0.9899	
	平成29年4月末現在	2,064,428,083		0.9803	
	平成29年5月末現在	2,011,551,929		0.9788	
	平成29年6月末現在	1,841,343,510		0.9914	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
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
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

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
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
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
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
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

特定期間	計算期間	収益率(%)
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
第23特定期間	第130期	2.5
	第131期	4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
	第135期	5.9
第24特定期間	第136期	1.0
	第137期	1.6
	第138期	0.1
	第139期	3.0
	第140期	2.4
	第141期	0.8

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

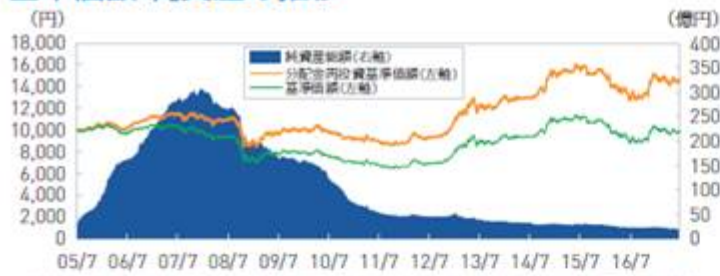
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	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
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238

(参考情報)

運用実績

2017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。

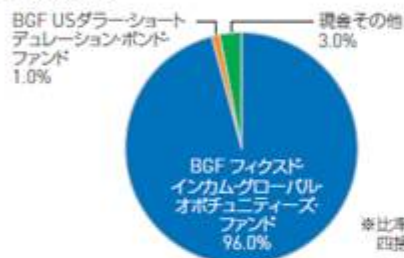
分配の推移

設定来累計		3,580円
直近1年間累計		240円
第137期	2017年2月	20円
第138期	2017年3月	20円
第139期	2017年4月	20円
第140期	2017年5月	20円
第141期	2017年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



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

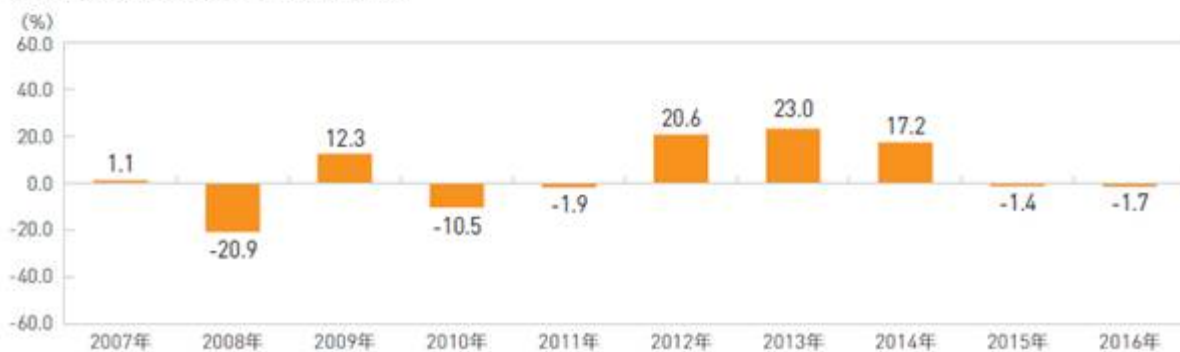
組入上位10銘柄*(%)

	銘柄名	種別	比率
1	FNMA 15YR TBA(REG B) 2.5 07/18/2017	政府系不動産担保証券	11.3
2	FGOLD 30YR 4% HLB 150K 2016	政府系不動産担保証券	1.9
3	TREASURY BOND (OTR) 3 05/15/2047	国債	1.4
4	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2019	国債	1.2
5	FNMA 30YR 4% HLB 150K 2016	政府系不動産担保証券	1.0
6	FNMA 30YR 3.5% SHLB 175K 2015	政府系不動産担保証券	1.0
7	SPDR BLOOMBERG BARCLAYS HIGH YIELD	その他	0.9
8	FNMA 30YR 3.5% SHLB 175K 2016	政府系不動産担保証券	0.9
9	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2020	国債	0.9
10	FNMA 30YR 3.5% HLB 150K 2016	政府系不動産担保証券	0.8

*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12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。

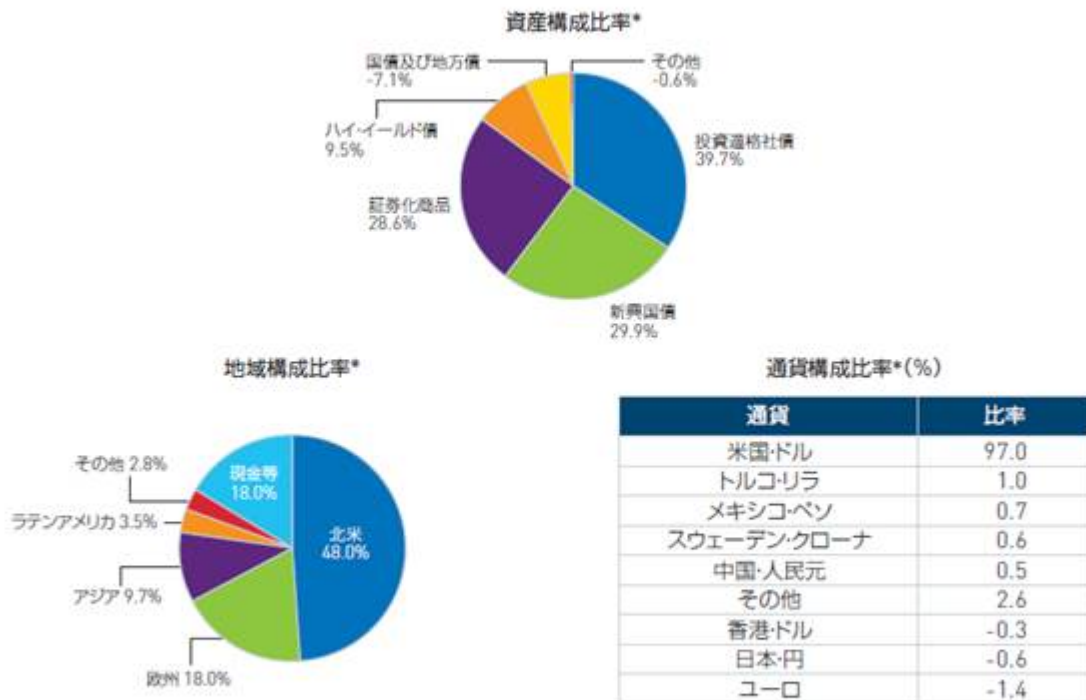


※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。
※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

2017年6月末現在

主要投資対象ファンドの主な資産の状況

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



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

投資者は販売会社に、購入と同時にまたは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時までには受け付けたものを当日のお申込みとします。受付時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとします。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

- a . 購入受付日の翌営業日の基準価額の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、販売会社により下記と異なる換金単位を別に定める場合があります。また、取り扱いを行うコースは、各販売会社により異なります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

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

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

(2) 換金不可日

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

(3) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(4) 換金受付の制限

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

(5) 換金代金の支払い

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

(6) 換金の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

当ファンドにおいて基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に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。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c．a．およびb．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

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

信託約款の変更

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

- e．委託会社は、この信託約款の変更を行わないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa．～e．の規定にしていますが、

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、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

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

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

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

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

(4) 反対者の買取請求権

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

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成28年12月21日から平成29年6月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (平成28年12月20日現在)	当特定期間末 (平成29年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	227	563
金銭信託	23,691,284	18,647,855
投資証券	2,305,339,577	1,864,176,440
派生商品評価勘定	5,648	14,471
未収入金	57,058,457	149,765,094
流動資産合計	2,386,095,193	2,032,604,423
資産合計		
	2,386,095,193	2,032,604,423
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	4,637,171	3,895,488
未払解約金	-	102,200,235
未払受託者報酬	80,182	69,354
未払委託者報酬	2,806,705	2,427,696
その他未払費用	200,469	173,395
流動負債合計	7,724,527	108,766,168
負債合計		
	7,724,527	108,766,168
純資産の部		
元本等		
元本	2,318,585,887	1,947,744,238
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,784,779	23,905,983
（分配準備積立金）	401,884,121	330,117,322
元本等合計	2,378,370,666	1,923,838,255
純資産合計		
	2,378,370,666	1,923,838,255
負債純資産合計		
	2,386,095,193	2,032,604,423

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自 平成28年 6月21日 至 平成28年12月20日)	当特定期間 (自 平成28年12月21日 至 平成29年 6月20日)
営業収益		
受取配当金	41,209,437	35,317,237
受取利息	1,388	2,391
有価証券売買等損益	25,069,356	28,089,680
為替差損益	256,560,352	107,782,204
営業収益合計	322,840,533	44,372,896
営業費用		
受託者報酬	487,443	470,713
委託者報酬	17,062,136	16,476,441
その他費用	1,531,728	1,459,185
営業費用合計	19,081,307	18,406,339
営業利益又は営業損失()	303,759,226	62,779,235
経常利益又は経常損失()	303,759,226	62,779,235
当期純利益又は当期純損失()	303,759,226	62,779,235
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()	4,070,490	2,038,277
期首剰余金又は期首欠損金()	221,702,434	59,784,779
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,878,495	2,894,783
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,878,495	2,894,783
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,972,235	52,074
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,972,235	52,074
分配金	29,107,783	25,792,513
期末剰余金又は期末欠損金()	59,784,779	23,905,983

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

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

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (平成28年12月20日現在)	当特定期間末 (平成29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	2,318,585,887口	1,947,744,238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 23,905,983円
3 1口当たり純資産額	1.0258円	0.9877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28年6月21日 至 平成28年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第130期計算期間(平成28年6月21日～平成28年7月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(6,068,320円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(120,351,619円)、分配準備積立金(426,895,447円)により、分配対象収益は553,315,386円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,981,577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131期計算期間(平成28年7月21日～平成28年8月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,239,236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)(120,294,598円)、分配準備積立金(426,111,281円)により、分配対象収益は549,645,115円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,964,061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132期計算期間(平成28年8月23日～平成28年9月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(6,294,115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)(119,718,811円)、分配準備積立金(420,590,800円)により、分配対象収益は546,603,726円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,924,221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133期計算期間(平成28年9月21日～平成28年10月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(6,250,641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)(119,551,547円)、分配準備積立金(419,620,617円)により、分配対象収益は545,422,805円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,901,427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134期計算期間(平成28年10月21日～平成28年11月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(6,911,114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)(114,984,606円)、分配準備積立金(403,249,360円)により、分配対象収益は525,145,080円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,699,326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135期計算期間(平成28年11月22日～平成28年12月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(6,776,263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)(113,817,554円)、分配準備積立金(399,745,029円)により、分配対象収益は520,338,846円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,637,171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28年12月21日 至 平成29年 6月20日)
分配金の計算過程	<p>第136期計算期間(平成28年12月21日～平成29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(2,739,634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)(113,940,163円)、分配準備積立金(400,739,044円)により、分配対象収益は517,418,841円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,627,975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137期計算期間(平成29年 1月21日～平成29年 2月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,725,485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)(112,079,654円)、分配準備積立金(383,018,135円)により、分配対象収益は497,823,274円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,468,297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138期計算期間(平成29年 2月21日～平成29年 3月21日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,511,590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)(111,120,814円)、分配準備積立金(376,578,802円)により、分配対象収益は490,211,206円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,417,076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139期計算期間(平成29年 3月22日～平成29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(2,578,412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)(106,184,771円)、分配準備積立金(356,612,782円)により、分配対象収益は465,375,965円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,207,976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140期計算期間(平成29年 4月21日～平成29年 5月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,997,806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)(105,700,152円)、分配準備積立金(351,931,289円)により、分配対象収益は462,629,247円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、4,175,701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141期計算期間(平成29年 5月23日～平成29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(5,294,477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)(98,970,809円)、分配準備積立金(328,718,333円)により、分配対象収益は432,983,619円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,895,488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28年12月20日現在)	当特定期間末 (平成29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。 (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。 (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 (2) デリバティブ取引 同左 (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28年12月20日現在)	当特定期間末 (平成29年6月20日現在)
期首元本額	2,457,641,093円	2,318,585,887円
期中追加設定元本額	45,386,341円	22,724,293円
期中一部解約元本額	184,441,547円	393,565,942円

2 有価証券関係

前特定期間末(平成28年12月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	4,553,146
合計	4,553,146

当特定期間末(平成29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	7,182,228
合計	7,182,228

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28年12月20日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	57,054,594	-	57,048,946	5,648
合計		57,054,594	-	57,048,946	5,648

区分	種類	当特定期間末（平成29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	149,753,329	-	149,738,858	14,471
合計		149,753,329	-	149,738,858	14,471

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィク クスド・インカム・グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド クラスJ投資証券	1,634,348.790	16,506,922.770	
		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	11,927.820	171,760.600	
	アメリカドル	小計	1,646,276.610	16,678,683.370 (1,864,176,440)	
投資証券	合計		1,646,276.610	1,864,176,440 (1,864,176,440)	
合計				1,864,176,440 (1,864,176,440)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラス」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、2016年8月31日に終了する計算期間(2015年9月1日から2016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2016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 2016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		7,607,469,093	1,484,250,865
未実現評価益 / 損		37,631,938	(8,806,856)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	7,645,101,031	1,475,444,009
銀行預金	2 (a)	197,253,428	51,762,586
ブローカーに対する債権	16	1,804,000	-
未収利息および未収配当金	2 (a)	70,019,223	6,597,906
売却投資有価証券未収金	2 (a)	2,773,920,572 [*]	2,448,312 [*]
販売投資証券未収金	2 (a)	14,723,281	9,284,348
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	-	73,149
差金決済取引	2 (c)	13,777	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	81,646,556
スワップの時価	2 (c)	28,550,764	2,169,593
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	43,295,857	1,212,004
その他の資産	2 (a, c)	8,976	-
資産合計		10,774,690,909	1,630,638,463
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	232,683	-
ブローカーに対する債務	16	42,679,120	2,481,283
未払収益分配金	2 (a)	1,500,489	119,024
購入投資有価証券未払金	2 (a)	2,072,463,093 [*]	84,180,430 [*]
買戻し投資証券未払金	2 (a)	17,026,235	8,557,557
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	20,819,465	246,246
未決済先渡為替予約	2 (c)	20,954,829	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	715,445,265	-
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	29,978,716	989,681
その他の負債	5, 6, 7, 8	14,545,694	1,291,406
負債合計		2,935,645,589	97,865,627
純資産合計		7,839,045,320	1,532,772,836

^{*} 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 2016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	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在	2014年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	7,839,045,320	9,072,127,942	3,779,625,069
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	9.80	9.90	-
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.95	10.15	10.35
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	9.97	10.07	10.22
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	9.96	10.07	10.22
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.01	10.08	10.24
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.34	7.47	7.62
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	14.66	14.68	14.86
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.59	9.77	-
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	人民元	97.07	97.84	-
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	12.32	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	95.50	97.58	100.55
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.34	13.20	13.18
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	9.96	10.01	-
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.83	9.82	9.85
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,024	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	14.69	14.43	14.21
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	100.12	100.32	-
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	19.58	19.26	19.16
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.00	9.92	-
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	9.97	10.07	10.22
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.95	10.03	10.18
クラスC 無分配投資証券	米ドル	11.85	11.87	12.01
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.27	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	9.85	9.96	-
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.95	-	-
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.86	-	-
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.52	10.60	10.76
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.36	7.49	7.64
クラスD 無分配投資証券	米ドル	13.59	13.37	13.29

3 会計年度末における純資産価額の概要 2016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	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在	2014年 8月31日現在
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.53	10.53	10.56
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.26	10.21	10.18
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.66	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	14.98	14.64	14.34
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	19.95	19.53	19.33
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.68	12.61	12.66
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.38	9.42	9.49
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.75	9.86	-
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.80	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	9.76	9.93	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	10.75	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	10.25	10.09	-
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.16	11.15	-
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.52	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	10.70	10.53	10.42
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,043	1,035	1,031
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	9.97	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	9.84	9.93	-
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	9.97	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	10.45	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	9.82	10.02	10.21
クラスX無分配投資証券	米ドル	10.29	10.07	-
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.78	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	10.14	9.93	-
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.35	11.28	-
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.91	10.78	10.68
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.36	10.14	-
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	10.16	10.07	-

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

3 会計年度末における純資産価額の概要 2016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	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在	2014年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,532,772,836	1,497,665,243	952,088,045
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	8.60	8.63	8.72
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	8.59	8.62	8.71
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	9.90	9.87	9.94
クラスA 無分配投資証券	米ドル	12.98	12.84	12.80
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.20	10.20	10.22
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	8.61	8.63	8.73
クラスC 無分配投資証券	米ドル	10.92	10.94	11.05
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.86	9.89	10.00
クラスD 無分配投資証券	米ドル	13.15	12.97	12.88
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.03	-	-
クラスE 無分配投資証券	米ドル	12.02	11.96	11.98
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.00	-	-
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.04	-	-
クラスX 無分配投資証券	米ドル	14.16	13.90	13.74

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。

損益および純資産変動計算書 2016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		9,072,127,942	1,497,665,243
収益			
預金利息	2 (b)	65,599	39,257
債券利息	2 (b)	264,401,993	33,808,395
スワップ利息	2 (c)	12,874,123	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	3,397,213	52
差金決済取引配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	8,517	-
有価証券貸付	2 (b)	1,120,833	265,535
投資運用報酬リベート	5	25,127	-
収益合計	2 (b)	281,893,405	34,113,239
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	249	-
スワップ利息	2 (c)	2,792,762	163,403
差金決済取引配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	17,997	-
管理事務代行報酬	7	8,667,169	967,964
保管および預託報酬	2 (h), 8	1,831,219	226,027
販売報酬	6	8,167,350	1,871,366
税金	9	2,891,230	611,073
投資運用報酬	5	54,061,327	7,467,919
費用合計		78,429,303	11,307,752
純利益		203,464,102	22,805,487
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	74,839,821	(8,878,293)
事後通告証券契約	2 (c)	(58,222,212)	2,148,033
差金決済取引	2 (c)	122,676	-
上場先物取引	2 (c)	(136,638,528)	(4,081,508)
オプション契約	2 (c)	(33,679,444)	(207,741)
スワップ取引	2 (c)	(57,510,267)	(1,565,526)
先渡為替予約	2 (c)	(110,158,700)	2,637,338
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(5,275,389)	(923,190)
当期実現純評価損		(326,522,043)	(10,870,887)
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)	141,613,036	5,197,055
事後通告証券契約	2 (c)	496,462	(25,799)
差金決済取引	2 (c)	13,777	-
上場先物取引	2 (c)	(21,232,011)	233,809
オプション契約	2 (c)	12,062,381	112,975
スワップ取引	2 (c)	5,083,958	140,664
先渡為替予約	2 (c)	(51,091,548)	(70,437)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	301,954	12,441
当期末実現純評価益 / (損) の純変動		87,248,009	5,600,708
運用成績による純資産の増加 / (減少)		(35,809,932)	17,535,308
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		2,976,853,261	856,085,505
投資証券買戻しによる正味支払額		(4,141,357,655)	(837,472,517)
資本の変動による純資産の増加 / (減少)		(1,164,504,394)	18,612,988
配当金宣言額	17	(32,768,296)	(1,040,703)
期末純資産		7,839,045,320	1,532,772,836

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 2016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	211,846	87,687	145,280	154,253
クラスAユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,904,183	255,709	1,611,935	1,547,957
クラスA 毎日分配型投資証券	5,605,752	1,143,930	2,762,519	3,987,163
クラスA 毎月分配型投資証券	2,013,062	470,896	2,052,317	431,641
クラスA 毎四半期分配型投資証券	18,011,710	2,131,000	9,472,177	10,670,533
クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,054,561	111,135	461,277	704,419
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	286,546	71,959	214,990	143,515
クラスA豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	219,459	18,098	36,846	200,711
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	698,892	347,820	608,823	437,889
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	124,900	102,659	132,716	94,843
クラスA 無分配投資証券	119,220,247	25,664,950	63,186,807	81,698,390
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8,227,110	585,500	5,989,287	2,823,323
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	30,105,613	5,993,966	18,753,158	17,346,421
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	1,120,551	102,272	236,332	986,491
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	42,239,089	53,880,570	75,259,839	20,859,820
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	882,865	392,682	231,028	1,044,519
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	497,457	1,868,222	217,629	2,148,050
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	4,224,624	99,095	4,277,865	45,854
クラスC 毎日分配型投資証券	1,097,779	172,509	111,937	1,158,351
クラスC 毎四半期分配型投資証券	4,443,641	419,971	2,390,361	2,473,251
クラスC 無分配投資証券	17,274,390	3,122,522	6,594,037	13,802,875
クラスD 毎年分配型投資証券	1,796,297	5,365	242,180	1,559,482
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	663	1,006,442	1,004,660	2,445
クラスDユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	-	776,735	17,620	759,115
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	-	332,620	-	332,620
クラスD 毎四半期分配型投資証券	25,549,477	8,022,543	11,345,195	22,226,825
クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	364,680	178,313	101,212	441,781
クラスD 無分配投資証券	81,375,640	25,573,557	47,959,021	58,990,176
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	6,417,239	4,478,083	3,498,610	7,396,712
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	64,098,964	23,396,771	41,026,281	46,469,454
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	2,544,248	997,884	1,835,759	1,706,373

発行済投資証券口数変動表 2016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	14,882	16,846	-	31,728
クラスE無分配投資証券	45,746,857	11,011,515	21,549,208	35,209,164
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	57,931,707	19,819,310	24,087,919	53,663,098
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	43,166,256	767,413	4,492,652	39,441,017
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,430,086	1,500,000	-	4,930,086
クラスI無分配投資証券	48,945,064	7,966,300	16,214,379	40,696,985
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	253,635	581,759	19,813
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	30,184,936	7,172,244	14,771,027	22,586,153
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	19,377,177	14,367,200	8,607,212	25,137,165
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	42,398,779	6,809,154	1,673,752	47,534,181
クラスJ毎月分配型投資証券	2,372,008	465,292	755,633	2,081,667
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	16,112,041	2,117,532	287,986	17,941,587
クラスX毎月分配型投資証券	3,600,783	528,616	1,153,827	2,975,572
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	2,582,339	229,603	559,217	2,252,725
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	281,203	30,521	80,022	231,702
クラスX無分配投資証券	4,594,300	134,483	189,860	4,538,923
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	7,137,455	8,796,180	904,392	15,029,243
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	10,700,019	36,456,390	-	47,156,409
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	881,847	-	-	881,847
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	427,439	25,570	-	453,009
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	12,649,024	18,486,140	55,775	31,079,389
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	76,417,341	10,474,885	40,587,083	46,305,143

発行済投資証券口数変動表 2016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	2,365,697	1,873,581	1,041,794	3,197,484
クラスA 毎月分配型投資証券	2,624,823	4,921,988	3,863,343	3,683,468
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配 型投資証券	125,876	682	125,864	694
クラスA 無分配投資証券	33,507,492	21,157,216	22,294,853	32,369,855
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	952,930	2,783,091	1,644,344	2,091,677
クラスC 毎日分配型投資証券	652,235	521,024	257,542	915,717
クラスC 無分配投資証券	2,144,477	3,109,969	2,961,014	2,293,432
クラスD 毎月分配型投資証券	2,011,725	1,488,541	1,338,448	2,161,818
クラスD 無分配投資証券	24,062,052	20,010,497	19,613,574	24,458,975
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	-	40,162	-	40,162
クラスE 無分配投資証券	24,811,965	13,789,853	14,625,070	23,976,748
クラスI 無分配投資証券	-	500	-	500
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	-	455	-	455
クラスX 無分配投資証券	25,530,538	1,032,112	775,332	25,787,318

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 2016年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
米国			
2,548,215	SPDR Barclays High Yield Bond ETF	93,430,303	1.19
602,223	SPDR Gold Shares - ETF	75,253,786	0.96
ファンド合計		168,684,089	2.15
普通/優先株式			
カナダ			
5,883	Norbord Inc	141,839	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	22,815	0.00
		164,654	0.00
ケイマン諸島			
600,000	Fufeng Group Ltd	262,220	0.01
147,094	Vantage Drilling Co	1,324	0.00
		263,544	0.01
フランス			
11,186	SFR Group SA	295,609	0.01
ギリシャ			
198,658	Eurobank Ergasias SA	119,763	0.00
日本			
15,000	SoftBank Group Corp	980,646	0.01
米国			
11,381	Apple Inc	1,210,711	0.02
106,206	Bank of America Corp	1,702,482	0.02
42,220	BorgWarner Inc	1,460,812	0.02
36,088	Citigroup Inc	1,731,502	0.02
31,904	Concho Resources Inc	4,170,172	0.05
20,522	Delta Air Lines Inc	761,161	0.01
280,000	GMAC Capital Trust I (Pref)	7,081,200	0.09
28,117	JPMorgan Chase & Co	1,903,240	0.02
78,950	Matador Resources Co	1,821,377	0.02
42,457	Morgan Stanley	1,369,238	0.02
38,009	United Continental Holdings Inc	1,913,753	0.03
38,318	US Bancorp	1,692,889	0.02
		26,818,537	0.34
ベトナム			
299,341	Vingroup JSC	645,519	0.01
普通/優先株式合計		29,288,272	0.38

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
アルゼンチン			
USD 1,039,000	Arcor SAIC '144A' 6% 6/7/2023	1,117,964	0.02
ARS 3,401,120	Argentina Bogar Bonds FRN 4/2/2018	263,556	0.00
ARS 268,744,566	Argentina Bonar Bonds FRN 28/3/2017	19,089,808	0.24
ARS 115,682,195	Argentina Bonar Bonds FRN 9/10/2017	8,327,884	0.11
USD 7,972,886	Argentina Bonar Bonds 9% 29/11/2018*	9,136,927	0.12
ARS 2,999,000	Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2033	1,318,917	0.02
EUR 5,198,232	Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2033	6,122,798	0.08
USD 34,257,000	Argentine Republic Government International Bond '144A' 6.25% 22/4/2019	36,723,504	0.47
EUR 9,356,817	Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033	11,156,583	0.14
USD 1,497,000	Generacion Mediterraneo SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	1,553,138	0.02
USD 2,173,000	Petrobras Argentina SA '144A' 7.375% 21/7/2023	2,243,623	0.03
USD 277,000	YPF SA 8.5% 28/7/2025	298,384	0.00
USD 3,104,000	YPF SA '144A' 8.5% 28/7/2025	3,343,629	0.04
		100,696,715	1.29
オーストラリア			
USD 590,000	APT Pipelines Ltd 3.875% 11/10/2022	607,158	0.01
USD 2,262,000	APT Pipelines Ltd 4.2% 23/3/2025	2,323,239	0.03
USD 2,400,000	AusNet Services Holdings Pty Ltd FRN 17/3/2076	2,638,236	0.03
USD 844,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd 4.4% 19/5/2026*	894,332	0.01
USD 2,090,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd/United Kingdom FRN 15/6/2026 (Perpetual)*	2,344,033	0.03
USD 4,420,000	BHP Billiton Finance USA Ltd 5% 30/9/2043	5,257,051	0.07
USD 500,000	Broadspectrum Ltd '144A' 8.375% 15/5/2020	540,000	0.01
USD 2,171,000	Commonwealth Bank of Australia 2.85% 18/5/2026	2,215,425	0.03
EUR 2,000,000	Cromwell SPV Finance Pty Ltd 2% 4/2/2020	2,245,403	0.03
USD 1,400,000	Goodman Funding Pty Ltd 6% 22/3/2022	1,617,259	0.02
USD 187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	46,875	0.00
EUR 100,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/6/2071	117,067	0.00
EUR 110,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074	116,133	0.00
USD 777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	837,800	0.01
USD 510,000	SGSP Australia Assets Pty Ltd 3.3% 9/4/2023	526,817	0.01
		22,326,828	0.29
オーストリア			
EUR 1,600,000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 8.125% 30/10/2023	2,229,785	0.03
USD 800,000	Erste Group Bank AG FRN 26/5/2025	829,736	0.01
EUR 600,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 21/2/2025	633,504	0.01
EUR 100,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	117,611	0.00
USD 1,658,000	Suzano Austria GmbH '144A' 5.75% 14/7/2026*	1,691,160	0.02
EUR 600,000	UNIQA Insurance Group AG FRN 27/7/2046	723,252	0.01
		6,225,048	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ベルギー			
EUR 6,605,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2% 17/3/2028	8,192,943	0.10
EUR 920,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.75% 17/3/2036	1,228,821	0.02
EUR 1,000,000	KBC Group NV FRN 19/3/2019 (Perpetual)	1,109,251	0.01
		10,531,015	0.13
バミューダ			
CNY 1,000,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 5% 8/8/2019	129,524	0.00
USD 1,435,000	Digicel Ltd '144A' 6% 15/4/2021	1,321,994	0.02
USD 1,500,000	GCX Ltd 7% 1/8/2019	1,507,681	0.02
USD 200,000	Golden Ocean Group Ltd 3.07% 30/1/2019	117,000	0.00
CNH 6,000,000	IT Ltd 6.25% 15/5/2018	904,228	0.01
USD 1,900,000	Noble Group Ltd FRN 24/6/2019 (Perpetual)	1,054,500	0.01
USD 1,047,000	Noble Group Ltd 3.625% 20/3/2018	895,185	0.01
HKD 1,062,588	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/9/2016	99,316	0.00
HKD 12,396,855	REXLot Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	1,174,666	0.02
		7,204,094	0.09
ブラジル			
EUR 4,114,000	Brazilian Government International Bond 2.875% 1/4/2021	4,693,429	0.06
USD 7,212,000	Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	7,687,992	0.10
USD 1,768,000	Brazilian Government International Bond 5% 27/1/2045	1,664,130	0.02
USD 4,590,000	Brazilian Government International Bond 7.125% 20/1/2037	5,496,525	0.07
		19,542,076	0.25
英領バージン諸島			
USD 1,000,000	Asia View Ltd 1.5% 8/8/2019	1,052,500	0.01
USD 1,200,000	CDBI Treasure I Ltd 2.25% 2/8/2021	1,201,266	0.01
USD 673,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4% 25/8/2021	689,825	0.01
USD 1,100,000	CNOOC Finance 2012 Ltd 5% 2/5/2042	1,330,071	0.02
USD 1,600,000	Cosmos Boom Investment Ltd 0.5% 23/6/2020	1,544,000	0.02
USD 2,000,000	Franshion Capital Ltd 6.8% 30/9/2016 (Perpetual)	2,197,500	0.03
USD 2,100,000	Hanrui Overseas Investment Co Ltd 4.9% 28/6/2019	2,055,690	0.03
USD 1,800,000	Huarong Finance II Co Ltd 3.25% 3/6/2021	1,848,055	0.02
USD 744,000	LS Finance 2022 Ltd 4.25% 16/10/2022	778,659	0.01
USD 1,700,000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd 4.2% 27/7/2026	1,776,384	0.02
USD 1,200,000	PB Issuer No 4 Ltd 3.25% 3/7/2021	1,045,500	0.01
USD 5,903,000	Proven Honour Capital Ltd 4.125% 19/5/2025	6,338,346	0.08
USD 2,250,000	Proven Honour Capital Ltd 4.125% 6/5/2026	2,396,250	0.03
USD 2,039,000	RH International Finance Ltd 3.875% 20/7/2021	2,046,412	0.03
HKD 6,000,000	Shine Power International Ltd 28/7/2019 (Zero Coupon)	768,871	0.01
USD 612,000	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 6.125% 27/3/2020	643,946	0.01
		27,713,275	0.35

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ			
USD 4,360,000	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5% 15/12/2023	4,389,975	0.06
USD 4,800,000	Barrick Gold Corp 5.25% 1/4/2042	5,330,407	0.07
GBP 1,000,000	Glencore Canada Financial Corp 7.375% 27/5/2020	1,547,869	0.02
USD 1,404,000	MEG Energy Corp '144A' 6.5% 15/3/2021	1,161,810	0.01
USD 1,774,000	MEG Energy Corp '144A' 7% 31/3/2024	1,436,940	0.02
USD 3,582,000	Novelis Inc 8.75% 15/12/2020	3,763,339	0.05
USD 3,259,000	Transcanada Trust FRN 15/8/2076	3,470,835	0.04
EUR 206,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc 4.5% 15/5/2023	191,678	0.00
USD 2,392,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 6.125% 15/4/2025	2,110,940	0.03
USD 392,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 6.75% 15/8/2018	397,390	0.00
		23,801,183	0.30
ケイマン諸島			
USD 2,150,000	ABQ Finance Ltd 3.625% 13/4/2021	2,231,711	0.03
CNH 5,000,000	Agile Group Holdings Ltd 6.5% 28/2/2017	753,077	0.01
HKD 6,000,000	ASM Pacific Technology Ltd 2% 28/3/2019	792,169	0.01
USD 3,600,000	CDBL Funding 1 4.25% 2/12/2024	3,883,500	0.05
USD 2,200,000	China Aoyuan Property Group Ltd 6.525% 25/4/2019*	2,301,750	0.03
USD 4,000,000	China Overseas Finance Investment Cayman V Ltd 5/1/2023 (Zero Coupon)	4,142,000	0.05
HKD 13,765,456	China Precious Metal Resources Holdings Co Ltd 7.25% 4/2/2018	1,464,064	0.02
USD 3,516,000	DP World Crescent Ltd 3.908% 31/5/2023	3,680,461	0.05
USD 2,600,000	EI Sukuk Co Ltd 3.542% 31/5/2021	2,687,178	0.03
USD 1,658,000	Fibria Overseas Finance Ltd 5.25% 12/5/2024*	1,707,740	0.02
USD 2,500,000	Global A&T Electronics Ltd 10% 1/2/2019	1,993,750	0.03
USD 2,090,000	Goodman HK Finance 4.375% 19/6/2024	2,267,650	0.03
USD 2,150,000	Greenland Hong Kong Holdings Ltd 3.875% 28/7/2019	2,150,000	0.03
HKD 6,000,000	HC International Inc 5% 27/11/2019	646,849	0.01
USD 1,597,000	Hutchison Whampoa International 11 Ltd 4.625% 13/1/2022	1,798,818	0.02
USD 350,704	Kaisa Group Holdings Ltd 6.56% 30/6/2020	325,716	0.00
USD 1,942,000	Maoye International Holdings Ltd 7.75% 19/5/2017*	1,922,580	0.03
CNH 4,000,000	Panda Funding Investment 2013 3.95% 17/12/2016	597,893	0.01
GBP 3,775,538	Punch Taverns Finance B Ltd 5.267% 30/3/2024	4,442,421	0.06
GBP 2,450,000	Punch Taverns Finance B Ltd 5.943% 30/9/2022	3,016,469	0.04
GBP 1,339,433	Punch Taverns Finance B Ltd 7.369% 30/9/2021	1,754,916	0.02
USD 1,600,000	Semiconductor Manufacturing International Corp 7/11/2018 (Zero Coupon)	1,844,000	0.02
USD 3,500,000	Semiconductor Manufacturing International Corp 7/7/2022 (Zero Coupon)	3,867,920	0.05
USD 2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,137,500	0.03
CNH 7,300,000	Shui On Development Holding Ltd 6.875% 26/2/2017	1,099,787	0.01
USD 1,500,000	Silergy Corp 4/8/2021 (Zero Coupon)	1,752,405	0.02
USD 1,656,000	Suzano Trading Ltd '144A' 5.875% 23/1/2021*	1,763,309	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 402,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A B1' '144A' FRN 20/1/2027	403,003	0.01
USD 3,000,000	TPK Holding Co Ltd 8/4/2020 (Zero Coupon)	2,737,500	0.04
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	798,150	0.01
EUR 983,000	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027*	1,122,971	0.01
EUR 100,000	Viridian Group FundCo II Ltd 7.5% 1/3/2020	118,555	0.00
USD 1,050,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 8.125% 30/8/2019	1,052,625	0.01
		63,258,437	0.81
チリ			
USD 1,901,000	AES Gener SA '144A' 5% 14/7/2025*	1,975,266	0.03
USD 1,591,000	GNL Quintero SA '144A' 4.634% 31/7/2029*	1,666,701	0.02
USD 802,000	GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029*	840,160	0.01
		4,482,127	0.06
中国			
CNH 10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,521,468	0.02
USD 4,750,000	CRRC Corp Ltd 5/2/2021 (Zero Coupon)	4,928,719	0.06
USD 650,000	Shenzhen Expressway Co Ltd 2.875% 18/7/2021	658,811	0.01
USD 2,800,000	Sunshine Life Insurance Corp Ltd 3.15% 20/4/2021	2,849,000	0.04
USD 1,408,000	Sunshine Life Insurance Corp Ltd 4.5% 20/4/2026	1,498,527	0.02
		11,456,525	0.15
コロンビア			
COP 14,240,500,000	Colombian TES 6% 28/4/2028	4,285,083	0.05
COP 17,800,500,000	Colombian TES 7% 4/5/2022	6,011,826	0.08
COP 45,392,000,000	Colombian TES 7.5% 26/8/2026	15,401,245	0.20
COP 14,240,500,000	Colombian TES 7.75% 18/9/2030	4,925,313	0.06
COP 45,392,000,000	Colombian TES 10% 24/7/2024	17,811,784	0.23
		48,435,251	0.62
キプロス			
EUR 800,000	Aroundtown Property Holdings Plc 1.5% 3/5/2022	897,288	0.01
EUR 2,700,000	Aroundtown Property Holdings Plc 1.5% 15/7/2024	2,974,685	0.04
EUR 400,000	Aroundtown Property Holdings Plc 3% 5/5/2020	628,936	0.01
		4,500,909	0.06
デンマーク			
EUR 375,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2020 (Perpetual)	432,538	0.01
DKK 34,124,397	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2% 1/10/2047	4,974,015	0.06
DKK 42,090,638	Nykredit Realkredit A/S 2% 1/10/2047	6,114,702	0.08
DKK 53,181,148	Realkredit Danmark A/S 2% 1/10/2047	7,755,732	0.10
		19,276,987	0.25
エジプト			
USD 5,554,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/6/2025	5,290,185	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フィンランド			
EUR 100,000	Outokumpu OYJ 7.25% 16/6/2021	117,242	0.00
EUR 100,000	Stora Enso OYJ 2.125% 16/6/2023	114,315	0.00
		231,557	0.00
フランス			
EUR 50,000	Areva SA 4.875% 23/9/2024	54,283	0.00
EUR 356,000	BiSoho SAS 5.875% 1/5/2023	423,603	0.01
EUR 800,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	900,781	0.01
USD 302,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 19/8/2025 (Perpetual)	307,663	0.00
USD 100,000	BNP Paribas SA FRN 25/6/2037 (Perpetual)	113,000	0.00
GBP 3,500,000	BNP Paribas SA 1.125% 16/8/2022	4,590,168	0.06
EUR 1,200,000	Casino Guichard Perrachon SA 2.33% 7/2/2025	1,357,739	0.02
EUR 400,000	Casino Guichard Perrachon SA 3.248% 7/3/2024	480,298	0.01
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon SA 3.994% 9/3/2020	249,936	0.00
EUR 1,300,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.048% 5/8/2026	1,529,518	0.02
EUR 100,000	Casino Guichard Perrachon SA 5.976% 26/5/2021	130,584	0.00
EUR 1,000,000	CNP Assurances FRN 10/6/2047*	1,167,440	0.02
EUR 1,300,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 13/1/2025 (Perpetual)	1,480,568	0.02
EUR 100,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	114,419	0.00
EUR 1,300,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)*	1,454,442	0.02
EUR 627,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	742,967	0.01
EUR 100,000	Dry Mix Solutions Investissements SAS FRN 15/3/2023	114,178	0.00
EUR 1,700,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2022 (Perpetual)	1,898,072	0.02
EUR 500,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	560,062	0.01
GBP 300,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2029 (Perpetual)	394,307	0.01
EUR 100,000	Europcar Groupe SA 5.75% 15/6/2022	116,831	0.00
EUR 300,000	Faurecia 3.625% 15/6/2023	350,810	0.00
EUR 1,100,000	Fonciere Des Regions 1.875% 20/5/2026	1,323,565	0.02
EUR 100,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	116,920	0.00
EUR 200,000	Novafives SAS 4.5% 30/6/2021	209,873	0.00
EUR 495,000	Orange SA FRN 1/10/2021 (Perpetual)	595,461	0.01
GBP 100,000	Orange SA FRN 1/4/2023 (Perpetual)	144,589	0.00
EUR 100,000	Orange SA FRN 7/2/2024 (Perpetual)	128,264	0.00
EUR 911,000	Orange SA FRN 1/10/2026 (Perpetual)	1,138,961	0.02
EUR 510,000	Rexel SA 3.5% 15/6/2023	595,072	0.01
EUR 503,000	SFR Group SA 5.375% 15/5/2022	589,791	0.01
EUR 865,000	SFR Group SA 5.625% 15/5/2024	1,023,655	0.01
USD 3,760,000	SFR Group SA '144A' 6% 15/5/2022	3,839,900	0.05
USD 2,093,000	SFR Group SA '144A' 7.375% 1/5/2026	2,166,255	0.03
USD 7,280,000	Societe Generale SA '144A' 4.25% 19/8/2026	7,382,601	0.09
EUR 110,000	Solvay Finance SA FRN 2/6/2021 (Perpetual)	132,568	0.00
EUR 300,000	Tereos Finance Groupe I SA 4.125% 16/6/2023	349,415	0.00
EUR 176,000	THOM Europe SAS 7.375% 15/7/2019*	207,697	0.00
EUR 1,094,000	Total SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	1,311,225	0.02
EUR 350,000	Verallia Packaging SASU 5.125% 1/8/2022	419,709	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR 250,000	WFS Global Holding SAS 9.5% 15/7/2022*	269,780	0.00
		40,476,970	0.52
ドイツ			
EUR 600,000	alstria office REIT-AG 2.125% 12/4/2023	724,973	0.01
EUR 800,000	Bayer AG FRN 2/4/2075*	858,008	0.01
EUR 1,700,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075	1,887,456	0.02
EUR 6,397,000	Commerzbank AG 4% 23/3/2026	7,331,716	0.09
EUR 1,300,000	Commerzbank AG 7.75% 16/3/2021	1,754,980	0.02
EUR 4,800,000	Deutsche Bank AG 4.5% 19/5/2026	5,173,730	0.07
EUR 1,500,000	Deutsche Bank AG 5% 24/6/2020	1,749,993	0.02
EUR 12,472,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	15,602,905	0.20
EUR 21,879,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 1.75% 15/4/2020*	29,538,241	0.38
EUR 1,000,000	Eurogrid GmbH 1.5% 18/4/2028	1,207,581	0.02
EUR 100,000	FTE Verwaltungs GmbH 9% 15/7/2020	118,022	0.00
EUR 800,000	HSH Nordbank AG FRN 14/2/2017	858,045	0.01
USD 1,249,000	HSH Nordbank AG 7.25% 30/9/2016 (Perpetual)	369,080	0.01
EUR 390,000	ProGroup AG 5.125% 1/5/2022	468,642	0.01
EUR 1,102,000	Senvion Holding GmbH 6.625% 15/11/2020	1,289,242	0.02
EUR 100,000	Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027	112,853	0.00
EUR 802,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	930,851	0.01
EUR 907,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4% 15/1/2025	1,078,488	0.01
EUR 100,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4.625% 15/2/2026	121,747	0.00
EUR 801,600	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.625% 15/4/2023	966,054	0.01
EUR 412,290	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.75% 15/1/2023	495,694	0.01
		72,638,301	0.93
ギリシャ			
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2023	1,884,618	0.03
EUR 3,107,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2024	2,583,349	0.03
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2025	1,791,436	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2026	1,763,881	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2027	1,718,182	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2028	1,678,941	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2029	1,647,388	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2030	1,622,047	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2031	1,596,153	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ギリシャ(続き)		
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2032	1,576,655	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2033	1,553,652	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2034	1,533,847	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2035	1,518,040	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2036	1,504,078	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2037	1,494,052	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2038	1,485,072	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2039	1,480,705	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2040	1,480,090	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2041	1,479,414	0.02
EUR 2,207,807	Hellenic Republic Government Bond (Step-up coupon) 3% 24/2/2042	1,480,952	0.02
		32,872,552	0.42
	ガーンジー		
GBP 1,075,000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 2.75% 8/8/2025	1,411,020	0.02
USD 1,759,947	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	1,841,521	0.02
		3,252,541	0.04
	香港		
USD 2,000,000	AIA Group Ltd 3.2% 11/3/2025	2,061,606	0.03
EUR 2,600,000	BAIC Inalfa HK Investment Co Ltd 1.9% 2/11/2020	2,949,432	0.04
USD 2,800,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 2/12/2020 (Perpetual)*	2,855,829	0.04
USD 1,200,000	Baosteel Hong Kong Investment Co Ltd 1/12/2018 (Zero Coupon)	1,191,420	0.01
CNH 2,074,196	China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	286,641	0.00
USD 1,000,000	CITIC Ltd FRN 22/11/2018 (Perpetual)	1,128,750	0.01
USD 2,350,000	Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd FRN 21/7/2021 (Perpetual)	2,352,926	0.03
CNH 3,000,000	Yufu Eternity Ltd 5.625% 26/11/2017	448,756	0.01
		13,275,360	0.17
	インド		
USD 800,000	Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026*	814,424	0.01
USD 200,000	Bharat Petroleum Corp Ltd 4.625% 25/10/2022	217,938	0.00
INR 2,130,000,000	Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	35,190,512	0.45
INR 450,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 7.875% 21/8/2019	6,736,457	0.09
INR 338,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.45% 21/8/2019	5,259,478	0.07
INR 830,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 9.65% 17/1/2019	12,815,772	0.16
USD 1,019,000	ICICI Bank Ltd/Dubai 4% 18/3/2026*	1,074,466	0.01
INR 2,288,000,000	India Government Bond 7.16% 20/5/2023	34,331,325	0.44

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インド(続き)			
INR 410,410,000	India Government Bond 7.68% 15/12/2023	6,343,868	0.08
INR 1,101,210,000	India Government Bond 7.72% 25/5/2025	17,094,349	0.22
INR 695,000,000	India Government Bond 7.88% 19/3/2030	11,067,524	0.14
INR 789,520,000	India Government Bond 8.27% 9/6/2020	12,307,853	0.16
INR 1,830,000,000	India Government Bond 8.28% 21/9/2027	29,585,677	0.38
INR 390,000,000	India Government Bond 8.33% 9/7/2026	6,278,199	0.08
INR 2,000,000,000	India Government Bond 8.6% 2/6/2028	33,089,755	0.42
INR 363,860,000	Indian Trade Government Licence 31/12/2049 (Zero Coupon)	1,087	0.00
INR 250,000,000	LIC Housing Finance Ltd 8.25% 23/10/2025	3,789,717	0.05
INR 1,600,000,000	Mahanagar Telephone Nigam Ltd 8.29% 28/11/2024	24,808,708	0.32
USD 1,800,000	NTPC Ltd 4.25% 26/2/2026*	1,933,695	0.03
USD 1,580,000	NTPC Ltd 5.625% 14/7/2021	1,801,516	0.02
INR 400,000,000	NTPC Ltd 9.17% 22/9/2024	6,553,325	0.08
USD 924,000	ONGC Videsh Ltd 4.625% 15/7/2024	1,008,315	0.01
INR 1,300,000,000	Power Finance Corp Ltd 8.36% 26/2/2020	19,918,079	0.25
INR 500,000,000	Power Finance Corp Ltd 8.65% 28/11/2019	7,734,877	0.10
INR 1,600,000,000	Power Finance Corp Ltd 8.65% 28/12/2024	25,363,726	0.32
INR 700,000,000	Power Finance Corp Ltd 8.96% 21/10/2019	10,889,332	0.14
INR 1,600,000,000	Rural Electrification Corp Ltd 8.57% 21/12/2024	25,170,004	0.32
INR 2,100,000,000	Rural Electrification Corp Ltd 9.06% 23/9/2017	31,902,252	0.41
INR 800,000,000	Steel Authority of India Ltd 9% 14/10/2024	12,487,191	0.16
USD 150,000	Videocon Industries Ltd 2.8% 31/12/2020	126,938	0.00
		385,696,359	4.92
インドネシア			
USD 1,130,000	Berau Coal Energy Tbk PT(Defaulted) 7.25% 13/3/2017	242,950	0.00
EUR 4,933,000	Indonesia Government International Bond '144A' 2.625% 14/6/2023	5,809,704	0.07
EUR 1,674,000	Indonesia Government International Bond 2.625% 14/6/2023	1,971,013	0.03
EUR 1,700,000	Indonesia Government International Bond 3.375% 30/7/2025	2,068,166	0.03
USD 4,796,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	5,371,520	0.07
USD 2,101,000	Indonesia Government International Bond 5.95% 8/1/2046*	2,676,149	0.03
USD 1,678,000	Indonesia Government International Bond 6.75% 15/1/2044	2,313,543	0.03
IDR 49,027,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	3,398,626	0.04
IDR 79,586,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/7/2021	6,356,980	0.08
IDR 221,450,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	18,016,497	0.23
IDR 172,573,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	13,993,178	0.18
IDR 307,104,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	25,165,626	0.32
IDR 236,210,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	19,314,373	0.25
IDR 89,493,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.75% 15/5/2031	7,542,644	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インドネシア(続き)			
USD 950,000	Pelabuhan Indonesia II PT 5.375% 5/5/2045	980,324	0.01
USD 4,550,000	Pertamina Persero PT 5.625% 20/5/2043	4,808,067	0.06
		120,029,360	1.53
アイルランド			
EUR 1,510,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	1,603,756	0.02
EUR 175,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023	205,825	0.00
EUR 662,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.25% 15/1/2022	768,137	0.01
USD 1,100,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 6% 30/6/2021	1,135,750	0.01
USD 500,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 6.25% 31/1/2019	513,750	0.01
EUR 525,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	636,244	0.01
EUR 550,000	Avoca Clo XIV Ltd 12/7/2028 (Zero Coupon)	505,407	0.01
EUR 150,000	Avoca Clo XIV Ltd Class E FRN 12/7/2028	152,526	0.00
EUR 150,000	Avoca Clo XIV Ltd Class F FRN 12/7/2028	137,900	0.00
EUR 1,887,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)	2,042,734	0.03
EUR 335,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	374,322	0.00
EUR 4,658,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	5,203,098	0.07
EUR 1,200,000	Carlyle Global Market Strategies Euro CLO 2015-3 DAC '2015-3X D' FRN 15/1/2029	1,251,187	0.02
EUR 662,000	eircom Finance DAC 4.5% 31/5/2022	757,473	0.01
USD 3,212,000	Endo Ltd / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 6% 15/7/2023	2,930,950	0.04
EUR 245,636	German Residential Funding 2013-2 Ltd '2013-2 D' FRN 27/11/2024	277,106	0.00
EUR 968,750	German Residential Funding 2013-2 Ltd '2013-2 E' FRN 27/11/2024	1,096,469	0.01
EUR 1,616,019	German Residential Funding 2013-2 Ltd '2013-2 F' FRN 27/11/2024	1,832,712	0.02
EUR 730,000	Harvest Clo XI Ltd FRN 26/3/2029	735,925	0.01
EUR 2,466,458	Magellan Mortgages No4 Plc FRN 20/7/2059	2,322,212	0.03
EUR 1,010,027	Taurus 2016-2 DEU DAC '2016-DE2 C' FRN 3/1/2027	1,128,776	0.01
EUR 1,073,339	Taurus 2016-2 DEU DAC '2016-DE2 D' FRN 3/1/2027	1,202,733	0.02
		26,814,992	0.34
イタリア			
EUR 448,467	Asset Backed European Securitisation Transaction Nine Srl FRN 10/12/2028	500,952	0.01
EUR 2,283,384	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl FRN 10/12/2028	2,550,167	0.03
GBP 300,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	404,858	0.01
EUR 5,150,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/6/2048	5,938,125	0.08
EUR 695,000	Assicurazioni Generali SpA 5.125% 16/9/2024	1,046,636	0.01
EUR 457,000	Enel SpA FRN 10/1/2074	560,592	0.01
EUR 200,000	Enel SpA FRN 15/1/2075	241,680	0.00
GBP 105,000	Enel SpA FRN 10/9/2075	155,659	0.00
EUR 2,168,554	Fondi Immobili Pubblici Funding SRL FRN 10/1/2023	2,346,170	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR 2,100,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	2,292,010	0.03
USD 3,015,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 17/9/2025 (Perpetual)	2,807,719	0.04
EUR 1,300,000	Intesa Sanpaolo SpA 2.855% 23/4/2025	1,448,285	0.02
EUR 700,000	Intesa Sanpaolo SpA 3.928% 15/9/2026	818,676	0.01
EUR 50,000	Intesa Sanpaolo SpA 5% 23/9/2019	61,398	0.00
EUR 150,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	188,349	0.00
EUR 1,100,000	Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13/9/2023	1,487,850	0.02
EUR 62,762,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.25% 15/9/2032*	77,536,587	0.99
EUR 8,380,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.7% 15/9/2018	9,864,048	0.13
EUR 2,888,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2% 1/12/2025	3,489,039	0.04
EUR 16,455,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/9/2021	22,242,026	0.28
EUR 15,100,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.15% 12/11/2017*	17,295,841	0.22
EUR 7,295,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.25% 22/4/2017*	8,254,392	0.11
EUR 21,619,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.35% 15/9/2019	28,958,437	0.37
EUR 17,510,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.35% 15/9/2024	22,997,390	0.29
EUR 71,368,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.55% 22/10/2016*	79,814,995	1.02
EUR 50,721,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	63,647,943	0.81
EUR 40,110,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.25% 1/9/2046	55,951,544	0.71
EUR 876,000	LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 1/4/2024	1,064,216	0.01
EUR 315,000	Officine Maccaferri SpA 5.75% 1/6/2021	285,348	0.00
EUR 500,000	Onorato Armatori SpA 7.75% 15/2/2023*	577,370	0.01
EUR 1,355,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	1,644,328	0.02
EUR 1,167,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.625% 19/1/2024	1,418,162	0.02
EUR 3,712,000	UniCredit SpA FRN 28/10/2025	4,348,272	0.06
EUR 450,000	UniCredit SpA FRN 3/1/2027	500,231	0.01
EUR 2,700,000	UniCredit SpA 6.95% 31/10/2022	3,436,074	0.04
EUR 100,000	Veneto Banca SpA 4% 20/5/2019	106,546	0.00
		426,281,915	5.44
日本			
JPY 40,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 23/3/2018 (Zero Coupon)	389,924	0.00
JPY 20,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/The 25/3/2020 (Zero Coupon)	195,810	0.00
USD 2,650,000	Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The FRN 24/7/2026 (Perpetual)	2,699,025	0.03
JPY 16,138,800,000	Japan Government Two Year Bond 0.1% 15/9/2017	156,703,604	2.00
JPY 70,000,000	Kandenko Co Ltd 31/3/2021 (Zero Coupon)	727,583	0.01
JPY 80,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	811,782	0.01
JPY 20,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	193,494	0.00
USD 900,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.85% 1/3/2026	985,081	0.01
USD 900,000	Mitsui OSK Lines Ltd 24/4/2020 (Zero Coupon)	799,875	0.01
JPY 130,000,000	Nagoya Railroad Co Ltd 11/12/2024 (Zero Coupon)	1,381,102	0.02
USD 1,150,000	Nippon Life Insurance Co FRN 16/10/2044	1,284,228	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本(続き)			
JPY 40,000,000	Nipro Corp 29/1/2021 (Zero Coupon)	426,898	0.01
USD 100,000	Shizuoka Bank Ltd/The 25/4/2018 (Zero Coupon)	98,375	0.00
EUR 300,000	SoftBank Group Corp 4.625% 15/4/2020	376,014	0.00
EUR 160,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025*	202,376	0.00
EUR 247,000	SoftBank Group Corp 5.25% 30/7/2027*	312,664	0.00
USD 1,300,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.632% 14/7/2026	1,289,845	0.02
JPY 80,000,000	Suzuki Motor Corp 31/3/2021 (Zero Coupon)	854,654	0.01
JPY 100,000,000	Suzuki Motor Corp 31/3/2023 (Zero Coupon)	1,091,417	0.01
JPY 80,000,000	Takashimaya Co Ltd 11/12/2018 (Zero Coupon)	774,043	0.01
JPY 50,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2018 (Zero Coupon)	487,164	0.01
JPY 50,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	490,855	0.01
JPY 120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,175,730	0.02
JPY 40,000,000	Unicharm Corp 25/9/2020 (Zero Coupon)	466,712	0.01
USD 500,000	Yamaguchi Financial Group Inc 20/12/2018 (Zero Coupon)	555,060	0.01
USD 1,500,000	Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	1,527,930	0.02
		176,301,245	2.25
ジャージー			
GBP 1,100,000	AA Bond Co Ltd 5.5% 31/7/2022	1,485,026	0.02
EUR 200,000	Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15/8/2024	230,839	0.00
GBP 243,000	CPUK Finance Ltd 7% 28/8/2020	340,736	0.00
GBP 100,000	Enterprise Funding Ltd 3.5% 10/9/2020	105,111	0.00
USD 100,000	HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/12/2016 (Perpetual)	102,125	0.00
EUR 1,085,912	Mercury Bondco Plc 8.25% 30/5/2021	1,268,526	0.02
USD 600,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	678,810	0.01
EUR 1,950,000	UBS Group Funding Jersey Ltd 1.25% 1/9/2026	2,183,282	0.03
USD 9,064,000	UBS Group Funding Jersey Ltd '144A' 2.65% 1/2/2022	9,092,339	0.12
USD 412,000	West China Cement Ltd 6.5% 11/9/2019	429,510	0.00
		15,916,304	0.20
ルクセンブルグ			
USD 2,430,000	Actavis Funding SCS 3% 12/3/2020	2,515,078	0.03
USD 5,400,000	Actavis Funding SCS 3.8% 15/3/2025	5,699,762	0.07
EUR 505,000	Altice Financing SA 5.25% 15/2/2023	595,929	0.01
EUR 100,000	Altice Finco SA 9% 15/6/2023	128,182	0.00
EUR 280,000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/2/2025	309,253	0.01
EUR 458,000	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/5/2022	541,170	0.01
USD 3,043,000	Altice Luxembourg SA '144A' 7.625% 15/2/2025*	3,145,701	0.04
EUR 498,000	Befesa Zinc SAU Via Zinc Capital SA 8.875% 15/5/2018	566,908	0.01
EUR 810,000	Bilbao Luxembourg SA 11.063% 1/12/2018	893,141	0.01
EUR 125,000	BMBG Bond Finance SCA 3% 15/6/2021*	143,021	0.00
EUR 175,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.75% 15/5/2021	207,618	0.00
EUR 200,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15/5/2023	235,051	0.00
EUR 240,000	CNH Industrial Finance Europe SA 2.875% 27/9/2021	284,635	0.00
EUR 475,000	CNH Industrial Finance Europe SA 2.875% 17/5/2023	549,607	0.01
USD 140,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 9% 30/6/2021	143,675	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
USD 73,120	Codere Finance 2 Luxembourg SA 9% 30/6/2021	75,314	0.00
EUR 151,000	ContourGlobal Power Holdings SA 5.125% 15/6/2021	180,070	0.00
USD 3,592,530	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	3,738,136	0.05
EUR 618,000	Fiat Chrysler Finance Europe 4.75% 22/3/2021*	767,692	0.01
EUR 459,000	Fiat Chrysler Finance Europe 4.75% 15/7/2022	567,646	0.01
EUR 359,000	Fiat Chrysler Finance Europe 6.625% 15/3/2018	433,854	0.01
GBP 100,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.5% 1/11/2022	135,259	0.00
USD 1,414,000	Gazprom OAO Via Gaz Capital SA '144A' 4.95% 19/7/2022	1,474,166	0.02
EUR 175,000	Gestamp Funding Luxembourg SA 3.5% 15/5/2023	203,581	0.00
EUR 389,000	Glencore Finance Europe SA 3.375% 30/9/2020	470,488	0.01
USD 945,000	Intelsat Jackson Holdings SA 5.5% 1/8/2023	647,325	0.01
USD 1,693,000	Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	1,320,540	0.02
EUR 800,000	JH-Holding Finance SA 8.25% 1/12/2022	958,398	0.01
EUR 125,000	Lecta SA 6.5% 1/8/2023	142,550	0.00
EUR 480,000	Matterhorn Telecom SA 3.875% 1/5/2022	536,993	0.01
EUR 317,000	Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15/6/2021*	360,384	0.01
EUR 300,000	OHL Investments SA 4% 25/4/2018	304,660	0.00
EUR 200,000	Play Finance 2 SA 5.25% 1/2/2019	229,614	0.00
EUR 1,960,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)	2,270,409	0.03
EUR 251,000	Swissport Investments SA 6.75% 15/12/2021	292,614	0.00
USD 100,000	Telecom Italia Capital SA 6% 30/9/2034	101,000	0.00
USD 100,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	104,000	0.00
EUR 300,000	Telecom Italia Finance SA 6.125% 15/11/2016	350,283	0.01
EUR 600,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	919,305	0.01
EUR 729,000	Telenet Finance V Luxembourg SCA 6.75% 15/8/2024	913,052	0.01
EUR 400,000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc 6.375% 1/5/2022	474,737	0.01
EUR 749,000	Wind Acquisition Finance SA 4% 15/7/2020	852,180	0.01
USD 200,000	Wind Acquisition Finance SA '144A' 4.75% 15/7/2020	204,750	0.00
EUR 200,000	Wind Acquisition Finance SA 7% 23/4/2021	232,353	0.00
USD 400,000	Wind Acquisition Finance SA '144A' 7.375% 23/4/2021	414,000	0.01
		35,634,084	0.46
マレーシア			
USD 2,200,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	2,486,099	0.03
USD 1,000,000	Cahaya Capital Ltd 18/9/2021 (Zero Coupon)	989,500	0.01
MYR 20,500,000	Malaysia Government Bond 4.736% 15/3/2046	5,311,013	0.07
MYR 44,700,000	Malaysia Government Investment Issue 3.99% 15/10/2025	11,281,074	0.14
MYR 141,980,000	Malaysia Government Investment Issue 4.07% 30/9/2026	36,392,070	0.47
		56,459,756	0.72
モーリシャス			
USD 1,500,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023	1,488,819	0.02
USD 1,800,000	HT Global IT Solutions Holdings Ltd 7% 14/7/2021	1,905,457	0.02
		3,394,276	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
メキシコ			
USD 6,416,000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands '144A' FRN 11/8/2026*	6,430,436	0.08
MXN 228,300,000	Mexican Bonos 4.75% 14/6/2018	12,041,192	0.16
MXN 180,555,100	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	9,545,229	0.12
MXN 176,800,000	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	10,676,120	0.14
MXN 16,749,900	Mexican Udibonos 3.5% 14/12/2017	4,960,126	0.06
		43,653,103	0.56
モンゴル			
USD 2,790,000	Development Bank of Mongolia LLC 5.75% 21/3/2017	2,720,250	0.03
USD 5,853,000	Mongolia Government International Bond 5.125% 5/12/2022	4,947,043	0.06
CNH 5,000,000	Mongolia Government International Bond 7.5% 30/6/2018	705,909	0.01
USD 2,219,000	Trade & Development Bank of Mongolia LLC 9.375% 19/5/2020	2,110,990	0.03
		10,484,192	0.13
オランダ			
EUR 2,300,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)*	2,553,098	0.03
USD 74,359	AE-Rotor Holding BV 4.969% 28/3/2018	74,573	0.00
EUR 975,000	ASML Holding NV 0.625% 7/7/2022	1,111,024	0.01
EUR 2,525,000	ASML Holding NV 1.375% 7/7/2026	2,966,813	0.04
USD 3,946,000	Bharti Airtel International Netherlands BV 5.125% 11/3/2023	4,348,567	0.06
EUR 100,000	Constellium NV 4.625% 15/5/2021	104,499	0.00
USD 259,000	Constellium NV '144A' 7.875% 1/4/2021	280,367	0.00
USD 1,006,000	Constellium NV '144A' 8% 15/1/2023	1,028,635	0.01
EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2020 (Perpetual)	226,123	0.00
EUR 400,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2021 (Perpetual)	476,431	0.01
EUR 100,000	Darling Global Finance BV 4.75% 30/5/2022	117,062	0.00
EUR 360,000	Euro-Galaxy IV CLO BV '2015-4X D' FRN 30/7/2028	384,360	0.01
EUR 515,000	Euro-Galaxy IV CLO BV '2015-4X E' FRN 30/7/2028	509,196	0.01
EUR 300,000	Euro-Galaxy IV CLO BV '2015-4X F' FRN 30/7/2028	273,995	0.00
EUR 100,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	116,656	0.00
EUR 1,300,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)	1,413,612	0.02
USD 818,000	Greenko Dutch BV 8% 1/8/2019	881,865	0.01
USD 4,190,000	ING Bank NV '144A' 2.05% 15/8/2021	4,201,099	0.05
USD 867,000	Jababeka International BV 7.5% 24/9/2019	921,233	0.01
EUR 292,000	Koninklijke KPN NV FRN 14/9/2018 (Perpetual)	352,197	0.01
EUR 1,200,000	LGE HoldCo VI BV 7.125% 15/5/2024	1,519,676	0.02
USD 1,686,000	Marfrig Holdings Europe BV '144A' 8% 8/6/2023*	1,761,870	0.02
USD 5,315,000	Mylan NV '144A' 3.95% 15/6/2026	5,509,951	0.07
EUR 1,900,000	North Westerly CLO IV 2013 BV 'IV-X A-1' FRN 15/1/2026	2,120,806	0.03
EUR 1,471,000	North Westerly CLO IV 2013 BV 'IV-X D' FRN 15/1/2026	1,630,201	0.02
USD 2,316,000	Petrobras Global Finance BV 3% 15/1/2019*	2,230,308	0.03
GBP 3,973,000	Petrobras Global Finance BV 6.25% 14/12/2026*	4,763,539	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
USD 2,080,000	Petrobras Global Finance BV 6.85% 5/6/2115	1,745,120	0.02
USD 2,164,000	Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/5/2021	2,338,202	0.03
USD 2,836,000	Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	3,133,780	0.04
EUR 900,000	PortAventura Entertainment Barcelona BV 7.25% 1/12/2020	1,053,473	0.01
EUR 402,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075	415,816	0.01
USD 1,500,000	Royal Capital B.V. FRN 5/5/2019 (Perpetual)	1,571,505	0.02
EUR 100,000	Samvardhana Motherson Automotive Systems Group BV 4.125% 15/7/2021	115,248	0.00
EUR 180,000	Schaeffler Holding Finance BV 5.75% 15/11/2021	218,313	0.00
EUR 2,848,000	SNS Bank NV FRN 5/11/2025	3,217,258	0.04
EUR 1,500,000	Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	1,736,948	0.02
EUR 400,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2020 (Perpetual)*	473,467	0.01
GBP 100,000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	142,180	0.00
EUR 500,000	Telefonica Europe BV FRN 18/9/2021 (Perpetual)	651,365	0.01
USD 930,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 2.8% 21/7/2023	937,169	0.01
USD 2,556,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 1/10/2026	2,585,431	0.03
EUR 100,000	United Group BV 7.875% 15/11/2020	117,457	0.00
EUR 300,000	United Group BV 7.875% 15/11/2020	351,802	0.01
EUR 2,000,000	Vonovia Finance BV 1.5% 10/6/2026	2,359,055	0.03
EUR 306,000	Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/1/2025	346,034	0.01
		65,387,379	0.83
ニュージーランド			
NZD 4,931,000	New Zealand Government Bond 2.51% 20/9/2035	4,143,263	0.05
NZD 5,570,000	New Zealand Government Bond 3% 20/9/2030	4,934,239	0.07
		9,077,502	0.12
ノルウェー			
EUR 222,000	Norske Skog AS 11.75% 15/12/2019	197,012	0.00
USD 3,519,000	Norwegian Air Shuttle ASA 2016-1 Class B Pass Through Trust '144A' 7.5% 10/11/2023	3,470,684	0.04
EUR 400,000	Silk Bidco AS 7.5% 1/2/2022	479,890	0.01
		4,147,586	0.05
フィリピン			
USD 250,000	SMC Global Power Holdings Corp FRN 7/11/2019 (Perpetual)	270,000	0.00
ポルトガル			
EUR 253,080	GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Atlantes Finance FRN 20/3/2033	283,743	0.00
EUR 200,000	Novo Banco SA (Restricted) 2.625% 8/5/2017	54,603	0.00
EUR 1,800,000	Novo Banco SA (Restricted) 4% 21/1/2019	501,455	0.01
EUR 2,000,000	Novo Banco SA (Restricted) 4.75% 15/1/2018	546,029	0.01
EUR 12,191,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 2.875% 15/10/2025*	13,643,519	0.17
EUR 11,515,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 3.875% 15/2/2030	13,439,893	0.17

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ポルトガル(続き)			
EUR 7,899,500	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4.1% 15/2/2045	9,145,188	0.12
EUR 4,861,012	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 5.65% 15/2/2024	6,452,540	0.08
EUR 611,183	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta Electricity Receivables 4.172% 16/2/2017	688,015	0.01
EUR 3,968,456	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	4,478,830	0.06
EUR 13,700,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta IV Electricity Receivables 2.423% 12/2/2021	15,313,840	0.19
		64,547,655	0.82
ロシア連邦			
RUB 5,168,538,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/8/2021	76,395,548	0.97
シンガポール			
USD 2,350,000	Berau Capital Resources Pte Ltd (Defaulted) 12.5% 8/7/2015	511,125	0.01
SGD 1,100,000	OSIM International Ltd 18/9/2019 (Zero Coupon)	836,983	0.01
SGD 2,000,000	Suntec Real Estate Investment Trust 1.75% 5/9/2021	1,460,306	0.02
USD 1,600,000	Theta Capital Pte Ltd 7% 11/4/2022	1,690,000	0.02
USD 424,000	TML Holdings Pte Ltd 5.75% 7/5/2021	457,390	0.00
USD 2,200,000	United Overseas Bank Ltd FRN 16/9/2026	2,271,137	0.03
		7,226,941	0.09
スロベニア			
EUR 13,355,000	Slovenia Government Bond 2.125% 28/7/2025	16,648,566	0.21
USD 8,008,000	Slovenia Government International Bond 4.125% 18/2/2019*	8,468,460	0.11
USD 2,990,000	Slovenia Government International Bond (Restricted) 5.25% 18/2/2024*	3,472,137	0.04
USD 3,337,000	Slovenia Government International Bond (Restricted) 5.5% 26/10/2022	3,862,778	0.05
USD 2,640,000	Slovenia Government International Bond (Restricted) 5.85% 10/5/2023	3,128,506	0.04
		35,580,447	0.45
韓国			
USD 1,200,000	GS Engineering & Construction Corp 4.5% 21/7/2021	1,215,168	0.02
USD 3,000,000	Hyundai Capital Services Inc 2.875% 16/3/2021	3,115,809	0.04
USD 600,000	Hyundai Heavy Industries Co Ltd 29/6/2020 (Zero Coupon)	581,250	0.01
KRW 1,800,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	1,628,072	0.02
USD 1,390,000	Shinhan Bank 3.875% 24/3/2026	1,485,268	0.02
USD 1,457,000	Small & Medium Business Corp 2.125% 30/8/2026	1,444,239	0.02
USD 240,000	Woori Bank FRN 10/6/2045	251,646	0.00
USD 3,100,000	Woori Bank 4.75% 30/4/2024	3,352,204	0.04
		13,073,656	0.17
スペイン			
EUR 800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19/2/2019 (Perpetual)	845,885	0.01
EUR 2,600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 18/2/2020 (Perpetual)	2,733,974	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スペイン(続き)			
EUR 2,400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)*	2,838,234	0.04
EUR 1,600,000	Banco Popular Espanol SA FRN 10/10/2018 (Perpetual)	1,870,315	0.02
EUR 1,000,000	Banco Popular Espanol SA FRN 10/4/2020 (Perpetual)	1,028,907	0.01
EUR 2,100,000	Banco Santander SA FRN 12/3/2019 (Perpetual)	2,132,226	0.03
EUR 6,200,000	Bankia SA FRN 22/5/2024	6,924,755	0.09
EUR 2,000,000	BPE Financiaciones SA 2% 3/2/2020	2,269,718	0.03
EUR 200,000	Cellnex Telecom SA 2.375% 16/1/2024	230,620	0.00
EUR 6,100,000	Ibercaja Banco SA FRN 28/7/2025	6,406,643	0.08
EUR 2,000,000	Mapfre SA 1.625% 19/5/2026	2,378,857	0.03
EUR 1,200,000	Merlin Properties Socimi SA 2.225% 25/4/2023	1,414,938	0.02
EUR 900,000	Metrovacesa SA 2.375% 23/5/2022	1,058,799	0.01
EUR 600,000	Santander Issuances SAU 3.25% 4/4/2026	694,335	0.01
		32,828,206	0.42
スリランカ			
USD 1,750,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/1/2022	1,813,793	0.02
USD 549,000	Sri Lanka Government International Bond 6% 14/1/2019	568,918	0.01
USD 1,400,000	Sri Lanka Government International Bond 6.125% 3/6/2025	1,443,750	0.02
USD 2,329,000	Sri Lanka Government International Bond 6.25% 4/10/2020	2,462,521	0.03
USD 3,562,000	Sri Lanka Government International Bond 6.825% 18/7/2026	3,838,055	0.05
USD 3,300,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 3/11/2025	3,552,734	0.05
USD 300,000	SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	301,500	0.00
		13,981,271	0.18
スウェーデン			
SEK 8,513,442	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd FRN 10/11/2055	995,887	0.01
GBP 3,500,000	Nordea Bank AB 2.375% 2/6/2022	4,924,134	0.06
GBP 1,660,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 1.25% 5/8/2022	2,178,953	0.03
EUR 525,000	Verisure Holding AB 6% 1/11/2022	638,260	0.01
		8,737,234	0.11
スイス			
EUR 510,000	Credit Suisse AG FRN 18/9/2025	623,022	0.01
USD 800,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 18/12/2024 (Perpetual)	785,000	0.01
USD 200,000	UBS AG FRN 22/5/2023	206,867	0.00
EUR 745,000	UBS AG FRN 12/2/2026	896,003	0.01
USD 1,250,000	UBS Group AG FRN 22/3/2021 (Perpetual)	1,264,100	0.02
EUR 1,135,000	UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	1,325,819	0.02
USD 700,000	UBS Group AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	747,435	0.01
		5,848,246	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	台湾		
USD 4,000,000	Advanced Semiconductor Engineering Inc 27/3/2018 (Zero Coupon)	3,895,000	0.05
USD 1,000,000	Neo Solar Power Corp 18/7/2017 (Zero Coupon)	955,000	0.01
		4,850,000	0.06
	タイ		
THB 79,000,000	Bangkok Dusit Medical Services PCL 18/9/2019 (Zero Coupon)	2,604,579	0.03
	トルコ		
TRY 30,820,000	Turkey Government Bond 8% 12/3/2025	9,449,491	0.12
TRY 30,820,000	Turkey Government Bond 10.6% 11/2/2026*	11,073,052	0.14
USD 12,876,000	Turkey Government International Bond 6.75% 3/4/2018	13,720,987	0.18
USD 2,770,000	Turkey Government International Bond 7% 11/3/2019	3,029,687	0.04
USD 7,275,000	Turkey Government International Bond 7.5% 7/11/2019	8,186,194	0.10
USD 1,939,524	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	1,875,277	0.02
		47,334,688	0.60
	アラブ首長国連邦		
USD 2,800,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC FRN 12/1/2023	2,876,049	0.04
USD 1,450,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC 3.625% 22/6/2021	1,502,251	0.02
USD 850,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC 4.375% 22/6/2026*	916,368	0.01
USD 2,800,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC 5.875% 13/12/2021	3,225,698	0.04
EUR 1,130,000	Glencore Finance Dubai Ltd 2.625% 19/11/2018	1,311,623	0.02
		9,831,989	0.13
	英国		
EUR 2,000,000	Anglo American Capital Plc 1.5% 1/4/2020	2,181,907	0.03
EUR 210,000	Anglo American Capital Plc 1.75% 20/11/2017	236,606	0.00
EUR 1,310,000	Anglo American Capital Plc 1.75% 3/4/2018	1,472,579	0.02
EUR 100,000	Anglo American Capital Plc 2.5% 18/9/2018	114,040	0.00
EUR 2,665,000	Anglo American Capital Plc 2.75% 7/6/2019	3,060,675	0.04
EUR 200,000	Anglo American Capital Plc 2.875% 20/11/2020	226,614	0.00
EUR 100,000	Anglo American Capital Plc 3.25% 3/4/2023	111,131	0.00
EUR 356,000	Anglo American Capital Plc 3.5% 28/3/2022	403,195	0.00
GBP 860,000	Anglo American Capital Plc 6.875% 1/5/2018	1,212,724	0.02
GBP 626,237	Annington Finance No 5 Plc 13% 15/1/2023	946,588	0.01
USD 1,300,000	Aon Plc 3.5% 14/6/2024	1,366,368	0.02
USD 1,300,000	Aon Plc 3.875% 15/12/2025	1,402,290	0.02
GBP 942,874	Auburn Securities 5 Plc FRN 1/12/2041	1,190,347	0.02
USD 200,000	Barclays Bank Plc 7.625% 21/11/2022	224,975	0.00
USD 2,825,000	Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	2,833,433	0.04
GBP 450,000	Barclays Plc FRN 15/9/2022 (Perpetual)*	587,830	0.01
GBP 1,160,000	Barclays Plc 3.25% 12/2/2027	1,540,320	0.02
GBP 386,787	Brass No 3 Plc FRN 16/4/2051	507,355	0.01
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc Class C2 FRN 22/10/2037	950,862	0.01
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc Class D2 FRN 22/10/2037	4,660,503	0.06
GBP 350,000	Cognita Financing Plc 7.75% 15/8/2021	483,644	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 1,194,471	DECO 12-UK 4 plc '2007-C4X B' FRN 27/1/2020	1,501,155	0.02
GBP 286,441	DECO 12-UK 4 plc '2007-C4X C' FRN 27/1/2020	366,002	0.00
EUR 785,000	EC Finance Plc 5.125% 15/7/2021*	922,793	0.01
GBP 1,430,000	E-CARAT 5 Plc 'B' FRN 18/4/2023	1,850,355	0.02
GBP 10,240,000	Enterprise Inns Plc 6% 6/10/2023*	13,566,326	0.17
GBP 390,000	Enterprise Inns Plc 6.875% 15/2/2021	546,084	0.01
GBP 504,692	Eurosail 2006-4np Plc '2006-4X A3C' FRN 10/12/2044	634,667	0.01
EUR 158,605	Eurosail 2006-4np Plc '2006-4X B1A' FRN 10/12/2044	123,939	0.00
GBP 2,485,000	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A3' FRN 13/6/2045	2,969,028	0.04
GBP 1,325,000	Finsbury Square 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 16/2/2058	1,732,737	0.02
GBP 494,796	Finsbury Square 2016-1 Plc '2016-1 X' FRN 16/2/2058	647,877	0.01
GBP 140,000	Gala Electric Casinos Ltd 11.5% 1/6/2019	191,519	0.00
GBP 140,845	Gemgarto 2015-1 PLC '2015-1 X1' FRN 16/2/2047	175,380	0.00
GBP 455,000	Gemgarto Plc '2015-2 B' FRN 16/2/2054	592,383	0.01
GBP 102,500	Gemgarto Plc '2015-2 X1' FRN 16/2/2054	133,896	0.00
GBP 1,619,369	Gosforth Funding 2014-1 Plc '2014-1 A1' FRN 19/10/2056	2,114,947	0.03
GBP 615,000	Gosforth Funding 2014-1 Plc '2014-1 A2' FRN 19/10/2056	805,890	0.01
GBP 10,718,223	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	13,734,334	0.18
GBP 1,450,000	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	2,092,859	0.03
GBP 3,220,000	Hawksmoor Mortgages 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 25/5/2053	4,136,933	0.05
EUR 1,190,000	HBOS Plc FRN 18/3/2030	1,473,272	0.02
GBP 435,000	House of Fraser Funding Plc FRN 15/9/2020	530,897	0.01
USD 2,175,000	HSBC Holdings Plc FRN 1/6/2021 (Perpetual)	2,281,031	0.03
EUR 1,435,000	HSBC Holdings Plc FRN 29/9/2023 (Perpetual)*	1,645,329	0.02
EUR 2,400,000	HSBC Holdings Plc 0.875% 6/9/2024	2,666,483	0.03
GBP 1,550,000	HSBC Holdings Plc 2.625% 16/8/2028	2,030,819	0.03
USD 2,272,000	HSBC Holdings Plc 3.6% 25/5/2023	2,354,696	0.03
GBP 200,000	Iceland Bondco Plc 6.75% 15/7/2024*	240,293	0.00
GBP 175,000	IDH Finance Plc 6.25% 15/8/2022	229,257	0.00
EUR 2,231,000	Ineos Finance Plc 4% 1/5/2023	2,547,185	0.03
EUR 251,000	Inovyn Finance Plc 6.25% 15/5/2021	295,962	0.00
EUR 380,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	466,213	0.01
USD 528,000	International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/2/2022	569,712	0.01
EUR 2,796,000	Kensington Mortgage Securities Plc '2007-1X A3B' FRN 14/6/2040	2,912,004	0.04
EUR 600,000	Leek Finance Number Nineteen Plc FRN 21/12/2038	674,360	0.01
GBP 6,300,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X A' FRN 20/8/2025	8,149,831	0.10
GBP 8,830,000	Logistics UK 2015 Plc '2015-1X E' FRN 20/8/2025	10,868,248	0.14
EUR 1,050,000	Ludgate Funding Plc '2007-1 BB' FRN 1/1/2061	862,595	0.01
EUR 900,000	Ludgate Funding Plc '2007-1 MB' FRN 1/1/2061	797,930	0.01
GBP 2,000,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,944,241	0.02
GBP 143,428	Nemus II Arden Plc '2006-2 C' FRN 15/2/2020	175,443	0.00
GBP 600,000	New Look Secured Issuer Plc 6.5% 1/7/2022	763,011	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 100,000	Old Mutual Plc 8% 3/6/2021	150,886	0.00
EUR 542,000	OTE Plc 3.5% 9/7/2020	623,737	0.01
EUR 4,891,340	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A1' FRN 15/1/2043	5,365,017	0.07
GBP 5,282,265	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A2' FRN 15/1/2043	6,848,105	0.09
GBP 1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'C' FRN 15/1/2043	1,482,662	0.02
GBP 100,000	Pension Insurance Corp Plc 6.5% 3/7/2024	132,082	0.00
GBP 550,000	Pizzaexpress Financing 2 Plc 6.625% 1/8/2021	719,958	0.01
GBP 923,504	Precise Mortgage Funding 2014-1 Plc '2014-1 A' FRN 12/9/2047	1,198,349	0.02
GBP 81,956	Punch Taverns Finance Plc FRN 15/7/2021	101,863	0.00
GBP 800,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' FRN 15/10/2027	881,611	0.01
GBP 1,167,900	Punch Taverns Finance Plc 7.274% 15/10/2026	1,636,795	0.02
GBP 425,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' 7.274% 15/10/2026	589,174	0.01
GBP 1,460,335	Punch Taverns Finance Plc 7.32% 15/10/2025	2,050,618	0.03
GBP 544,000	Punch Taverns Finance Plc '144A' 7.32% 15/10/2025	732,147	0.01
GBP 800,000	Rochester Financing No.1 Plc 2.018% 16/7/2046	1,046,842	0.01
USD 2,114,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/8/2021 (Perpetual)	2,158,922	0.03
USD 10,800,000	Santander UK Group Holdings Plc 2.875% 5/8/2021	10,773,389	0.14
USD 3,175,000	Sensata Technologies UK Financing Co plc '144A' 6.25% 15/2/2026	3,492,500	0.04
GBP 93,978	Silk Road Finance Number Three Plc '2012-1 A' FRN 21/6/2055	123,205	0.00
GBP 10,250,000	Silverstone Master Issuer Plc '2015-1X 1A' FRN 21/1/2070	13,411,702	0.17
EUR 990,000	Sky Plc 1.5% 15/9/2021	1,157,522	0.01
EUR 4,300,000	Sky Plc 2.25% 17/11/2025	5,265,151	0.07
EUR 200,000	Sky Plc 2.5% 15/9/2026	248,686	0.00
GBP 4,070,000	Slate No.1 Plc FRN 24/1/2051	5,023,619	0.06
GBP 475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	638,465	0.01
GBP 4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,474,051	0.07
GBP 2,215,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2036	2,724,930	0.03
GBP 818,000	Spirit Issuer Plc 6.582% 28/12/2018	1,121,478	0.01
GBP 400,000	SSE Plc FRN 10/9/2020 (Perpetual)	530,848	0.01
USD 1,360,000	Standard Chartered Plc FRN 2/4/2022 (Perpetual)	1,363,672	0.02
USD 5,126,000	Standard Chartered Plc '144A' 2.1% 19/8/2019	5,141,457	0.07
USD 1,700,000	Standard Chartered Plc 4.05% 12/4/2026	1,811,444	0.02
USD 975,000	Standard Chartered Plc 4.3% 19/2/2027*	983,166	0.01
USD 3,180,000	Standard Chartered Plc '144A' 4.3% 19/2/2027	3,218,532	0.04
GBP 895,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/4/2019	1,176,960	0.01
GBP 735,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 5.75% 15/4/2019	986,467	0.01
EUR 302,000	Synlab Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	366,446	0.00
EUR 483,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	591,486	0.01
EUR 666,707	Taurus 2013 GMF1 Plc '2013-GMF1 D' FRN 21/5/2024	754,264	0.01
EUR 2,583,200	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 A' FRN 1/2/2026	2,855,689	0.04
EUR 1,821,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 D' FRN 1/2/2026	1,985,613	0.03
EUR 2,309,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 E' FRN 1/2/2026	2,504,063	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国 (続き)			
GBP 385,000	Temese Funding 1 Plc FRN 21/11/2021	502,982	0.01
EUR 431,000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 2.5% 1/7/2024	496,888	0.01
GBP 100,000	Tesco Plc 5% 24/3/2023	145,244	0.00
GBP 200,000	Tesco Plc 6% 14/12/2029	307,999	0.00
GBP 962,824	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,556,761	0.02
GBP 2,176,603	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,031,635	0.04
GBP 983,226	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,345,459	0.02
EUR 100,000	Titan Global Finance Plc 3.5% 17/6/2021	114,760	0.00
GBP 100,000	Travis Perkins Plc 4.5% 7/9/2023	134,255	0.00
GBP 360,000	Trinity Square 2015-1 Plc '2015-1X B' FRN 15/7/2051	453,620	0.01
USD 203,000	Tullow Oil Plc '144A' 6% 1/11/2020	178,133	0.00
GBP 451,100	Turbo Finance 4 Plc 'A' FRN 20/1/2021	590,808	0.01
GBP 4,831,425	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	6,603,920	0.08
GBP 12,850,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	14,107,500	0.18
GBP 4,469,400	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	6,278,378	0.08
GBP 1,484,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,920,341	0.02
GBP 32,188,000	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0.125% 22/3/2026	53,057,724	0.68
USD 2,000,000	Vedanta Resources Plc 6% 31/1/2019	1,895,000	0.02
USD 2,394,000	Vedanta Resources Plc 8.25% 7/6/2021*	2,300,634	0.03
EUR 106,000	Virgin Media Finance Plc 4.5% 15/1/2025	122,818	0.00
GBP 1,323,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027	1,823,113	0.02
GBP 360,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.5% 15/1/2025	506,812	0.01
GBP 2,484,000	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	3,611,758	0.05
GBP 1,530,000	Vodafone Group Plc 3% 12/8/2056	2,082,360	0.03
USD 5,220,000	Vodafone Group Plc 4.375% 19/2/2043	5,378,453	0.07
GBP 200,000	Voyage Care Bondco Plc 6.5% 1/8/2018*	261,667	0.00
GBP 510,000	Vue International Bidco Plc 7.875% 15/7/2020	700,964	0.01
GBP 7,880,282	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	10,142,921	0.13
GBP 4,795,000	Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	6,172,718	0.08
		344,301,100	4.39
米国			
USD 2,180,000	1211 Avenue of the Americas Trust '2015-1211 A1A2' '144A' 3.901% 10/8/2035	2,447,214	0.03
USD 5,687,000	AbbVie Inc 3.2% 14/5/2026	5,832,584	0.07
USD 750,000	ACAS CLO 2012-1 Ltd '2012-1A CR' '144A' FRN 20/9/2023	765,748	0.01
USD 500,000	ACAS CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A2BR' '144A' FRN 25/10/2025	500,000	0.01
USD 265,000	ACAS CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 18/7/2026	264,109	0.00
USD 400,000	ACAS CLO 2015-1 Ltd '2015-1A A1' '144A' FRN 18/4/2027	400,160	0.01
USD 1,000,000	ACAS CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 18/4/2027	968,972	0.01
USD 1,000,000	Adirondack Park CLO Ltd '2013-1A D' '144A' FRN 15/4/2024	972,122	0.01
USD 5,575,000	Aetna Inc 3.2% 15/6/2026	5,676,878	0.07
USD 2,310,000	Aetna Inc 4.375% 15/6/2046	2,401,571	0.03
USD 2,525,000	Air Lease Corp 3% 15/9/2023	2,511,112	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,871,585	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2015-C A' '144A' 3.875% 25/3/2057	7,752,231	0.10
USD 2,910,000	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-B A' '144A' 4% 25/9/2065	2,910,905	0.04
USD 2,585,563	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-1 A' '144A' 4.25% 25/7/2047	2,588,240	0.03
USD 4,272,548	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-A A' '144A' 4.25% 25/8/2064	4,264,562	0.05
USD 2,140,000	Alcatel-Lucent USA Inc 6.45% 15/3/2029	2,332,600	0.03
USD 2,180,000	Ally Financial Inc 8% 1/11/2031	2,735,900	0.04
USD 250,000	ALM V Ltd '2012-5A DR' '144A' FRN 18/10/2027	238,383	0.00
USD 310,000	ALM VI Ltd '2012-6A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	310,988	0.00
USD 2,685,000	ALM VI Ltd '2012-6A CR' '144A' FRN 15/7/2026	2,646,582	0.03
USD 3,225,000	ALM VI Ltd '2012-6A DR' '144A' FRN 15/7/2026	3,056,122	0.04
USD 3,750,000	ALM VII Ltd '2012-7A A1' '144A' FRN 19/10/2024	3,749,217	0.05
USD 1,495,000	ALM VII Ltd '2012-7A C' '144A' FRN 19/10/2024	1,497,105	0.02
USD 780,000	ALM VII Ltd '2012-7A D' '144A' FRN 19/10/2024	757,804	0.01
USD 1,803,000	ALM VII R Ltd '2013-7RA A2' '144A' FRN 24/4/2024	1,809,089	0.02
USD 490,000	ALM VII R Ltd '2013-7RA C' '144A' FRN 24/4/2024	482,010	0.01
USD 970,000	ALM VII R Ltd '2013-7RA D' '144A' FRN 24/4/2024	919,989	0.01
USD 2,240,000	ALM VII R-2 Ltd '2013-7R2A A2' '144A' FRN 24/4/2024	2,244,805	0.03
USD 625,000	ALM VII R-2 Ltd '2013-7R2A C' '144A' FRN 24/4/2024	613,835	0.01
USD 250,000	ALM VII R-2 Ltd '2013-7R2A D' '144A' FRN 24/4/2024	244,258	0.00
USD 385,000	ALM VIII Ltd '2013-8A B' '144A' FRN 20/1/2026	382,034	0.01
USD 700,000	ALM VIII Ltd '2013-8A C' '144A' FRN 20/1/2026	673,880	0.01
USD 900,000	ALM VIII Ltd '2013-8A D' '144A' FRN 20/1/2026	786,131	0.01
USD 400,000	ALM X Ltd '2013-10A B' '144A' FRN 15/1/2025	393,510	0.01
USD 510,000	ALM X Ltd '2013-10A C' '144A' FRN 15/1/2025	483,586	0.01
USD 1,000,000	ALM XI Ltd '2014-11A A2A' '144A' FRN 17/10/2026	994,379	0.01
USD 655,000	ALM XI Ltd '2014-11A C' '144A' FRN 17/10/2026	639,143	0.01
USD 433,000	ALM XII Ltd '2015-12A B' '144A' FRN 16/4/2027	441,363	0.01
USD 260,000	ALM XII Ltd '2015-12A C1' '144A' FRN 16/4/2027	257,155	0.00
USD 500,000	ALM XII Ltd '2015-12A D' '144A' FRN 16/4/2027	456,561	0.01
USD 425,000	ALM XIV Ltd '2014-14A A1' '144A' FRN 28/7/2026	425,188	0.01
USD 831,000	ALM XIV Ltd '2014-14A B' '144A' FRN 28/7/2026	832,942	0.01
USD 1,235,000	ALM XIV Ltd '2014-14A C' '144A' FRN 28/7/2026	1,209,491	0.02
USD 720,000	ALM XVII Ltd '2015-17A C1' '144A' FRN 15/1/2028	702,699	0.01
USD 275,000	ALM XVIII Ltd '2016-18A D' '144A' FRN 15/7/2027	261,250	0.00
USD 1,840,784	Alternative Loan Trust '2005-38 A3' FRN 25/9/2035	1,589,719	0.02
USD 4,642,739	Alternative Loan Trust '2005-72 A3' FRN 25/1/2036	3,959,943	0.05
USD 1,542,218	Alternative Loan Trust '2005-76 2A1' FRN 25/2/2036	1,366,126	0.02
USD 2,753,130	Alternative Loan Trust '2006-23CB 2A5' FRN 25/8/2036	953,739	0.01
USD 1,588,270	Alternative Loan Trust '2006-J7 2A1' FRN 20/11/2036	953,798	0.01
USD 3,374,132	Alternative Loan Trust '2006-0A6 1A2' FRN 25/7/2046	2,846,864	0.04
USD 1,012,919	Alternative Loan Trust '2006-0A8 1A1' FRN 25/7/2046	839,694	0.01
USD 1,207,280	Alternative Loan Trust '2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046	923,598	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,729,753	Alternative Loan Trust '2006-0A14 1A1' FRN 25/11/2046	4,633,962	0.06
USD 9,672,857	Alternative Loan Trust '2007-0A2 1A1' FRN 25/3/2047	7,598,999	0.10
USD 2,011,963	Alternative Loan Trust '2007-0A3 1A1' FRN 25/4/2047	1,725,994	0.02
USD 11,569,411	Alternative Loan Trust '2007-0H3 A1A' FRN 25/9/2047	9,706,136	0.12
USD 2,467,073	Alternative Loan Trust '2005-80CB 4A1' 6% 25/2/2036	1,963,344	0.03
USD 5,711,364	Alternative Loan Trust '2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	3,957,821	0.05
USD 1,869,853	Alternative Loan Trust '2006-15CB A1' 6.5% 25/6/2036	1,375,337	0.02
USD 5,830,096	Alternative Loan Trust '2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	4,653,568	0.06
USD 4,500,000	Altice US Finance I Corp '144A' 5.375% 15/7/2023	4,736,250	0.06
USD 2,221,000	Altria Group Inc 5.375% 31/1/2044	2,891,011	0.04
USD 2,150,000	Amazon.com Inc 4.95% 5/12/2044	2,718,689	0.03
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc '144A' 4.625% 1/3/2020	2,377,769	0.03
USD 1,586,681	American Home Mortgage Assets Trust '2006-3 2A11' FRN 25/10/2046	1,121,601	0.01
USD 3,495,124	American Home Mortgage Assets Trust '2006-4 1A12' FRN 25/10/2046	2,346,306	0.03
USD 4,881,218	American Home Mortgage Assets Trust '2006-5 A1' FRN 25/11/2046	2,661,251	0.03
USD 968,439	American Home Mortgage Assets Trust '2007-1 A1' FRN 25/2/2047	538,060	0.01
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	2,068,336	0.03
USD 5,380,000	American International Group Inc 3.9% 1/4/2026	5,680,091	0.07
USD 4,980,000	American Tower Corp 3.375% 15/10/2026	5,119,044	0.07
USD 7,404,000	Amgen Inc 4.4% 1/5/2045	7,970,521	0.10
USD 380,000	AMMC CLO 15 Ltd '2014-15A C1' '144A' FRN 9/12/2026	389,269	0.01
USD 530,000	AMMC CLO 15 Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 9/12/2026	520,147	0.01
USD 710,000	AMMC CLO 16 Ltd '2015-16A C' '144A' FRN 14/4/2027	715,465	0.01
USD 280,000	AMMC CLO 16 Ltd '2015-16A D' '144A' FRN 14/4/2027	268,732	0.00
USD 1,365,000	AMMC CLO 17 Ltd '2015-17A B' '144A' FRN 15/11/2027	1,367,492	0.02
USD 670,000	AMMC CLO 17 Ltd '2015-17A C' '144A' FRN 15/11/2027	669,161	0.01
USD 450,000	AMMC CLO 18 Ltd '2016-18A D' '144A' FRN 26/5/2028	445,394	0.01
USD 830,000	AMMC CLO IX Ltd '2011-9A DR' '144A' FRN 15/1/2022	838,777	0.01
USD 1,320,000	AMMC CLO IX Ltd '2011-9A ER' '144A' FRN 15/1/2022	1,333,794	0.02
USD 500,000	AMMC CLO X Ltd '2012-10A D' '144A' FRN 11/4/2022	522,380	0.01
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 13/7/2025	835,551	0.01
USD 1,270,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A2A' '144A' FRN 13/7/2025	1,262,770	0.02
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A B' '144A' FRN 13/7/2025	336,792	0.00
USD 2,375,000	Anchorage Capital CLO 3 Ltd '2014-3A B' '144A' FRN 28/4/2026	2,386,490	0.03
USD 1,098,969	Anchorage Capital CLO 3 Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 28/4/2026	1,060,370	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A D' '144A' FRN 15/4/2027	572,877	0.01
USD 500,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A E1' '144A' FRN 15/4/2027	437,340	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,812,500	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A C' '144A' FRN 15/10/2027	1,810,288	0.02
USD 1,625,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A D' '144A' FRN 15/10/2027	1,591,479	0.02
USD 390,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd '2016-8A D' '144A' FRN 28/7/2028	371,475	0.00
USD 2,870,000	Angel Oak Mortgage Trust I LLC (Step-up coupon) '2016-1 A1' '144A' 3.5% 25/7/2046	2,864,934	0.04
USD 1,515,157	Angel Oak Mortgage Trust LLC (Step-up coupon) '2015-1 A' '144A' FRN 25/11/2045	1,522,952	0.02
USD 250,000	Annisa CLO Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/7/2028	231,347	0.00
USD 2,910,000	Apache Corp 4.75% 15/4/2043	3,025,623	0.04
USD 2,255,000	Apidos CLO IX '2012-9AR CR' '144A' FRN 15/7/2023	2,271,572	0.03
USD 1,235,000	Apidos CLO IX '2012-9AR DR' '144A' FRN 15/7/2023	1,223,964	0.02
USD 500,000	Apidos CLO IX '2012-9AR ER' '144A' FRN 15/7/2023	500,153	0.01
USD 4,350,000	Apidos CLO XI '2012-11A A' '144A' FRN 17/1/2023	4,334,504	0.06
USD 1,140,000	Apidos CLO XI '2012-11A C' '144A' FRN 17/1/2023	1,144,172	0.01
USD 19,957,000	Apidos CLO XII '2013-12A A' '144A' FRN 15/4/2025	19,851,798	0.25
USD 1,110,000	Apidos CLO XIV '2013-14A C1' '144A' FRN 15/4/2025	1,104,173	0.01
USD 500,000	Apidos CLO XIX '2014-19A D' '144A' FRN 17/10/2026	495,856	0.01
USD 800,000	Apidos CLO XIX '2014-19A E' '144A' FRN 17/10/2026	733,139	0.01
USD 1,290,000	Apidos CLO XV '2013-15A A1' '144A' FRN 20/10/2025	1,289,705	0.02
USD 550,000	Apidos CLO XV '2013-15A D' '144A' FRN 20/10/2025	497,896	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI '2013-16A C' '144A' FRN 19/1/2025	454,729	0.01
USD 675,000	Apidos CLO XVII '2014-17A A1A' '144A' FRN 17/4/2026	675,708	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XVII '2014-17A B' '144A' FRN 17/4/2026	249,161	0.00
USD 1,030,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A A1' '144A' FRN 22/7/2026	1,029,432	0.01
USD 420,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A C' '144A' FRN 22/7/2026	414,559	0.01
USD 375,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A D' '144A' FRN 22/7/2026	346,157	0.00
USD 500,000	Apidos CLO XXI '2015-21A C' '144A' FRN 18/7/2027	467,394	0.01
USD 8,702,000	Apple Inc 3.85% 4/8/2046	9,067,945	0.12
USD 4,417,000	Apple Inc 4.65% 23/2/2046	5,175,944	0.07
USD 3,160,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	3,160,000	0.04
USD 800,000	ARES CLO Ltd '2012-2A AR' '144A' FRN 12/10/2023	798,229	0.01
USD 740,000	ARES CLO Ltd '2012-2A CR' '144A' FRN 12/10/2023	742,924	0.01
USD 750,000	ARES CLO Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 12/10/2023	731,708	0.01
USD 710,000	Ares XXII CLO Ltd '2007-22A B' '144A' FRN 15/8/2019	694,408	0.01
USD 1,000,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1A CR' '144A' FRN 19/4/2023	1,020,636	0.01
USD 2,000,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 19/4/2023	2,006,068	0.03
USD 1,750,000	Ares XXIII CLO Ltd '2012-1A E' '144A' FRN 19/4/2023	1,727,188	0.02
USD 335,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3A D' '144A' FRN 17/1/2024	335,179	0.00
USD 275,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3X C' FRN 17/1/2024	275,144	0.00
USD 750,000	Ares XXV CLO Ltd '2012-3X D' FRN 17/1/2024	750,400	0.01
USD 390,000	Ares XXVII CLO Ltd '2013-2A D' '144A' FRN 28/7/2025	376,674	0.00
USD 2,000,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A A2' '144A' FRN 15/11/2025	2,002,461	0.03
USD 255,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A B' '144A' FRN 15/11/2025	259,266	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 515,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A C' '144A' FRN 15/11/2025	516,257	0.01
USD 275,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 5/12/2025	274,404	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 5/12/2025	236,092	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1X C' FRN 5/12/2025	249,458	0.00
USD 840,000	Ares XXXIX CLO Ltd '2016-39A E' '144A' FRN 18/7/2028	821,811	0.01
USD 925,000	Ares XXXVII CLO Ltd '2015-4A C' '144A' FRN 15/10/2026	929,410	0.01
USD 835,000	Ares XXXVII CLO Ltd '2015-4A D2' '144A' FRN 15/10/2026	825,097	0.01
USD 280,000	Ares XXXVIII CLO Ltd '2015-38A D' '144A' FRN 20/1/2027	271,878	0.00
USD 6,503,984	Argent Mortgage Loan Trust '2005-W1 A2' FRN 25/5/2035	5,121,507	0.07
USD 2,635,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	2,433,567	0.03
USD 720,000	Arrowpoint CLO 2016-5 Ltd '2016-5A D' '144A' FRN 15/7/2028	715,708	0.01
USD 900,000	Ashland Inc 3.875% 15/4/2018	928,125	0.01
USD 5,194,000	AT&T Inc 3.4% 15/5/2025	5,374,047	0.07
USD 13,690,000	AT&T Inc 4.125% 17/2/2026	14,960,480	0.19
USD 330,000	Atlas Senior Loan Fund II Ltd '2012-2A D' '144A' FRN 30/1/2024	328,571	0.00
USD 975,000	Atlas Senior Loan Fund III Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 18/8/2025	971,436	0.01
USD 300,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A3L' '144A' FRN 17/2/2026	297,064	0.00
USD 330,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd '2012-1A A3LR' '144A' FRN 15/8/2024	330,000	0.00
USD 540,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd '2012-1A B1LR' '144A' FRN 15/8/2024	540,000	0.01
USD 1,625,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd '2012-1A B2L' '144A' FRN 15/8/2024	1,625,600	0.02
USD 705,000	Atlas Senior Loan Fund V Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 16/7/2026	708,255	0.01
USD 375,000	Atlas Senior Loan Fund V Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 16/7/2026	349,203	0.00
USD 250,000	Atlas Senior Loan Fund VI Ltd '2014-6A D' '144A' FRN 15/10/2026	239,124	0.00
USD 1,710,000	Atrium CDO Corp '144A' FRN 23/10/2022	1,714,526	0.02
USD 3,000,000	Atrium IX '144A' FRN 28/2/2024	2,948,127	0.04
USD 1,540,000	Atrium VII '144A' FRN 16/11/2022	1,543,048	0.02
USD 644,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	640,983	0.01
USD 830,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	805,423	0.01
USD 1,250,000	Atrium XII '144A' FRN 22/10/2026	1,208,438	0.02
USD 564,000	AutoZone Inc 3.125% 21/4/2026	583,036	0.01
USD 2,178,670	Aventura Mall Trust '2013-AVM E' '144A' FRN 5/12/2032	2,211,355	0.03
USD 780,000	Aviation Capital Group Corp '144A' 7.125% 15/10/2020	917,163	0.01
USD 2,185,000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance Inc 5.5% 1/4/2023	2,264,206	0.03
USD 17,143,537	B2R Mortgage Trust '2015-2 XA' '144A' FRN 15/11/2048	1,090,929	0.01
USD 984,238	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	983,076	0.01
USD 2,979,780	B2R Mortgage Trust '2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	3,063,455	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 530,000	Babson CLO Ltd '2012-1A A2' '144A' FRN 15/4/2022	530,554	0.01
USD 750,000	Babson CLO Ltd '2012-1A B' '144A' FRN 15/4/2022	753,593	0.01
USD 5,110,000	Babson CLO Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 20/4/2025	5,078,929	0.06
USD 1,000,000	Babson CLO Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 20/7/2025	988,774	0.01
USD 260,000	Babson CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 23/4/2027	248,300	0.00
USD 300,000	Babson CLO Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/7/2028	284,250	0.00
EUR 101,000	Ball Corp 4.375% 15/12/2023	129,917	0.00
USD 623,000	Baltimore Gas & Electric Co 2.4% 15/8/2026	621,131	0.01
USD 770,000	Baltimore Gas & Electric Co 3.5% 15/8/2046	785,243	0.01
USD 2,030,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSMZ M' '144A' FRN 15/9/2018	2,033,786	0.03
USD 1,917,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSNY F' '144A' FRN 15/9/2026	1,906,074	0.02
USD 2,925,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL1 D' '144A' FRN 15/12/2031	2,793,271	0.04
USD 1,767,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-200P F' '144A' FRN 14/4/2033	1,626,527	0.02
USD 5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2016-ISQ E' '144A' FRN 14/8/2034	4,481,550	0.06
USD 4,197,285	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2015-UBS7 XA' FRN 15/9/2048	257,589	0.00
USD 1,331,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-1 AMFX' FRN 15/1/2049	1,325,423	0.02
USD 3,640,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-3 AJ' FRN 10/6/2049	3,646,480	0.05
USD 13,213,736	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2016-UB10 XA' FRN 15/6/2049	1,731,382	0.02
USD 5,361,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	5,477,859	0.07
USD 323,256	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2008-1 A4' FRN 10/2/2051	336,509	0.00
USD 265,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2015-UBS7 D' 3.167% 15/9/2048	212,972	0.00
USD 976,114	Banc of America Funding 2006-A Trust '2006-A 3A2' FRN 20/2/2036	785,764	0.01
USD 386,264	Banc of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Inc '2005-3 AM' 4.727% 10/7/2043	384,815	0.01
USD 33,485	Banc of America Re-REMIC Trust '2010-UB4 A4B' '144A' FRN 20/12/2041	33,352	0.00
GBP 2,150,000	Bank of America Corp 2.3% 25/7/2025	2,883,008	0.04
USD 14,825,000	Bank of America Corp 3.5% 19/4/2026	15,534,947	0.20
USD 18,730,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	20,276,826	0.26
USD 3,026,000	Bank of New York Mellon Corp/The FRN 20/9/2026 (Perpetual)	3,026,000	0.04
USD 2,597,000	Bank of New York Mellon Corp/The 2.8% 4/5/2026	2,683,017	0.03
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust '1998-2 B1' FRN 10/12/2025	2,272,674	0.03
USD 280,000	Battalion Clo 2007-I Ltd '2007-1A C' '144A' FRN 14/7/2022	277,048	0.00
USD 960,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A A2' '144A' FRN 17/10/2026	960,459	0.01
USD 680,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A B' '144A' FRN 17/10/2026	701,704	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 710,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A C' '144A' FRN 17/10/2026	644,601	0.01
USD 250,000	Battalion CLO VIII Ltd '2015-8A C' '144A' FRN 18/4/2027	245,291	0.00
USD 320,000	Battalion CLO VIII Ltd '2015-8A D' '144A' FRN 18/4/2027	288,877	0.00
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	5,329,154	0.07
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	2,015,444	0.03
USD 841,371	Bayview Commercial Asset Trust '2006-3A A2' '144A' FRN 25/10/2036	695,105	0.01
USD 6,826,285	Bayview Commercial Asset Trust '2007-4A A1' '144A' FRN 25/9/2037	5,768,224	0.07
USD 1,428,221	Bayview Commercial Asset Trust '2008-4 A3' '144A' FRN 25/7/2038	1,465,348	0.02
USD 9,080,441	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2004-B A1' '144A' FRN 28/5/2039	6,668,673	0.09
USD 1,688,402	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2005-E A1' '144A' FRN 28/12/2040	1,306,951	0.02
USD 5,790,000	Bayview Opportunity Master Fund IIa Trust (Step-up coupon) '2016-RPL3 A1' '144A' 3.475% 28/7/2031	5,797,411	0.07
USD 2,147,359	Bayview Opportunity Master Fund IIIa Trust (Step-up coupon) '2014-16RP A' '144A' FRN 28/11/2029	2,144,632	0.03
USD 802,260	Bayview Opportunity Master Fund IIIb RPL Trust (Step-up coupon) '2015-3 A1' '144A' 3.623% 28/4/2030	799,183	0.01
USD 1,450,000	BBCMS Trust '2015-SLP D' '144A' FRN 15/2/2028	1,425,230	0.02
USD 20,840,000	BBCMS Trust '2015-SRCH XA' '144A' FRN 10/8/2035	1,666,471	0.02
USD 11,710,000	BBCMS Trust '2015-SRCH XB' '144A' FRN 10/8/2035	243,041	0.00
USD 1,002,612	BCAP LLC 2010-RR11-I Trust '2010-RR11 4A1' '144A' FRN 27/3/2047	918,804	0.01
USD 1,634,188	BCMSC Trust '2000-A A2' FRN 15/6/2030	750,799	0.01
USD 1,517,154	BCMSC Trust '2000-A A3' FRN 15/6/2030	847,710	0.01
USD 2,597,573	BCMSC Trust '2000-A A4' FRN 15/6/2030	1,533,035	0.02
USD 1,259,475	Bear Stearns ALT-A Trust '2006-6 1A1' FRN 25/11/2036	991,027	0.01
USD 4,795,133	Bear Stearns ALT-A Trust II '2007-1 1A1' FRN 25/9/2047	3,320,740	0.04
USD 292,285	Bear Stearns ARM Trust '2004-5 2A' FRN 25/7/2034	292,320	0.00
USD 1,297,721	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,100,957	0.01
USD 2,429,751	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-EC2 M2' FRN 25/2/2036	2,156,184	0.03
USD 6,704,623	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	6,527,854	0.08
USD 5,746,436	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE9 2A' FRN 25/11/2036	4,941,042	0.06
USD 3,266,711	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE10 22A' FRN 25/12/2036	2,777,976	0.04
USD 1,694,340	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-AQ2 A2' FRN 25/1/2037	1,540,901	0.02
USD 1,048,862	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	964,244	0.01
USD 1,367,426	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	1,100,958	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,154,348	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 23A' FRN 25/3/2037	2,437,172	0.03
USD 5,683,171	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE3 1A4' FRN 25/4/2037	3,454,433	0.04
USD 4,578,462	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2005-AC9 A5' 6.25% 25/12/2035	4,461,649	0.06
USD 5,403,448	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2006-AC1 1A2' 6.25% 25/2/2036	4,207,642	0.05
USD 764,915	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust '2005-4 M2' FRN 25/1/2036	730,715	0.01
USD 410,654	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2007-PW18 AM' FRN 11/6/2050	425,641	0.01
USD 2,754,978	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust '2007-PW15 A1A' 5.317% 11/2/2044	2,786,018	0.04
USD 826,441	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR2 A1' FRN 25/3/2037	679,033	0.01
USD 1,226,621	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR3 1A1' FRN 25/3/2037	1,015,609	0.01
USD 1,012,588	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR4 2A1' FRN 25/6/2037	837,118	0.01
USD 1,330,000	Bear Stearns Second Lien Trust '2007-SV1A M1' '144A' FRN 25/12/2036	1,264,848	0.02
EUR 400,000	Belden Inc 5.5% 15/4/2023	477,171	0.01
USD 2,295,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA A1A' '144A' FRN 20/7/2026	2,303,317	0.03
USD 760,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA B' '144A' FRN 20/7/2026	753,459	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA C' '144A' FRN 20/7/2026	470,546	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners Clo IX Ltd '2016-9A E' '144A' FRN 20/7/2028	430,000	0.01
USD 1,020,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA A2' '144A' FRN 18/4/2027	1,018,251	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA C' '144A' FRN 18/4/2027	599,183	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA D' '144A' FRN 18/4/2027	457,707	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd '2015-8A B' '144A' FRN 20/1/2028	497,658	0.01
USD 680,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd '2015-8A C' '144A' FRN 20/1/2028	647,802	0.01
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd '2015-8A D' '144A' FRN 20/1/2028	445,785	0.01
USD 460,000	Betony CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	435,911	0.01
USD 2,400,000	BHMS 2014-ATLS Mortgage Trust '2014-ATLS AFL' '144A' FRN 5/7/2033	2,397,235	0.03
USD 280,000	Birchwood Park CLO Ltd '2014-1A D1' '144A' FRN 15/7/2026	264,753	0.00
USD 470,000	BlueMountain CLO 2012-1 Ltd '2012-1A B' '144A' FRN 20/7/2023	470,932	0.01
USD 280,000	BlueMountain CLO 2012-1 Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 20/7/2023	281,058	0.00
USD 1,100,000	BlueMountain CLO 2012-1 Ltd '2012-1A D' '144A' FRN 20/7/2023	1,111,799	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 530,000	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd '2012-2A B1' '144A' FRN 20/11/2024	530,337	0.01
USD 250,000	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd '2012-2A C' '144A' FRN 20/11/2024	250,417	0.00
USD 2,475,000	BlueMountain CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 15/5/2025	2,470,186	0.03
USD 260,000	BlueMountain CLO 2013-1 Ltd '2013-1A B' '144A' FRN 15/5/2025	259,609	0.00
USD 3,125,000	BlueMountain CLO 2013-1 Ltd '2013-1A C' '144A' FRN 15/5/2025	3,055,789	0.04
USD 1,020,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A' '144A' FRN 22/1/2025	1,018,348	0.01
USD 2,280,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A' '144A' FRN 29/10/2025	2,279,327	0.03
USD 840,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A C' '144A' FRN 29/10/2025	832,808	0.01
USD 682,000	BlueMountain CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 30/4/2026	676,622	0.01
USD 790,000	BlueMountain CLO 2014-2 Ltd '2014-2A A' '144A' FRN 20/7/2026	791,950	0.01
USD 530,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd '2014-4A E' '144A' FRN 30/11/2026	487,600	0.01
USD 250,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A B' '144A' FRN 13/4/2027	252,290	0.00
USD 480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	474,103	0.01
USD 889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	858,748	0.01
USD 750,000	BlueMountain CLO 2015-2 Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 18/7/2027	659,925	0.01
USD 280,000	BlueMountain CLO 2015-4 Ltd '2015-4A D2' '144A' FRN 20/1/2027	271,532	0.00
USD 280,000	BlueMountain CLO 2015-4 Ltd '2015-4A E' '144A' FRN 20/1/2027	269,592	0.00
USD 250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 20/8/2028	237,445	0.00
USD 530,000	BlueMountain CLO II Ltd '2006-2A B' '144A' FRN 15/7/2018	522,742	0.01
USD 1,575,000	BlueMountain CLO Ltd '2011-1A E' '144A' FRN 16/8/2022	1,582,542	0.02
USD 5,709	BNC Mortgage Loan Trust '2007-3 A2' FRN 25/7/2037	5,710	0.00
USD 1,055,000	Bowman Park CLO Ltd '2014-1A D2' '144A' FRN 23/11/2025	1,023,762	0.01
USD 3,520,000	Brooklyn Arena Local Development Corp 5% 15/7/2042	4,284,685	0.05
USD 609,000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.9% 1/8/2046	664,593	0.01
USD 3,962,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 F' '144A' FRN 10/3/2033	3,853,234	0.05
USD 1,200,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 D' '144A' 3.633% 10/3/2033	1,223,703	0.02
USD 1,530,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 E' '144A' 3.717% 10/3/2033	1,537,503	0.02
USD 2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust '2015-1740 E' '144A' FRN 13/1/2035	1,880,506	0.02
USD 2,079,000	Caesars Entertainment Resort Properties LLC / Caesars Entertainment Resort Prope 8% 1/10/2020	2,115,382	0.03
USD 1,204,000	CalAtlantic Group Inc 10.75% 15/9/2016	1,207,124	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	California Pollution Control Financing Authority '144A' 5% 21/11/2045	2,255,760	0.03
USD 273,000	California Resources Corp '144A' 8% 15/12/2022	187,005	0.00
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,728,010	0.03
USD 1,000,000	California Statewide Communities Development Authority '144A' 5% 1/12/2025	1,221,865	0.02
USD 1,000,000	California Statewide Communities Development Authority '144A' 5% 1/12/2026	1,222,795	0.02
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,527,600	0.02
USD 2,184,000	Calpine Corp 5.5% 1/2/2024	2,184,000	0.03
USD 2,140,000	Calpine Corp 5.75% 15/1/2025	2,140,000	0.03
USD 1,038,747	Canyon Capital CLO 2006-1 Ltd '2006-1A A1' '144A' FRN 15/12/2020	1,026,931	0.01
USD 570,000	Canyon Capital CLO 2012-1 Ltd '2012-1A B1' '144A' FRN 15/1/2024	571,425	0.01
USD 330,000	Canyon Capital CLO 2012-1 Ltd '2012-1A D' '144A' FRN 15/1/2024	333,390	0.00
USD 330,000	Canyon Capital CLO 2015-1 Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 15/4/2027	331,966	0.00
USD 250,000	Canyon Capital CLO 2016-1 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2028	245,620	0.00
USD 15,925,000	Capital One Financial Corp 3.75% 28/7/2026	16,041,539	0.20
USD 660,000	Carlyle Daytona CLO Ltd '2007-1A A3L' '144A' FRN 27/4/2021	636,651	0.01
USD 520,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-1 Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 20/4/2022	524,037	0.01
USD 1,225,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-2 Ltd '2012-2A B1R' '144A' FRN 20/7/2023	1,225,066	0.02
USD 1,375,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-2 Ltd '2012-2A C1R' '144A' FRN 20/7/2023	1,378,523	0.02
USD 2,900,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-2 Ltd '2012-2A ER' '144A' FRN 20/7/2023	2,917,971	0.04
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-3 Ltd '2012-3A C' '144A' FRN 4/10/2024	1,458,728	0.02
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-3 Ltd '2012-3A CR' '144A' FRN 14/10/2028	1,455,000	0.02
USD 771,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-4 Ltd '2012-4A D' '144A' FRN 20/1/2025	773,009	0.01
USD 500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-1 Ltd '2013-1A D' '144A' FRN 14/2/2025	493,303	0.01
USD 1,190,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-3 Ltd '2013-3A B' '144A' FRN 15/7/2025	1,191,625	0.02
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-3 Ltd '2013-3A C' '144A' FRN 15/7/2025	244,167	0.00
USD 715,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd '2014-5A C' '144A' FRN 16/10/2025	715,863	0.01
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/4/2027	489,240	0.01
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	519,246	0.01
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd '2015-1A E1' '144A' FRN 20/4/2027	437,303	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd '2015-2A C' '144A' FRN 27/4/2027	247,935	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 280,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 27/4/2027	252,652	0.00
USD 380,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd '2015-3A D' '144A' FRN 28/7/2028	342,667	0.00
USD 727,282	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd '2015-4A SBB1' '144A' 9.196% 20/10/2027	720,722	0.01
USD 500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-1 Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	501,554	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-3 Ltd '2016-3A D' '144A' FRN 20/10/2029	241,543	0.00
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-FRE1 A4' FRN 25/7/2036	1,175,265	0.02
USD 1,388,715	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-FRE2 A2' FRN 25/10/2036	826,153	0.01
USD 3,487,465	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-FRE2 A3' FRN 25/10/2036	2,085,513	0.03
USD 3,672,256	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-FRE2 A5' FRN 25/10/2036	2,173,259	0.03
USD 1,080,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-NC4 A3' FRN 25/10/2036	781,027	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2007-RFC1 A4' FRN 25/12/2036	965,689	0.01
USD 2,629,110	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-NC5 A3' FRN 25/1/2037	1,563,026	0.02
USD 846,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2006-NC5 A4' FRN 25/1/2037	512,221	0.01
USD 4,368,548	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2007-FRE1 A2' FRN 25/2/2037	4,206,024	0.05
USD 1,544,382	Carrington Mortgage Loan Trust Series '2007-HE1 A2' FRN 25/6/2037	1,427,359	0.02
USD 1,285,000	Catholic Health Initiatives 4.35% 1/11/2042	1,284,228	0.02
USD 1,222,244	C-BASS 2006-CB9 TRUST '2006-CB9 A2' FRN 25/11/2036	767,366	0.01
USD 204,327	C-BASS 2006-CB9 TRUST '2006-CB9 A4' FRN 25/11/2036	130,801	0.00
USD 5,986,495	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) '2007-CB1 AF2' 3.936% 25/1/2037	2,990,501	0.04
USD 1,525,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	1,605,062	0.02
USD 4,340,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.75% 15/2/2026	4,665,500	0.06
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT D' '144A' FRN 10/4/2029	535,541	0.01
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT X' '144A' FRN 10/4/2029	903,125	0.01
USD 2,080,000	CD 2006-CD3 Mortgage Trust '2006-CD3 AM' 5.648% 15/10/2048	2,080,500	0.03
USD 1,215,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJ' FRN 15/11/2044	1,222,076	0.02
USD 2,200,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJA' FRN 15/11/2044	2,208,671	0.03
USD 2,540,407	CDGJ Commercial Mortgage Trust '2014-BXCH EPA' '144A' FRN 15/12/2027	2,538,504	0.03
USD 1,515,000	CDW LLC / CDW Finance Corp 5.5% 1/12/2024	1,626,731	0.02
USD 540,000	Cedar Funding III CLO Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 20/5/2026	536,850	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 450,000	Cedar Funding III CLO Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 20/5/2026	440,687	0.01
EUR 275,000	Cemex Finance LLC 4.625% 15/6/2024	320,305	0.00
USD 1,697,000	Cemex Finance LLC '144A' 9.375% 12/10/2022	1,892,325	0.02
USD 740,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C3 D' '144A' FRN 10/1/2048	536,293	0.01
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C3 XD' '144A' FRN 10/1/2048	689,909	0.01
USD 2,270,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 C' FRN 10/5/2058	2,469,555	0.03
USD 9,428,167	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	1,216,521	0.02
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XB' FRN 10/5/2058	335,777	0.00
USD 750,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 A4' 3.283% 10/5/2058	799,225	0.01
USD 1,820,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust '2015-SMRT E' '144A' FRN 10/4/2028	1,756,955	0.02
USD 1,194,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL1 D' '144A' FRN 15/6/2031	1,185,788	0.02
USD 752,000	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL1 E' '144A' FRN 15/6/2031	751,333	0.01
USD 22,636,023	CG-CCRE Commercial Mortgage Trust '2014-FL2 XCP' '144A' FRN 15/11/2031	340	0.00
USD 7,605,000	CGGS Commercial Mortgage Trust '2016-RNDB AFL' '144A' FRN 15/2/2033	7,667,587	0.10
USD 3,860,000	CGGS Commercial Mortgage Trust '2016-RNDB CFL' '144A' FRN 15/2/2033	3,899,526	0.05
USD 2,480,000	CGGS Commercial Mortgage Trust '2016-RNDB DFL' '144A' FRN 15/2/2033	2,516,579	0.03
USD 10,600,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital '144A' 4.908% 23/7/2025	11,733,246	0.15
USD 9,372,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital '144A' 6.484% 23/10/2045	11,578,234	0.15
USD 270,000	Chesapeake Funding LLC '2013-1A B' '144A' FRN 7/1/2025	269,496	0.00
USD 385,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A B' '144A' FRN 7/3/2026	383,071	0.01
USD 205,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A C' '144A' FRN 7/3/2026	199,759	0.00
USD 755,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A D' '144A' FRN 7/3/2026	752,727	0.01
USD 3,621,723	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2006-OA4 A1' FRN 25/4/2046	2,024,333	0.03
USD 297,022	CHLUPA Trust '2013-VM A' '144A' 3.326% 15/8/2020	295,908	0.00
USD 1,096,000	CHS/Community Health Systems Inc 8% 15/11/2019*	1,046,680	0.01
USD 500,000	CIFC Funding 2012-I Ltd '2012-1A B1R' '144A' FRN 14/8/2024	498,643	0.01
USD 1,250,000	CIFC Funding 2012-II Ltd '2012-2A B2R' '144A' FRN 5/12/2024	1,234,555	0.02
USD 2,900,000	CIFC Funding 2013-IV Ltd '2013-4A B1' '144A' FRN 27/11/2024	2,895,410	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 440,000	CIFC Funding 2013-IV Ltd '2013-4A D' '144A' FRN 27/11/2024	430,788	0.01
USD 2,020,000	CIFC Funding 2014 Ltd '2014-1A A' '144A' FRN 18/4/2025	2,022,111	0.03
USD 4,750,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A1L' '144A' FRN 24/5/2026	4,752,820	0.06
USD 750,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A3L' '144A' FRN 24/5/2026	747,802	0.01
USD 1,390,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A B1L' '144A' FRN 24/5/2026	1,307,912	0.02
USD 1,013,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A C1' '144A' FRN 22/7/2026	1,017,053	0.01
USD 1,266,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 22/7/2026	1,181,228	0.02
USD 745,000	CIFC Funding 2014-IV Ltd '2014-4A D' '144A' FRN 17/10/2026	699,975	0.01
USD 2,345,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A A1' '144A' FRN 17/1/2027	2,346,192	0.03
USD 990,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A A1' '144A' FRN 22/1/2027	988,506	0.01
USD 370,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A B' '144A' FRN 22/1/2027	370,647	0.00
USD 650,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 22/1/2027	653,111	0.01
USD 680,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 22/1/2027	664,000	0.01
USD 970,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A A' '144A' FRN 15/4/2027	966,464	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 15/4/2027	238,413	0.00
USD 1,125,000	CIFC Funding 2015-IV Ltd '2015-4A C1' '144A' FRN 20/10/2027	1,062,727	0.01
USD 940,000	CIT Group Inc 4.25% 15/8/2017	958,565	0.01
USD 2,455,000	CIT Group Inc '144A' 5.5% 15/2/2019	2,611,506	0.03
USD 563,500	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP D' '144A' FRN 15/9/2027	554,411	0.01
USD 8,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-SMP XB' '144A' FRN 12/1/2030	33,981	0.00
USD 190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P D' '144A' FRN 10/5/2035	190,875	0.00
USD 6,834,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P E' '144A' FRN 10/5/2035	6,563,157	0.08
USD 13,427,616	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC19 XA' FRN 10/3/2047	870,683	0.01
USD 335,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC21 D' '144A' FRN 10/5/2047	284,411	0.00
USD 11,428,259	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC21 XA' FRN 10/5/2047	827,417	0.01
USD 59,527,942	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC23 XA' FRN 10/7/2047	3,782,527	0.05
USD 2,420,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC25 XE' '144A' FRN 10/10/2047	187,261	0.00
USD 3,350,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-GC27 C' FRN 10/2/2048	3,336,828	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 64,534,670	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-P1 XA' FRN 15/9/2048	3,499,409	0.04
USD 8,252,551	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P3 XA' FRN 15/4/2049	1,017,426	0.01
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-C1 C' FRN 10/5/2049	1,244,184	0.02
USD 590,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-GC37 D' '144A' 2.788% 10/4/2049	419,044	0.01
USD 610,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-P1 D' '144A' 3.225% 15/9/2048	494,098	0.01
USD 16,728,000	Citigroup Inc 4.125% 25/7/2028	17,122,271	0.22
USD 4,230,000	Citigroup Mortgage Loan Trust '2006-NC1 A2D' FRN 25/8/2036	3,226,410	0.04
USD 2,055,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2033	2,532,099	0.03
USD 715,000	City of Houston TX Airport System Revenue 5% 1/7/2024	829,060	0.01
USD 3,180,000	City of Portland OR Sewer System Revenue 5% 15/6/2023	3,958,989	0.05
USD 1,715,000	City of San Jose CA Airport Revenue 5% 1/3/2037	1,748,751	0.02
USD 1,475,000	City of Seattle WA Municipal Light & Power Revenue 5% 1/4/2023	1,826,515	0.02
USD 1,425,000	City of Seattle WA Municipal Light & Power Revenue 5% 1/4/2024	1,803,259	0.02
USD 1,320,000	City of Seattle WA Municipal Light & Power Revenue 5% 1/4/2025	1,702,939	0.02
USD 3,480,000	Clark County School District 5% 15/6/2023	4,290,805	0.05
USD 3,995,000	Clark County School District 5% 15/6/2024	5,005,475	0.06
USD 1,540,000	Clark County School District 5% 15/6/2026	1,962,668	0.03
USD 1,540,000	Clark County School District 5% 15/6/2027	1,949,109	0.03
USD 1,675,000	Clark County School District 5% 15/6/2028	2,105,349	0.03
USD 2,160,000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc 6.5% 15/11/2022	2,273,400	0.03
USD 3,971,000	Cleco Corporate Holdings LLC '144A' 3.743% 1/5/2026	4,181,664	0.05
USD 1,440,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	1,623,758	0.02
USD 2,782,397	COLT 2015-1 LLC '2015-1 A1V' '144A' FRN 26/12/2045	2,771,938	0.04
USD 2,038,766	COLT 2016-1 Mortgage Loan Trust '2016-1 A1' '144A' 3% 25/5/2046	2,063,615	0.03
USD 3,561,000	Comcast Corp 2.35% 15/1/2027	3,534,976	0.05
USD 1,903,000	Comcast Corp 3.4% 15/7/2046	1,884,348	0.02
USD 3,073,000	Comcast Corp 4.4% 15/8/2035	3,530,645	0.05
USD 5,420,000	COMM 2007-C9 Mortgage Trust '2007-C9 AJFL' '144A' FRN 10/12/2049	5,216,938	0.07
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust '2013-300P D' '144A' FRN 10/8/2030	105,497	0.00
USD 1,295,000	COMM 2013-CCRE11 Mortgage Trust '2013-CR11 D' '144A' FRN 10/10/2046	1,229,352	0.02
USD 5,466,950	COMM 2013-CCRE11 Mortgage Trust '2013-CR11 XA' FRN 10/10/2046	313,645	0.00
USD 2,844,023	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust '2013-CR7 XA' FRN 10/3/2046	172,716	0.00
USD 640,000	COMM 2013-GAM '2013-GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	668,252	0.01
USD 3,770,000	COMM 2013-LC13 Mortgage Trust '2013-LC13 D' '144A' FRN 10/8/2046	3,583,932	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust '2013-WWP D' '144A' 3.898% 10/3/2031	1,750,240	0.02
USD 100,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust '2014-CR18 C' FRN 15/7/2047	107,091	0.00
USD 3,115,000	COMM 2014-FL4 Mortgage Trust '2014-FL4 D' '144A' FRN 13/7/2031	3,051,051	0.04
USD 1,296,000	COMM 2014-FL5 Mortgage Trust '2014-FL5 B' '144A' FRN 15/10/2031	1,273,039	0.02
USD 3,260,000	COMM 2014-FL5 Mortgage Trust '2014-FL5 D' '144A' FRN 15/10/2031	2,948,222	0.04
USD 8,685,773	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust '2014-LC15 XA' FRN 10/4/2047	555,195	0.01
USD 1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT D' '144A' FRN 13/8/2027	1,427,749	0.02
USD 1,020,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT E' '144A' FRN 13/8/2027	1,007,296	0.01
USD 8,430,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT F' '144A' FRN 13/8/2027	7,892,840	0.10
USD 6,905,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT G' '144A' FRN 13/8/2027	6,230,347	0.08
USD 5,265,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC E' '144A' FRN 13/2/2032	5,142,161	0.07
USD 1,405,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC F' '144A' FRN 13/2/2032	1,375,699	0.02
USD 27,430,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC XCP' '144A' FRN 13/2/2032	181,107	0.00
USD 1,090,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust '2015-3BP F' '144A' FRN 10/2/2035	966,000	0.01
USD 29,267,119	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust '2015-CR22 XA' FRN 10/3/2048	1,702,765	0.02
USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 CME' '144A' FRN 10/5/2048	1,770,971	0.02
USD 5,320,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 D' FRN 10/5/2048	4,152,341	0.05
USD 41,742,208	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	2,421,977	0.03
USD 2,715,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust '2015-CR25 D' FRN 10/8/2048	2,102,290	0.03
USD 23,660,230	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust '2015-CR25 XA' FRN 10/8/2048	1,525,141	0.02
USD 4,146,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 D' '144A' FRN 10/2/2048	3,280,419	0.04
USD 1,501,940	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 XA' FRN 10/2/2048	115,109	0.00
USD 5,733,232	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 XA' FRN 10/7/2048	276,595	0.00
USD 21,327,969	COMM 2016-DC2 Mortgage Trust '2016-DC2 XA' FRN 10/2/2049	1,581,203	0.02
USD 133,433	Commercial Mortgage Trust '2006-GG7 AM' FRN 10/7/2038	133,301	0.00
USD 1,275,000	Commercial Mortgage Trust '2007-GG11 AM' FRN 10/12/2049	1,309,647	0.02
USD 1,490,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/7/2022	1,814,462	0.02
USD 3,725,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/7/2023	4,636,768	0.06
USD 1,490,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/7/2025	1,928,343	0.02
USD 1,450,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/7/2026	1,904,481	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,450,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/7/2028	1,940,578	0.02
USD 440,000	Commonwealth of Pennsylvania 5% 15/9/2024	545,646	0.01
USD 945,000	Communications Sales & Leasing Inc / CSL Capital LLC 8.25% 15/10/2023	994,612	0.01
USD 1,707,161	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-4 A6' FRN 1/5/2032	1,045,253	0.01
USD 2,119,388	Conseco Financial Corp '1997-3 M1' FRN 15/3/2028	2,097,807	0.03
USD 1,480,000	Conseco Financial Corp '1997-6 M1' FRN 15/1/2029	1,477,312	0.02
USD 1,634,826	Conseco Financial Corp '1999-5 A5' FRN 1/3/2030	1,404,657	0.02
USD 1,196,316	Conseco Financial Corp '1999-5 A6' FRN 1/3/2030	998,015	0.01
USD 1,736,329	Conseco Financial Corp '1998-8 A1' 6.28% 1/9/2030	1,843,125	0.02
USD 750,467	Conseco Financial Corp '1998-6 M1' 6.63% 1/6/2030	664,890	0.01
USD 2,009,000	CONSOL Energy Inc 5.875% 15/4/2022	1,828,190	0.02
USD 10,995	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	11,373	0.00
USD 444,483	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	465,152	0.01
USD 850,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Thru Certificates 6.125% 29/4/2018	893,562	0.01
USD 2,140,000	Continental Resources Inc/OK 5% 15/9/2022	2,097,200	0.03
USD 890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,252,826	0.02
USD 8,992,000	Core Industrial Trust '2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	8,256,589	0.11
USD 2,480,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW D' '144A' FRN 10/2/2034	2,540,446	0.03
USD 250,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW E' '144A' FRN 10/2/2034	243,076	0.00
USD 13,340,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	511,255	0.01
USD 9,240,000	Core Industrial Trust '2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	625,871	0.01
USD 3,416,236	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-S3 A3' FRN 25/5/2037	2,689,096	0.03
USD 70,460	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-4 A2' FRN 25/4/2047	70,509	0.00
USD 2,318,862	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) '2006-S3 A3' 6.287% 25/6/2021	2,469,069	0.03
USD 2,532,118	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) '2006-S3 A4' 6.406% 25/1/2029	2,511,654	0.03
USD 1,156,320	Countrywide Commercial Mortgage Trust '2007-MF1 A' '144A' FRN 12/11/2043	1,174,827	0.02
USD 770,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2029	976,780	0.01
USD 770,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2030	973,638	0.01
USD 770,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2031	969,726	0.01
USD 770,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2032	965,830	0.01
USD 1,000,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2034	1,244,280	0.02
USD 910,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2035	1,127,758	0.01
USD 1,000,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2036	1,234,340	0.02
USD 1,530,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2038	1,883,996	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,015,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.504% 1/10/2024	2,041,638	0.03
USD 1,390,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2036	1,620,670	0.02
USD 1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	2,124,116	0.03
USD 1,000,000	County of Sacramento CA Airport System Revenue 5.25% 1/7/2039	1,072,145	0.01
USD 250,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A C' '144A' 3.3% 17/7/2023	247,331	0.00
USD 3,169,887	Credit Suisse ABS Repackaging Trust '2013-A B' '144A' 2.5% 25/1/2030	3,005,874	0.04
USD 7,611,968	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 A1AM' FRN 15/9/2039	7,849,690	0.10
USD 1,750,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 AM' FRN 15/9/2039	1,796,650	0.02
USD 23,902	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C5 AAB' FRN 15/9/2040	23,964	0.00
USD 580,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C5 AM' 5.343% 15/12/2039	582,243	0.01
USD 6,342	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005- C3 AJ' 4.771% 15/7/2037	6,339	0.00
USD 181,645	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005- C2 AMFX' 4.877% 15/4/2037	164,628	0.00
USD 320,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005- C3 B' 4.882% 15/7/2037	319,650	0.00
USD 861,899	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC '2007- CB6 A4' '144A' FRN 25/7/2037	553,350	0.01
USD 1,006,057	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC '2007- RP1 A' '144A' FRN 25/5/2046	810,738	0.01
USD 577,998	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) '2006-CB2 AF4' 3.487% 25/12/2036	443,116	0.01
USD 4,296,384	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) '2006-SL1 A2' '144A' 5.556% 25/9/2036	1,244,137	0.02
USD 679,000	Crown Castle International Corp 2.25% 1/9/2021	677,773	0.01
USD 3,143,000	Crown Castle International Corp 3.7% 15/6/2026	3,313,453	0.04
USD 2,360,000	Crown Castle International Corp 4.45% 15/2/2026	2,610,378	0.03
USD 940,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust '2015-C1 C' FRN 15/4/2050	1,001,198	0.01
USD 540,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust '2015-C1 D' '144A' FRN 15/4/2050	454,510	0.01
USD 890,000	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust '2015-C3 C' FRN 15/8/2048	932,351	0.01
USD 250,000	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust '2015-C3 D' FRN 15/8/2048	192,228	0.00
USD 21,948,510	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust '2016-C5 XA' FRN 15/11/2048	1,472,724	0.02
USD 1,260,000	CSAIL 2016-C6 Commercial Mortgage Trust '2016-C6 C' FRN 15/1/2049	1,390,467	0.02
USD 7,593,591	CSAIL 2016-C6 Commercial Mortgage Trust '2016-C6 XA' FRN 15/1/2049	971,004	0.01
USD 1,090,000	CSC Holdings LLC '144A' 6.625% 15/10/2025	1,188,781	0.02
USD 1,990,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.125% 15/1/2023	2,288,500	0.03
USD 1,090,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.875% 15/10/2025	1,284,837	0.02
USD 338,879	CSMC Series '2010-20R 9A1' '144A' FRN 27/1/2036	334,733	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 870,000	CSMC Series '2014-4R 16A3' '144A' FRN 27/2/2036	702,202	0.01
USD 812,473	CSMC Series '2014-9R 6A1' '144A' FRN 27/3/2036	786,667	0.01
USD 1,460,572	CSMC Series '2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	1,357,894	0.02
USD 2,708,147	CSMC Series '2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	1,293,952	0.02
USD 1,879,609	CSMC Series '2014-9R 9A1' '144A' FRN 27/8/2036	1,616,005	0.02
USD 1,650,000	CSMC Series '2015-4R 1A4' '144A' FRN 27/10/2036	702,864	0.01
USD 570,000	CSMC Series '2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	507,224	0.01
USD 1,572,509	CSMC Series '2015-10R 4A1' '144A' FRN 27/7/2037	1,572,509	0.02
USD 3,675,703	CSMC Series '2015-8R 5A1' '144A' FRN 27/8/2037	3,648,136	0.05
USD 2,515,307	CSMC Series '2014-9R 3A1' '144A' FRN 27/11/2037	2,379,453	0.03
USD 5,956,401	CSMC Series '2014-11R 16A1' '144A' FRN 27/9/2047	5,709,720	0.07
USD 5,140,000	CSMC Series '2010-UD1 B' '144A' FRN 16/12/2049	5,218,282	0.07
USD 615,000	CSMC Series '2009-RR1 A3C' '144A' 5.383% 15/2/2040	617,700	0.01
USD 3,060,000	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	3,048,449	0.04
USD 1,390,000	CSMC Trust '2015-DEAL D' '144A' FRN 15/4/2029	1,385,639	0.02
USD 5,600,000	CSMC Trust '2013-5R 1A6' '144A' FRN 27/2/2036	4,888,860	0.06
USD 21,700,000	CSMC Trust '2015-GLPA XA' '144A' FRN 15/11/2037	518,956	0.01
USD 1,320,000	CSMC Trust '2014-TIKI D' '144A' FRN 15/9/2038	1,270,113	0.02
USD 790,000	CSMC Trust '2014-TIKI E' '144A' FRN 15/9/2038	751,894	0.01
USD 1,360,000	CSMC Trust '2014-TIKI F' '144A' FRN 15/9/2038	1,294,692	0.02
USD 1,020,000	CSMC Trust '2014-USA E' '144A' 4.373% 15/9/2037	892,510	0.01
USD 250,000	Cumberland Park CLO Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2026	215,827	0.00
USD 4,940,000	CVS Health Corp 2.875% 1/6/2026	5,074,538	0.06
USD 2,970,000	CVS Health Corp 3.875% 20/7/2025	3,281,516	0.04
USD 388,552	CWABS Asset-Backed Certificates Trust '2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	344,059	0.00
USD 1,815,186	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series '2004-U 2A' FRN 15/3/2034	1,435,410	0.02
USD 4,153,496	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2007-S1 A3' FRN 25/11/2036	4,128,757	0.05
USD 480,056	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S2 A3' 5.841% 25/7/2027	539,937	0.01
USD 1,234,798	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A4' 5.842% 25/6/2035	1,230,555	0.02
USD 774,830	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A5' 6.155% 25/6/2035	725,773	0.01
USD 571,098	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series '2006-RES 5B1B' '144A' FRN 15/5/2035	482,578	0.01
USD 1,891,247	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series '2005-B 2A' FRN 15/5/2035	1,616,644	0.02
USD 4,000,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	4,466,860	0.06
USD 6,411,000	DaVita HealthCare Partners Inc 5.125% 15/7/2024	6,619,518	0.08
USD 3,640,000	DBJPM 16-C3 Mortgage Trust '2016-C3 D' '144A' FRN 10/9/2049	2,752,541	0.04
USD 8,476,880	DCP Rights LLC '2014-1A A' '144A' 5.463% 25/10/2044	8,424,562	0.11
USD 4,929,165	Deephaven Residential Mortgage Trust '2016-1A A1' '144A' 4% 25/7/2046	4,919,765	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 763,197	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT '2007-RS1 A2' '144A' FRN 27/1/2037	1,499,168	0.02
USD 997,136	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2007-0A4 1A1B' FRN 25/8/2047	792,963	0.01
USD 2,080,000	Devon Energy Corp 5.85% 15/12/2025	2,354,071	0.03
USD 5,195,000	Diamond 1 Finance Corp / Diamond 2 Finance Corp '144A' 6.02% 15/6/2026	5,550,354	0.07
USD 2,285,000	Dignity Health 5.267% 1/11/2064	2,735,218	0.04
USD 1,937,000	Discover Bank/Greenwood DE 3.45% 27/7/2026	1,955,647	0.03
EUR 1,730,000	Discovery Communications LLC 1.9% 19/3/2027	1,870,219	0.02
USD 6,260,000	Discovery Communications LLC 4.875% 1/4/2043	5,937,682	0.08
USD 2,580,000	Discovery Communications LLC 4.9% 11/3/2026	2,799,429	0.04
USD 2,050,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	2,111,500	0.03
USD 1,525,000	DISH DBS Corp 5.875% 15/7/2022	1,565,031	0.02
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,145,623	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,141,225	0.01
USD 2,175,000	District of Columbia 5% 1/6/2038	2,642,821	0.03
USD 3,246,000	Dollar Tree Inc 5.75% 1/3/2023	3,505,680	0.04
USD 40,000	DPL Inc 6.5% 15/10/2016	40,133	0.00
USD 450,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A C' '144A' FRN 15/10/2026	446,564	0.01
USD 340,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A D' '144A' FRN 15/10/2026	328,115	0.00
USD 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A C' '144A' FRN 9/11/2025	250,916	0.00
USD 630,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A D' '144A' FRN 9/11/2025	614,350	0.01
USD 255,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A E' '144A' FRN 9/11/2025	229,560	0.00
USD 250,000	Dryden 43 Senior Loan Fund '2016-43A E' '144A' FRN 20/7/2029	234,000	0.00
USD 740,000	Dryden XXII Senior Loan Fund '2011-22A CR' '144A' FRN 15/1/2022	740,802	0.01
USD 1,550,000	Dryden XXV Senior Loan Fund '2012-25A A' '144A' FRN 15/1/2025	1,551,687	0.02
USD 3,065,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund '2013-28A A1L' '144A' FRN 15/8/2025	3,038,207	0.04
USD 700,000	Eastern Municipal Water District Financing Authority 5% 1/7/2033	888,832	0.01
USD 735,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust '2015-11MD A' '144A' FRN 10/9/2035	809,386	0.01
USD 1,751,000	Emera US Finance LP '144A' 3.55% 15/6/2026	1,848,748	0.02
USD 943,000	Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 5.375% 15/1/2023	851,057	0.01
USD 3,000,000	Energy Northwest 2.814% 1/7/2024	3,131,790	0.04
USD 1,510,000	Energy Northwest 5% 1/7/2027	1,970,467	0.03
USD 765,000	Energy Northwest 5% 1/7/2028	991,838	0.01
USD 3,120,000	Energy Transfer Partners LP 4.75% 15/1/2026	3,281,433	0.04
USD 997,000	Energy Corp 2.95% 1/9/2026	1,008,844	0.01
USD 1,537,000	Enterprise Products Operating LLC 4.9% 15/5/2046	1,660,895	0.02
USD 963,000	Enterprise Products Operating LLC 5.1% 15/2/2045	1,068,229	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,155,000	EOG Resources Inc 4.15% 15/1/2026	2,379,841	0.03
USD 1,980,000	Exelon Corp 3.4% 15/4/2026	2,086,651	0.03
USD 2,000,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2013-C01 M2' FRN 25/10/2023	2,185,367	0.03
USD 4,850,813	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M2' FRN 25/5/2024	4,739,305	0.06
USD 715,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C03 1M2' FRN 25/7/2024	712,957	0.01
USD 610,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C02 1M2' FRN 25/9/2028	668,225	0.01
USD 4,230,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C04 1M2' FRN 25/1/2029	4,303,457	0.06
USD 4,710,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C05 2M2' FRN 25/1/2029	4,786,015	0.06
USD 355,996	Fannie Mae Pool '310139' 3.5% 1/11/2025	376,167	0.00
USD 1,660,708	Fannie Mae Pool '890183' 3.5% 1/1/2025	1,754,723	0.02
USD 580,800	Fannie Mae Pool '890376' 3.5% 1/11/2026	614,244	0.01
USD 3,731,330	Fannie Mae Pool '931002' 3.5% 1/4/2024	3,945,363	0.05
USD 360,913	Fannie Mae Pool '931071' 3.5% 1/5/2024	381,218	0.01
USD 7,393,298	Fannie Mae Pool '931407' 3.5% 1/6/2024	7,812,045	0.10
USD 160,736	Fannie Mae Pool '932196' 3.5% 1/11/2024	169,863	0.00
USD 246,752	Fannie Mae Pool 'AB1150' 3.5% 1/6/2025	260,730	0.00
USD 430,519	Fannie Mae Pool 'AB1241' 3.5% 1/7/2025	455,178	0.01
USD 130,058	Fannie Mae Pool 'AB1364' 3.5% 1/8/2025	137,501	0.00
USD 1,124,195	Fannie Mae Pool 'AB1767' 3.5% 1/11/2025	1,188,335	0.02
USD 447,580	Fannie Mae Pool 'AB1775' 3.5% 1/11/2025	475,745	0.01
USD 9,417,143	Fannie Mae Pool 'AB2141' 3.5% 1/9/2025	9,946,950	0.13
USD 380,985	Fannie Mae Pool 'AB3906' 3.5% 1/2/2026	402,620	0.01
USD 100,024	Fannie Mae Pool 'AB4285' 3.5% 1/1/2027	107,319	0.00
USD 9,545,082	Fannie Mae Pool 'AB4584' 3.5% 1/3/2042	10,237,944	0.13
USD 550,552	Fannie Mae Pool 'AB7173' 3.5% 1/12/2027	583,901	0.01
USD 216,334	Fannie Mae Pool 'AD5097' 3.5% 1/11/2025	228,800	0.00
USD 149,370	Fannie Mae Pool 'AD5102' 3.5% 1/12/2025	158,003	0.00
USD 5,675,872	Fannie Mae Pool 'AD5108' 3.5% 1/12/2025	6,003,984	0.08
USD 621,934	Fannie Mae Pool 'AD8064' 3.5% 1/3/2026	658,585	0.01
USD 330,560	Fannie Mae Pool 'AD8231' 3.5% 1/10/2025	349,489	0.00
USD 1,148,798	Fannie Mae Pool 'AD9751' 3.5% 1/12/2025	1,214,196	0.02
USD 464,932	Fannie Mae Pool 'AE0518' 3.5% 1/11/2025	491,577	0.01
USD 218,169	Fannie Mae Pool 'AE0703' 3.5% 1/12/2025	231,878	0.00
USD 644,428	Fannie Mae Pool 'AE1806' 3.5% 1/10/2025	681,052	0.01
USD 106,382	Fannie Mae Pool 'AE1842' 3.5% 1/8/2025	112,405	0.00
USD 1,002,498	Fannie Mae Pool 'AE2127' 3.5% 1/1/2026	1,060,411	0.01
USD 286,230	Fannie Mae Pool 'AE2771' 3.5% 1/8/2026	303,774	0.00
USD 3,829,021	Fannie Mae Pool 'AE2779' 3.5% 1/9/2026	4,052,527	0.05
USD 1,082,627	Fannie Mae Pool 'AE2780' 3.5% 1/9/2026	1,143,870	0.01
USD 361,668	Fannie Mae Pool 'AE3357' 3.5% 1/10/2025	382,308	0.01
USD 693,995	Fannie Mae Pool 'AE3813' 3.5% 1/9/2025	733,746	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,387,297	Fannie Mae Pool 'AE4614' 3.5% 1/9/2025	1,466,821	0.02
USD 3,151,018	Fannie Mae Pool 'AE6822' 3.5% 1/11/2025	3,334,525	0.04
USD 874,798	Fannie Mae Pool 'AE6823' 3.5% 1/11/2025	927,870	0.01
USD 1,157,176	Fannie Mae Pool 'AE7758' 3.5% 1/11/2025	1,223,318	0.02
USD 217,045	Fannie Mae Pool 'AH0969' 3.5% 1/12/2025	229,472	0.00
USD 8,218	Fannie Mae Pool 'AH1519' 3.5% 1/12/2025	8,686	0.00
USD 3,452,919	Fannie Mae Pool 'AH1524' 3.5% 1/12/2025	3,653,203	0.05
USD 189,683	Fannie Mae Pool 'AH1601' 3.5% 1/9/2026	200,851	0.00
USD 373,722	Fannie Mae Pool 'AH3235' 3.5% 1/2/2026	395,120	0.01
USD 149,280	Fannie Mae Pool 'AH3431' 3.5% 1/1/2026	157,821	0.00
USD 69,881	Fannie Mae Pool 'AH3553' 3.5% 1/2/2026	73,816	0.00
USD 302,251	Fannie Mae Pool 'AH5614' 3.5% 1/2/2026	321,320	0.00
USD 273,144	Fannie Mae Pool 'AH5806' 3.5% 1/2/2026	290,373	0.00
USD 164,182	Fannie Mae Pool 'AH9377' 3.5% 1/4/2026	173,597	0.00
USD 454,346	Fannie Mae Pool 'AI2067' 3.5% 1/5/2026	480,183	0.01
USD 44,016	Fannie Mae Pool 'AI4201' 3.5% 1/7/2026	46,495	0.00
USD 55,334	Fannie Mae Pool 'AI6653' 3.5% 1/8/2026	58,506	0.00
USD 164,251	Fannie Mae Pool 'AI8260' 3.5% 1/7/2026	173,646	0.00
USD 450,398	Fannie Mae Pool 'AI9955' 3.5% 1/10/2026	478,048	0.01
USD 603,195	Fannie Mae Pool 'AJ0064' 3.5% 1/11/2026	637,786	0.01
USD 208,764	Fannie Mae Pool 'AJ0493' 3.5% 1/9/2026	220,838	0.00
USD 63,157	Fannie Mae Pool 'AJ1441' 3.5% 1/9/2026	66,789	0.00
USD 52,153	Fannie Mae Pool 'AJ1585' 3.5% 1/10/2026	55,110	0.00
USD 8,926,694	Fannie Mae Pool 'AJ1739' 3.5% 1/9/2026	9,431,028	0.12
USD 248,575	Fannie Mae Pool 'AJ1758' 3.5% 1/9/2026	262,862	0.00
USD 87,256	Fannie Mae Pool 'AJ3006' 3.5% 1/10/2026	92,213	0.00
USD 1,518,596	Fannie Mae Pool 'AJ4128' 3.5% 1/10/2026	1,611,129	0.02
USD 143,770	Fannie Mae Pool 'AJ5342' 3.5% 1/11/2026	152,022	0.00
USD 13,483	Fannie Mae Pool 'AJ9552' 3.5% 1/1/2027	14,246	0.00
USD 66,444	Fannie Mae Pool 'AK0285' 3.5% 1/12/2026	71,209	0.00
USD 741,784	Fannie Mae Pool 'AK5054' 3.5% 1/3/2027	784,425	0.01
USD 954,014	Fannie Mae Pool 'AK5577' 3.5% 1/4/2027	1,012,426	0.01
USD 870,933	Fannie Mae Pool 'AK5578' 3.5% 1/4/2027	926,073	0.01
USD 225,519	Fannie Mae Pool 'AL0578' 3.5% 1/8/2026	238,461	0.00
USD 339,195	Fannie Mae Pool 'AL0787' 3.5% 1/8/2026	358,602	0.00
USD 233,428	Fannie Mae Pool 'AL0846' 3.5% 1/10/2026	246,856	0.00
USD 329,453	Fannie Mae Pool 'AL2939' 3.5% 1/11/2027	349,929	0.00
USD 299,096	Fannie Mae Pool 'AL3678' 3.5% 1/5/2028	317,876	0.00
USD 1,416,228	Fannie Mae Pool 'AL4009' 3.5% 1/7/2043	1,522,187	0.02
USD 5,774,995	Fannie Mae Pool 'AL4010' 3.5% 1/7/2043	6,175,541	0.08
USD 14,683	Fannie Mae Pool 'AL4082' 3.5% 1/10/2027	15,515	0.00
USD 348,967	Fannie Mae Pool 'AL5931' 3.5% 1/9/2028	368,731	0.00
USD 18,270,081	Fannie Mae Pool 'AL6392' 3.5% 1/1/2045	19,640,562	0.25
USD 704,279	Fannie Mae Pool 'AL6493' 3.5% 1/2/2030	755,816	0.01
USD 5,797,132	Fannie Mae Pool 'AL7051' 3.5% 1/1/2030	6,199,084	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 127,370	Fannie Mae Pool 'AL7205' 3.5% 1/12/2029	134,594	0.00
USD 16,494,472	Fannie Mae Pool 'AL7232' 3.5% 1/9/2045	17,737,437	0.23
USD 11,148,674	Fannie Mae Pool 'AL7495' 3.5% 1/10/2045	11,989,186	0.15
USD 131,625	Fannie Mae Pool 'AL7632' 3.5% 1/10/2030	139,030	0.00
USD 10,605,928	Fannie Mae Pool 'AL7808' 3.5% 1/12/2030	11,342,430	0.14
USD 10,278,513	Fannie Mae Pool 'AL7809' 3.5% 1/1/2030	10,965,036	0.14
USD 174,718	Fannie Mae Pool 'AL8077' 3.5% 1/12/2029	184,547	0.00
USD 17,243,390	Fannie Mae Pool 'AL8081' 3.5% 1/2/2031	18,222,051	0.23
USD 3,790,486	Fannie Mae Pool 'AL8082' 3.5% 1/2/2031	4,007,535	0.05
USD 1,533,384	Fannie Mae Pool 'AL8235' 3.5% 1/6/2030	1,620,823	0.02
USD 260,561	Fannie Mae Pool 'AL8236' 3.5% 1/7/2027	275,220	0.00
USD 454,765	Fannie Mae Pool 'AL8278' 3.5% 1/4/2046	489,123	0.01
USD 33,267,342	Fannie Mae Pool 'AL8561' 3.5% 1/6/2031	35,706,164	0.46
USD 5,635,412	Fannie Mae Pool 'AL8562' 3.5% 1/6/2031	6,038,360	0.08
USD 6,748,631	Fannie Mae Pool 'AL8563' 3.5% 1/6/2031	7,220,070	0.09
USD 8,493,957	Fannie Mae Pool 'AL8734' 3.5% 1/6/2046	9,084,977	0.12
USD 811,207	Fannie Mae Pool 'AL8757' 3.5% 1/5/2031	867,882	0.01
USD 1,859,587	Fannie Mae Pool 'AL8760' 3.5% 1/6/2046	1,994,055	0.03
USD 960,000	Fannie Mae Pool 'AM8314' 2.69% 1/4/2025	1,006,475	0.01
USD 1,840,000	Fannie Mae Pool 'AN1506' 2.5% 1/5/2026	1,898,334	0.02
USD 3,642,947	Fannie Mae Pool 'AO9155' 3.5% 1/7/2027	3,855,935	0.05
USD 95,311	Fannie Mae Pool 'AP4635' 3.5% 1/9/2027	101,461	0.00
USD 251,639	Fannie Mae Pool 'AQ2243' 3.5% 1/10/2027	266,240	0.00
USD 1,575,056	Fannie Mae Pool 'AS0508' 3.5% 1/9/2028	1,664,386	0.02
USD 5,369,275	Fannie Mae Pool 'AS1303' 3.5% 1/12/2028	5,720,800	0.07
USD 2,659,496	Fannie Mae Pool 'AS1360' 3.5% 1/12/2028	2,809,119	0.04
USD 960,504	Fannie Mae Pool 'AS1361' 3.5% 1/12/2028	1,014,542	0.01
USD 927,246	Fannie Mae Pool 'AS1537' 3.5% 1/1/2029	979,557	0.01
USD 1,509,635	Fannie Mae Pool 'AS1539' 3.5% 1/1/2044	1,619,110	0.02
USD 3,807,694	Fannie Mae Pool 'AS1866' 3.5% 1/3/2029	4,056,743	0.05
USD 2,751,856	Fannie Mae Pool 'AS1991' 3.5% 1/3/2029	2,931,823	0.04
USD 50,562	Fannie Mae Pool 'AS2091' 3.5% 1/4/2029	53,407	0.00
USD 242,200	Fannie Mae Pool 'AS2993' 3.5% 1/8/2029	255,842	0.00
USD 417,383	Fannie Mae Pool 'AS5439' 3.5% 1/7/2030	445,070	0.01
USD 8,434,198	Fannie Mae Pool 'AS5873' 3.5% 1/9/2030	8,915,352	0.11
USD 1,055,169	Fannie Mae Pool 'AS5874' 3.5% 1/9/2030	1,114,533	0.01
USD 3,582,379	Fannie Mae Pool 'AS6167' 3.5% 1/11/2030	3,833,046	0.05
USD 1,014,080	Fannie Mae Pool 'AS6424' 3.5% 1/12/2030	1,074,641	0.01
USD 21,169,655	Fannie Mae Pool 'AS6590' 3.5% 1/2/2046	22,757,284	0.29
USD 5,682,756	Fannie Mae Pool 'AS6919' 3.5% 1/3/2031	6,019,685	0.08
USD 14,200,897	Fannie Mae Pool 'AS7012' 3.5% 1/4/2046	15,281,660	0.20
USD 16,964,562	Fannie Mae Pool 'AS7169' 3.5% 1/5/2046	18,259,422	0.23
USD 1,454,097	Fannie Mae Pool 'AS7635' 3.5% 1/7/2031	1,556,436	0.02
USD 1,551,078	Fannie Mae Pool 'AS7636' 3.5% 1/7/2031	1,654,003	0.02
USD 4,224,434	Fannie Mae Pool 'AS7705' 3% 1/8/2031	4,460,368	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,639,151	Fannie Mae Pool 'AS9175' 3.5% 1/8/2030	8,085,439	0.10
USD 1,608,956	Fannie Mae Pool 'AT7940' 3.5% 1/7/2043	1,728,413	0.02
USD 8,368,987	Fannie Mae Pool 'AU1633' 3.5% 1/7/2043	8,967,058	0.11
USD 1,912,872	Fannie Mae Pool 'AV0638' 3.5% 1/11/2028	2,034,366	0.03
USD 2,872,357	Fannie Mae Pool 'AV1368' 3.5% 1/11/2028	3,035,459	0.04
USD 1,670,684	Fannie Mae Pool 'AV2925' 3.5% 1/1/2029	1,765,783	0.02
USD 4,121,386	Fannie Mae Pool 'AV4998' 3.5% 1/1/2029	4,378,513	0.06
USD 231,022	Fannie Mae Pool 'AV5068' 3.5% 1/2/2029	244,019	0.00
USD 3,080,680	Fannie Mae Pool 'AV6368' 3.5% 1/1/2029	3,256,253	0.04
USD 459,603	Fannie Mae Pool 'AV6417' 3.5% 1/2/2029	485,549	0.01
USD 501,588	Fannie Mae Pool 'AV7129' 3.5% 1/3/2029	532,835	0.01
USD 114,349	Fannie Mae Pool 'AV8051' 3.5% 1/3/2029	120,833	0.00
USD 2,899,885	Fannie Mae Pool 'AV9338' 3.5% 1/3/2029	3,063,032	0.04
USD 1,908,752	Fannie Mae Pool 'AV9341' 3.5% 1/3/2029	2,034,030	0.03
USD 129,622	Fannie Mae Pool 'AV9344' 3.5% 1/3/2029	136,947	0.00
USD 527,192	Fannie Mae Pool 'AW0132' 3.5% 1/6/2029	561,703	0.01
USD 387,611	Fannie Mae Pool 'AW0315' 3.5% 1/3/2029	409,418	0.01
USD 3,490,574	Fannie Mae Pool 'AW0607' 3.5% 1/4/2029	3,688,843	0.05
USD 87,744	Fannie Mae Pool 'AW1531' 3.5% 1/3/2029	92,680	0.00
USD 318,243	Fannie Mae Pool 'AW1538' 3.5% 1/3/2029	336,147	0.00
USD 666,217	Fannie Mae Pool 'AW3158' 3.5% 1/7/2029	703,833	0.01
USD 855,543	Fannie Mae Pool 'AW3563' 3.5% 1/5/2029	903,676	0.01
USD 608,042	Fannie Mae Pool 'AW4058' 3.5% 1/8/2029	642,336	0.01
USD 101,927	Fannie Mae Pool 'AW6899' 3.5% 1/7/2029	107,717	0.00
USD 3,842,481	Fannie Mae Pool 'AW7067' 3.5% 1/7/2029	4,058,659	0.05
USD 464,001	Fannie Mae Pool 'AW7070' 3.5% 1/7/2029	491,471	0.01
USD 553,341	Fannie Mae Pool 'AW7072' 3.5% 1/7/2029	585,471	0.01
USD 1,702,387	Fannie Mae Pool 'AW7093' 3.5% 1/7/2029	1,798,163	0.02
USD 697,680	Fannie Mae Pool 'AW8952' 3.5% 1/7/2029	737,231	0.01
USD 123,385	Fannie Mae Pool 'AW9004' 3.5% 1/8/2029	130,737	0.00
USD 1,011,217	Fannie Mae Pool 'AW9033' 3.5% 1/8/2029	1,071,072	0.01
USD 311,859	Fannie Mae Pool 'AX0134' 3.5% 1/9/2029	329,404	0.00
USD 2,138,706	Fannie Mae Pool 'AX0159' 3.5% 1/9/2029	2,259,029	0.03
USD 150,899	Fannie Mae Pool 'AX1306' 3.5% 1/8/2044	161,703	0.00
USD 102,383	Fannie Mae Pool 'AX1326' 3.5% 1/9/2029	108,144	0.00
USD 52,093	Fannie Mae Pool 'AX2893' 3.5% 1/11/2029	55,505	0.00
USD 1,407,999	Fannie Mae Pool 'AX3144' 3.5% 1/10/2029	1,487,546	0.02
USD 1,853,640	Fannie Mae Pool 'AX3176' 3.5% 1/10/2029	1,958,714	0.03
USD 810,559	Fannie Mae Pool 'AX3721' 3.5% 1/7/2027	856,628	0.01
USD 134,644	Fannie Mae Pool 'AX5239' 3.5% 1/11/2029	142,367	0.00
USD 1,103,657	Fannie Mae Pool 'AX5240' 3.5% 1/11/2029	1,170,266	0.02
USD 1,113,679	Fannie Mae Pool 'AX5241' 3.5% 1/11/2029	1,180,033	0.02
USD 97,474,422	Fannie Mae Pool 'AX5306' 3.5% 1/1/2027	103,008,825	1.31
USD 1,095,937	Fannie Mae Pool 'AX5787' 3.5% 1/10/2029	1,172,044	0.02
USD 4,414,224	Fannie Mae Pool 'AX7241' 3.5% 1/11/2029	4,664,031	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 364,000	Fannie Mae Pool 'AX7281' 3.5% 1/12/2029	390,574	0.01
USD 984,245	Fannie Mae Pool 'AX9956' 3.5% 1/12/2029	1,039,839	0.01
USD 936,151	Fannie Mae Pool 'AX9958' 3.5% 1/12/2029	992,761	0.01
USD 4,618,134	Fannie Mae Pool 'AX9991' 3.5% 1/1/2030	4,883,186	0.06
USD 2,922,573	Fannie Mae Pool 'AY0008' 3.5% 1/1/2030	3,090,629	0.04
USD 461,320	Fannie Mae Pool 'AY0018' 3.5% 1/1/2030	487,504	0.01
USD 622,513	Fannie Mae Pool 'AY0951' 3.5% 1/12/2029	657,715	0.01
USD 107,917	Fannie Mae Pool 'AY1180' 3.5% 1/6/2030	115,118	0.00
USD 217,005	Fannie Mae Pool 'AY1631' 3.5% 1/1/2030	229,272	0.00
USD 20,593	Fannie Mae Pool 'AY3081' 3.5% 1/2/2030	21,753	0.00
USD 2,644,662	Fannie Mae Pool 'AY4203' 3.5% 1/5/2045	2,843,947	0.04
USD 693,910	Fannie Mae Pool 'AY4450' 3.5% 1/2/2045	746,200	0.01
USD 228,823	Fannie Mae Pool 'AY4652' 3.5% 1/6/2030	244,800	0.00
USD 896,381	Fannie Mae Pool 'AY5000' 3.5% 1/3/2030	947,316	0.01
USD 5,047,755	Fannie Mae Pool 'AY5300' 3.5% 1/3/2045	5,410,427	0.07
USD 367,265	Fannie Mae Pool 'AY5331' 3.5% 1/4/2030	389,612	0.01
USD 549,986	Fannie Mae Pool 'AY6016' 3.5% 1/9/2045	588,100	0.01
USD 1,675,276	Fannie Mae Pool 'AY6303' 3.5% 1/2/2045	1,801,401	0.02
USD 1,539,171	Fannie Mae Pool 'AY6539' 3.5% 1/4/2030	1,626,387	0.02
USD 616,765	Fannie Mae Pool 'AY8195' 3.5% 1/4/2030	651,740	0.01
USD 620,202	Fannie Mae Pool 'AY8208' 3.5% 1/4/2030	655,598	0.01
USD 1,488,307	Fannie Mae Pool 'AY8260' 3.5% 1/5/2030	1,572,950	0.02
USD 109,515	Fannie Mae Pool 'AY8283' 3.5% 1/6/2030	115,753	0.00
USD 172,677	Fannie Mae Pool 'AY9113' 3.5% 1/5/2030	182,408	0.00
USD 323,355	Fannie Mae Pool 'AY9910' 3.5% 1/7/2030	341,547	0.00
USD 267,225	Fannie Mae Pool 'AZ0111' 3.5% 1/12/2030	285,914	0.00
USD 496,266	Fannie Mae Pool 'AZ1750' 3.5% 1/6/2030	528,449	0.01
USD 858,423	Fannie Mae Pool 'AZ2264' 3.5% 1/6/2030	907,071	0.01
USD 770,858	Fannie Mae Pool 'AZ2298' 3.5% 1/7/2030	814,796	0.01
USD 366,026	Fannie Mae Pool 'AZ2306' 3.5% 1/7/2030	386,823	0.01
USD 599,304	Fannie Mae Pool 'AZ2588' 3.5% 1/7/2045	640,962	0.01
USD 245,198	Fannie Mae Pool 'AZ2604' 3.5% 1/8/2045	263,658	0.00
USD 368,171	Fannie Mae Pool 'AZ2619' 3.5% 1/8/2045	395,889	0.01
USD 691,547	Fannie Mae Pool 'AZ2621' 3.5% 1/8/2045	739,472	0.01
USD 1,077,935	Fannie Mae Pool 'AZ2639' 3.5% 1/9/2045	1,152,581	0.01
USD 1,530,041	Fannie Mae Pool 'AZ2659' 3.5% 1/10/2045	1,635,994	0.02
USD 873,784	Fannie Mae Pool 'AZ2665' 3.5% 1/10/2045	939,377	0.01
USD 1,193,166	Fannie Mae Pool 'AZ2959' 3.5% 1/9/2030	1,274,973	0.02
USD 1,438,972	Fannie Mae Pool 'AZ3166' 3.5% 1/7/2030	1,520,723	0.02
USD 334,670	Fannie Mae Pool 'AZ5298' 3.5% 1/4/2030	354,078	0.00
USD 524,647	Fannie Mae Pool 'AZ5436' 3.5% 1/8/2030	560,595	0.01
USD 10,962,248	Fannie Mae Pool 'AZ5664' 3.5% 1/7/2030	11,585,453	0.15
USD 1,975,639	Fannie Mae Pool 'AZ5666' 3.5% 1/7/2030	2,095,578	0.03
USD 2,500,614	Fannie Mae Pool 'AZ5689' 3.5% 1/8/2030	2,642,797	0.03
USD 2,522,211	Fannie Mae Pool 'AZ5709' 3.5% 1/8/2030	2,675,411	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 953,882	Fannie Mae Pool 'AZ5720' 3.5% 1/9/2030	1,008,092	0.01
USD 1,498,708	Fannie Mae Pool 'AZ5730' 3.5% 1/9/2045	1,597,017	0.02
USD 1,234,635	Fannie Mae Pool 'AZ5965' 3.5% 1/7/2030	1,319,206	0.02
USD 3,424,628	Fannie Mae Pool 'AZ7189' 3.5% 1/7/2026	3,617,297	0.05
USD 73,414	Fannie Mae Pool 'AZ7439' 3.5% 1/8/2030	78,302	0.00
USD 1,586,889	Fannie Mae Pool 'AZ8539' 3.5% 1/9/2030	1,697,675	0.02
USD 5,083	Fannie Mae Pool 'AZ8719' 3.5% 1/8/2030	5,388	0.00
USD 649,908	Fannie Mae Pool 'AZ8736' 3.5% 1/9/2030	694,606	0.01
USD 1,442,251	Fannie Mae Pool 'AZ9173' 3.5% 1/9/2045	1,534,634	0.02
USD 2,309,813	Fannie Mae Pool 'AZ9183' 3.5% 1/9/2030	2,441,109	0.03
USD 2,893,158	Fannie Mae Pool 'AZ9184' 3.5% 1/9/2030	3,071,302	0.04
USD 2,212,166	Fannie Mae Pool 'AZ9185' 3.5% 1/9/2030	2,346,321	0.03
USD 1,485,068	Fannie Mae Pool 'AZ9200' 3.5% 1/10/2030	1,570,426	0.02
USD 1,474,648	Fannie Mae Pool 'AZ9201' 3.5% 1/10/2030	1,565,482	0.02
USD 987,584	Fannie Mae Pool 'AZ9202' 3.5% 1/10/2030	1,047,820	0.01
USD 36,991	Fannie Mae Pool 'AZ9234' 3.5% 1/10/2030	39,096	0.00
USD 3,117,762	Fannie Mae Pool 'AZ9235' 3.5% 1/10/2030	3,346,416	0.04
USD 2,417,760	Fannie Mae Pool 'AZ9236' 3.5% 1/10/2030	2,565,389	0.03
USD 1,114,397	Fannie Mae Pool 'AZ9237' 3.5% 1/10/2030	1,181,525	0.02
USD 1,256,781	Fannie Mae Pool 'AZ9255' 3.5% 1/10/2045	1,339,071	0.02
USD 1,801,348	Fannie Mae Pool 'AZ9530' 3.5% 1/11/2045	1,925,989	0.02
USD 882,068	Fannie Mae Pool 'AZ9573' 3.5% 1/12/2045	943,103	0.01
USD 71,008	Fannie Mae Pool 'BA0339' 3.5% 1/11/2030	75,756	0.00
USD 313,245	Fannie Mae Pool 'BA0542' 3.5% 1/2/2031	335,595	0.00
USD 197,996	Fannie Mae Pool 'BA0569' 3.5% 1/3/2031	211,782	0.00
USD 521,605	Fannie Mae Pool 'BA1152' 3.5% 1/3/2031	558,944	0.01
USD 274,591	Fannie Mae Pool 'BA1155' 3.5% 1/3/2031	290,243	0.00
USD 2,979,188	Fannie Mae Pool 'BA2532' 3.5% 1/10/2045	3,185,644	0.04
USD 2,111,367	Fannie Mae Pool 'BA2883' 3.5% 1/11/2030	2,241,609	0.03
USD 1,156,742	Fannie Mae Pool 'BA2884' 3.5% 1/11/2030	1,237,570	0.02
USD 3,199,348	Fannie Mae Pool 'BA2892' 3.5% 1/11/2030	3,383,513	0.04
USD 3,267,401	Fannie Mae Pool 'BA2893' 3.5% 1/11/2030	3,511,698	0.04
USD 1,579,783	Fannie Mae Pool 'BA2894' 3.5% 1/11/2030	1,676,217	0.02
USD 1,001,252	Fannie Mae Pool 'BA2895' 3.5% 1/11/2030	1,061,994	0.01
USD 1,473,194	Fannie Mae Pool 'BA2899' 3.5% 1/11/2045	1,573,011	0.02
USD 2,228,684	Fannie Mae Pool 'BA2900' 3.5% 1/11/2045	2,388,276	0.03
USD 4,101,997	Fannie Mae Pool 'BA2901' 3.5% 1/11/2045	4,386,060	0.06
USD 2,004,901	Fannie Mae Pool 'BA2912' 3.5% 1/11/2030	2,120,478	0.03
USD 1,019,057	Fannie Mae Pool 'BA2913' 3.5% 1/11/2030	1,082,499	0.01
USD 990,418	Fannie Mae Pool 'BA2914' 3.5% 1/11/2030	1,050,952	0.01
USD 204,870	Fannie Mae Pool 'BA3084' 3.5% 1/12/2045	220,333	0.00
USD 470,932	Fannie Mae Pool 'BA3492' 3.5% 1/11/2030	503,632	0.01
USD 238,744	Fannie Mae Pool 'BA3553' 3.5% 1/11/2045	256,647	0.00
USD 579,876	Fannie Mae Pool 'BA3975' 3.5% 1/2/2046	623,687	0.01
USD 4,929,986	Fannie Mae Pool 'BA3976' 3.5% 1/2/2046	5,282,773	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 750,723	Fannie Mae Pool 'BA3984' 3.5% 1/2/2046	802,724	0.01
USD 902,785	Fannie Mae Pool 'BA4497' 3.5% 1/9/2030	953,576	0.01
USD 252,181	Fannie Mae Pool 'BA4700' 3.5% 1/11/2045	271,110	0.00
USD 538,293	Fannie Mae Pool 'BA4702' 3.5% 1/11/2045	575,567	0.01
USD 2,878,504	Fannie Mae Pool 'BA4709' 3.5% 1/12/2030	3,050,675	0.04
USD 3,425,505	Fannie Mae Pool 'BA4734' 3.5% 1/12/2045	3,670,381	0.05
USD 3,009,690	Fannie Mae Pool 'BA4749' 3.5% 1/12/2030	3,235,049	0.04
USD 3,064,578	Fannie Mae Pool 'BA4769' 3.5% 1/1/2031	3,241,323	0.04
USD 2,249,769	Fannie Mae Pool 'BA4788' 3.5% 1/2/2031	2,384,303	0.03
USD 402,746	Fannie Mae Pool 'BA5324' 3.5% 1/11/2045	432,949	0.01
USD 315,227	Fannie Mae Pool 'BA6575' 3.5% 1/11/2030	332,987	0.00
USD 3,199,850	Fannie Mae Pool 'BA7489' 3.5% 1/6/2046	3,444,803	0.04
USD 931,862	Fannie Mae Pool 'BA7572' 3% 1/8/2031	985,635	0.01
USD 2,033,811	Fannie Mae Pool 'BC0729' 3.5% 1/2/2046	2,181,615	0.03
USD 2,862,694	Fannie Mae Pool 'BC0922' 3.5% 1/5/2031	3,078,943	0.04
USD 2,316,738	Fannie Mae Pool 'BC1468' 3% 1/7/2031	2,450,448	0.03
USD 3,018,239	Fannie Mae Pool 'BC1528' 3% 1/8/2031	3,192,438	0.04
USD 632,798	Fannie Mae Pool 'BC1795' 3.5% 1/3/2031	678,058	0.01
USD 544,380	Fannie Mae Pool 'BC1801' 3.5% 1/4/2031	582,469	0.01
USD 3,419,948	Fannie Mae Pool 'BC2073' 3.5% 1/6/2046	3,681,749	0.05
USD 1,599,503	Fannie Mae Pool 'BC2467' 3.5% 1/2/2031	1,711,113	0.02
USD 207,405	Fannie Mae Pool 'BC2879' 3.5% 1/1/2046	221,826	0.00
USD 587,344	Fannie Mae Pool 'BC2893' 3.5% 1/2/2046	629,916	0.01
USD 176,190	Fannie Mae Pool 'BC3323' 3.5% 1/2/2046	188,465	0.00
USD 1,546,187	Fannie Mae Pool 'BC3591' 3.5% 1/3/2031	1,656,622	0.02
USD 960,753	Fannie Mae Pool 'BC3593' 3.5% 1/3/2031	1,027,881	0.01
USD 3,705,827	Fannie Mae Pool 'BC4433' 3.5% 1/4/2031	3,970,545	0.05
USD 2,359,358	Fannie Mae Pool 'BC4434' 3.5% 1/4/2031	2,524,261	0.03
USD 1,968,761	Fannie Mae Pool 'BC4664' 3.5% 1/6/2046	2,105,915	0.03
USD 241,543	Fannie Mae Pool 'BC4863' 3.5% 1/2/2031	258,811	0.00
USD 227,855	Fannie Mae Pool 'BC4864' 3.5% 1/1/2031	244,059	0.00
USD 3,413,695	Fannie Mae Pool 'BC5052' 3.5% 1/4/2046	3,653,979	0.05
USD 686,022	Fannie Mae Pool 'BC5995' 3.5% 1/4/2031	727,390	0.01
USD 2,349,285	Fannie Mae Pool 'BC5996' 3.5% 1/4/2031	2,526,171	0.03
USD 669,613	Fannie Mae Pool 'BC5997' 3.5% 1/4/2031	717,560	0.01
USD 2,155,173	Fannie Mae Pool 'BC6052' 3.5% 1/6/2031	2,280,552	0.03
USD 2,289,305	Fannie Mae Pool 'BC6053' 3.5% 1/6/2031	2,432,782	0.03
USD 193,497	Fannie Mae Pool 'BC7649' 3.5% 1/4/2031	208,070	0.00
USD 5,437,976	Fannie Mae Pool 'BC7878' 3.5% 1/4/2046	5,832,187	0.07
USD 969,514	Fannie Mae Pool 'BC8581' 3.5% 1/5/2031	1,042,651	0.01
USD 2,852,210	Fannie Mae Pool 'BC8936' 3.5% 1/6/2046	3,060,017	0.04
USD 211,160	Fannie Mae Pool 'BC9737' 3.5% 1/6/2031	227,072	0.00
USD 100,149	Fannie Mae Pool 'BC9847' 3.5% 1/6/2031	106,186	0.00
USD 1,262,106	Fannie Mae Pool 'BD0432' 3.5% 1/6/2031	1,335,422	0.02
USD 5,851,566	Fannie Mae Pool 'BD0492' 3.5% 1/7/2046	6,240,027	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 781,024	Fannie Mae Pool 'BD1613' 3.5% 1/7/2031	840,102	0.01
USD 408,450	Fannie Mae Pool 'BD1619' 3.5% 1/7/2031	437,200	0.01
USD 602,635	Fannie Mae Pool 'BD1621' 3.5% 1/7/2031	645,053	0.01
USD 193,324	Fannie Mae Pool 'BD1623' 3.5% 1/7/2031	206,156	0.00
USD 762,762	Fannie Mae Pool 'BD1989' 3.5% 1/8/2031	820,462	0.01
USD 740,205	Fannie Mae Pool 'BD1990' 3.5% 1/8/2031	793,450	0.01
USD 545,349	Fannie Mae Pool 'BD1991' 3.5% 1/8/2031	583,734	0.01
USD 247,142	Fannie Mae Pool 'BD1992' 3.5% 1/7/2031	264,539	0.00
USD 340,639	Fannie Mae Pool 'BD1993' 3.5% 1/8/2031	363,247	0.00
USD 1,564,709	Fannie Mae Pool 'BD3668' 3.5% 1/7/2046	1,668,588	0.02
USD 1,768,849	Fannie Mae Pool 'BD3684' 3.5% 1/7/2031	1,877,491	0.02
USD 181,774	Fannie Mae Pool 'BD3901' 3.5% 1/6/2031	195,525	0.00
USD 463,000	Fannie Mae Pool 'BD6360' 3.5% 1/9/2031	491,219	0.01
USD 12,499,000	Fannie Mae Pool 'BF1669' 1/5/2035 (Zero Coupon)	12,479,470	0.16
USD 1,567,489	Fannie Mae Pool 'MA2195' 3.5% 1/2/2030	1,657,173	0.02
USD 213,091	Fannie Mae Pool 'MA2280' 3.5% 1/5/2030	225,377	0.00
USD 641,165	Fannie Mae Pool 'MA2377' 3.5% 1/8/2030	678,025	0.01
USD 2,034,576	Fannie Mae Pool 'MA2406' 3.5% 1/9/2030	2,149,409	0.03
USD 589,148	Fannie Mae Pool 'MA2486' 3.5% 1/12/2030	624,291	0.01
USD 2,098,939	Fannie Mae Pool 'MA2515' 3.5% 1/1/2031	2,224,157	0.03
USD 28,388	Fannie Mae Pool 'MA2625' 3.5% 1/5/2031	30,095	0.00
USD 1,925,775	Fannie Mae Pool 'MA2685' 3.5% 1/7/2031	2,041,695	0.03
USD 6,941,481	Fannie Mae REMICS '2016-40 JF' FRN 25/7/2046	6,942,717	0.09
USD 6,870,164	Fannie Mae REMICS '2016-44 FA' FRN 25/7/2046	6,875,033	0.09
USD 7,353,584	Fannie Mae REMICS '2016-46 HF' FRN 25/7/2046	7,353,499	0.09
USD 4,865,215	Fannie Mae REMICS '2016-49 EF' FRN 25/8/2046	4,863,524	0.06
USD 4,500,602	Fannie Mae REMICS '2016-52 MF' FRN 25/8/2046	4,499,019	0.06
USD 7,168,449	Fannie Mae REMICS '2016-55 FK' FRN 25/8/2046	7,173,011	0.09
USD 8,927,000	Fannie Mae REMICS '2016-60 FD' FRN 25/9/2046	8,919,981	0.11
USD 29,729,000	Fannie Mae REMICS '2016-60 LF' FRN 25/9/2046	29,705,419	0.38
USD 6,085,000	Fannie Mae REMICS '2016-62 FA' FRN 25/9/2046	6,072,424	0.08
USD 4,732,943	Fannie Mae REMICS '2016-63 AF' FRN 25/9/2046	4,730,515	0.06
USD 13,010,000	Fannie Mae REMICS '2016-6 4 FA' FRN 25/9/2046	13,004,468	0.17
USD 12,056,200	Fannie Mae REMICS '2016-64 FP' FRN 25/9/2046	12,059,207	0.15
USD 8,891,000	Fannie Mae REMICS '2016-67 FB' FRN 25/9/2046	8,841,108	0.11
USD 15,192,614	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/8/2022	266,880	0.00
USD 1,000,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/7/2023	1,108,784	0.01
USD 1,090,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/10/2023	1,209,527	0.02
USD 18,392,896	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/9/2024	910,408	0.01
USD 9,812,569	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2025	508,157	0.01
USD 19,965,013	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2025	650,172	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 20,987,995	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2026	1,535,144	0.02
USD 22,136,964	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/3/2026	2,324,214	0.03
USD 8,090,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/5/2026	800,518	0.01
USD 2,090,653	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/10/2043	213,440	0.00
USD 2,240,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 2.673% 25/3/2026	2,354,327	0.03
USD 2,210,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 2.77% 25/5/2025	2,324,861	0.03
USD 730,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.205% 25/3/2025	798,643	0.01
USD 37,985,319	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K041 X1' FRN 25/10/2024	1,461,029	0.02
USD 9,043,992	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K042 X1' FRN 25/12/2024	659,123	0.01
USD 10,654,114	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K049 X1' FRN 25/7/2025	479,501	0.01
USD 7,007,189	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K718X1' FRN 25/1/2022	204,779	0.00
USD 36,272,449	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KC01 X1' FRN 25/12/2022	1,159,768	0.01
USD 750,000	Finn Square CLO Ltd '2012-1A B1' '144A' FRN 24/12/2023	748,979	0.01
USD 2,185,000	First Data Corp '144A' 5% 15/1/2024	2,239,625	0.03
USD 6,460,000	First Data Corp '144A' 5.75% 15/1/2024	6,637,650	0.08
USD 1,430,322	First Franklin Mortgage Loan Trust '2006-FF5 2A3' FRN 25/4/2036	1,259,848	0.02
USD 707,802	FirstKey Lending 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 A' '144A' 2.553% 9/3/2047	706,369	0.01
USD 1,000,000	Flagship CLO VIII Ltd '2014-8A C' '144A' FRN 16/1/2026	994,975	0.01
USD 450,000	Flatiron CLO 2011-1 Ltd '2011-1A D' '144A' FRN 15/1/2023	449,351	0.01
USD 875,000	Flatiron CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 17/1/2026	872,104	0.01
USD 1,800,000	Flatiron CLO Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 25/10/2024	1,802,255	0.02
USD 1,829,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,831,698	0.02
USD 7,250,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A A2R' '144A' FRN 20/4/2023	7,254,774	0.09
USD 5,270,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A BR' '144A' FRN 20/4/2023	5,295,289	0.07
USD 4,300,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A CR' '144A' FRN 20/4/2023	4,296,889	0.05
USD 1,000,000	Fraser Sullivan CLO VII Ltd '2012-7A DR' '144A' FRN 20/4/2023	989,890	0.01
USD 8,703	Freddie Mac Gold Pool 'E02735' 3.5% 1/10/2025	9,220	0.00
USD 941,088	Freddie Mac Gold Pool 'E02746' 3.5% 1/11/2025	997,081	0.01
USD 108,457	Freddie Mac Gold Pool 'E02894' 3.5% 1/5/2026	114,855	0.00
USD 268,565	Freddie Mac Gold Pool 'E02927' 3.5% 1/7/2026	286,314	0.00
USD 333,765	Freddie Mac Gold Pool 'E02955' 3.5% 1/8/2026	355,999	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 32,125	Freddie Mac Gold Pool 'E04044' 3.5% 1/8/2027	34,032	0.00
USD 9,573	Freddie Mac Gold Pool 'E04045' 3.5% 1/8/2027	10,140	0.00
USD 115,022	Freddie Mac Gold Pool 'G14018' 3.5% 1/1/2026	121,897	0.00
USD 940,354	Freddie Mac Gold Pool 'G14334' 3.5% 1/12/2026	996,587	0.01
USD 110,288	Freddie Mac Gold Pool 'G14335' 3.5% 1/9/2026	116,847	0.00
USD 1,146,574	Freddie Mac Gold Pool 'G14578' 3.5% 1/8/2027	1,214,686	0.02
USD 268,575	Freddie Mac Gold Pool 'G14817' 3.5% 1/10/2026	284,396	0.00
USD 524,571	Freddie Mac Gold Pool 'G15096' 3.5% 1/4/2024	555,728	0.01
USD 477,316	Freddie Mac Gold Pool 'G15114' 3.5% 1/5/2026	511,377	0.01
USD 764,321	Freddie Mac Gold Pool 'G15132' 3.5% 1/6/2024	809,745	0.01
USD 109,435	Freddie Mac Gold Pool 'G15150' 3.5% 1/7/2029	115,881	0.00
USD 120,624	Freddie Mac Gold Pool 'G15167' 3.5% 1/8/2029	127,729	0.00
USD 29,715	Freddie Mac Gold Pool 'G15219' 3.5% 1/11/2029	31,466	0.00
USD 20,667,659	Freddie Mac Gold Pool 'G15227' 3.5% 1/12/2029	22,161,135	0.28
USD 713,484	Freddie Mac Gold Pool 'G15290' 3.5% 1/2/2030	763,009	0.01
USD 499,986	Freddie Mac Gold Pool 'G15529' 3.5% 1/6/2030	529,538	0.01
USD 1,494,800	Freddie Mac Gold Pool 'G15559' 3.5% 1/7/2030	1,583,214	0.02
USD 11,369,636	Freddie Mac Gold Pool 'G15670' 3.5% 1/11/2030	12,133,794	0.15
USD 5,824,308	Freddie Mac Gold Pool 'G15673' 3.5% 1/11/2030	6,206,674	0.08
USD 505,065	Freddie Mac Gold Pool 'G15723' 3.5% 1/10/2030	535,046	0.01
USD 352,932	Freddie Mac Gold Pool 'G15754' 3.5% 1/6/2030	373,983	0.00
USD 186,382	Freddie Mac Gold Pool 'G15765' 3.5% 1/12/2030	197,427	0.00
USD 61,481	Freddie Mac Gold Pool 'G18363' 3.5% 1/9/2025	65,137	0.00
USD 16,241	Freddie Mac Gold Pool 'G18368' 3.5% 1/11/2025	17,210	0.00
USD 267,971	Freddie Mac Gold Pool 'G18383' 3.5% 1/4/2026	283,870	0.00
USD 348,752	Freddie Mac Gold Pool 'G18401' 3.5% 1/9/2026	369,517	0.00
USD 75,449	Freddie Mac Gold Pool 'G18493' 3.5% 1/1/2029	79,894	0.00
USD 774,082	Freddie Mac Gold Pool 'G18498' 3.5% 1/1/2029	819,681	0.01
USD 71,863	Freddie Mac Gold Pool 'G18503' 3.5% 1/2/2029	76,096	0.00
USD 469,247	Freddie Mac Gold Pool 'G18506' 3.5% 1/3/2029	496,889	0.01
USD 278,270	Freddie Mac Gold Pool 'G18525' 3.5% 1/9/2029	294,662	0.00
USD 866,534	Freddie Mac Gold Pool 'G18542' 3.5% 1/2/2030	918,376	0.01
USD 838,442	Freddie Mac Gold Pool 'G18546' 3.5% 1/3/2030	888,698	0.01
USD 726,025	Freddie Mac Gold Pool 'G18551' 3.5% 1/4/2030	769,452	0.01
USD 1,473,119	Freddie Mac Gold Pool 'G18558' 3.5% 1/6/2030	1,561,456	0.02
USD 182,940	Freddie Mac Gold Pool 'G18566' 3.5% 1/8/2030	193,880	0.00
USD 2,069,480	Freddie Mac Gold Pool 'G18570' 3.5% 1/9/2030	2,193,297	0.03
USD 1,008,308	Freddie Mac Gold Pool 'G18573' 3.5% 1/10/2030	1,069,246	0.01
USD 687,266	Freddie Mac Gold Pool 'G18576' 3.5% 1/11/2030	728,952	0.01
USD 1,318,391	Freddie Mac Gold Pool 'G18593' 3.5% 1/3/2031	1,398,281	0.02
USD 327,150	Freddie Mac Gold Pool 'J12954' 3.5% 1/9/2020	346,421	0.00
USD 104,976	Freddie Mac Gold Pool 'J12989' 3.5% 1/9/2025	111,206	0.00
USD 14,350	Freddie Mac Gold Pool 'J13098' 3.5% 1/9/2025	15,195	0.00
USD 20,554	Freddie Mac Gold Pool 'J13178' 3.5% 1/10/2025	21,773	0.00
USD 63,913	Freddie Mac Gold Pool 'J13269' 3.5% 1/10/2020	67,678	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 80,916	Freddie Mac Gold Pool 'J13300' 3.5% 1/10/2025	85,682	0.00
USD 261,522	Freddie Mac Gold Pool 'J13342' 3.5% 1/10/2025	277,677	0.00
USD 10,149	Freddie Mac Gold Pool 'J13413' 3.5% 1/11/2025	10,747	0.00
USD 298,558	Freddie Mac Gold Pool 'J13432' 3.5% 1/11/2025	316,257	0.00
USD 905,890	Freddie Mac Gold Pool 'J13433' 3.5% 1/11/2025	959,254	0.01
USD 44,198	Freddie Mac Gold Pool 'J13456' 3.5% 1/11/2025	47,289	0.00
USD 724,210	Freddie Mac Gold Pool 'J13496' 3.5% 1/11/2025	766,871	0.01
USD 110,337	Freddie Mac Gold Pool 'J13510' 3.5% 1/11/2025	116,837	0.00
USD 32,380	Freddie Mac Gold Pool 'J13542' 3.5% 1/11/2025	34,299	0.00
USD 13,000	Freddie Mac Gold Pool 'J13585' 3.5% 1/11/2025	13,772	0.00
USD 240,277	Freddie Mac Gold Pool 'J13592' 3.5% 1/11/2020	254,431	0.00
USD 863,382	Freddie Mac Gold Pool 'J13597' 3.5% 1/11/2025	921,802	0.01
USD 205,832	Freddie Mac Gold Pool 'J13669' 3.5% 1/11/2020	217,957	0.00
USD 1,053,968	Freddie Mac Gold Pool 'J13807' 3.5% 1/12/2025	1,116,445	0.01
USD 505,085	Freddie Mac Gold Pool 'J13878' 3.5% 1/1/2026	535,087	0.01
USD 171,766	Freddie Mac Gold Pool 'J13883' 3.5% 1/12/2025	184,100	0.00
USD 399,410	Freddie Mac Gold Pool 'J13885' 3.5% 1/12/2025	423,144	0.01
USD 328,387	Freddie Mac Gold Pool 'J13914' 3.5% 1/12/2025	347,970	0.00
USD 281,380	Freddie Mac Gold Pool 'J13918' 3.5% 1/12/2025	298,066	0.00
USD 332,327	Freddie Mac Gold Pool 'J13949' 3.5% 1/12/2025	357,070	0.00
USD 283,790	Freddie Mac Gold Pool 'J14069' 3.5% 1/1/2026	300,663	0.00
USD 79,389	Freddie Mac Gold Pool 'J14097' 3.5% 1/1/2026	84,099	0.00
USD 47,492	Freddie Mac Gold Pool 'J14426' 3.5% 1/2/2021	50,290	0.00
USD 619,956	Freddie Mac Gold Pool 'J14490' 3.5% 1/2/2026	656,738	0.01
USD 248,929	Freddie Mac Gold Pool 'J1459 5' 3.5% 1/3/2026	263,665	0.00
USD 35,770	Freddie Mac Gold Pool 'J14619' 3.5% 1/2/2026	37,878	0.00
USD 652,803	Freddie Mac Gold Pool 'J14731' 3.5% 1/3/2026	691,483	0.01
USD 653,861	Freddie Mac Gold Pool 'J14793' 3.5% 1/3/2021	692,378	0.01
USD 96,086	Freddie Mac Gold Pool 'J14816' 3.5% 1/3/2021	101,746	0.00
USD 118,075	Freddie Mac Gold Pool 'J14888' 3.5% 1/4/2026	125,030	0.00
USD 11,832	Freddie Mac Gold Pool 'J14954' 3.5% 1/4/2021	12,529	0.00
USD 764,121	Freddie Mac Gold Pool 'J14979' 3.5% 1/4/2026	809,133	0.01
USD 21,600	Freddie Mac Gold Pool 'J15111' 3.5% 1/4/2026	22,880	0.00
USD 591,889	Freddie Mac Gold Pool 'J15115' 3.5% 1/4/2021	626,755	0.01
USD 47,858	Freddie Mac Gold Pool 'J15989' 3.5% 1/7/2026	50,706	0.00
USD 1,003,444	Freddie Mac Gold Pool 'J16061' 3.5% 1/7/2026	1,062,883	0.01
USD 9,152	Freddie Mac Gold Pool 'J16317' 3.5% 1/8/2026	9,695	0.00
USD 269,601	Freddie Mac Gold Pool 'J16319' 3.5% 1/8/2026	285,482	0.00
USD 351,446	Freddie Mac Gold Pool 'J16368' 3.5% 1/8/2026	372,149	0.00
USD 541,682	Freddie Mac Gold Pool 'J16376' 3.5% 1/8/2026	573,845	0.01
USD 1,057,164	Freddie Mac Gold Pool 'J16392' 3.5% 1/8/2026	1,119,603	0.01
USD 751,928	Freddie Mac Gold Pool 'J16433' 3.5% 1/8/2026	796,428	0.01
USD 1,126,344	Freddie Mac Gold Pool 'J16564' 3.5% 1/9/2026	1,192,693	0.02
USD 199,980	Freddie Mac Gold Pool 'J16625' 3.5% 1/9/2026	211,760	0.00
USD 23,000	Freddie Mac Gold Pool 'J16641' 3.5% 1/9/2026	24,491	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 79,588	Freddie Mac Gold Pool 'J16665' 3.5% 1/9/2026	84,322	0.00
USD 841,932	Freddie Mac Gold Pool 'J16710' 3.5% 1/9/2026	891,527	0.01
USD 990,238	Freddie Mac Gold Pool 'J16713' 3.5% 1/10/2026	1,049,105	0.01
USD 238,660	Freddie Mac Gold Pool 'J17019' 3.5% 1/10/2026	253,035	0.00
USD 1,197,140	Freddie Mac Gold Pool 'J17142' 3.5% 1/11/2026	1,267,659	0.02
USD 97,736	Freddie Mac Gold Pool 'J18136' 3.5% 1/2/2027	103,493	0.00
USD 864,187	Freddie Mac Gold Pool 'J19306' 3.5% 1/6/2027	920,069	0.01
USD 203,200	Freddie Mac Gold Pool 'J19499' 3.5% 1/6/2027	215,170	0.00
USD 710,512	Freddie Mac Gold Pool 'J27339' 3.5% 1/2/2029	758,544	0.01
USD 1,067,575	Freddie Mac Gold Pool 'J28027' 3.5% 1/4/2029	1,130,558	0.01
USD 60,186	Freddie Mac Gold Pool 'J29001' 3.5% 1/8/2029	63,731	0.00
USD 404,947	Freddie Mac Gold Pool 'J29016' 3.5% 1/8/2029	433,390	0.01
USD 99,127	Freddie Mac Gold Pool 'J29219' 3.5% 1/7/2029	104,966	0.00
USD 350,865	Freddie Mac Gold Pool 'J29692' 3.5% 1/11/2029	372,575	0.00
USD 500,354	Freddie Mac Gold Pool 'J29813' 3.5% 1/11/2029	531,496	0.01
USD 521,914	Freddie Mac Gold Pool 'J29880' 3.5% 1/11/2029	558,644	0.01
USD 561,607	Freddie Mac Gold Pool 'J30137' 3.5% 1/12/2029	595,007	0.01
USD 23,874	Freddie Mac Gold Pool 'J30155' 3.5% 1/12/2029	25,300	0.00
USD 1,616,395	Freddie Mac Gold Pool 'J30246' 3.5% 1/12/2029	1,713,047	0.02
USD 34,617	Freddie Mac Gold Pool 'J30804' 3.5% 1/2/2030	36,656	0.00
USD 654,567	Freddie Mac Gold Pool 'J30948' 3.5% 1/3/2030	693,142	0.01
USD 571,273	Freddie Mac Gold Pool 'J31708' 3.5% 1/5/2030	604,925	0.01
USD 437,813	Freddie Mac Gold Pool 'J31771' 3.5% 1/6/2030	465,160	0.01
USD 16,906,345	Freddie Mac Gold Pool 'J31951' 3.5% 1/12/2028	17,902,246	0.23
USD 1,821,706	Freddie Mac Gold Pool 'J31961' 3.5% 1/3/2027	1,929,017	0.02
USD 187,976	Freddie Mac Gold Pool 'J3 1969' 3.5% 1/5/2030	201,530	0.00
USD 95,074	Freddie Mac Gold Pool 'J32074' 3.5% 1/6/2030	101,825	0.00
USD 1,036,571	Freddie Mac Gold Pool 'J32079' 3.5% 1/7/2030	1,098,937	0.01
USD 884,954	Freddie Mac Gold Pool 'J32081' 3.5% 1/7/2030	938,138	0.01
USD 26,185	Freddie Mac Gold Pool 'J32203' 3.5% 1/7/2030	27,728	0.00
USD 47,097	Freddie Mac Gold Pool 'J32247' 3.5% 1/7/2030	50,254	0.00
USD 327,919	Freddie Mac Gold Pool 'J32378' 3.5% 1/8/2030	351,623	0.00
USD 634,061	Freddie Mac Gold Pool 'J32490' 3.5% 1/8/2030	679,736	0.01
USD 416,059	Freddie Mac Gold Pool 'J32494' 3.5% 1/8/2030	446,227	0.01
USD 4,433,706	Freddie Mac Gold Pool 'J32523' 3.5% 1/8/2030	4,738,810	0.06
USD 28,505	Freddie Mac Gold Pool 'J32554' 3.5% 1/8/2030	30,186	0.00
USD 684,064	Freddie Mac Gold Pool 'J32613' 3.5% 1/8/2030	725,381	0.01
USD 757,335	Freddie Mac Gold Pool 'J32681' 3.5% 1/9/2030	804,813	0.01
USD 1,600,592	Freddie Mac Gold Pool 'J32746' 3.5% 1/9/2030	1,716,683	0.02
USD 1,227,679	Freddie Mac Gold Pool 'J32748' 3.5% 1/9/2030	1,312,313	0.02
USD 1,283,801	Freddie Mac Gold Pool 'J32784' 3.5% 1/9/2030	1,382,259	0.02
USD 1,171,060	Freddie Mac Gold Pool 'J32787' 3.5% 1/9/2030	1,256,238	0.02
USD 658,008	Freddie Mac Gold Pool 'J32789' 3.5% 1/9/2030	705,078	0.01
USD 1,033,037	Freddie Mac Gold Pool 'J32791' 3.5% 1/9/2030	1,104,331	0.01
USD 523,832	Freddie Mac Gold Pool 'J32792' 3.5% 1/9/2030	558,980	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	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 438,021	Freddie Mac Gold Pool 'J32878' 3.5% 1/10/2030	464,484	0.01
USD 394,972	Freddie Mac Gold Pool 'J33102' 3.5% 1/11/2030	418,910	0.01
USD 622,639	Freddie Mac Gold Pool 'J33161' 3.5% 1/11/2030	664,400	0.01
USD 981,423	Freddie Mac Gold Pool 'J33175' 3.5% 1/8/2030	1,040,706	0.01
USD 974,062	Freddie Mac Gold Pool 'J33301' 3.5% 1/11/2030	1,038,748	0.01
USD 72,681	Freddie Mac Gold Pool 'J33632' 3.5% 1/12/2028	76,973	0.00
USD 1,590,782	Freddie Mac Gold Pool 'J34452' 3.5% 1/5/2031	1,714,155	0.02
USD 981,041	Freddie Mac Gold Pool 'J34833' 3% 1/7/2031	1,038,301	0.01
USD 1,896,212	Freddie Mac Gold Pool 'J34870' 3% 1/7/2031	2,006,792	0.03
USD 966,503	Freddie Mac Gold Pool 'Q37953' 3.5% 1/12/2045	1,032,010	0.01
USD 2,413,490	Freddie Mac Gold Pool 'Q37954' 3.5% 1/12/2045	2,571,397	0.03
USD 2,435,947	Freddie Mac Gold Pool 'Q41115' 3.5% 1/6/2046	2,611,832	0.03
USD 1,614,318	Freddie Mac Gold Pool 'Q41915' 3.5% 1/7/2046	1,724,318	0.02
USD 4,355,707	Freddie Mac Gold Pool 'Q41916' 3.5% 1/7/2046	4,642,039	0.06
USD 875,215	Freddie Mac Gold Pool 'Q42043' 3.5% 1/7/2046	934,855	0.01
USD 1,868,735	Freddie Mac Gold Pool 'Q42045' 3.5% 1/7/2046	1,991,587	0.03
USD 7,890	Freddie Mac Gold Pool 'V60188' 3.5% 1/1/2027	8,354	0.00
USD 2,288,014	Freddie Mac Gold Pool 'V60343' 3.5% 1/11/2028	2,441,142	0.03
USD 704,148	Freddie Mac Gold Pool 'V60529' 3.5% 1/3/2029	751,287	0.01
USD 625,925	Freddie Mac Gold Pool 'V60548' 3.5% 1/7/2029	668,957	0.01
USD 703,736	Freddie Mac Gold Pool 'V60610' 3.5% 1/8/2029	749,729	0.01
USD 8,702,752	Freddie Mac REMICS '4588 FA' FRN 15/6/2046	8,703,346	0.11
USD 2,914,585	Freddie Mac REMICS '4589 TF' FRN 15/6/2046	2,917,371	0.04
USD 3,211,171	Freddie Mac REMICS '4594 FG' FRN 15/6/2046	3,219,843	0.04
USD 6,228,000	Freddie Mac REMICS '4604 FH' FRN 15/8/2046	6,227,084	0.08
USD 1,514,000	FREMF 2015-K47 Mortgage Trust '2015-K47 B' '144A' FRN 25/6/2048	1,504,372	0.02
USD 3,132,000	FREMF 2015-K50 Mortgage Trust '2015-K50 B' '144A' FRN 25/10/2048	3,151,378	0.04
USD 109,644,414	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust '2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	489,255	0.01
USD 1,680,000	FREMF 2016-K54 Mortgage Trust '2016-K54 B' '144A' FRN 25/2/2026	1,714,034	0.02
USD 2,140,000	Frontier Communications Corp 10.5% 15/9/2022	2,345,975	0.03
USD 1,545,704	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2034	1,554,266	0.02
USD 2,380,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF EFX' '144A' FRN 15/12/2034	2,333,176	0.03
USD 790,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF FFX' '144A' FRN 15/12/2034	750,161	0.01
USD 12,152,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF GFX' '144A' FRN 15/12/2034	11,225,911	0.14
USD 1,610,000	Galaxy XV CLO Ltd '2013-15A A' '144A' FRN 15/4/2025	1,606,392	0.02
EUR 800,000	Gates Global LLC / Gates Global Co 5.75% 15/7/2022	827,427	0.01
USD 2,188,000	General Electric Co FRN 21/1/2021 (Perpetual)	2,347,024	0.03
USD 5,195,000	General Motors Financial Co Inc 5.25% 1/3/2026	5,810,472	0.07
USD 659,901	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	615,596	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 16,280	GFT Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2015-GFT1 A' '144A' 3.721% 25/1/2055	16,290	0.00
USD 690,103	GFT Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2015-GFT2 A' '144A' 4.336% 25/6/2059	691,622	0.01
USD 261,599	Ginnie Mae II Pool '729081' 4.5% 20/11/2039	283,015	0.00
USD 228,780	Ginnie Mae II Pool '736422' 4.5% 20/1/2040	246,676	0.00
USD 107,365	Ginnie Mae II Pool '738761' 4.5% 20/9/2041	117,425	0.00
USD 882,419	Ginnie Mae II Pool '742269' 4.5% 20/1/2040	960,751	0.01
USD 141,286	Ginnie Mae II Pool '752492' 4.5% 20/8/2040	152,270	0.00
USD 453,237	Ginnie Mae II Pool '752527' 4.5% 20/8/2040	488,486	0.01
USD 321,026	Ginnie Mae II Pool '752723' 4.5% 20/9/2040	346,022	0.00
USD 454,416	Ginnie Mae II Pool '763245' 4.5% 20/4/2041	494,267	0.01
USD 68,353	Ginnie Mae II Pool '763251' 4.5% 20/5/2041	73,670	0.00
USD 115,689	Ginnie Mae II Pool '763298' 4.5% 20/5/2041	124,686	0.00
USD 416,980	Ginnie Mae II Pool '770949' 4.5% 20/7/2041	449,891	0.01
USD 159,549	Ginnie Mae II Pool 'AB1413' 4.5% 20/6/2042	171,959	0.00
USD 118,621	Ginnie Mae II Pool 'AB5467' 4.5% 20/11/2041	127,738	0.00
USD 142,112	Ginnie Mae II Pool 'AH8916' 4.5% 20/8/2038	153,929	0.00
USD 146,797	Ginnie Mae II Pool 'AK1040' 4.5% 20/11/2044	158,219	0.00
USD 578,302	Ginnie Mae II Pool 'AM1091' 4.5% 20/10/2041	623,653	0.01
USD 435,802	Ginnie Mae II Pool 'AM8530' 4.5% 20/5/2045	473,938	0.01
USD 211,342	Ginnie Mae II Pool 'A08536' 4.5% 20/9/2041	227,777	0.00
USD 1,232,433	Ginnie Mae II Pool 'A08590' 4.5% 20/11/2045	1,328,339	0.02
USD 241,516	Ginnie Mae II Pool 'AQ2794' 4.5% 20/10/2045	260,309	0.00
USD 189,670	Ginnie Mae II Pool 'AS3774' 4.5% 20/4/2046	206,405	0.00
USD 6,738,875	Ginnie Mae II Pool 'MA2225' 4.5% 20/9/2044	7,270,832	0.09
USD 7,010,994	Ginnie Mae II Pool 'MA2447' 4.5% 20/12/2044	7,564,432	0.10
USD 5,703,798	Ginnie Mae II Pool 'MA2523' 4.5% 20/1/2045	6,154,048	0.08
USD 1,863,151	Ginnie Mae II Pool 'MA2603' 4.5% 20/2/2045	2,010,226	0.03
USD 2,643,054	Ginnie Mae II Pool 'MA2680' 4.5% 20/3/2045	2,851,693	0.04
USD 9,931,403	Ginnie Mae II Pool 'MA2756' 4.5% 20/4/2045	10,715,373	0.14
USD 7,437,458	Ginnie Mae II Pool 'MA2828' 4.5% 20/5/2045	8,024,560	0.10
USD 7,820,450	Ginnie Mae II Pool 'MA2963' 4.5% 20/7/2045	8,437,785	0.11
USD 23,297,775	Ginnie Mae II Pool 'MA3876' 4.5% 20/8/2046	25,136,868	0.32
USD 326,411	GMACM Home Equity Loan Trust '2006-HE4 A2' FRN 25/12/2036	294,803	0.00
USD 770,000	GoldenTree Loan Opportunities IV Ltd '2007-4A B' '144A' FRN 18/8/2022	761,174	0.01
USD 703,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd '2014-9A D' '144A' FRN 29/10/2026	685,873	0.01
USD 565,000	Goldentree Loan Opportunities VI Ltd '2012-6A C' '144A' FRN 17/4/2022	566,820	0.01
USD 600,000	Goldentree Loan Opportunities VI Ltd '2012-6A E' '144A' FRN 17/4/2022	595,007	0.01
USD 330,000	Goldentree Loan Opportunities VIII Ltd '2014-8A C' '144A' FRN 19/4/2026	327,185	0.00
USD 750,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd '2015-11A D' '144A' FRN 18/4/2027	739,787	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 750,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd '2015-11A E' '144A' FRN 18/4/2027	691,194	0.01
EUR 2,025,000	Goldman Sachs Group Inc/The 1.625% 27/7/2026	2,325,902	0.03
USD 14,310,000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.25% 21/10/2025*	15,271,696	0.19
USD 3,964,802	Government National Mortgage Association '2013-145 SI' FRN 16/4/2040	433,690	0.01
USD 21,406,409	Government National Mortgage Association '2014-172 IO' FRN 16/1/2049	1,322,811	0.02
USD 5,546,429	Government National Mortgage Association '2016-110 IO' FRN 16/5/2058	477,475	0.01
USD 8,332,714	Government National Mortgage Association '2016-87 IO' FRN 16/8/2058	687,043	0.01
USD 1,970,838	Government National Mortgage Association '2013-191 IA' 1.23% 16/7/2042	20,309	0.00
USD 22,482,676	Government National Mortgage Association '2015-103 CI' 4% 20/7/2045	2,688,494	0.03
USD 8,620,736	Government National Mortgage Association '2015-152 PI' 4% 20/10/2045	719,456	0.01
USD 13,171,376	Government National Mortgage Association '2016-58 PI' 4% 20/10/2045	946,612	0.01
USD 2,187,141	Government National Mortgage Association '2015-176 IO' 4% 20/11/2045	161,521	0.00
USD 2,622,371	Government National Mortgage Association '2016-82 IM' 4% 20/2/2046	367,093	0.00
USD 3,944,674	Government National Mortgage Association '2016-82 WI' 4% 20/5/2046	330,665	0.00
USD 2,530,000	GP Portfolio Trust '2014-GPP E' '144A' FRN 15/2/2027	2,437,473	0.03
USD 7,520,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE F' '144A' FRN 10/6/2028	7,441,617	0.10
USD 1,540,000	Gramercy Park CLO Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 17/7/2023	1,529,067	0.02
USD 730,000	Grant County Public Utility District No2 4.584% 1/1/2040	819,206	0.01
USD 2,325,000	Great Wolf Trust '2015-WFMZ M' '144A' FRN 15/5/2032	2,201,066	0.03
USD 2,135,000	Great Wolf Trust '2015-WOLF D' '144A' FRN 15/5/2034	2,123,813	0.03
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing '1999-5 M1B' FRN 15/12/2029	1,118,081	0.01
USD 1,429,366	Greenpoint Manufactured Housing '1999-5 M2' FRN 15/12/2029	1,278,957	0.02
USD 2,313,466	GreenPoint Mortgage Funding Trust '2006-AR2 4A1' FRN 25/3/2036	1,924,986	0.02
USD 160,000	GS Mortgage Securities Corp II '2005-ROCK H' '144A' 5.713% 3/5/2032	188,729	0.00
USD 1,820,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2016-RENT C' '144A' FRN 10/2/2029	1,886,476	0.02
USD 3,365,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL D' '144A' FRN 15/7/2031	3,277,147	0.04
USD 420,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL E' '144A' FRN 15/7/2031	418,263	0.01
USD 1,627,576	GS Mortgage Securities Trust '2007-GG10 A4' FRN 10/8/2045	1,660,830	0.02
USD 1,661,396	GS Mortgage Securities Trust '2014-GC20 XA' FRN 10/4/2047	100,364	0.00
USD 490,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GC22 D' '144A' FRN 10/6/2047	404,246	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,110,000	GS Mortgage Securities Trust '2015-GS1 C' FRN 10/11/2048	1,198,357	0.02
USD 220,000	GS Mortgage Securities Trust '2015-GC32 D' 3.345% 10/7/2048	173,399	0.00
USD 563,429	GSAA Trust '2007-2 AF3' FRN 25/3/2037	261,336	0.00
USD 1,492,189	GSAMP Trust '2007-H1 A1B' FRN 25/1/2047	986,574	0.01
USD 1,739,542	GSMPs Mortgage Loan Trust '2005-RP1 1AF' '144A' FRN 25/1/2035	1,511,423	0.02
USD 2,160,457	GSMPs Mortgage Loan Trust '2005-RP2 1AF' '144A' FRN 25/3/2035	1,875,282	0.02
USD 1,601,570	GSMPs Mortgage Loan Trust '2006-RP1 1AF1' '144A' FRN 25/1/2036	1,350,989	0.02
USD 1,490,000	GT Loan Financing I Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 28/10/2024	1,486,395	0.02
USD 5,210,000	Halliburton Co 3.8% 15/11/2025	5,404,948	0.07
USD 2,140,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	2,295,150	0.03
USD 2,171,000	HCA Inc 5.875% 1/5/2023	2,322,970	0.03
USD 5,348,000	HCA Inc 5.875% 15/2/2026	5,675,565	0.07
USD 2,348,000	HCA Inc 8% 1/10/2018	2,632,695	0.03
USD 944,000	HD Supply Inc '144A' 5.25% 15/12/2021	1,011,732	0.01
USD 3,260,000	HD Supply Inc '144A' 5.75% 15/4/2024	3,496,350	0.04
USD 2,023,000	HD Supply Inc 7.5% 15/7/2020	2,111,506	0.03
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	973,749	0.01
USD 845,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2030	1,045,683	0.01
USD 780,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2034	950,059	0.01
USD 2,250,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 1/1/2044	2,632,770	0.03
USD 3,200,000	Hess Corp 5.6% 15/2/2041	3,290,261	0.04
USD 400,000	Highbridge Loan Management 3-2014 '3A-2014 C' '144A' FRN 18/1/2025	383,749	0.01
USD 785,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd '4A-2014 B' '144A' FRN 28/7/2025	787,817	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 E' '144A' FRN 29/1/2026	226,401	0.00
USD 430,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 D' '144A' FRN 5/5/2027	402,155	0.01
USD 380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 E1' '144A' FRN 5/5/2027	338,029	0.00
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd '7A-2015 C' '144A' FRN 15/11/2026	330,136	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd '7A-2015 D' '144A' FRN 15/11/2026	319,738	0.00
USD 440,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd '8A-2016 D' '144A' FRN 20/4/2027	420,995	0.01
USD 716,304	Hilton USA Trust '2013-HLF EFL' '144A' FRN 5/11/2030	717,121	0.01
USD 10,346,000	Hilton USA Trust '2013-HLT EFX' '144A' FRN 5/11/2030	10,395,301	0.13
USD 17,825,000	Hilton USA Trust '2013-HLT X1FX' '144A' FRN 5/11/2030	178	0.00
USD 2,125,000	Hilton USA Trust '2013-HLT AFX' '144A' 2.662% 5/11/2030	2,130,549	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,150,000	Hilton USA Trust '2013-HLT BFX' '144A' 3.367% 5/11/2030	2,157,277	0.03
USD 777,673	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series '2004-A M2' FRN 25/7/2034	735,385	0.01
USD 12,098,732	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series '2006-E 2A3' FRN 25/4/2037	8,033,044	0.10
USD 4,025,671	Home Equity Mortgage Trust (Step-up coupon) '2006-2 1A1' 5.867% 25/7/2036	1,944,669	0.02
USD 1,899,719	Home Loan Mortgage Loan Trust '2005-1 A3' FRN 15/4/2036	1,718,883	0.02
USD 840,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2019	929,926	0.01
USD 840,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2020	962,686	0.01
USD 1,230,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2022	1,489,598	0.02
USD 1,365,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2023	1,692,129	0.02
USD 1,450,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2024	1,837,991	0.02
USD 815,000	Horry County School District/SC 5% 1/3/2025	1,050,034	0.01
USD 520,000	HPS Loan Management 9-2016 Ltd '9A-2016 D2' '144A' FRN 19/7/2027	475,652	0.01
USD 1,140,000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust '2016-10HY A' '144A' 2.835% 10/8/2038	1,181,118	0.02
EUR 400,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/4/2021	480,817	0.01
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,658,800	0.02
USD 1,177,000	Hyundai Auto Receivables Trust '2013-B CERT' 16/9/2019 (Zero Coupon)	797,041	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	721,800	0.01
USD 850,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6% 1/8/2020	828,750	0.01
USD 6,147,531	Impac CMB Trust Series '2005-7 A1' FRN 25/11/2035	5,065,498	0.06
USD 9,153,490	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust '2007-HOA1 AXPP' 25/7/2047 (Zero Coupon)	747,235	0.01
USD 2,242,857	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2007-FLX2 A1A' FRN 25/4/2037	1,923,756	0.02
USD 945,000	Informatica LLC '144A' 7.125% 15/7/2023	885,937	0.01
USD 5,380,000	Intel Corp 4.1% 19/5/2046	5,892,501	0.08
USD 3,277,000	International Paper Co 4.4% 15/8/2047	3,313,984	0.04
USD 2,800,000	International Paper Co 5.15% 15/5/2046	3,130,539	0.04
USD 351,000	Invitation Homes 2013-SFR1 Trust '2013-SFR1 F' '144A' FRN 17/12/2030	347,131	0.00
USD 1,458,148	Invitation Homes 2014-SFR1 Trust '2014-SFR1 A' '144A' FRN 17/6/2031	1,452,483	0.02
USD 1,140,216	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 A' '144A' FRN 17/9/2031	1,139,378	0.01
USD 1,400,000	Invitation Homes 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 E' '144A' FRN 17/9/2031	1,402,765	0.02
USD 940,000	Invitation Homes 2014-SFR3 Trust '2014-SFR3 D' '144A' FRN 17/12/2031	951,233	0.01
USD 684,000	Invitation Homes 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2032	692,803	0.01
USD 1,580,000	Invitation Homes 2015-SFR3 Trust '2015-SFR3 E' '144A' FRN 17/8/2032	1,598,299	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,107,871	Irwin Home Equity Loan Trust '2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	982,720	0.01
USD 389,000	iStar Inc 4% 1/11/2017	390,945	0.01
USD 673,533	JP Morgan Alternative Loan Trust '2007-A2 2A1' FRN 25/5/2037	558,209	0.01
USD 2,660,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY D' '144A' FRN 10/6/2027	2,591,118	0.03
USD 1,540,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY E' '144A' FRN 10/6/2027	1,432,756	0.02
USD 1,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-PHH B' '144A' FRN 15/8/2027	1,168,056	0.02
USD 1,595,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	1,584,895	0.02
USD 3,621,451	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	3,618,905	0.05
USD 1,080,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT1' '144A' FRN 15/11/2031	1,061,100	0.01
USD 165,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 BAT2' '144A' FRN 15/11/2031	162,112	0.00
USD 2,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW1' '144A' FRN 15/11/2031	2,061,500	0.03
USD 1,160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 DFW2' '144A' FRN 15/11/2031	1,102,000	0.01
USD 520,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 VINE' '144A' FRN 15/11/2031	510,900	0.01
USD 1,270,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO A' '144A' FRN 15/1/2032	1,270,702	0.02
USD 5,204,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO D' '144A' FRN 15/1/2032	5,211,114	0.07
USD 2,182,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO E' '144A' FRN 15/1/2032	2,185,646	0.03
USD 725,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-CSMO F' '144A' FRN 15/1/2032	705,008	0.01
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-UES E' '144A' FRN 5/9/2032	4,858,062	0.06
USD 575,680	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2002-CIB4 C' '144A' FRN 12/5/2034	583,210	0.01
USD 930,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-SGP A' '144A' FRN 15/7/2036	938,267	0.01
USD 160,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-LC11 C' FRN 15/4/2046	165,753	0.00
USD 5,025,602	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C20 XA' FRN 15/7/2047	258,911	0.00
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-JP1 D' FRN 15/1/2049	2,110,609	0.03
USD 2,295,292	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2008-C2 A4FL' FRN 12/2/2051	2,232,818	0.03
USD 47,447	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2008-C2 ASB' FRN 12/2/2051	48,083	0.00
USD 920,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY A' '144A' 3.429% 10/6/2027	951,020	0.01
USD 1,550,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-ATRM D' '144A' 5.355% 5/10/2028	1,587,163	0.02
USD 2,180,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2006-CB17 AM' 5.464% 12/12/2043	2,139,382	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,276,728	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series '2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	1,262,174	0.02
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust '2006-CW1 M1' FRN 25/5/2036	773,606	0.01
USD 1,075,755	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A3A' 5.83% 25/7/2036	609,967	0.01
USD 813,658	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A6' 6% 25/7/2036	461,243	0.01
USD 3,167,339	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A5' 6.41% 25/7/2036	1,794,442	0.02
USD 1,459,606	JP Morgan Resecuritization Trust Series '2015-3 1A7' '144A' FRN 26/6/2037	1,270,495	0.02
USD 9,290,558	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C21 XA' FRN 15/8/2047	590,807	0.01
USD 974,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 C' FRN 15/9/2047	1,016,420	0.01
USD 950,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 D' '144A' FRN 15/9/2047	788,011	0.01
USD 2,349,199	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 D' '144A' FRN 15/9/2047	1,949,301	0.03
USD 3,476,036	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	133,403	0.00
USD 11,493,345	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C24 XA' FRN 15/11/2047	623,939	0.01
USD 2,309,704	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C26 XA' FRN 15/1/2048	138,786	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	248,678	0.00
USD 7,793,555	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C28 XA' FRN 15/10/2048	504,639	0.01
USD 780,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C33 A4' FRN 15/12/2048	865,274	0.01
USD 18,768,883	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C33 XA' FRN 15/12/2048	1,327,429	0.02
USD 2,637,000	JPMorgan Chase & Co 2.7% 18/5/2023	2,683,784	0.03
USD 9,640,000	JPMorgan Chase & Co 3.2% 15/6/2026	9,929,653	0.13
USD 8,630,000	JPMorgan Chase & Co 4.25% 1/10/2027	9,357,777	0.12
USD 505,000	Keuka Park CLO Ltd '2013-1A D' '144A' FRN 21/10/2024	473,017	0.01
USD 3,120,000	Kinder Morgan Inc/DE 5.55% 1/6/2045	3,208,864	0.04
USD 522,000	KLA-Tencor Corp 4.65% 1/11/2024	575,192	0.01
USD 9,329,000	Kraft Heinz Foods Co 3% 1/6/2026	9,494,548	0.12
USD 331,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	339,996	0.00
USD 835,000	Lam Research Corp 3.45% 15/6/2023	857,992	0.01
USD 2,283,000	Lam Research Corp 3.9% 15/6/2026	2,387,662	0.03
USD 128,779	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2006-C4 AJ' FRN 15/6/2038	129,086	0.00
USD 261,895	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2005-C7 D' FRN 15/11/2040	264,437	0.00
USD 123,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C1 AJ' 5.484% 15/2/2040	123,399	0.00
USD 1,409,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AMFL' '144A' 6.114% 15/7/2040	1,440,748	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust '2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	3,875,860	0.05
USD 125,614	LCM IX LP '144A' FRN 14/7/2022	125,725	0.00
USD 1,000,000	LCM IX LP '144A' FRN 14/7/2022	1,001,317	0.01
USD 2,640,000	LCM X LP '144A' FRN 15/4/2022	2,633,907	0.03
USD 500,000	LCM XIII LP '144A' FRN 19/1/2023	498,769	0.01
USD 380,000	LCM XIV LP '144A' FRN 15/7/2025	377,243	0.00
USD 845,000	LCM XV LP '144A' FRN 25/8/2024	849,671	0.01
USD 670,000	LCM XVI LP '144A' FRN 15/7/2026	670,704	0.01
USD 440,000	LCM XVII LP '144A' FRN 15/10/2026	431,881	0.01
USD 830,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	831,126	0.01
USD 580,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	571,328	0.01
USD 570,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	516,187	0.01
USD 480,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	328,170	0.00
USD 5,630,000	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2001-B M1' FRN 15/4/2040	6,032,117	0.08
USD 943,078	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2001-B M2' FRN 15/4/2040	689,944	0.01
USD 1,550,545	Lehman XS Trust Series '2007-20N A1' FRN 25/12/2037	1,183,145	0.02
USD 1	Lehman XS Trust Series '2006-12N A2A2' FRN 25/8/2046	1	0.00
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.125% 1/12/2018	1,449,000	0.02
USD 6,482,432	LFRF '2015-1' '144A' 3.5% 31/12/2049	6,475,016	0.08
USD 720,000	Lime Street CLO Ltd '2007-1A B' '144A' FRN 20/6/2021	691,298	0.01
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC '2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,041,328	0.03
USD 1,104,030	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP A1A2' '144A' FRN 15/9/2028	1,122,262	0.01
USD 3,737,115	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP E' '144A' FRN 15/9/2028	3,729,660	0.05
USD 5,154,873	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 1A' FRN 25/2/2036	4,096,276	0.05
USD 2,396,402	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 2A3' FRN 25/2/2036	1,310,594	0.02
USD 5,926,114	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-6 1A' FRN 25/7/2036	3,801,644	0.05
USD 2,041,984	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-7 2A2' FRN 25/8/2036	965,047	0.01
USD 1,934,232	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-9 2A4' FRN 25/10/2036	847,625	0.01
USD 433,234	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	188,589	0.00
USD 4,455,858	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	1,957,656	0.03
USD 1,585,117	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	704,789	0.01
USD 4,213,600	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-11 1A' FRN 25/12/2036	2,451,253	0.03
USD 15,877,142	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-2 2A3' FRN 25/3/2046	7,154,990	0.09
USD 1,893,494	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-2 2A4' FRN 25/3/2046	884,793	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,239,622	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-3 2A3' FRN 25/5/2046	1,560,041	0.02
USD 3,660,000	Long Island Power Authority 5% 1/9/2044	4,351,630	0.06
USD 750,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	1,178,317	0.02
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,939,600	0.08
USD 1,285,000	Los Angeles Department of Water & Power 6.603% 1/7/2050	2,046,260	0.03
USD 1,430,000	Los Angeles Unified School District/ CA 5% 1/7/2030	1,830,328	0.02
USD 12,579,857	LSTAR Securities Investment Ltd '2016-2 A' '144A' FRN 1/3/2021	12,319,454	0.16
USD 5,461,304	LSTAR Securities Investment Trust '2015-2 A' '144A' FRN 1/1/2020	5,420,344	0.07
USD 6,771,534	LSTAR Securities Investment Trust '2015-3 A' '144A' FRN 1/3/2020	6,683,213	0.09
USD 2,332,619	LSTAR Securities Investment Trust '2015-10 A1' '144A' FRN 1/11/2020	2,285,967	0.03
USD 810,000	LSTAR Securities Investment Trust '2015-10 A2' '144A' FRN 1/11/2020	773,550	0.01
USD 6,494,268	LSTAR Securities Investment Trust '2014-1 NOTE' '144A' FRN 1/9/2021	6,437,443	0.08
USD 512,507	LSTAR Securities Investment Trust '2014-2 A' '144A' FRN 1/12/2021	506,101	0.01
USD 1,430,000	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust '2002-A B2' FRN 25/3/2032	1,412,215	0.02
USD 1,240,000	Madison Avenue Trust '2013-650M E' '144A' FRN 12/10/2032	1,233,788	0.02
USD 580,000	Madison Park Funding Ltd '2012-9A C1R' '144A' FRN 15/8/2022	584,500	0.01
USD 3,250,000	Madison Park Funding Ltd '2012-9A DR' '144A' FRN 15/8/2022	3,250,369	0.04
USD 610,000	Madison Park Funding Ltd '2012-9A E' '144A' FRN 15/8/2022	600,722	0.01
USD 1,100,000	Madison Park Funding Ltd (Step-up coupon) '2012-9A B2R' '144A' 3.14% 15/8/2022	1,104,385	0.01
USD 1,710,000	Madison Park Funding Ltd (Step-up coupon) '2012-9A C2R' '144A' 4.01% 15/8/2022	1,714,167	0.02
USD 250,000	Madison Park Funding VIII Ltd '2012-8A BR' '144A' FRN 22/4/2022	250,985	0.00
USD 1,026,000	Madison Park Funding VIII Ltd '2012-8A CR' '144A' FRN 22/4/2022	1,030,075	0.01
USD 732,000	Madison Park Funding VIII Ltd '2012-8A DR' '144A' FRN 22/4/2022	730,138	0.01
USD 2,240,000	Madison Park Funding X Ltd '2012-10A B1' '144A' FRN 20/1/2025	2,269,983	0.03
USD 1,255,000	Madison Park Funding X Ltd '2012-10A D' '144A' FRN 20/1/2025	1,263,539	0.02
USD 2,229,000	Madison Park Funding XI Ltd '2013-11A D' '144A' FRN 23/10/2025	2,132,677	0.03
USD 434,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A C' '144A' FRN 19/1/2025	430,819	0.01
USD 750,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A D' '144A' FRN 19/1/2025	729,878	0.01
USD 854,000	Madison Park Funding XIV Ltd '2014-14A D' '144A' FRN 20/7/2026	841,038	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	Madison Park Funding XIX Ltd '2015-19A D' '144A' FRN 22/1/2028	235,776	0.00
USD 280,000	Madison Park Funding XV Ltd '2014-15A B1' '144A' FRN 27/1/2026	283,971	0.00
USD 400,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A A2A' '144A' FRN 20/4/2026	399,820	0.01
USD 250,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A B' '144A' FRN 20/4/2026	251,063	0.00
USD 300,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A C' '144A' FRN 20/4/2026	297,152	0.00
USD 510,000	Madison Park Funding XX Ltd '2016-20A E' '144A' FRN 27/4/2027	508,142	0.01
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	1,014,571	0.01
USD 1,335,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2025	1,732,396	0.02
USD 1,570,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2026	2,076,608	0.03
USD 1,265,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2027	1,660,123	0.02
USD 1,140,000	Massachusetts Clean Water Trust/ The 5% 1/2/2028	1,486,742	0.02
USD 1,455,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	1,669,074	0.02
USD 2,621,000	Massachusetts Institute of Technology 3.885% 1/7/2116	2,711,065	0.03
USD 3,845,802	Mastr Asset Backed Securities Trust '2006-HE2 A3' FRN 25/6/2036	1,836,533	0.02
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust '2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	849,059	0.01
USD 1,070,990	MASTR Resecuritization Trust '2008-3 A1' '144A' FRN 25/8/2037	721,847	0.01
USD 738,360	Mastr Specialized Loan Trust '2006-3 A' '144A' FRN 25/6/2046	649,754	0.01
USD 100,000	Meccanica Holdings USA Inc '144A' 6.25% 15/1/2040	100,750	0.00
USD 380,000	Meccanica Holdings USA Inc '144A' 7.375% 15/7/2039	413,250	0.01
USD 1,004,530	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series '2006-RM3 A2B' FRN 25/6/2037	298,905	0.00
USD 831,870	Merrill Lynch Mortgage Trust '2007-C1 A1A' FRN 12/6/2050	846,806	0.01
USD 670,000	Merrill Lynch Mortgage Trust '2008-C1 AJ' FRN 12/2/2051	690,367	0.01
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	1,989,884	0.03
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,132,230	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	2,027,123	0.03
USD 4,330,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	4,719,700	0.06
USD 1,680,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5.073% 1/4/2050	2,027,155	0.03
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	1,027,968	0.01
USD 2,000,000	Micron Technology Inc '144A' 5.625% 15/1/2026	1,930,000	0.02
USD 5,346,000	Microsoft Corp 3.7% 8/8/2046	5,544,743	0.07
USD 2,625,000	Microsoft Corp 3.75% 12/2/2045	2,744,121	0.04
USD 3,008,000	Microsoft Corp 4.45% 3/11/2045	3,503,879	0.04
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd '2016-1A C' '144A' FRN 20/4/2028	506,221	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/4/2028	503,947	0.01
USD 227,862	ML-CFC Commercial Mortgage Trust '2006-4 AM' FRN 12/12/2049	228,466	0.00
USD 1,344,469	ML-CFC Commercial Mortgage Trust '2007-7 A4' FRN 12/6/2050	1,371,565	0.02
EUR 3,880,000	Molson Coors Brewing Co 1.25% 15/7/2024	4,462,790	0.06
USD 321,000	Molson Coors Brewing Co 4.2% 15/7/2046	340,525	0.00
USD 1,070,000	Monsanto Co 3.95% 15/4/2045	1,041,877	0.01
USD 4,832,000	Morgan Stanley 3.125% 27/7/2026	4,897,302	0.06
USD 9,717,000	Morgan Stanley 3.875% 27/1/2026	10,411,970	0.13
USD 8,850,000	Morgan Stanley 3.95% 23/4/2027	9,262,808	0.12
USD 8,410,000	Morgan Stanley 4.35% 8/9/2026	9,058,247	0.12
USD 90,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013- C13 D' '144A' FRN 15/11/2046	89,043	0.00
USD 7,351,962	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013- C13 XA' FRN 15/11/2046	419,739	0.01
USD 325,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014- C14 C' FRN 15/2/2047	356,000	0.00
USD 9,212,686	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014- C19 XA' FRN 15/12/2047	552,942	0.01
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014- C19 XD' '144A' FRN 15/12/2047	936,765	0.01
USD 3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014- C19 XF' '144A' FRN 15/12/2047	346,060	0.00
USD 3,381,578	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C20 XA' FRN 15/2/2048	273,930	0.00
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C21 XB' '144A' FRN 15/3/2048	91,660	0.00
USD 51,554,593	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C22 XA' FRN 15/4/2048	3,559,736	0.05
USD 260,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C25 C' FRN 15/10/2048	277,029	0.00
USD 20,361,853	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C25 XA' FRN 15/10/2048	1,539,062	0.02
USD 10,896,405	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C26 XA' FRN 15/10/2048	807,342	0.01
USD 5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C26 XD' '144A' FRN 15/10/2048	570,818	0.01
USD 6,587,998	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2016- C29 XA' FRN 15/5/2049	769,210	0.01
USD 8,700,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2016- C29 XB' FRN 15/5/2049	690,850	0.01
USD 480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C23 D' '144A' FRN 15/7/2050	397,645	0.01
USD 1,570,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C26 D' '144A' 3.06% 15/10/2048	1,154,796	0.01
USD 220,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2015- C20 D' '144A' 3.071% 15/2/2048	159,657	0.00
USD 700,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2015-XLF2 AFSB' '144A' FRN 15/8/2026	701,312	0.01
USD 2,513,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT F' '144A' FRN 13/7/2029	2,479,665	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,750,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT G' '144A' FRN 13/7/2029	1,690,318	0.02
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E F' '144A' FRN 9/9/2032	1,227,382	0.02
USD 780,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ11 AMFL' FRN 12/2/2044	770,206	0.01
USD 590,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AM' FRN 12/4/2049	592,476	0.01
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AMFL' FRN 12/4/2049	900,547	0.01
USD 2,785,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ15 AM' FRN 11/6/2049	2,851,323	0.04
USD 1,152,801	Morgan Stanley Capital I Trust '2005-IQ9 AJ' 4.77% 15/7/2056	1,150,035	0.01
USD 2,160,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ13 AM' 5.406% 15/3/2044	2,189,318	0.03
USD 1,186,352	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust '2006-2 A2' FRN 25/11/2036	548,515	0.01
USD 2,270,566	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2006- 15XS A2B' 5.507% 25/11/2036	1,357,528	0.02
USD 607,677	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2012-XA A' '144A' 2% 27/7/2049	602,512	0.01
USD 204,626	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2009-GG10 A4A' '144A' FRN 12/8/2045	207,144	0.00
USD 5,250,000	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2009-GG10 A4B' '144A' FRN 12/8/2045	5,324,312	0.07
USD 582,000	Morgan Stanley Re-REMIC Trust '2010-GG10 A4B' '144A' FRN 15/8/2045	592,116	0.01
USD 1,272,730	Morgan Stanley Resecuritization Trust '2014-R8 3B1' '144A' FRN 26/6/2047	1,147,665	0.01
USD 10,194,488	Mortgage Loan Resecuritization Trust '2009-RS1 A85' '144A' FRN 16/4/2036	8,476,263	0.11
USD 1,630,000	Mountain Hawk I CLO Ltd '2013-1A B1' '144A' FRN 20/1/2024	1,592,085	0.02
USD 1,215,000	Mountain Hawk II CLO Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 22/7/2024	1,204,282	0.02
USD 172,000	MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CKSV D' '144A' FRN 15/10/2030	162,608	0.00
USD 180,322	MSCC Heloc Trust '2007-1 A' FRN 25/12/2031	179,388	0.00
USD 500,000	Muir Grove CLO Ltd '2007-1A C' '144A' FRN 25/3/2020	500,821	0.01
USD 860,000	Muir Woods CLO Ltd '2012-1A B' '144A' FRN 14/9/2023	860,666	0.01
USD 530,000	Muir Woods CLO Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 14/9/2023	531,751	0.01
USD 370,000	Nationstar Home Equity Loan Trust '2007-C 2AV3' FRN 25/6/2037	348,130	0.00
USD 11,406,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA A2B' '144A' FRN 15/12/2028	11,330,967	0.14
USD 5,299,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA A3' '144A' FRN 15/11/2030	5,388,427	0.07
USD 4,370,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A3' '144A' FRN 15/10/2031	4,297,639	0.06
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA B' '144A' FRN 17/10/2044	4,602,728	0.06
USD 4,510,000	Navient Private Education Loan Trust '2016-AA A2B' '144A' FRN 15/12/2045	4,675,233	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 15,615,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	15,726,123	0.20
USD 1,760,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-CA B' '144A' 3.25% 15/5/2040	1,761,074	0.02
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA B' '144A' 3.5% 15/8/2044	2,941,057	0.04
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA B' '144A' 3.5% 15/12/2044	2,189,647	0.03
USD 2,150,000	Navient Private Education Loan Trust '2016-AA B' '144A' 3.5% 16/12/2058	2,056,147	0.03
USD 2,178,000	Neiman Marcus Group Ltd LLC '144A' 8% 15/10/2021	1,878,525	0.02
USD 1,505,000	Netflix Inc 5.5% 15/2/2022	1,632,925	0.02
USD 1,250,000	Neuberger Berman CLO XII Ltd '2012-12A ER' '144A' FRN 25/7/2023	1,252,811	0.02
USD 5,470,000	Neuberger Berman CLO XIII Ltd '2012-13A B' '144A' FRN 23/1/2024	5,475,821	0.07
USD 500,000	Neuberger Berman CLO XIII Ltd '2012-13A C' '144A' FRN 23/1/2024	500,549	0.01
USD 375,000	Neuberger Berman CLO XIII Ltd '2012-13A D' '144A' FRN 23/1/2024	375,470	0.00
USD 1,300,000	Neuberger Berman CLO XVI Ltd '2014-16A B2R' '144A' FRN 15/4/2026	1,300,000	0.02
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVI Ltd '2014-16A D' '144A' FRN 15/4/2026	238,814	0.00
USD 542,000	Neuberger Berman CLO XVII Ltd '2014-17A D' '144A' FRN 4/8/2025	510,858	0.01
USD 260,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A B' '144A' FRN 14/11/2025	260,988	0.00
USD 640,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A C' '144A' FRN 14/11/2025	623,462	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman Clo XX Ltd '2015-20A D' '144A' FRN 15/1/2028	234,045	0.00
USD 910,000	Neuberger Berman Clo XX Ltd '2015-20A E' '144A' FRN 15/1/2028	862,159	0.01
USD 330,000	Neuberger Berman Clo XXI Ltd '2016-21A E' '144A' FRN 20/4/2027	322,934	0.00
USD 1,770,000	New Jersey Educational Facilities Authority 5% 1/7/2023	2,223,014	0.03
USD 2,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2027 (Zero Coupon)	1,482,672	0.02
USD 2,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2031 (Zero Coupon)	1,248,032	0.02
USD 2,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2033 (Zero Coupon)	1,162,301	0.02
USD 2,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2035 (Zero Coupon)	1,014,983	0.01
USD 2,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 15/12/2036 (Zero Coupon)	968,500	0.01
USD 715,000	New Jersey Turnpike Authority 5% 1/1/2045	857,575	0.01
USD 1,235,361	New Residential Mortgage Loan Trust '2015-2A A2' '144A' FRN 25/8/2055	1,253,559	0.02
USD 1,159,000	New York and Presbyterian Hospital/ The 3.563% 1/8/2036	1,210,024	0.02
USD 2,420,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.28% 1/5/2026	2,387,015	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	2,235,806	0.03
USD 980,000	New York Mortgage Securitization Trust '2013-1 A' '144A' FRN 27/8/2024	987,350	0.01
USD 1,390,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,707,643	0.02
USD 1,225,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,542,404	0.02
USD 835,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2037	1,011,377	0.01
USD 1,290,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2037	1,557,475	0.02
USD 1,250,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2038	1,512,094	0.02
USD 295,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2039	356,624	0.00
USD 710,000	New York State Housing Finance Agency 3.25% 1/11/2041	722,972	0.01
USD 775,000	New York State Thruway Authority 5% 1/5/2019	860,397	0.01
USD 1,460,000	New York State Thruway Authority 5% 1/1/2031	1,781,996	0.02
USD 780,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2024	985,257	0.01
USD 1,930,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2025	2,481,806	0.03
USD 3,410,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2026	4,456,188	0.06
USD 810,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2027	1,046,042	0.01
USD 910,000	New York State Urban Development Corp 5% 15/3/2028	1,167,789	0.02
USD 4,555,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	5,255,103	0.07
USD 3,020,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	3,536,918	0.05
USD 7,474,000	Newell Brands Inc 4.2% 1/4/2026	8,197,513	0.10
USD 660,000	NextGear Floorplan Master Owner '2014-1A B' '144A' 2.61% 15/10/2019	654,367	0.01
USD 1,370,000	NextGear Floorplan Master Owner Trust '2015-1A B' '144A' FRN 15/7/2019	1,361,888	0.02
USD 2,710,000	Noble Energy Inc 5.05% 15/11/2044	2,761,499	0.04
USD 1,734,000	Norfolk Southern Corp 2.9% 15/6/2026	1,795,682	0.02
USD 125,000	North Carolina Medical Care Commission 5% 1/6/2040	149,955	0.00
USD 606,000	Northern States Power Co/MN 3.6% 15/5/2046	647,893	0.01
USD 5,560,000	Northern Trust Corp FRN 1/10/2026 (Perpetual)	5,692,050	0.07
USD 111,474	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	121,222	0.00
USD 363,000	NRG Energy Inc 7.625% 15/1/2018	390,679	0.01
USD 350,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd '2014-10A C' '144A' FRN 20/7/2026	350,388	0.00
USD 430,000	Oak Hill Credit Partners XII Ltd '2015-12A D1' '144A' FRN 23/1/2027	420,506	0.01
USD 1,405,000	Oaktree EIF II Series A2 Ltd '2014-A2 B' '144A' FRN 15/11/2025	1,408,595	0.02
USD 450,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd '2015-B1A B' '144A' FRN 15/2/2026	451,577	0.01
USD 650,000	Oaktree EIF II Series B1 Ltd '2015-B1A C' '144A' FRN 15/2/2026	652,632	0.01
USD 939,179	Oakwood Mortgage Investors Inc '2001-D A2' FRN 15/1/2019	741,615	0.01
USD 781,002	Oakwood Mortgage Investors Inc '2001-D A4' FRN 15/9/2031	711,681	0.01
USD 1,580,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	2,055,175	0.03
USD 390,000	OCP CLO 2014-5 Ltd '2014-5A A1' '144A' FRN 26/4/2026	385,496	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,540,000	OCP CLO 2014-7 Ltd '2014-7A A1A' '144A' FRN 20/10/2026	1,541,629	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2015-8 Ltd '2015-8A A1' '144A' FRN 17/4/2027	440,544	0.01
USD 430,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A C' '144A' FRN 15/4/2027	431,122	0.01
USD 600,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	603,787	0.01
USD 1,500,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2027	1,514,529	0.02
USD 1,500,000	Octagon Investment Partners 27 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/7/2027	1,479,959	0.02
USD 935,000	Octagon Investment Partners XII Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 5/5/2023	939,568	0.01
USD 1,730,000	Octagon Investment Partners XII Ltd '2012-1A ER' '144A' FRN 5/5/2023	1,719,799	0.02
USD 335,000	Octagon Investment Partners XIV Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 15/1/2024	332,397	0.00
USD 1,075,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 25/10/2025	1,072,695	0.01
USD 3,010,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd '2013-1A A2R' '144A' FRN 25/10/2025	3,010,000	0.04
USD 335,000	Octagon Investment Partners XX Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 12/8/2026	319,210	0.00
USD 1,775,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 14/11/2026	1,690,745	0.02
USD 3,100,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 14/11/2026	3,021,011	0.04
USD 555,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A C1' '144A' FRN 25/11/2025	555,792	0.01
USD 460,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A D1' '144A' FRN 25/11/2025	442,210	0.01
USD 255,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A E1' '144A' FRN 25/11/2025	228,198	0.00
USD 641,000	OHA Credit Partners IX Ltd '2013-9A A1' '144A' FRN 20/10/2025	640,820	0.01
USD 4,725,000	OHA Credit Partners VII Ltd '2012-7A A' '144A' FRN 20/11/2023	4,730,865	0.06
USD 4,870,000	OHA Credit Partners VIII Ltd '2013-8A A' '144A' FRN 20/4/2025	4,850,514	0.06
USD 280,000	OHA Credit Partners XI Ltd '2015-11A E' '144A' FRN 20/10/2028	268,281	0.00
USD 1,360,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd '2013-2A A' '144A' FRN 23/8/2024	1,355,577	0.02
USD 394,000	Oncor Electric Delivery Co LLC 5.3% 1/6/2042	515,449	0.01
USD 5,978,136	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A A' '144A' 2.43% 18/6/2024	5,985,470	0.08
USD 5,402,792	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A A' '144A' 2.47% 18/9/2024	5,418,228	0.07
USD 9,000,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A A' '144A' 2.57% 18/7/2025	9,022,356	0.12
USD 4,205,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A B' '144A' 3.02% 18/9/2024	4,201,442	0.05
USD 16,601,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A B' '144A' 3.1% 18/7/2025	16,273,153	0.21

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,785,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A A' '144A' 3.19% 18/3/2026	4,844,622	0.06
USD 8,748,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A B' '144A' 3.24% 18/6/2024	8,773,755	0.11
USD 6,750,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A C' '144A' 4.32% 18/7/2025	6,723,990	0.09
USD 2,815,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A C' '144A' 4.33% 18/9/2024	2,781,171	0.04
USD 1,503,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A C' '144A' 5.12% 18/3/2026	1,501,772	0.02
USD 10,100,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A D' '144A' 5.31% 18/9/2024	9,961,494	0.13
USD 7,000,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-3A C' '144A' 5.82% 20/11/2028	6,946,611	0.09
USD 8,171,000	Oracle Corp 2.65% 15/7/2026	8,269,277	0.11
USD 2,103,000	Oracle Corp 3.9% 15/5/2035	2,226,150	0.03
USD 5,549,000	Oracle Corp 4% 15/7/2046	5,871,422	0.08
USD 2,030,000	Oracle Corp 4.125% 15/5/2045	2,179,409	0.03
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,838,232	0.06
USD 1,000,000	Orange County Sanitation District 5% 1/2/2034	1,257,700	0.02
USD 716,492	Origen Manufactured Housing Contract Trust '2001-A M1' FRN 15/3/2032	712,311	0.01
USD 1,125,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A C' '144A' FRN 22/1/2025	1,100,911	0.01
USD 730,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A D' '144A' FRN 22/1/2025	687,112	0.01
USD 1,330,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A A1' '144A' FRN 22/7/2025	1,319,736	0.02
USD 320,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A C' '144A' FRN 22/7/2025	301,196	0.00
USD 570,000	OZLM Funding Ltd '2012-2A A2' '144A' FRN 30/10/2023	570,836	0.01
USD 1,387,000	OZLM Funding Ltd '2012-2A B' '144A' FRN 30/10/2023	1,388,776	0.02
USD 1,250,000	OZLM Funding Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 22/7/2027	1,200,373	0.02
USD 720,000	OZLM IX Ltd '2014-9A B' '144A' FRN 20/1/2027	720,941	0.01
USD 1,400,000	OZLM VI Ltd '2014-6A B' '144A' FRN 17/4/2026	1,401,685	0.02
USD 532,000	OZLM VII Ltd '2014-7A C' '144A' FRN 17/7/2026	502,289	0.01
USD 386,000	OZLM VII Ltd '2014-7A D' '144A' FRN 17/7/2026	341,394	0.00
USD 2,735,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A A2A' '144A' FRN 17/10/2026	2,728,197	0.03
USD 725,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A B' '144A' FRN 17/10/2026	727,563	0.01
USD 1,315,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A C' '144A' FRN 17/10/2026	1,241,196	0.02
USD 531,000	OZLM XI Ltd '2015-11A B' '144A' FRN 30/1/2027	532,914	0.01
USD 874,000	OZLM XI Ltd '2015-11A C1' '144A' FRN 30/1/2027	850,352	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A1' '144A' FRN 30/4/2027	620,896	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A2' '144A' FRN 30/4/2027	621,465	0.01
USD 290,000	OZLM XII Ltd '2015-12A B' '144A' FRN 30/4/2027	291,049	0.00
USD 2,375,000	OZLM XII Ltd '2015-12A C' '144A' FRN 30/4/2027	2,224,610	0.03
USD 770,000	OZLM XII Ltd '2015-12A D' '144A' FRN 30/4/2027	657,826	0.01
USD 335,000	OZLM XIII Ltd '2015-13A C' '144A' FRN 30/7/2027	331,141	0.00
USD 470,000	OZLM XIV Ltd '2015-14A C' '144A' FRN 15/1/2029	469,037	0.01
USD 660,000	OZLM XIV Ltd '2015-14A D' '144A' FRN 15/1/2029	616,667	0.01
USD 250,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1A' '144A' FRN 17/10/2025	250,269	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 875,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 17/10/2022	871,337	0.01
USD 530,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/10/2022	528,858	0.01
USD 990,000	Palmer Square Loan Funding 2016-2 Ltd '2016-2A A2' '144A' FRN 21/6/2024	991,976	0.01
USD 1,040,000	Palmer Square Loan Funding 2016-2 Ltd '2016-2A B' '144A' FRN 21/6/2024	1,039,432	0.01
USD 1,700,000	Palmer Square Loan Funding 2016-2 Ltd '2016-2A C' '144A' FRN 21/6/2024	1,708,592	0.02
USD 120,257	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	105,963	0.00
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,189,315	0.02
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	469,502	0.01
USD 3,408,000	Pfizer Inc 2.75% 3/6/2026	3,545,600	0.05
USD 540,000	PFS Financing Corp '2014-AA B' '144A' FRN 15/2/2019	537,963	0.01
USD 1,179,000	Philip Morris International Inc 4.25% 10/11/2044	1,324,275	0.02
USD 360,000	Pinnacle Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 15/4/2026	342,301	0.00
USD 1,070,000	Ply Gem Industries Inc 6.5% 1/2/2022	1,108,787	0.01
USD 715,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	850,235	0.01
USD 1,425,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.81% 15/10/2065	1,767,342	0.02
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	334,883	0.00
USD 1,135,000	Port Authority of New York & New Jersey 5% 15/10/2044	1,342,313	0.02
USD 1,780,000	Port of Morrow OR 2.987% 1/9/2036	1,804,190	0.02
USD 2,130,000	Post Holdings Inc '144A' 7.75% 15/3/2024	2,374,290	0.03
USD 5,380,000	PPL Capital Funding Inc 3.1% 15/5/2026	5,491,885	0.07
USD 4,801,766	Pretium Mortgage Credit Partners I 2015-NPL4 LLC (Step-up coupon) '2015-NPL4 A1' '144A' 4.375% 27/11/2030	4,851,817	0.06
USD 5,900,298	Pretium Mortgage Credit Partners I 2016-NPL3 LLC (Step-up coupon) '2016-NPL3 A1' '144A' 4.375% 27/5/2031	5,966,681	0.08
USD 403,819	Prime Mortgage Trust '2006-DR1 2A1' '144A' 5.5% 25/5/2035	378,383	0.01
USD 2,925,109	Progress Residential 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 A' '144A' FRN 17/2/2032	2,942,595	0.04
USD 978,000	Progress Residential 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/2/2032	985,541	0.01
USD 2,518,157	Progress Residential 2015-SFR2 Trust '2015-SFR2 A' '144A' 2.74% 12/6/2032	2,555,291	0.03
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust '2015-SFR3 F' '144A' 6.643% 12/11/2032	610,952	0.01
USD 2,450,000	Progress Residential 2016-SFR1 Trust '2016-SFR1 E' '144A' FRN 17/9/2033	2,476,433	0.03
EUR 638,000	PSPC Escrow Corp 6% 1/2/2023	673,513	0.01
USD 125,000	Public Power Generation Agency 5% 1/1/2034	153,183	0.00
USD 12,241,000	QUALCOMM Inc 4.8% 20/5/2045	13,927,541	0.18

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 660,000	Race Point IX CLO Ltd '2015-9A A1' '144A' FRN 15/4/2027	658,869	0.01
USD 745,000	Race Point V CLO Ltd '2011-5A DR' '144A' FRN 15/12/2022	747,550	0.01
USD 500,000	Race Point V CLO Ltd '2011-5A ER' '144A' FRN 15/12/2022	502,445	0.01
USD 705,000	Race Point VI CLO Ltd '2012-6A E' '144A' FRN 24/5/2023	654,140	0.01
USD 2,375,000	Race Point VIII CLO Ltd '2013-8A A' '144A' FRN 20/2/2025	2,364,137	0.03
USD 510,037	RAIT 2014-FL3 Trust '2014-FL3 C' '144A' FRN 15/12/2031	509,790	0.01
USD 1,686,127	RALI Series 2007-QH1 Trust '2007-QH1 A1' FRN 25/2/2037	1,406,960	0.02
USD 2,705,700	RALI Series 2007-QH6 Trust '2007-QH6 A1' FRN 25/7/2037	2,165,858	0.03
USD 1,756,570	RALI Series 2007-QH9 Trust '2007-QH9 A1' FRN 25/11/2037	1,204,554	0.02
USD 1,426,672	RBSSP Resecuritization Trust '2013-4 1A1' '144A' FRN 26/12/2037	1,405,515	0.02
USD 4,047	RBSSP Resecuritization Trust '2012-2 1A6' '144A' FRN 26/5/2047	3,899	0.00
USD 2,020,854	RCO Mortgage LLC '2015-NQM1 A' '144A' FRN 25/11/2045	2,020,804	0.03
USD 310,000	Regatta IV Funding Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 25/7/2026	286,170	0.00
USD 585,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A B' '144A' FRN 25/10/2026	585,414	0.01
USD 1,025,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 25/10/2026	961,726	0.01
USD 3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	5,078,871	0.06
USD 638,000	Republic Of Sri Lanka 6.825% 18/7/2026	687,445	0.01
USD 319,000	Republic Services Inc 2.9% 1/7/2026	325,853	0.00
USD 504,075	Resource Capital Corp 2014-CRE2 Ltd '2014-CRE2 A' '144A' FRN 15/4/2032	498,096	0.01
USD 715,000	Resource Capital Corp 2014-CRE2 Ltd '2014-CRE2 B' '144A' FRN 15/4/2032	675,496	0.01
USD 4,770,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	5,364,576	0.07
USD 3,470,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	3,582,775	0.05
USD 2,130,000	Rite Aid Corp '144A' 6.125% 1/4/2023	2,316,375	0.03
USD 945,000	Riverbed Technology Inc '144A' 8.875% 1/3/2023	1,018,238	0.01
USD 343,000	Rolta Americas LLC 8.875% 24/7/2019	39,445	0.00
USD 5,940,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	6,296,400	0.08
USD 2,215,000	Sabine Pass LNG LP 7.5% 30/11/2016	2,244,072	0.03
USD 880,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	911,900	0.01
USD 1,027,787	SACO I Trust '2006-9 A1' FRN 25/8/2036	1,468,710	0.02
USD 700,000	San Diego County Water Authority Financing Corp 5% 1/5/2032	892,864	0.01
USD 4,259	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S4 R' '144A' 1.43% 16/4/2019	4,260	0.00
USD 3	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-S4 R' '144A' 1.43% 16/4/2019	1,462,500	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 118,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023	146,892	0.00
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/7/2026	1,745,740	0.02
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,538,674	0.02
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A SUB' '144A' 17/7/2026 (Zero Coupon)	137,472	0.00
USD 1,415,000	SESI LLC 7.125% 15/12/2021	1,393,775	0.02
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust '2006-OPT2 A3D' FRN 25/10/2036	760,029	0.01
USD 857,684	Silver Bay Realty 2014-1 Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/9/2031	850,901	0.01
USD 525,000	Silver Bay Realty 2014-1 Trust '2014-1 E' '144A' FRN 17/9/2031	520,152	0.01
USD 820,000	Silver Bay Realty 2014-1 Trust '2014-1 F' '144A' FRN 17/9/2031	793,564	0.01
USD 2,395,000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5.375% 15/4/2025	2,508,763	0.03
USD 420,488	SLC Private Student Loan Trust '2006-A A5' FRN 15/7/2036	419,030	0.01
USD 3,900,000	SLC Private Student Loan Trust '2006-A C' FRN 15/7/2036	3,434,410	0.04
USD 46,516	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A2' FRN 15/6/2021	46,402	0.00
USD 90,900	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	89,985	0.00
USD 454,974	SLM Private Credit Student Loan Trust '2005-B A2' FRN 15/3/2023	453,631	0.01
USD 298,882	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-C A4' FRN 15/3/2023	297,379	0.00
USD 3,808,713	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-A A4' FRN 15/12/2023	3,771,545	0.05
USD 9,010,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A3' FRN 15/3/2024	8,460,571	0.11
USD 402,028	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-B A4' FRN 15/3/2024	399,623	0.01
USD 1,245,323	SLM Private Credit Student Loan Trust '2007-A A2' FRN 15/9/2025	1,236,900	0.02
USD 1,340,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2007-A A3' FRN 15/12/2026	1,296,321	0.02
USD 5,066,582	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-A A3' FRN 15/6/2033	4,773,226	0.06
USD 6,218,000	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-B A5' FRN 15/12/2039	5,697,165	0.07
USD 183,417	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A1' '144A' FRN 15/7/2022	183,346	0.00
USD 6,050,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A A2B' '144A' FRN 17/5/2027	6,085,847	0.08
USD 1,305,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B A2B' '144A' FRN 17/6/2030	1,308,382	0.02
USD 2,840,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	2,934,687	0.04
USD 4,350,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-A A3' '144A' FRN 15/1/2043	4,438,367	0.06
USD 1,239,000	SLM Private Education Loan Trust '2012-E A2B' '144A' FRN 15/6/2045	1,256,584	0.02
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A B' '144A' 2.5% 15/3/2047	4,102,087	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B B' '144A' 3% 16/5/2044	2,641,462	0.03
USD 1,315,715	SLM Private Education Loan Trust '2012-B A2' '144A' 3.48% 15/10/2030	1,341,532	0.02
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-C B' '144A' 3.5% 15/6/2044	2,477,425	0.03
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A B' '144A' 3.5% 15/11/2044	4,674,927	0.06
USD 732,253	SLM Student Loan 4.54% 17/10/2044	766,963	0.01
USD 2,080,000	SMB Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/5/2026	2,088,009	0.03
USD 2,000,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B A2B' '144A' FRN 15/7/2027	1,992,538	0.03
USD 5,360,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-A A2B' '144A' FRN 15/5/2031	5,396,492	0.07
USD 5,040,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-A A3' '144A' FRN 17/2/2032	5,016,942	0.06
USD 4,250,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2B' '144A' FRN 17/2/2032	4,271,179	0.05
USD 8,410,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B A3' '144A' FRN 17/5/2032	8,523,523	0.11
USD 7,400,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-C A3' '144A' FRN 16/8/2032	7,603,712	0.10
USD 3,166,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	3,176,737	0.04
USD 2,140,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	2,159,354	0.03
USD 4,560,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B B' '144A' 3.5% 17/12/2040	4,456,488	0.06
USD 3,880,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-C B' '144A' 3.5% 15/9/2043	3,777,229	0.05
USD 7,090,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-C C' '144A' 4.5% 17/9/2046	7,021,580	0.09
USD 2,757,218	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC '2015-D A2' '144A' 2.72% 27/10/2036	2,805,400	0.04
USD 1,030,000	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC '2016-C A2B' '144A' 2.36% 25/12/2032	1,030,294	0.01
USD 3,275,000	Solarcity Lmc Series IV LLC '2015-1 B' '144A' 5.58% 21/8/2045	3,250,438	0.04
USD 1,175,000	Sound Point CLO I Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 20/10/2023	1,176,575	0.02
USD 2,035,000	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A3L' '144A' FRN 26/4/2025	2,026,990	0.03
USD 250,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A C1' '144A' FRN 15/7/2025	250,000	0.00
USD 1,190,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A D' '144A' FRN 15/7/2025	1,169,633	0.02
USD 1,340,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A E' '144A' FRN 15/7/2025	1,206,083	0.02
USD 4,301,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A A' '144A' FRN 21/1/2026	4,290,269	0.05
USD 775,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A D' '144A' FRN 21/1/2026	752,218	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A D' '144A' FRN 20/7/2027	666,993	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2027	630,000	0.01
USD 2,025,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A A' '144A' FRN 23/1/2027	2,027,168	0.03
USD 590,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 23/1/2027	562,066	0.01
USD 500,000	Sound Point CLO VIII Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	471,829	0.01
USD 990,000	Sound Point CLO X Ltd '2015-3A E' '144A' FRN 20/1/2028	951,552	0.01
USD 1,300,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	1,301,239	0.02
USD 540,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 20/10/2028	517,290	0.01
USD 650,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/10/2028	593,608	0.01
USD 3,287,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	3,345,114	0.04
USD 1,500,000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4.857% 15/7/2045	1,875,359	0.02
USD 1,890,000	Southern Co/The 2.95% 1/7/2023	1,953,822	0.03
USD 6,257,000	Southern Co/The 3.25% 1/7/2026	6,524,696	0.08
USD 535,000	Spectrum Brands Inc 5.75% 15/7/2025	583,819	0.01
USD 100,000	Springleaf Funding Trust '2014-AA B' '144A' 3.45% 15/12/2022	100,100	0.00
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA B' '144A' 3.62% 15/11/2024	10,978,698	0.14
USD 2,326,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	2,573,138	0.03
USD 3,165,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,109,613	0.04
USD 9,838,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,846,395	0.14
USD 1,810,000	State of California 4.988% 1/4/2039	1,976,629	0.03
USD 3,815,000	State of California 5% 1/9/2027	4,972,051	0.06
USD 755,000	State of California 5% 1/9/2032	957,748	0.01
USD 755,000	State of California 7.3% 1/10/2039	1,169,276	0.02
USD 1,515,000	State of California 7.35% 1/11/2039	2,354,704	0.03
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	3,977,757	0.05
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,205,811	0.03
USD 3,710,000	State of Georgia 5% 1/7/2023	4,645,662	0.06
USD 5,425,000	State of Georgia 5% 1/7/2024	6,942,617	0.09
USD 1,710,000	State of Georgia 5% 1/2/2026	2,254,695	0.03
USD 750,000	State of Georgia 5% 1/7/2026	996,337	0.01
USD 840,000	State of Georgia 5% 1/2/2029	1,085,263	0.01
USD 1,505,000	State of Hawaii 5% 1/4/2022	1,823,661	0.02
USD 1,505,000	State of Hawaii 5% 1/4/2023	1,862,588	0.02
USD 1,445,000	State of Maryland 5% 1/6/2021	1,724,904	0.02
USD 1,445,000	State of Maryland 5% 1/6/2022	1,765,212	0.02
USD 1,445,000	State of Maryland 5% 1/6/2023	1,807,283	0.02
USD 1,445,000	State of Maryland 5% 1/6/2024	1,847,577	0.02
USD 1,510,000	State of Nevada Highway Improvement Revenue 5% 1/12/2027	1,954,242	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 770,000	State of Nevada Highway Improvement Revenue 5% 1/12/2028	989,358	0.01
USD 1,000,000	State of New Jersey 5% 1/6/2027	1,227,015	0.02
USD 1,000,000	State of New Jersey 5% 1/6/2032	1,201,385	0.02
USD 2,030,000	State of North Carolina 5% 1/6/2024	2,595,558	0.03
USD 3,500,000	State of North Carolina 5% 1/6/2026	4,647,982	0.06
USD 2,500,000	State of North Carolina 5% 1/6/2027	3,293,312	0.04
USD 5,780,000	State of North Carolina 5% 1/6/2025	7,542,727	0.10
USD 2,690,000	State of Ohio 5% 15/12/2023	3,373,341	0.04
USD 2,000,000	State of Ohio 5% 15/9/2024	2,540,200	0.03
USD 1,900,000	State of Ohio 5% 15/12/2024	2,424,799	0.03
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	6,200,175	0.08
USD 1,460,000	State of Washington 5% 1/8/2025	1,883,451	0.02
USD 1,460,000	State of Washington 5% 1/8/2026	1,902,490	0.02
USD 1,460,000	State of Washington 5% 1/8/2027	1,887,050	0.02
USD 1,505,000	State of Washington 5% 1/7/2028	1,879,948	0.02
USD 2,495,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2034	3,105,601	0.04
USD 8,567,000	State Street Corp 2.65% 19/5/2026	8,802,451	0.11
USD 575,000	Steele Creek CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 21/8/2026	576,754	0.01
USD 1,045,000	Stewart Park CLO Ltd '2015-1A E' '144A' FRN 15/4/2026	916,632	0.01
USD 3,560,000	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A B' '144A' 0.5% 25/12/2044	3,346,400	0.04
USD 68,775	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A A' '144A' 1.5% 25/12/2044	68,775	0.00
USD 2,769,315	Structured Asset Mortgage Investments II Trust '2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	2,166,904	0.03
USD 7,402,580	Structured Asset Mortgage Investments II Trust '2006-AR4 3A1' FRN 25/6/2036	5,921,250	0.08
USD 1,525,111	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series '2006-RF4 2A1' '144A' 6% 25/10/2036	1,358,357	0.02
USD 484,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 3.9% 15/7/2026	489,900	0.01
USD 1,120,000	Symphony CLO IX LP '2012-9A C' '144A' FRN 16/4/2022	1,121,227	0.01
USD 1,860,000	Symphony CLO IX LP '2012-9A D' '144A' FRN 16/4/2022	1,862,011	0.02
USD 1,210,000	Symphony CLO IX LP '2012-9A E' '144A' FRN 16/4/2022	1,195,060	0.02
USD 1,370,000	Symphony CLO VIII LP '2012-8A ER' '144A' FRN 9/1/2023	1,383,352	0.02
USD 1,600,000	Symphony CLO X Ltd '2012-10A CR' '144A' FRN 23/7/2023	1,601,240	0.02
USD 1,800,000	Symphony CLO X Ltd '2012-10A DR' '144A' FRN 23/7/2023	1,786,797	0.02
USD 3,180,000	Symphony CLO X Ltd '2012-10A ER' '144A' FRN 23/7/2023	3,191,914	0.04
USD 360,000	Symphony CLO XI Ltd '2013-11A B1' '144A' FRN 17/1/2025	360,871	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XI Ltd '2013-11A C' '144A' FRN 17/1/2025	250,321	0.00
USD 4,000,000	Symphony CLO XII Ltd '2013-12A A' '144A' FRN 15/10/2025	3,993,283	0.05
USD 1,140,000	Symphony CLO XII Ltd '2013-12A C' '144A' FRN 15/10/2025	1,130,449	0.01
USD 810,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A C' '144A' FRN 17/10/2026	812,025	0.01
USD 1,275,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 17/10/2026	1,258,733	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 425,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A E' '144A' FRN 17/10/2026	380,919	0.01
USD 330,000	Symphony CLO XVI Ltd '2015-16A E' '144A' FRN 15/7/2028	296,515	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVII Ltd '2016-17A E' '144A' FRN 15/4/2028	250,128	0.00
USD 2,133,000	Synchrony Credit Card Master Note Trust '2016-2 A' 2.21% 15/5/2024	2,175,583	0.03
USD 445,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	473,925	0.01
USD 952,000	Tenet Healthcare Corp 8.125% 1/4/2022	973,420	0.01
USD 1,600,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	1,847,424	0.02
USD 500,000	Thacher Park CLO Ltd '2014-1A D1' '144A' FRN 20/10/2026	476,000	0.01
USD 1,804,589	Thornburg Mortgage Securities Trust '2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	1,651,419	0.02
USD 4,820,000	TICP CLO I Ltd '2014-1A A1' '144A' FRN 26/4/2026	4,814,257	0.06
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/7/2027	287,940	0.00
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/7/2027	273,292	0.00
USD 1,416,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A A' '144A' FRN 20/1/2027	1,413,881	0.02
USD 1,096,000	T-Mobile USA Inc 5.25% 1/9/2018	1,113,810	0.01
USD 4,340,000	T-Mobile USA Inc 6% 15/4/2024	4,654,650	0.06
USD 640,000	T-Mobile USA Inc 6.633% 28/4/2021	676,000	0.01
USD 620,000	T-Mobile USA Inc 6.731% 28/4/2022	656,425	0.01
USD 195,000	T-Mobile USA Inc 6.836% 28/4/2023	210,356	0.00
USD 2,845,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	2,744,230	0.04
USD 2,945,000	Tobacco Settlement Financing Corp/ VA 6.706% 1/6/2046	2,543,862	0.03
USD 2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,970,856	0.04
USD 1,525,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	1,593,625	0.02
USD 2,150,000	TransDigm Inc 6.5% 15/7/2024	2,246,750	0.03
USD 1,750,000	Treman Park CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	1,741,947	0.02
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd '2006-1A A2' '144A' FRN 3/3/2039	1,691,709	0.02
USD 1,254,117	Tricon American Homes 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 A' '144A' FRN 17/5/2032	1,246,299	0.02
USD 450,000	Trimaran CLO VII Ltd '2007-1A A3L' '144A' FRN 15/6/2021	439,076	0.01
USD 9,750,000	U.S. Residential Opportunity Fund IV Trust (Step-up coupon) '2016-2IV A' '144A' 3.475% 27/8/2036	9,750,000	0.12
USD 197,572	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	210,661	0.00
USD 3,929,318	UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust '2012-C2 XA' '144A' FRN 10/5/2063	213,944	0.00
USD 2,942,850	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	3,071,599	0.04
USD 2,150,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	2,225,250	0.03
USD 945,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	989,888	0.01
USD 7,822,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2019	8,121,450	0.10
USD 95,126,500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2020* †	98,945,366	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	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 262,325,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2021*	269,790,585	3.44
USD 111,407,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/7/2026*	112,248,306	1.43
USD 18,836,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.25% 15/1/2025*	19,343,629	0.25
USD 93,955,300	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2026*	99,387,268	1.27
USD 8,430,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.75% 15/2/2045	8,725,709	0.11
USD 2,750,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1% 15/2/2046	3,103,054	0.04
USD 57,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 31/7/2018	56,961,035	0.73
USD 12,465,000	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/7/2023	12,327,690	0.16
USD 1,496,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/8/2026	1,487,468	0.02
USD 9,739,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2046	9,775,521	0.12
USD 59,162,100	United States Treasury Note/Bond 2.5% 15/5/2046* †	62,614,763	0.80
USD 970,000	UnitedHealth Group Inc 3.1% 15/3/2026	1,025,719	0.01
USD 450,000	UnitedHealth Group Inc 4.75% 15/7/2045	561,275	0.01
USD 1,370,000	University of Arizona 5% 1/8/2039	1,630,759	0.02
USD 4,264,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	4,331,294	0.06
USD 2,130,000	Univision Communications Inc '144A' 8.5% 15/5/2021	2,224,341	0.03
USD 2,844,715	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	3,033,177	0.04
USD 852,259	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	883,153	0.01
USD 4,780,000	US Bancorp 2.375% 22/7/2026	4,745,778	0.06
USD 1,200,000	US Residential Opportunity Fund II Trust '2016-111 A' '144A' 3.475% 27/7/2036	1,200,648	0.02
USD 6,050,000	US Residential Opportunity Fund II Trust (Step-up coupon) '2016-211 A' '144A' 3.475% 27/8/2036	6,050,000	0.08
USD 6,867,425	US Residential Opportunity Fund III Trust '2016-1111 A' '144A' 3.475% 27/7/2036	6,872,431	0.09
USD 15,650,000	US Residential Opportunity Fund III Trust (Step-up coupon) '2016-2111 A' '144A' 3.475% 27/8/2036	15,677,441	0.20
USD 11,000,000	US Residential Opportunity Fund IV Trust (Step-up coupon) '2016-11V A' '144A' 3.475% 27/7/2036	11,000,000	0.14
USD 1,402,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2014-1 M1' '144A' FRN 25/9/2044	1,444,060	0.02
USD 5,137,672	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2015-1 AFL' '144A' FRN 25/6/2045	5,176,205	0.07
USD 5,829,991	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-1 AFL' '144A' FRN 25/4/2046	5,850,396	0.07
USD 500,000	Venture X CLO Ltd '2012-10A C' '144A' FRN 20/7/2022	501,970	0.01
USD 1,075,000	Venture XI CLO Ltd '2012-11A DR' '144A' FRN 14/11/2022	1,064,650	0.01
USD 375,000	Venture XII CLO Ltd '2012-12A D' '144A' FRN 28/2/2024	366,207	0.00
USD 850,000	VENTURE XIII CLO Ltd '2013-13A D' '144A' FRN 10/6/2025	825,458	0.01
USD 2,045,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A A' '144A' FRN 15/1/2027	2,047,920	0.03
USD 420,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A C' '144A' FRN 15/1/2027	421,562	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,030,000	Venture XVII CLO Ltd '2014-17A B1' '144A' FRN 15/7/2026	1,032,325	0.01
USD 250,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A B1' '144A' FRN 15/4/2027	249,205	0.00
USD 320,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A C' '144A' FRN 15/4/2027	321,230	0.00
USD 330,000	Venture XX CLO Ltd '2015-20A D' '144A' FRN 15/4/2027	315,342	0.00
USD 1,470,000	Venture XXI CLO Ltd '2015-21A D' '144A' FRN 15/7/2027	1,362,427	0.02
EUR 400,000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd 7.5% 1/2/2023	427,908	0.01
USD 1,616,000	Verizon Communications Inc 2.625% 15/8/2026	1,606,471	0.02
USD 5,315,000	Verizon Communications Inc 3.5% 1/11/2024	5,715,762	0.07
USD 7,602,000	Verizon Communications Inc 4.125% 15/8/2046	7,640,922	0.10
USD 2,590,000	Verizon Communications Inc 4.862% 21/8/2046	2,900,923	0.04
USD 2,500,000	Vibrant CLO II Ltd '2013-2A B' '144A' FRN 24/7/2024	2,476,494	0.03
USD 1,310,000	Vibrant Clo IV Ltd '2016-4A C' '144A' FRN 20/7/2028	1,316,981	0.02
USD 390,000	Virginia Public School Authority 5% 1/8/2025	509,168	0.01
USD 2,150,000	Visa Inc 4.3% 14/12/2045	2,563,243	0.03
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust '2013-PENN E' '144A' FRN 13/12/2029	878,129	0.01
USD 1,527,434	VOLT XLIV LLC (Step-up coupon) '2016-NPL4 A1' '144A' 4.25% 25/4/2046	1,548,055	0.02
USD 3,931,897	VOLT XLV LLC (Step-up coupon) '2016-NPL5 A1' '144A' 4% 25/5/2046	3,971,582	0.05
USD 16,556,083	VOLT XLVI LLC (Step-up coupon) '2016-NPL6 A1' '144A' 3.844% 25/6/2046	16,639,789	0.21
USD 19,284,416	VOLT XLVII LLC (Step-up coupon) '2016-NPL7 A1' '144A' 3.75% 25/6/2046	19,376,472	0.25
USD 5,718,254	VOLT XLVIII LLC (Step-up coupon) '2016-NPL8 A1' '144A' 3.5% 25/7/2046	5,728,953	0.07
USD 1,260,000	Voya 2012-4 Ltd '2012-4A A1' '144A' FRN 15/10/2023	1,259,973	0.02
USD 395,000	Voya 2012-4 Ltd '2012-4A C' '144A' FRN 15/10/2023	395,326	0.01
USD 1,230,000	Voya CLO 2012-1 Ltd '2012-1A A2R' '144A' FRN 14/3/2022	1,231,459	0.02
USD 1,000,000	Voya CLO 2012-1 Ltd '2012-1A BR' '144A' FRN 14/3/2022	1,000,766	0.01
USD 1,890,000	Voya CLO 2012-1 Ltd '2012-1A CR' '144A' FRN 14/3/2022	1,892,477	0.02
USD 2,520,000	Voya CLO 2012-2 Ltd '2012-2A BR' '144A' FRN 15/10/2022	2,516,924	0.03
USD 3,090,000	Voya CLO 2012-2 Ltd '2012-2A CR' '144A' FRN 15/10/2022	3,092,622	0.04
USD 1,480,000	Voya CLO 2012-2 Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 15/10/2022	1,467,622	0.02
USD 520,000	Voya CLO 2012-2 Ltd '2012-2A ER' '144A' FRN 15/10/2022	520,781	0.01
USD 2,530,000	Voya CLO 2012-3 Ltd '2012-3A BR' '144A' FRN 15/10/2022	2,529,782	0.03
USD 624,000	Voya CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1' '144A' FRN 15/4/2024	620,268	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 25/4/2025	1,844,279	0.02
USD 1,210,000	Voya CLO 2013-2 Ltd '2013-2A C' '144A' FRN 25/4/2025	1,190,315	0.02
USD 2,640,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A1' '144A' FRN 18/1/2026	2,636,916	0.03
USD 835,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A2' '144A' FRN 18/1/2026	830,353	0.01
USD 685,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A B' '144A' FRN 18/1/2026	676,135	0.01
USD 440,000	Voya CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 18/4/2026	414,125	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 415,000	Voya CLO 2014-3 Ltd '2014-3A C' '144A' FRN 25/7/2026	396,609	0.01
USD 5,010,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A A1' '144A' FRN 14/10/2026	5,012,484	0.06
USD 510,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A A2A' '144A' FRN 14/10/2026	511,225	0.01
USD 295,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A B' '144A' FRN 14/10/2026	295,375	0.00
USD 775,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A C' '144A' FRN 14/10/2026	765,443	0.01
USD 275,000	Voya CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 18/4/2027	251,072	0.00
USD 275,000	Voya CLO 2016-2 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 19/7/2028	258,179	0.00
USD 3,339,928	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust '2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	2,907,775	0.04
USD 7,713,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 AJ' FRN 15/10/2048	7,677,494	0.10
USD 490,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 B' FRN 15/10/2048	486,279	0.01
USD 690,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 AMFL' '144A' FRN 15/6/2049	680,205	0.01
USD 690,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C29 AM' 5.339% 15/11/2048	695,316	0.01
USD 240,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 AMFX' '144A' 5.703% 15/6/2049	244,747	0.00
EUR 952,000	Walgreens Boots Alliance Inc 2.125% 20/11/2026	1,142,415	0.01
USD 794,000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.45% 1/6/2026	829,836	0.01
USD 5,380,000	Walgreens Boots Alliance Inc 3.8% 18/11/2024	5,782,997	0.07
USD 178,000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.65% 1/6/2046	197,388	0.00
USD 2,524,000	Walgreens Boots Alliance Inc 4.8% 18/11/2044	2,845,367	0.04
USD 995,687	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust '2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	845,895	0.01
USD 3,515,000	Washington Health Care Facilities Authority 5% 1/10/2038	4,182,604	0.05
USD 4,000,000	Washington Mill CLO Ltd '2014-1A A1' '144A' FRN 20/4/2026	3,996,541	0.05
USD 13,070,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 1/5/2009 (Zero Coupon)	2,842,725	0.04
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 6/11/2009 (Zero Coupon)	2,335,950	0.03
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 16/6/2010 (Zero Coupon)	739,283	0.01
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 4/2/2011 (Zero Coupon)	822,150	0.01
USD 630,000	Washington Mutual Bank / Debt not acquired by JPMorgan (Defaulted) 5.55% 16/6/2010	137,025	0.00
USD 2,618,495	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series (Step-up coupon) '2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,910,604	0.02
USD 2,451,850	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust '2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,668,705	0.02
USD 5,540,300	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series '2006-HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,633,152	0.03
USD 2,206,291	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 1A' FRN 25/10/2036	1,650,053	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,088,313	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	2,233,402	0.03
USD 2,240,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/1/2027	2,170,575	0.03
USD 1,250,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/1/2027	1,157,563	0.01
USD 1,981,768	Wedgewood Real Estate Trust '2016-1 A1' '144A' FRN 15/7/2046	1,982,926	0.03
USD 4,054,000	Wells Fargo & Co 3% 22/4/2026	4,190,462	0.05
USD 4,200,000	Wells Fargo & Co 4.3% 22/7/2027	4,660,732	0.06
USD 1,390,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2014-TISH SCH2' '144A' FRN 15/1/2027	1,349,788	0.02
USD 16,956,045	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 XA' FRN 15/2/2048	1,051,405	0.01
USD 8,648,452	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XA' FRN 15/5/2048	602,312	0.01
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	122,811	0.00
USD 1,170,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS4 C' FRN 15/12/2048	1,240,295	0.02
USD 1,210,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS4 D' FRN 15/12/2048	988,576	0.01
USD 2,290,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-C34 C' FRN 15/6/2049	2,454,361	0.03
USD 5,483,598	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XB' FRN 15/8/2049	623,896	0.01
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XD' '144A' FRN 15/8/2049	271,763	0.00
USD 13,225,762	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS3 XA' FRN 15/9/2057	890,393	0.01
USD 15,547,355	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-C33 XA' FRN 15/3/2059	1,866,330	0.02
USD 660,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS3 D' '144A' 3.153% 15/9/2057	454,925	0.01
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-P2 D' '144A' 3.241% 15/12/2048	340,445	0.00
USD 2,200,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 D' '144A' 3.768% 15/2/2048	1,640,767	0.02
USD 430,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C31 D' 3.852% 15/11/2048	330,599	0.00
USD 2,069,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 C' 3.894% 15/2/2048	1,936,538	0.02
USD 2,380,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	2,609,976	0.03
USD 830,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2019	923,325	0.01
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	1,026,332	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	1,047,397	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,169,946	0.02
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	990,095	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	1,070,107	0.01
USD 330,000	Westcott Park Clo Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	312,757	0.00
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 C' FRN 15/8/2045	390,051	0.01
USD 9,871,589	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 XA' '144A' FRN 15/8/2045	713,010	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 10,518,555	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C9 XA' '144A' FRN 15/11/2045	876,220	0.01
USD 4,986,091	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C20 XA' FRN 15/5/2047	296,062	0.00
USD 10,820,259	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C22 XA' FRN 15/9/2057	558,341	0.01
USD 14,897,800	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C23 XA' FRN 15/10/2057	559,979	0.01
USD 5,220,000	Williams Partners LP 4% 15/9/2025	5,243,827	0.07
USD 840,000	Wind River CLO Ltd '2012-1A D' '144A' FRN 15/1/2024	840,843	0.01
USD 7,000,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2016-A A' 2.03% 15/4/2025	7,063,764	0.09
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-D B' 3.34% 17/4/2023	681,360	0.01
USD 1,520,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-C C' 4.55% 15/8/2022	1,559,254	0.02
USD 1,977,801	WVUE 2015-1 (Step-up coupon) '2015-1A A' '144A' 4.5% 25/9/2020	1,997,183	0.03
EUR 324,000	XPO Logistics Inc 5.75% 15/6/2021	377,634	0.01
USD 680,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2025	587,394	0.01
USD 945,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	992,250	0.01
EUR 200,000	ZF North America Capital Inc 2.75% 27/4/2023	238,776	0.00
USD 430,000	Ziggurat CLO Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 17/10/2026	432,838	0.01
		4,831,116,242	61.63
	ベネズエラ		
USD 14,865,000	Petroleos de Venezuela SA 6% 16/5/2024	5,778,769	0.07
USD 3,441,000	Petroleos de Venezuela SA 6% 15/11/2026	1,318,006	0.02
USD 4,199,000	Venezuela Government International Bond 7% 31/3/2038*	1,784,575	0.02
USD 3,624,000	Venezuela Government International Bond 8.25% 13/10/2024	1,656,168	0.02
		10,537,518	0.13
	ベトナム		
USD 997,000	Vietnam Government International Bond 4.8% 19/11/2024	1,084,238	0.01
USD 500,000	Vietnam Joint Stock Commercial Bank for Industry and Trade 8% 17/5/2017	517,500	0.01
USD 2,110,000	Vingroup JSC 11.625% 7/5/2018	2,260,337	0.03
		3,862,075	0.05
債券合計		7,429,693,384	94.78
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取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		7,627,665,745	97.31

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
ルクセンブルグ			
EUR 7,611,687	Atalaya Luxco Pikco 11.5% 31/12/2049**	8,566,859	0.11
米国			
USD 5,313,068	American Homes 4 Rent '2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052	-	0.00
USD 11,890,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035**	7,936,575	0.10
USD 122,260,000	CSMC Trust '2014-USA X2' '144A' FRN 15/9/2037**	931,621	0.01
USD 2,391	Lehman Brothers Holdings Inc (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	168	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	63	0.00
		8,868,427	0.11
債券合計		17,435,286	0.22
その他の譲渡可能な有価証券合計		17,435,286	0.22
投資有価証券合計		7,645,101,031	97.53
その他の純資産		193,944,289	2.47
純資産合計(米ドル)		7,839,045,320	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。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2016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)
MXN	122,444,498	USD	6,670,000	Goldman Sachs	1/9/2016	(167,942)
MXN	110,833,607	USD	5,944,000	Morgan Stanley	1/9/2016	(58,505)
USD	5,184,000	MXN	94,864,090	Deutsche Bank	1/9/2016	146,519
USD	3,715,000	MXN	70,438,354	Goldman Sachs	1/9/2016	(25,423)
USD	3,715,000	MXN	70,449,403	Morgan Stanley	1/9/2016	(26,010)
BRL	14,656,371	USD	4,614,000	Morgan Stanley	2/9/2016	(77,545)
BRL	111,907,135	USD	33,760,354	RBS Plc	2/9/2016	877,254
CAD	1,395,863	USD	1,070,000	JP Morgan	2/9/2016	(5,766)
EUR	950,082	USD	1,060,000	Goldman Sachs	2/9/2016	(1,281)
GBP	807,013	USD	1,060,000	Citibank	2/9/2016	(2,974)
JPY	107,045,605	USD	1,060,000	Citibank	2/9/2016	(24,142)
RUB	482,429,900	USD	7,430,000	BNP Paribas	2/9/2016	(32,968)
RUB	70,528,516	USD	1,070,000	Societe Generale	2/9/2016	11,404
SEK	9,008,011	USD	1,060,000	Citibank	2/9/2016	(7,569)
TRY	3,218,332	USD	1,060,000	Morgan Stanley	2/9/2016	28,526
TWD	222,487,529	USD	6,998,664	Bank of America	2/9/2016	13,117
USD	36,448,607	BRL	117,105,225	Goldman Sachs	2/9/2016	202,082
USD	1,925,747	BRL	6,162,776	State Street	2/9/2016	18,239
USD	1,070,000	CAD	1,410,503	Barclays	2/9/2016	(5,396)
USD	1,060,000	EUR	955,752	HSBC Bank Plc	2/9/2016	(5,037)
USD	1,060,000	GBP	810,754	Goldman Sachs	2/9/2016	(1,926)
				Standard		
USD	1,060,000	JPY	107,792,884	Chartered Bank	2/9/2016	16,910
USD	7,430,000	RUB	479,309,300	Deutsche Bank	2/9/2016	80,815
USD	1,070,000	RUB	71,503,606	Citibank	2/9/2016	(26,355)
USD	1,060,000	SEK	9,068,547	Citibank	2/9/2016	497
USD	1,060,000	TRY	3,221,280	Barclays	2/9/2016	(29,523)
				Standard		
USD	6,998,664	TWD	219,968,010	Chartered Bank	2/9/2016	66,287
USD	1,060,000	ZAR	14,682,311	Barclays	2/9/2016	57,880
ZAR	14,683,734	USD	1,060,000	RBS Plc	2/9/2016	(57,783)
BRL	3,402,600	USD	1,060,000	Credit Suisse	6/9/2016	(8,106)
COP	3,243,600,000	USD	1,060,000	Credit Suisse	6/9/2016	40,888
EUR	2,500,000	USD	2,839,723	Credit Suisse	6/9/2016	(53,359)
EUR	115,800,000	USD	129,970,715	HSBC Bank Plc	6/9/2016	(906,331)
EUR	22,000,000	USD	24,401,538	Morgan Stanley	6/9/2016	118,466
EUR	20,000,000	USD	22,545,080	Northern Trust	6/9/2016	(254,168)
INR	235,166,400	USD	3,499,500	BNP Paribas	6/9/2016	9,931
INR	103,841,661	USD	1,545,033	Citibank	6/9/2016	4,615
INR	158,403,095	USD	2,332,888	HSBC Bank Plc	6/9/2016	30,990
INR	448,531,602	USD	6,620,243	JP Morgan	6/9/2016	73,275
MXN	625,000,000	USD	33,211,293	HSBC Bank Plc	6/9/2016	(35,131)
MXN	133,131,875	USD	7,270,000	Deutsche Bank	6/9/2016	(203,113)
USD	1,060,000	BRL	3,458,780	RBS Plc	6/9/2016	(9,261)

未決済先渡為替予約 2016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	1,060,000	COP	3,298,720,000	Credit Suisse	6/9/2016	(59,596)
USD	18,879,755	DKK	126,228,948	Bank of America	6/9/2016	(23,806)
USD	793,885	EUR	710,000	Barclays	6/9/2016	2,558
USD	2,283,091	EUR	2,045,000	Morgan Stanley	6/9/2016	3,846
USD	1,829,343	EUR	1,637,000	HSBC Bank Plc	6/9/2016	4,831
USD	938,520,163	EUR	842,851,000	RBS Plc	6/9/2016	(875,736)
USD	4,191,673	EUR	3,747,000	Citibank	6/9/2016	15,470
USD	4,219,425	GBP	3,275,000	Barclays	6/9/2016	(70,617)
USD	252,004	GBP	194,000	BNY Mellon	6/9/2016	(2,124)
USD	32,356,293	GBP	24,571,000	Goldman Sachs	6/9/2016	169,839
USD	190,927,400	GBP	144,894,000	HSBC Bank Plc	6/9/2016	1,125,437
USD	7,914,462	GBP	5,961,000	Citibank	6/9/2016	105,930
USD	6,066,053	GBP	4,661,000	Morgan Stanley	6/9/2016	(39,561)
				Standard		
USD	7,091,570	KRW	8,000,000,000	Chartered Bank	6/9/2016	(80,668)
USD	7,270,000	MXN	133,128,240	UBS	6/9/2016	203,306
USD	53,908,380	MXN	1,014,088,000	Goldman Sachs	6/9/2016	78,704
				Standard		
USD	7,376,817	NZD	10,396,000	Chartered Bank	6/9/2016	(159,444)
USD	1,214,598	SEK	10,441,000	Toronto Dominion	6/9/2016	(5,502)
USD	4,460,000	ZAR	62,686,192	Morgan Stanley	6/9/2016	184,896
ZAR	59,948,733	USD	4,460,000	Deutsche Bank	6/9/2016	(371,586)
ARS	41,989,500	USD	2,790,000	BNP Paribas	7/9/2016	18,190
RUB	1,130,595,000	USD	17,404,791	JP Morgan	7/9/2016	(92,502)
USD	2,790,000	ARS	42,945,400	BNP Paribas	7/9/2016	(82,119)
USD	1,993,865	RUB	128,375,000	Deutsche Bank	7/9/2016	28,117
USD	12,803,355	RUB	839,215,000	Credit Suisse	7/9/2016	(47,164)
USD	38,281,568	RUB	2,500,820,000	Morgan Stanley	7/9/2016	(12,354)
USD	17,251,774	RUB	1,130,595,000	Goldman Sachs	7/9/2016	(60,515)
USD	17,924,653	RUB	1,160,970,000	Citibank	7/9/2016	147,246
USD	6,819,227	RUB	438,940,000	HSBC Bank Plc	7/9/2016	97,938
RUB	402,942,800	USD	6,140,000	Deutsche Bank	8/9/2016	28,443
				Standard		
USD	4,944,423	CNH	33,118,697	Chartered Bank	8/9/2016	(2,241)
USD	8,551,259	EUR	7,665,929	Goldman Sachs	8/9/2016	6,459
USD	9,183,157	JPY	935,963,869	RBS Plc	8/9/2016	123,449
USD	4,189	NZD	5,831	Morgan Stanley	8/9/2016	(38)
USD	850,000	RUB	55,267,000	JP Morgan	8/9/2016	3,946
IDR	148,859,525,000	USD	11,298,636	Citibank	9/9/2016	(95,209)
IDR	358,260,187,036	USD	27,180,826	HSBC Bank Plc	9/9/2016	(217,540)
MXN	72,322,383	USD	4,002,000	Goldman Sachs	9/9/2016	(164,090)
MXN	126,216,410	USD	6,670,000	Morgan Stanley	9/9/2016	27,887
RUB	1,404,008,731	USD	21,520,344	Deutsche Bank	9/9/2016	(32,807)
USD	20,467,042	IDR	271,874,035,095	BNP Paribas	9/9/2016	5,328

未決済先渡為替予約 2016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	11,076,642	IDR	146,211,671,353	Deutsche Bank	9/9/2016	72,497
USD	25,846,388	IDR	346,194,029,914	HSBC Bank Plc	9/9/2016	(208,777)
USD	9,120,361	IDR	122,304,042,727	Citibank	9/9/2016	(84,454)
USD	49,077,930	INR	3,300,000,000	UBS	9/9/2016	(146,611)
USD	4,978,169	INR	338,888,888	JP Morgan	9/9/2016	(76,876)
USD	206,154,472	INR	14,166,934,019	Citibank	9/9/2016	(5,166,988)
USD	1,606,750	KRW	1,857,146,207	Bank of America	9/9/2016	(57,776)
USD	5,336,000	MXN	99,479,432	Morgan Stanley	9/9/2016	56,956
USD	5,336,000	MXN	99,205,311	Bank of America	9/9/2016	71,502
USD	2,430,348	THB	85,438,878	BNY Mellon	9/9/2016	(37,564)
TWD	141,287,500	USD	4,450,000	JP Morgan	12/9/2016	3,926
TWD	137,126,750	USD	4,450,000	Deutsche Bank	12/9/2016	(127,236)
USD	1,588,833	ARS	24,865,236	BNP Paribas	12/9/2016	(68,809)
USD	8,900,000	TWD	277,947,000	Deutsche Bank	12/9/2016	138,039
				Standard		
USD	43,644,302	IDR	572,293,773,593	Chartered Bank	13/9/2016	612,972
USD	1,010,000	ARS	15,251,000	RBS Plc	14/9/2016	(5,407)
MXN	196,827,440	USD	10,930,000	Morgan Stanley	15/9/2016	(490,992)
USD	5,190,000	CAD	6,832,353	Citibank	16/9/2016	(19,548)
USD	6,657,622	GBP	5,130,000	Citibank	16/9/2016	(64,106)
USD	4,630,000	TRY	13,794,340	Deutsche Bank	16/9/2016	(20,771)
MXN	19,164,806	USD	1,030,000	Goldman Sachs	19/9/2016	(13,957)
USD	1,030,000	MXN	19,164,798	Deutsche Bank	19/9/2016	13,957
AUD	1,375,000	CAD	1,343,609	Bank of America	21/9/2016	7,734
AUD	13,785,000	CAD	13,572,971	Citibank	21/9/2016	(763)
AUD	3,250,000	USD	2,478,320	Deutsche Bank	21/9/2016	(38,477)
AUD	4,625,000	USD	3,502,097	Citibank	21/9/2016	(30,013)
CAD	4,419,333	AUD	4,500,000	Morgan Stanley	21/9/2016	(8,483)
CAD	6,167,416	AUD	6,200,000	Citibank	21/9/2016	48,212
CAD	4,421,644	AUD	4,460,000	HSBC Bank Plc	21/9/2016	23,308
CAD	4,552,931	USD	3,522,000	Morgan Stanley	21/9/2016	(50,370)
CAD	4,047,517	USD	3,095,000	RBS Plc	21/9/2016	(8,750)
CAD	4,025,731	USD	3,085,000	Westpac	21/9/2016	(15,363)
CHF	2,330,170	EUR	2,150,000	Bank of America	21/9/2016	(23,555)
CHF	16,302	EUR	15,000	Morgan Stanley	21/9/2016	(119)
CHF	6,158,670	EUR	5,670,000	UBS	21/9/2016	(48,341)
CHF	1,218,094	EUR	1,125,000	Credit Suisse	21/9/2016	(13,529)
EUR	3,115,385	CHF	3,385,962	Credit Suisse	21/9/2016	24,444
EUR	5,844,615	CHF	6,362,939	UBS	21/9/2016	34,948
EUR	17,555,000	GBP	15,030,591	Deutsche Bank	21/9/2016	(117,700)
EUR	1,700,000	GBP	1,448,117	JP Morgan	21/9/2016	(1,670)
EUR	3,075,000	GBP	2,574,727	Citibank	21/9/2016	55,504
EUR	1,350,000	GBP	1,129,262	Morgan Stanley	21/9/2016	25,816
EUR	14,555,000	USD	16,153,721	HSBC Bank Plc	21/9/2016	79,498

未決済先渡為替予約 2016年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
EUR	2,560,000	USD	2,892,201	UBS	21/9/2016	(37,028)
EUR	17,876,250	USD	20,106,228	Citibank	21/9/2016	(168,812)
EUR	62,272,200	USD	70,328,429	RBS Plc	21/9/2016	(876,125)
EUR	5,314,000	USD	6,022,429	State Street	21/9/2016	(95,715)
GBP	15,229,489	EUR	17,555,000	JP Morgan	21/9/2016	378,346
GBP	1,127,403	EUR	1,350,000	Morgan Stanley	21/9/2016	(28,254)
GBP	4,017,406	EUR	4,775,000	Deutsche Bank	21/9/2016	(60,960)
GBP	1,366,667	USD	1,826,956	Goldman Sachs	21/9/2016	(36,009)
GBP	21,223,664	USD	28,190,481	HSBC Bank Plc	21/9/2016	(377,948)
GBP	1,710,000	USD	2,245,105	Barclays	21/9/2016	(4,237)
GBP	52,486,097	USD	68,590,092	Deutsche Bank	21/9/2016	190,270
GBP	12,977,000	USD	18,369,469	Citibank	21/9/2016	(1,363,770)
GBP	5,920,000	USD	8,406,400	UBS	21/9/2016	(648,541)
GBP	56,955,000	USD	75,282,408	JP Morgan	21/9/2016	(645,775)
GBP	1,708,333	USD	2,285,861	BNP Paribas	21/9/2016	(47,177)
JPY	13,535,094,959	USD	133,311,000	HSBC Bank Plc	21/9/2016	(2,216,524)
JPY	743,945,844	USD	7,426,560	Morgan Stanley	21/9/2016	(221,055)
JPY	632,724,750	USD	6,300,000	BNP Paribas	21/9/2016	(171,730)
JPY	11,162,757,431	USD	107,174,200	JP Morgan	21/9/2016	942,945
JPY	326,274,227	USD	3,085,000	Credit Suisse	21/9/2016	75,137
JPY	980,997,439	USD	9,177,000	Deutsche Bank	21/9/2016	324,473
MXN	63,840,115	USD	3,405,000	JP Morgan	21/9/2016	(21,091)
MXN	476,085,078	USD	25,284,000	State Street	21/9/2016	(48,639)
RUB	56,252,600	USD	860,000	Deutsche Bank	21/9/2016	(1,831)
RUB	501,102,000	USD	7,760,000	BNP Paribas	21/9/2016	(115,374)
SEK	169,700,000	USD	19,868,247	Deutsche Bank	21/9/2016	(22,484)
USD	1,296,814	AUD	1,715,000	Goldman Sachs	21/9/2016	9,328
USD	4,679,328	AUD	6,160,000	Citibank	21/9/2016	54,887
USD	47,541,256	CAD	62,415,665	Goldman Sachs	21/9/2016	(50,963)
USD	4,880,000	CAD	6,394,740	HSBC Bank Plc	21/9/2016	3,983
USD	1,300,000	CAD	1,702,527	State Street	21/9/2016	1,816
USD	3,428,571	CNH	22,882,971	Citibank	21/9/2016	12,565
USD	9,513,751	COP	29,445,060,000	BNY Mellon	21/9/2016	(452,189)
USD	12,121,461	COP	36,670,875,420	Credit Suisse	21/9/2016	(290,120)
USD	26,413,746	COP	80,583,991,695	State Street	21/9/2016	(860,618)
USD	12,026,019	EUR	10,748,073	Goldman Sachs	21/9/2016	38,672
USD	11,667,469	EUR	10,436,250	Citibank	21/9/2016	27,899
USD	39,618,857	EUR	35,499,877	Barclays	21/9/2016	25,776
USD	32,442,317	EUR	28,726,000	RBS Plc	21/9/2016	404,154
USD	21,736,060	EUR	19,292,000	Morgan Stanley	21/9/2016	219,655
USD	14,221,273	GBP	10,916,164	Goldman Sachs	21/9/2016	(83,805)
USD	32,743,073	GBP	24,830,000	Morgan Stanley	21/9/2016	204,620
USD	1,263,229	GBP	974,184	Bank of America	21/9/2016	(13,389)
USD	12,168,317	GBP	9,295,000	HSBC Bank Plc	21/9/2016	(12,308)

未決済先渡為替予約 2016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	96,057,244	GBP	72,934,000	JP Morgan	21/9/2016	480,945
USD	26,821,325	GBP	19,892,000	Citibank	21/9/2016	753,871
USD	58,041,968	GBP	39,835,510	RBS Plc	21/9/2016	5,839,557
USD	4,528,749	GBP	3,418,333	Deutsche Bank	21/9/2016	49,196
USD	1,824,421	GBP	1,366,667	UBS	21/9/2016	33,474
				Standard		
USD	24,249,422	IDR	318,710,159,363	Chartered Bank	21/9/2016	331,247
USD	5,270,524	INR	357,921,304	UBS	21/9/2016	(58,889)
USD	15,799,953	INR	1,073,764,796	HSBC Bank Plc	21/9/2016	(188,301)
USD	20,475,587	JPY	2,085,500,000	UBS	21/9/2016	276,429
USD	93,370,000	JPY	9,564,374,624	Westpac	21/9/2016	734,028
USD	10,265,310	JPY	1,041,617,604	Citibank	21/9/2016	176,698
USD	1,380,000	JPY	141,912,295	Deutsche Bank	21/9/2016	5,505
USD	2,156,250	JPY	221,481,165	Barclays	21/9/2016	11,089
USD	34,573,711	JPY	3,601,270,101	JP Morgan	21/9/2016	(306,474)
USD	12,754,000	JPY	1,351,717,385	State Street	21/9/2016	(338,090)
USD	12,386,000	JPY	1,307,910,817	Goldman Sachs	21/9/2016	(281,801)
USD	1,713,889	JPY	180,398,974	Bank of America	21/9/2016	(33,370)
USD	55,888,000	JPY	5,644,844,174	HSBC Bank Plc	21/9/2016	1,214,730
USD	10,625,600	KRW	11,664,783,680	JP Morgan	21/9/2016	182,271
USD	17,845,702	MXN	325,260,486	JP Morgan	21/9/2016	604,948
USD	1,700,000	MXN	30,978,692	UBS	21/9/2016	57,944
USD	1,705,000	MXN	32,095,092	Deutsche Bank	21/9/2016	3,768
USD	4,244,000	MXN	79,814,130	State Street	21/9/2016	13,373
USD	10,625,000	MXN	203,844,875	HSBC Bank Plc	21/9/2016	(179,999)
USD	7,430,000	RUB	484,740,630	BNP Paribas	21/9/2016	34,977
USD	860,000	RUB	55,485,117	Societe Generale	21/9/2016	13,540
USD	6,998,664	TWD	222,347,555	Bank of America	21/9/2016	(12,283)
COP	3,230,143,108	USD	1,094,222	BNP Paribas	26/9/2016	(1,965)
COP	10,015,593,258	USD	3,385,778	Credit Suisse	26/9/2016	947
RUB	445,033,500	USD	6,810,000	Deutsche Bank	26/9/2016	(29,785)
RUB	340,108,800	USD	5,210,000	Societe Generale	26/9/2016	(28,344)
USD	4,480,000	COP	13,041,728,000	Credit Suisse	26/9/2016	70,003
USD	5,250,000	ZAR	72,414,825	BNP Paribas	26/9/2016	331,376
ZAR	74,397,225	USD	5,250,000	JP Morgan	26/9/2016	(196,726)
CHF	569,726	EUR	531,000	Citibank	28/9/2016	(11,626)
CHF	1,329,447	EUR	1,239,000	UBS	28/9/2016	(27,038)
CHF	1,517,614	EUR	1,415,000	RBS Plc	28/9/2016	(31,573)
EUR	3,185,000	CHF	3,438,208	UBS	28/9/2016	48,401
ARS	34,746,923	USD	2,250,000	BNP Paribas	30/9/2016	39,704
ARS	13,543,269	USD	865,385	RBS Plc	30/9/2016	27,071
MXN	134,208,864	USD	7,360,000	Goldman Sachs	30/9/2016	(252,240)
USD	5,585,000	ARS	85,680,602	BNP Paribas	30/9/2016	(61,062)
EUR	2,950,253	GBP	2,500,000	Deutsche Bank	3/10/2016	15,076

未決済先渡為替予約 2016年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
GBP	675,935	USD	879,324	Goldman Sachs	3/10/2016	6,725
USD	8,925,000	CLP	6,029,819,250	Credit Suisse	3/10/2016	45,552
USD	8,254,063	GBP	6,250,000	Citibank	3/10/2016	61,256
BRL	126,994,911	USD	39,184,607	Goldman Sachs	4/10/2016	(260,273)
CAD	1,370,301	USD	1,060,000	Barclays	4/10/2016	(15,062)
EUR	937,063	USD	1,060,000	Citibank	4/10/2016	(14,283)
GBP	800,422	USD	1,060,000	Barclays	4/10/2016	(10,749)
JPY	106,315,763	USD	1,060,000	Barclays	4/10/2016	(29,655)
SEK	8,968,925	USD	1,070,000	Morgan Stanley	4/10/2016	(20,427)
USD	1,070,000	RUB	70,491,600	BNP Paribas	4/10/2016	(1,751)
USD	1,060,000	TRY	3,156,938	BNP Paribas	4/10/2016	(49)
USD	1,060,000	ZAR	15,120,660	Credit Suisse	4/10/2016	34,608
USD	641,000	ARS	9,698,330	RBS Plc	5/10/2016	3,814
USD	1,060,000	BRL	3,458,780	Credit Suisse	5/10/2016	201
USD	680,000	COP	2,012,120,000	RBS Plc	5/10/2016	773
				Standard		
USD	380,000	COP	1,124,990,000	Chartered Bank	5/10/2016	240
USD	18,151,620	GBP	13,862,000	Deutsche Bank	5/10/2016	(20,034)
TWD	141,020,500	USD	4,450,000	HSBC Bank Plc	13/10/2016	479
USD	1,466,136	SGD	2,000,000	Bank of America	13/10/2016	(506)
USD	4,450,000	TWD	140,887,000	HSBC Bank Plc	13/10/2016	3,734
USD	557,561	EUR	498,290	Goldman Sachs	14/10/2016	1,260
USD	3,440,406	EUR	3,042,879	Morgan Stanley	14/10/2016	43,277
USD	15,236,340	EUR	13,538,135	Bank of America	14/10/2016	122,101
USD	1,262,854	EUR	1,128,008	Citibank	14/10/2016	3,523
ARS	106,287,480	USD	6,988,000	BNP Paribas	18/10/2016	(55,828)
TRY	24,743,696	USD	8,296,402	Citibank	18/10/2016	(11,407)
USD	6,988,000	ARS	107,839,110	RBS Plc	18/10/2016	(45,370)
USD	14,643,338	TRY	43,498,036	Citibank	18/10/2016	78,778
USD	15,115,089	TRY	44,920,912	Morgan Stanley	18/10/2016	74,104
CNH	21,502,140	USD	3,215,000	BNP Paribas	7/11/2016	(12,016)
CNH	156,729,686	USD	23,502,000	Goldman Sachs	7/11/2016	(155,362)
USD	41,745,000	CNH	275,583,792	Deutsche Bank	7/11/2016	693,715
				Standard		
INR	3,506,565,000	USD	51,700,184	Chartered Bank	16/11/2016	84,305
INR	3,506,565,000	USD	51,658,294	Credit Suisse	16/11/2016	126,195
USD	3,719,243	INR	252,722,537	Deutsche Bank	16/11/2016	(12,930)
USD	6,319,702	INR	428,918,123	Citibank	16/11/2016	(14,505)
USD	10,228,165	INR	694,985,000	HSBC Bank Plc	16/11/2016	(35,283)
USD	4,647,981	INR	315,900,000	Barclays	16/11/2016	(17,189)
USD	4,957,226	ARS	77,977,382	BNP Paribas	18/11/2016	(46,311)
USD	30,690,000	SAR	116,990,280	Citibank	23/11/2016	(450,538)
USD	1,679,600	ARS	27,411,072	BNP Paribas	1/12/2016	(67,995)
USD	2,537,333	ARS	39,404,781	BNP Paribas	5/12/2016	30,163

未決済先渡為替予約 2016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	2,790,000	ARS	44,165,700	BNP Paribas	7/12/2016	(17,239)
USD	5,141,459	HKD	39,829,344	Barclays	13/12/2016	1,242
USD	63,132,271	INR	4,299,046,903	UBS	14/12/2016	(97,176)
USD	1,395,347	MYR	5,527,912	UBS	14/12/2016	45,874
USD	61,693,560	MYR	248,837,002	HSBC Bank Plc	14/12/2016	947,534
USD	3,899,338	TWD	122,985,118	JP Morgan	14/12/2016	7,136
EUR	2,500,000	JPY	290,111,425	Goldman Sachs	15/12/2016	(21,624)
EUR	5,900,000	USD	6,596,430	Citibank	15/12/2016	8,392
JPY	287,649,250	EUR	2,500,000	Morgan Stanley	15/12/2016	(2,311)
USD	6,519,323	EUR	5,900,000	State Street	15/12/2016	(85,499)
USD	3,400,000	SGD	4,584,924	Barclays	15/12/2016	38,379
USD	8,560,000	CNH	57,390,520	Citibank	21/12/2016	28,338
HKD	142,870,000	USD	18,200,000	HSBC Bank Plc	3/2/2017	245,887
USD	18,200,000	HKD	142,051,000	HSBC Bank Plc	3/2/2017	(140,147)
HKD	65,985,349	USD	8,515,000	HSBC Bank Plc	27/2/2017	5,976
USD	18,000,000	HKD	140,211,000	HSBC Bank Plc	27/2/2017	(106,057)
USD	2,646,000	ARS	45,246,600	BNP Paribas	11/5/2017	(22,046)
USD	5,115,000	ARS	91,302,750	BNP Paribas	28/7/2017	(79,661)
USD	137,482,305	JPY	16,138,800,000	Bank of America	15/9/2017	(21,687,473)
HKD	145,126,670	USD	18,325,000	Goldman Sachs	19/1/2018	435,447
USD	18,325,000	HKD	143,347,313	Goldman Sachs	19/1/2018	(205,431)
未実現純評価損						(23,349,532)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	188,566,712	USD	143,843,556	BNY Mellon	14/9/2016	(2,257,184)
USD	981,499	AUD	1,283,566	BNY Mellon	14/9/2016	17,727
未実現純評価損						(2,239,457)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	476,991,076	USD	362,410,642	BNY Mellon	14/9/2016	1,282,285
未実現純評価益						1,282,285
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	117,092,646	USD	119,456,634	BNY Mellon	14/9/2016	(197,658)
USD	1,352,249	CHF	1,306,209	BNY Mellon	14/9/2016	21,858
未実現純評価損						(175,800)
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	29,925	USD	4,483	BNY Mellon	14/9/2016	(14)
未実現純評価損						(14)

未決済先渡為替予約 2016年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,485,843,068	USD	1,649,420,965	BNY Mellon	14/9/2016	7,214,227
USD	8,249,316	EUR	7,336,789	BNY Mellon	14/9/2016	69,133
未実現純評価益						7,283,360
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	790,215,556	USD	1,033,144,323	BNY Mellon	14/9/2016	2,203,160
USD	4,058,240	GBP	3,099,665	BNY Mellon	14/9/2016	(2,972)
未実現純評価益						2,200,188
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	9,087,308	USD	1,172,073	BNY Mellon	14/9/2016	(399)
未実現純評価損						(399)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	52,165,439,518	USD	510,543,388	BNY Mellon	14/9/2016	(5,458,583)
USD	15,084,668	JPY	1,514,123,538	BNY Mellon	14/9/2016	424,220
未実現純評価損						(5,034,363)
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	318,043,231	USD	82,167,741	BNY Mellon	14/9/2016	(714,935)
USD	2,903,445	PLN	11,091,546	BNY Mellon	14/9/2016	62,842
未実現純評価損						(652,093)
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	576,294,947	USD	67,257,171	BNY Mellon	14/9/2016	114,147
USD	75,496	SEK	632,000	BNY Mellon	14/9/2016	1,611
未実現純評価益						115,758
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	44,952,289	USD	33,352,945	BNY Mellon	14/9/2016	(386,133)
USD	75,039	SGD	100,450	BNY Mellon	14/9/2016	1,371
未実現純評価損						(384,762)
未実現純評価損合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 8,953,541,573米ドル)						(20,954,829)

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 2016年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
米国			
USD (193,880,773)	Fannie Mae Pool '2.5 9/16' 2.5% TBA	(200,378,803)	(2.56)
USD (13,369,000)	Fannie Mae Pool '3 9/16' 3% TBA	(14,003,617)	(0.18)
USD (52,562,000)	Fannie Mae Pool '3 9/16' 3% TBA	(54,533,075)	(0.70)
USD (225,263,000)	Fannie Mae Pool '3.5 10/16' 3.5% TBA	(237,798,199)	(3.03)
USD (229,860,000)	Fannie Mae Pool '3.5 9/16' 3.5% TBA	(242,801,440)	(3.10)
USD (145,525,000)	Fannie Mae Pool '3.5 10/16' 3.5% TBA	(153,176,428)	(1.95)
USD (834,120,000)	Fannie Mae Pool '3.5 9/16' 3.5% TBA	(879,019,095)	(11.21)
USD 1,042,513,000	Fannie Mae Pool '4 9/16' 4% TBA	1,116,873,471	14.25
USD (11,487,000)	Fannie Mae Pool '4.5 9/16' 4.5% TBA	(12,545,957)	(0.16)
USD (6,283,000)	Fannie Mae Pool '4.5 10/16' 4.5% TBA	(6,858,041)	(0.09)
USD 3,510,000	Freddie Mac Gold Pool '3.5 9/16' 3.5% TBA	3,713,157	0.05
USD (7,208,000)	Freddie Mac Gold Pool '3.5 10/16' 3.5% TBA	(7,581,822)	(0.10)
USD (3,972,000)	Freddie Mac Gold Pool '3.5 9/16' 3.5% TBA	(4,183,167)	(0.05)
USD 700,000	Ginnie Mae I Pool '3 9/16' 3% TBA	732,840	0.01
USD (22,180,000)	Ginnie Mae II Pool '4.5 9/16' 4.5% TBA	(23,885,089)	(0.31)
T B A 合計		(715,445,265)	(9.13)

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。

未決済上場先物取引 2016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)
239	AUD	Australian 3 Year Bond	2016年9月	20,380,253	19,124
(147)	AUD	Australian 10 Year Bond	2016年9月	15,231,113	(96,948)
152	EUR	EURO STOXX 50 Index	2016年9月	5,154,242	271,942
105	EUR	VSTOXX Mini Index	2016年9月	247,468	(1,544)
27	EUR	FTSE MIB Index	2016年9月	2,562,685	134,473
10	EUR	DAX Index	2016年9月	2,965,548	308,255
(376)	EUR	Euro Bund	2016年9月	70,240,047	(528,943)
(470)	EUR	Euro BOBL	2016年9月	69,992,841	(410,569)
(639)	EUR	30 Year Euro-BUXL	2016年9月	137,998,362	(5,586,417)
(2,596)	EUR	Euro-BTP	2016年9月	421,341,733	(12,831,406)
(4,652)	EUR	Euro Schatz	2016年9月	580,677,755	(914,009)
13	JPY	Nikkei 225 (OSE)	2016年9月	2,125,992	57,674
224	KRW	Korean 10 Year Bond	2016年9月	26,630,887	233,040
642	USD	CBOE Volatility Index	2016年9月	9,386,040	(5,376)
253	USD	S&P 500 E Mini Index	2016年9月	27,466,313	(80,990)
90	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2016年9月	8,593,200	84,558
105	EUR	VSTOXX Mini Index	2016年10月	276,134	992
147	USD	CBOE Volatility Index	2016年10月	2,466,660	3,010
90	CAD	Canadian 10 Year Bond	2016年12月	10,060,746	4,117
287	GBP	Long Gilt	2016年12月	49,537,762	172,920
15,301	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2016年12月	1,856,202,563	(443,737)
104	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2016年12月	22,706,125	14,628
(211)	USD	US Ultra 10 Year Note	2016年12月	30,479,609	(18,659)
(610)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2016年12月	114,241,563	(232,643)
(648)	USD	US Long Bond (CBT)	2016年12月	110,423,250	(178,295)
(6,995)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2016年12月	916,454,297	(794,662)
合計				4,513,843,188	(20,819,465)

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 2016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)
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	58,498	58,498
MXN 55,991,678	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、4.3%の固定金利を支払う	Bank of America	7/12/2017	31,256	31,256
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	(155,510)	(155,510)
MXN 48,534,715	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIE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	27,488	27,488
MXN 37,929,872	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、4.7%の固定金利を支払う	Bank of America	6/12/2018	29,842	29,842
BRL 54,722,525	ファンドは12.02%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	2/1/2019	(48,345)	(48,345)
BRL 56,303,589	ファンドは12.03%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	2/1/2019	(46,129)	(46,129)
BRL 110,138,794	ファンドは12.24%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	2/1/2019	(37,485)	(37,485)
BRL 57,082,896	ファンドは12.285%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	2/1/2019	(20,245)	(20,245)
BRL 57,204,146	ファンドは12.462%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	2/1/2019	43,935	43,935
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	(42,391)	(42,391)
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	205,306	205,306
CNY 35,612,871	ファンドは2.495%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	16/3/2021	(47,241)	(47,241)
CNY 24,009,702	ファンドは2.725%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	12/5/2021	1,616	1,616
CNY 38,479,518	ファンドは2.74%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	12/5/2021	6,443	6,443
CNY 24,010,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	5,622	5,622
CNY 38,471,780	ファンドは2.75%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	12/5/2021	9,009	9,009
CNY 48,025,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	11,246	11,246
CNY 48,025,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	11,246	11,246
CNY 60,030,000	ファンドは2.772%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	12/5/2021	22,871	22,871
CNY 111,500,000	ファンドは2.595%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	21/9/2021	(119,546)	(119,546)
BRL 14,635,561	ファンドは12.47%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	127,632	127,632
BRL 8,949,589	ファンドは12.62%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	102,111	102,111
BRL 7,692,403	ファンドは12.73%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	104,556	104,556
BRL 33,595,361	ファンドは12.915%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	581,349	581,349
MXN 50,305,756	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIE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	(83,310)	(83,310)

金利スワップ 2016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 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	(94,675)	(94,675)
MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	(94,675)	(94,675)
MXN 10,285,479	ファンドは6.27%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	8,534	8,534
USD 8,430,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、6ヶ月USD CPURNASを支払う	Bank of America	15/2/2045	(1,849,217)	(1,849,217)
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	43,793	43,793
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	(22,008)	(22,008)
MXN 80,656,062	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.5500004%の固定金利を支払う	Barclays	21/3/2018	43,627	43,627
PLN 201,420,000	ファンドは1.755%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Barclays	21/12/2018	124,218	124,218
USD 41,500,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.1025%の固定金利を支払う	Barclays	16/7/2020	92,414	92,414
USD 16,720,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.2235%の固定金利を支払う	Barclays	19/7/2020	(2,021)	(2,021)
USD 20,770,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.2425%の固定金利を支払う	Barclays	9/8/2020	(8,375)	(8,375)
USD 20,820,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.2595%の固定金利を支払う	Barclays	10/8/2020	(15,394)	(15,394)
USD 20,800,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.2419%の固定金利を支払う	Barclays	19/8/2020	(7,233)	(7,233)
USD 20,800,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.24775%の固定金利を支払う	Barclays	23/8/2020	(9,149)	(9,149)
USD 20,815,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.2635%の固定金利を支払う	Barclays	24/8/2020	(15,494)	(15,494)
USD 20,790,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.3125%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	(35,497)	(35,497)
USD 20,784,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.3155%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	(36,706)	(36,706)
USD 81,330,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、0.78%の固定金利を支払う	Barclays	28/2/2021	63,247	63,247
USD 102,730,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.18%の固定金利を支払う	Barclays	28/2/2021	14,230	14,230
USD 29,860,000	ファンドは1.178%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	19/8/2021	(13,614)	(13,614)
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	(741,484)	(741,484)
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	(372,054)	(372,054)

金利スワップ 2016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 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	372,676	372,676
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	562,642	562,642
USD 4,423,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.263%の固定金利を支払う	Barclays	11/9/2025	(335,614)	(335,614)
USD 18,442,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.677%の固定金利を支払う	Barclays	5/5/2026	(450,822)	(450,822)
PLN 110,990,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.514%の固定金利を支払う	Barclays	21/12/2026	(841,606)	(841,606)
USD 26,280,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.41684%の固定金利を支払う	Barclays	15/1/2046	(4,731,205)	(4,731,205)
USD 26,280,000	ファンドは2.2272%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	10/2/2046	3,500,636	3,500,636
JPY 2,865,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.27%の固定金利を支払う	Barclays	20/7/2046	1,629,344	1,629,344
USD 34,976,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.7658%の固定金利を支払う	Barclays	16/8/2046	(660,232)	(660,232)
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	(23,373)	(23,373)
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	(209,793)	(209,793)
MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、4.77%の固定金利を支払う	Citibank	5/12/2018	26,715	26,715
MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、4.76%の固定金利を支払う	Citibank	6/12/2018	27,215	27,215
BRL 36,345,190	ファンドは12.75%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2021	335,326	335,326
CNY 52,367,187	ファンドは2.415%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Citibank	16/3/2021	(97,540)	(97,540)
CNY 53,075,400	ファンドは2.505%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Citibank	16/3/2021	(66,848)	(66,848)
BRL 20,137,910	ファンドは12.27%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	97,784	97,784
BRL 14,418,563	ファンドは12.365%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	96,314	96,314
BRL 7,832,501	ファンドは12.75%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	109,595	109,595
MXN 86,921,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	96,558	96,558
MXN 274,683,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、4.5939996%の固定金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(67,410)	(67,410)
COP 6,301,304,088	ファンドは7.02%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Citibank	15/7/2026	51,169	51,169
COP 9,451,956,132	ファンドは7.02%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Citibank	18/7/2026	76,539	76,539

金利スワップ 2016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)
GBP 34,540,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、0.665%の固定金利を支払う	Citigroup	7/9/2025	(95,922)	(95,922)
GBP 72,020,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、0.89%の固定金利を支払う	Citigroup	7/9/2025	(2,078,066)	(2,078,066)
MXN 52,524,131	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	(11,606)	(11,606)
COP 6,221,650,782	ファンドは7%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Credit Suisse	22/7/2026	47,208	47,208
COP 6,221,650,782	ファンドは7.05%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Credit Suisse	22/7/2026	55,062	55,062
USD 5,690,000	ファンドは3ヶ月USD BBA 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	2,769	2,769
KRW 22,575,222,776	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	147,955	147,955
KRW 22,575,222,776	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.69%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	(92,897)	(92,897)
USD 175,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.154%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	22/7/2021	214,906	214,906
MXN 34,297,942	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	(17,489)	(17,489)
MXN 78,885,265	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	(42,472)	(42,472)
MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	(347,793)	(347,793)
USD 3,171,807	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.2555%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/8/2025	(237,763)	(237,763)
SEK 115,000,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、1.5275%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	9/12/2025	(1,260,516)	(1,260,516)
SEK 181,800,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、1.5275%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	9/12/2025	(1,992,711)	(1,992,711)
SEK 114,900,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、1.5275%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	9/12/2025	(1,259,420)	(1,259,420)
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	743,999	743,999
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	390,473	390,473
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	819,562	819,562
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	(45,895)	(45,895)
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	(122,817)	(122,817)
PLN 420,215,000	ファンドは1.775%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	21/12/2018	300,967	300,967
USD 20,820,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.245%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	11/8/2020	(8,888)	(8,888)

金利スワップ 2016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 41,574,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.29%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	31/8/2020	(51,663)	(51,663)
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	175,621	175,621
CNY 111,500,000	ファンドは2.56%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	15/6/2021	(118,119)	(118,119)
USD 19,003,000	ファンドは0.981%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	30/6/2021	(173,533)	(173,533)
USD 175,010,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.0875%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/7/2021	761,216	761,216
EUR 7,380,000	ファンドは0.203%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	1/7/2023	57,800	57,800
EUR 7,380,000	ファンドは0.076%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/7/2023	2,544	2,544
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	(52)	(52)
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	284,189	284,189
EUR 12,070,000	ファンドは0.94%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/12/2025	938,045	938,045
EUR 19,120,000	ファンドは0.941%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/12/2025	1,487,990	1,487,990
EUR 12,070,000	ファンドは0.942%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/12/2025	940,621	940,621
USD 163,170,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6725%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	5/5/2026	(3,880,124)	(3,880,124)
USD 178,827,524	ファンドは1.3765%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	5/7/2026	(654,800)	(654,800)
USD 178,827,523	ファンドは1.3765%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	5/7/2026	(654,800)	(654,800)
USD 23,724,000	ファンドは1.3355%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	15/7/2026	(178,330)	(178,330)
COP 9,913,025,310	ファンドは7.02%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Goldman Sachs	19/7/2026	80,288	80,288
COP 6,608,683,540	ファンドは6.88%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Goldman Sachs	2/8/2026	29,847	29,847
PLN 58,344,641	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.58%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	21/12/2026	(530,123)	(530,123)
USD 3,870,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.1175%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/5/2046	(396,291)	(396,291)
USD 3,866,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.18%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/5/2046	(452,926)	(452,926)
JPY 1,434,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.495%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	12/8/2046	(149,298)	(149,298)
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 Bank Plc	4/1/2021	(45,669)	(45,669)

金利スワップ 2016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 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	81,386	81,386
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	(85,567)	(85,567)
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	(46,248)	(46,248)
PLN 557,985,000	ファンドは1.765%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	21/12/2018	371,879	371,879
BRL 30,055,744	ファンドは12.305%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	4,116	4,116
BRL 57,166,392	ファンドは12.52%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	69,508	69,508
BRL 51,114	ファンドは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	(676)	(676)
BRL 9,435,000	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	JP Morgan	4/1/2021	(61,960)	(61,960)
BRL 33,737,878	ファンドは12.17%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	57,119	57,119
BRL 34,917,848	ファンドは12.235%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	89,219	89,219
BRL 24,880,000	ファンドは12.7375%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	225,236	225,236
BRL 2,871,751	ファンドは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	76,259	76,259
BRL 16,995,037	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	125,256	125,256
HUF 6,843,020,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、2.32%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/9/2026	(818,890)	(818,890)
PLN 170,050,420	ファンドは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	(132,278)	(132,278)
PLN 223,860,000	ファンドは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	(375,356)	(375,356)
PLN 344,590,000	ファンドは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	(955,019)	(955,019)
USD 502,125,000	ファンドは0.9225%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	14/7/2018	(892,435)	(892,435)
PLN 384,970,000	ファンドは1.81%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	21/12/2018	342,763	342,763
USD 204,500,000	ファンドは1.181%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	20/8/2020	(172,551)	(172,551)
USD 502,125,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.325%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	14/7/2021	415,918	415,918
USD 57,780,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.1075%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/7/2021	199,705	199,705
PLN 114,415,000	ファンドは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	2,289,703	2,289,703
MXN 174,450,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIE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	190,446	190,446

金利スワップ 2016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)
PLN 108,905,359	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.611%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/12/2026	(1,066,421)	(1,066,421)
KRW 18,718,014,000	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	UBS	10/2/2017	43,010	43,010
KRW 47,645,854,000	ファンドは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	114,599	114,599
KRW 34,325,686,000	ファンドは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	87,011	87,011
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 5,194,191,435米ドル)				(9,892,828)	(9,892,828)

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 2016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 (16,583,472)	ファンドはMexico (United Mexican States)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	154,487	(55,494)
USD 16,583,472	ファンドはMexico (United Mexican States)に係るデフォルト・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	(86,872)	113,826
EUR 150,000	ファンドはStmicroelectronics NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2020	(1,516)	(489)
EUR 10,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2020	(355)	(241)
EUR 4,510,000	ファンドはKoninklijke DSM NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(14,626)	(166,821)
EUR 825,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(14,223)	21,894
EUR 627,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(10,545)	16,639
USD 7,165,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(244,954)	487,665
EUR 5,050,000	ファンドはWolters Kluwer NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	537	(175,542)
USD 3,960,000	ファンドはRussian Federationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(33,658)	209,142
JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(28,032)	(43,849)
EUR 9,820,000	ファンドはContinental AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(61,293)	(256,350)
EUR 549,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(5,656)	(11,799)
JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(46,284)	(70,159)
USD 43,111	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(458)	(258)
USD 1,880,000	ファンドはTransocean Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2017	32,876	42,918
USD (1,100,000)	ファンドはTransocean Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/3/2020	47,322	(195,436)
USD (3,000,000)	ファンドはChina (Peoples Republic of)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	42,039	17,548
EUR 2,904,000	ファンドはSociete Generale SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(41,503)	(49,340)
JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(23,207)	(19,995)
USD 219,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・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	(8,620)	(1,900)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 438,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・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	(18,584)	(3,800)
EUR 100,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(3,057)	(19,599)
EUR 17,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(421)	(207)
JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corporationに係るデフォルト・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	(23,895)	(43,789)
EUR 16,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(396)	(195)
EUR 17,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(421)	(207)
EUR 17,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(436)	(207)
EUR 46,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(1,030)	(1,110)
EUR 60,000	ファンドはIberdrola International BVに係るデフォルト・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	(1,425)	(1,224)
USD 219,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・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	(10,131)	(1,900)
EUR (2,904,000)	ファンドはBNP Paribas SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2020	31,798	47,938
EUR 72,052	ファンドはStmicroelectronics NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(926)	(235)
EUR 750,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	20/6/2021	(35,047)	(69,466)
USD (42,259,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	69,594	547,134
JPY 115,384,616	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(16,507)	(26,309)
EUR (100,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	20/6/2021	4,734	9,262
EUR 100,000	ファンドはNew Look Senior Issuer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,463)	7,342
EUR 1,500,000	ファンドはKoninklijke KPN NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(2,237)	(22,111)
USD (14,000,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	7,842	181,260
EUR 100,000	ファンドはNew Look Senior Issuer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,463)	7,342
USD 16,770,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(640,276)	1,141,403

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 400,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(4,076)	6,670
EUR (1,780,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	50,251	1,748
USD 18,540,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	80,891	1,261,873
USD 3,500,000	ファンドはRussian Federationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(137,296)	184,848
EUR 880,000	ファンドはBAE Systems PLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(9,773)	(15,412)
USD (21,134,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	463,521	967,450
USD 3,180,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	11,067	216,438
USD 6,360,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	27,457	432,875
EUR (3,400,000)	ファンドはVolkswagen AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	156,820	9,366
USD 10,523,780	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(212,292)	84,163
USD 13,962,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	(285,207)	(639,138)
USD 5,621,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	(4,263)	(257,312)
USD (179,940,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	4,418,379	8,237,106
USD (28,410,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	119,748	367,829
USD 4,050,703	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(53,713)	(24,265)
USD 8,060,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(232,466)	548,581
USD 1,240,435	ファンドはIndonesia (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(30,696)	24,847
USD (8,602,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	192,295	393,773
USD 2,911,148	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(34,651)	(17,439)
USD 7,277,871	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(86,628)	(43,597)
USD 4,366,723	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(53,942)	(26,158)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (300,000)	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	(1,538)	(17,225)
USD 4,050,704	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(50,092)	(24,265)
EUR (600,000)	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	(2,635)	(34,450)
USD 4,585,000	ファンドはVerizon Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	308	(106,740)
USD 2,911,148	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(35,962)	(17,439)
EUR (1,500,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	Barclays	20/6/2021	1,566	25,878
EUR (1,400,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	20/6/2021	40,109	129,669
USD 4,050,703	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(50,092)	(24,265)
USD (83,305,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	166,148	1,078,564
USD (28,570,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	85,859	369,901
USD (42,720,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	80,423	553,103
EUR (600,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	(2,250)	(22,556)
EUR (300,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	(973)	(11,278)
EUR (1,360,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	20/6/2021	38,974	125,965
USD 4,881,200	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(58,433)	(29,240)
EUR 1,920,000	ファンドはVodafone Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	3,181	(15,682)
EUR (1,875,000)	ファンドはAviva Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2021	15,984	(72,227)
USD 4,067,667	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(50,511)	(24,367)
USD 2,050,895	ファンドはThailand (Kingdom of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(12,191)	(14,888)
USD 3,254,133	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(38,947)	(19,493)
EUR (106,383)	ファンドはCNH Industrial NVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2020	2,383	14,175

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 1,500,000	ファンドはBank of America Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(18,085)	(20,388)
EUR 100,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(2,800)	(1,219)
EUR 33,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(555)	(402)
EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(33,408)	(1,585)
USD 1,400,000	ファンドはJP Morgan Chase & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(20,726)	(28,075)
USD 1,500,000	ファンドはMorgan Stanleyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(15,297)	(11,514)
EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(57,053)	(2,805)
USD 1,500,000	ファンドはWells Fargo & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(15,514)	(35,769)
USD 1,500,000	ファンドはJP Morgan Chase & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(24,099)	(30,080)
USD 1,400,000	ファンドはDow Chemical Co/TheIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	792	(14,197)
USD 1,000,000	ファンドはBoyd Gaming Corporationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(50,255)	(116,628)
EUR 100,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(2,669)	(19,599)
USD 455,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(21,006)	(3,948)
USD 1,500,000	ファンドはCitigroup Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(23,021)	(19,843)
EUR 102,000	ファンドはBanco Comercial Portugues SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	14,652	13,115
USD 1,400,000	ファンドはEl du Pont de Nemours & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(2,229)	(32,592)
USD (6,700,000)	ファンドはBrazil Federative (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2021	13,115	(471,261)
EUR 3,700,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(20,019)	194,253
EUR (4,060,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	41,902	70,043
EUR (2,310,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	23,841	39,852
EUR (589,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	6,079	10,161

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (9,000,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	92,887	155,268
USD 1,949,105	ファンドはThailand (Kingdom of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(9,019)	(14,149)
EUR (555,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	5,728	9,575
USD (1,800,000)	ファンドはBHP Billiton Ltdに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2021	48,218	(13,432)
EUR (3,376,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	34,843	58,243
EUR 1,340,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	(14,574)	(124,112)
EUR (570,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2021	(2,551)	(30,268)
EUR (4,625,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	47,734	79,790
EUR (1,360,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	20/6/2021	41,488	125,965
EUR (3,730,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	38,380	64,350
EUR (5,050,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	52,120	87,123
EUR 157,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(3,700)	2,618
USD 2,580,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(48,755)	175,600
EUR 1,606,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(19,091)	(34,515)
USD 4,155,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(141,649)	282,798
EUR 3,730,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	50,869	90,108
USD (27,540,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	BNP Paribas	20/6/2021	(14,102)	356,565
EUR 5,180,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(82,973)	(30,043)
EUR 859,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(11,547)	(15,044)
USD 4,260,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(159,187)	289,945
EUR (400,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2021	(3,590)	(21,241)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 2,180,000	ファンドはKoninklijke KPN NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(3,251)	(32,134)
EUR 846,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(40,731)	1,843
EUR 9,000,000	ファンドはAuchan Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(10,972)	(244,551)
EUR (10,036,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2021	(9,250)	58,206
EUR 3,755,000	ファンドはPernod-Richard SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(36,568)	(92,831)
EUR 2,362,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(56,156)	5,147
EUR 2,590,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(45,919)	(15,021)
EUR 2,880,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	(140,417)	(266,748)
EUR 157,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(3,700)	2,618
USD (32,320,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	BNP Paribas	20/6/2021	(41,945)	418,452
EUR 594,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(10,008)	15,763
EUR 1,300,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	(12,098)	(120,407)
EUR 100,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	(23)	(9,262)
EUR 310,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(7,756)	5,169
EUR 2,270,000	ファンドはGalp Energia SGPS SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(11,006)	(397,936)
EUR (4,540,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	34,420	78,324
EUR 157,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(3,623)	2,618
USD (21,000,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	BNP Paribas	20/6/2021	755	271,890
EUR 1,310,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	BNP Paribas	20/6/2021	(20,168)	(121,333)
EUR 600,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(12,481)	(3,155)
USD 938,629	ファンドはIndonesia (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(20,672)	18,801

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 310,000	ファンドはNumericable Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2016	(657)	(4,852)
EUR (2,900,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2018	(34,436)	239,161
EUR 4,100,000	ファンドはITRAXX.FINSR.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2018	(5,247)	(50,853)
EUR (2,300,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.20.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2018	(24,774)	236,007
EUR 2,900,000	ファンドはITRAXX.FINSR.20.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2018	(4,153)	(40,304)
USD 1,390,000	ファンドはBoyd Gaming Corporation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	(51,533)	(162,554)
EUR 100,000	ファンドはMelia Hotels International SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(2,960)	(19,367)
EUR 333,000	ファンドはBNP Paribas SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(2,617)	(5,497)
USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(44,001)	(52,197)
EUR 163,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(3,504)	(3,935)
USD 500,000	ファンドはBoyd Gaming Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(27,804)	(58,314)
USD 1,600,000	ファンドはChina (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(37,143)	(6,386)
EUR 125,000	ファンドはMelia Hotels International SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(2,251)	(24,208)
EUR 111,026	ファンドはStmicroelectronics NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(1,369)	(362)
USD 500,000	ファンドはBoyd Gaming Corporationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(25,046)	(58,314)
USD 1,300,000	ファンドはBoyd Gaming Corporationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(65,332)	(151,617)
EUR 73,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(2,454)	(1,762)
EUR 81,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(3,358)	(1,955)
EUR 200,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	4,036	19,646
USD 140,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(4,611)	9,529
EUR (600,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	15,814	(22,556)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 5,770,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(82,192)	(162,428)
USD (8,400,000)	ファンドはBrazil Federative (Republic of)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	20/6/2021	(11,900)	(590,835)
EUR 411,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(6,153)	(7,198)
USD 1,207,568	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(22,466)	9,657
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	2,983	(58,830)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	5,473	(58,830)
USD (400,000)	ファンドはBrazil Federative (Republic of)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	20/6/2021	(458)	(28,135)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(2,354)	(58,830)
EUR (1,300,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	27,936	(48,872)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	501	(58,830)
EUR 600,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(9,885)	(6,415)
USD 2,550,000	ファンドはPrudential Financial Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(30,778)	9,266
USD 4,404,500	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(132,158)	299,780
EUR 1,875,000	ファンドはAegon NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(7,410)	76,662
EUR 200,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(7,063)	1,149
USD 7,000,000	ファンドはChile (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(65,341)	(80,660)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(7,221)	(58,830)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(4,762)	(58,830)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	5,473	(58,830)
USD 4,651,666	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(53,580)	(27,865)
USD 3,958,111	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(48,895)	(23,711)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (2,660,000)	ファンドはBNP Paribas SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	19,848	41,728
USD (272,090)	ファンドはMalaysia (Federation of)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	20/6/2021	4,280	(2,176)
EUR 2,660,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(23,120)	(28,440)
USD (1,800,000)	ファンドはBHP Billiton Ltd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	20/6/2021	50,634	(13,432)
EUR (2,660,000)	ファンドはCredit Suisse Group AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	17,060	(32,603)
EUR 2,660,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(38,063)	(13,986)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	5,473	(58,830)
USD 1,119,712	ファンドはThailand (Kingdom of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(6,207)	(8,128)
USD 1,133,000	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	5,473	(58,830)
EUR (5,770,000)	ファンドはVolkswagen AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	122,665	15,895
EUR 589,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(12,437)	(13,655)
EUR 50,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	935	4,911
USD 8,710,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	41,649	592,822
USD 422,760	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(4,548)	28,774
EUR (270,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	1,957	(14,338)
EUR (810,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	17,213	(30,451)
USD (20,607,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	270,622	943,326
USD (20,612,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	273,207	943,555
EUR 200,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(2,825)	(18,524)
EUR 2,570,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(53,885)	(14,905)
EUR 1,100,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(41,496)	(101,883)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (28,369,944)	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2021	(30,295)	164,539
EUR 2,694,657	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	10,978	(249,582)
EUR 2,800,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(18,942)	(259,339)
EUR 1,480,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(20,220)	(8,584)
EUR 1,400,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(44,708)	(129,669)
EUR 2,800,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(18,942)	(259,339)
EUR 2,589,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(49,492)	(15,016)
EUR 2,880,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(106,621)	(266,748)
EUR 2,610,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(41,128)	(15,137)
EUR 100,000	ファンドはITRAXX.EUR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(123)	(1,725)
EUR 750,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(37,280)	(69,466)
EUR 1,440,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(23,112)	(133,374)
USD (14,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	28,455	640,877
USD (20,607,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	294,090	943,326
EUR (2,690,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2021	7,938	15,601
EUR (17,233,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	20/6/2021	40,029	297,304
EUR 100,000	ファンドはITRAXX.EUR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(94)	(1,725)
EUR (1,375,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	20/6/2021	2,527	23,722
EUR (100,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2021	454	580
USD (12,903,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	303,927	590,660
USD (12,903,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	252,315	590,660

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 564,555	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(9,051)	(52,290)
USD 18,538,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(148,561)	(848,613)
EUR 2,900,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(38,187)	(268,601)
EUR 1,300,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(17,707)	(120,407)
EUR 2,590,000	ファンドはITRAXX.EUR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(2,972)	(44,683)
EUR 1,700,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(53,883)	(157,456)
EUR 300,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2016	(2,799)	(4,737)
EUR 60,000	ファンドはNew Look Senior Issuer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2020	4,714	3,566
EUR 85,714	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2020	1,510	(4,874)
EUR 114,286	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2020	2,165	(6,498)
EUR 140,000	ファンドはNew Look Senior Issuer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2020	10,413	8,320
USD (83,200,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	(50,586)	1,077,204
EUR 240,000	ファンドはPizzaexpress Financing 1 Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(3,332)	14,481
USD (56,780,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	159,130	735,140
USD (83,070,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	(115,108)	1,075,521
USD (83,200,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	(23,725)	1,077,204
USD (70,719,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	196,073	915,611
USD (56,740,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	144,864	734,622
EUR 120,000	ファンドはTechem GmbHに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(1,315)	(23,751)
EUR (728,000)	ファンドはGlencore International AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2021	99,917	(51,793)
EUR 1,330,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Credit Suisse	20/6/2021	(14,346)	(123,186)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (28,330,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	83,227	366,793
EUR 4,625,000	ファンドはITV PLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(60,671)	(980,145)
USD (28,420,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	131,389	367,958
USD (20,607,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	313,668	943,326
USD (20,270,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	345,249	927,899
USD 20,542,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Credit Suisse	20/6/2021	(225,002)	(940,350)
USD (20,597,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	20/6/2021	236,276	942,868
USD (56,450,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	136,839	730,868
USD (56,450,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	177,840	730,868
USD (7,000,000)	ファンドはBrazil Federative (Republic of)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	20/6/2021	75,114	(492,363)
USD (138,420,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	(62,466)	1,792,147
EUR 180,000	ファンドはTechem GmbHに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2021	(3,133)	(35,627)
USD (70,078,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	218,981	907,312
USD (28,132,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	92,970	364,230
USD 14,197,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Credit Suisse	20/6/2021	(430,494)	(649,896)
USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	38,785	(15,709)
USD 2,220,000	ファンドはCMBX.NA.8.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/10/2057	(36,546)	62,532
USD 1,350,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Credit Suisse	11/5/2063	20,284	106,509
USD 300,000	ファンドはMacquarie Bank Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2020	(12,048)	8,265
EUR 250,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Deutsche Bank	20/6/2021	(3,599)	(23,155)
USD 1,229,350	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2021	(26,487)	9,832

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 5,321,511	ファンドはNational Australia Bank Limitedに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2021	(134,533)	(84,154)
USD 7,616,790	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Deutsche Bank	20/6/2021	6,238	(348,674)
EUR 100,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Deutsche Bank	20/6/2021	76	(9,262)
USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	31,671	(93,935)
USD (1,090,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	26,333	(90,610)
EUR (110,000)	ファンドはScandinavian Airlines Systemに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2017	1,868	(2,290)
EUR (410,000)	ファンドはScandinavian Airlines Systemに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2019	13,011	(24,929)
USD (3,000,000)	ファンドはChina (Peoples Republic of)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	43,460	17,548
USD 2,700,000	ファンドはHome Depot Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,412)	(90,206)
JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(21,854)	(24,912)
JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,701)	(21,703)
USD 3,600,000	ファンドはHome Depot Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	3,344	(120,275)
USD 700,000	ファンドはChina (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(11,415)	(2,794)
EUR 175,000	ファンドはMelia Hotels International SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(3,867)	(33,892)
JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,471)	(21,703)
USD 3,600,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(18,346)	(71,358)
JPY 87,976,539	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,153)	(21,703)
JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(41,241)	(49,823)
JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corporationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,070)	(26,993)
JPY 96,070,381	ファンドはItochu Corporationに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,364)	(23,699)
USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	177,378	10,052

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(19,930)	(2,076)
EUR 300,000	ファンドはCredit Suisse AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	1,370	2,530
EUR 60,000	ファンドはMonitchem Holdco 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(1,271)	(3,412)
USD 2,700,000	ファンドはHome Depot Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(10,031)	(90,206)
EUR 167,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(7,000)	(4,032)
EUR (100,000)	ファンドはCNH Industrial NVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	3,416	13,773
EUR 1,327,000	ファンドはElectricite de France SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(6,151)	(21,743)
EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(10,444)	(38,921)
EUR 267,000	ファンドはLouis Dreyfus Commodities BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(37,031)	(23,213)
USD 6,815,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	15,176	463,844
USD 11,320,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	15,885	(518,195)
USD 8,268,500	ファンドはCDX.NA.HY.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	10,187	(378,507)
EUR 454,000	ファンドはGalp Energia SGPS SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(5,448)	(79,587)
USD (12,925,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Goldman Sachs	20/6/2021	324,838	591,667
EUR 440,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(22,064)	24,144
USD (2,700,000)	ファンドはBHP Billiton Ltd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	20/6/2021	68,700	(20,148)
EUR (18,185,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Goldman Sachs	20/6/2021	(189,225)	1,684,312
USD (20,227,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Goldman Sachs	20/6/2021	399,130	925,930
EUR 680,000	ファンドはGalp Energia SGPS SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(8,222)	(119,206)
EUR 2,985,000	ファンドはUCB SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(19,157)	(693,174)
EUR (2,700,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Goldman Sachs	20/6/2021	15,249	250,077

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 (137,143)	ファンドはWind Acquisition Finance SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	12,062	17,502
EUR 1,440,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(11,388)	(25,219)
EUR (859,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	27,244	844
USD (83,172,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	(34,724)	1,076,842
EUR (2,180,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	2,529	37,609
EUR (411,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	13,789	404
USD 4,160,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(155,749)	283,139
USD (56,125,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	(52,934)	726,660
USD (83,149,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2021	(78,422)	1,076,544
USD 18,780,000	ファンドはCDX.NA.HY.26.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(83,192)	(859,691)
USD (20,271,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Goldman Sachs	20/6/2021	393,916	927,945
EUR 4,200,000	ファンドはVodafone Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(19,216)	(34,305)
USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(29,930)	15,709
USD (2,050,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	78,659	(137,164)
USD (5,750,000)	ファンドはIndonesia (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	HSBC Bank Plc	20/12/2020	333,735	(74,155)
USD 2,705,953	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(53,904)	21,640
EUR 1,700,000	ファンドはITRAXX.XO.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(56,250)	(157,456)
USD 1,290,625	ファンドはIndonesia (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(24,620)	25,852
EUR 2,800,000	ファンドはITRAXX.XO.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	20,733	(259,339)
EUR (100,000)	ファンドはITRAXX.XO.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	3,761	9,262
EUR (675,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(172)	11,645

クレジット・デフォルト・スワップ 2016年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 4,530,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(172,569)	308,322
EUR 2,900,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(54,784)	(268,601)
USD 1,803,969	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(36,280)	14,427
EUR 1,440,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(69,523)	(133,374)
EUR (4,655,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	5,588	80,308
EUR (2,641,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(675)	45,563
EUR (1,360,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	11,791	23,463
EUR (910,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	7,766	15,699
EUR (1,600,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(409)	27,603
EUR (9,820,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(2,510)	169,415
EUR (2,455,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(627)	42,354
EUR (4,510,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(1,153)	77,806
EUR 2,900,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(13,321)	(268,601)
EUR (379,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(97)	6,539
USD 4,615,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(170,475)	314,107
EUR 2,595,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(49,304)	(15,050)
USD 11,985,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	57,309	815,725
EUR 750,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(23,662)	(69,466)
EUR 1,440,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(68,836)	(133,374)
EUR (5,830,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(1,490)	100,579
USD 16,583,472	ファンドはMexico (United Mexican States)に係るデフォルト・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	(86,664)	55,494

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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)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	117,772	(113,826)
USD 5,400,000	ファンドはHome Depot Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(4,309)	(180,412)
EUR 5,115,000	ファンドはCompagnie De Saint Gobain SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(7,068)	(111,352)
USD 2,800,000	ファンドはBarrick Gold Corporationに係るデフォルト・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	(77,057)	24,753
EUR 240,000	ファンドはIberdrola International BVに係るデフォルト・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	(5,480)	(4,897)
USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(44,746)	(51,717)
USD 825,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・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	(28,507)	(7,158)
USD 637,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(29,409)	(5,527)
USD 1,500,000	ファンドはBoeing Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	187	(44,661)
EUR 187,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(6,956)	(4,514)
USD 392,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・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	(16,632)	(3,401)
USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(49,980)	(50,909)
USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(46,831)	(61,333)
EUR 200,000	ファンドはStatoil ASAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(7,342)	(5,157)
EUR 100,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(2,789)	(19,599)
USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(29,939)	(40,484)
USD 1,500,000	ファンドはBoeing Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	839	(44,661)
USD 1,500,000	ファンドはDow Chemical Company/Theに係るデフォルト・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	(16,589)	(15,211)
USD 1,500,000	ファンドはEi Du Pont De Nemours & Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(16,063)	(34,920)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 167,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(7,159)	(4,032)
USD 4,500,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(117,281)	(91,242)
USD 3,600,000	ファンドはAutozone Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(7,969)	(109,492)
USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Limitedに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(47,369)	(50,890)
USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(48,601)	(59,474)
JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(25,704)	(20,299)
EUR 300,000	ファンドはSynlab Unsecured Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(13,960)	(31,183)
EUR 160,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(4,003)	2,668
EUR (2,700,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	JP Morgan	20/6/2021	14,828	250,077
USD 2,814,400	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(78,727)	(45,419)
USD 10,295,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(340,056)	700,700
USD (20,612,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	JP Morgan	20/6/2021	277,329	943,555
EUR 4,703,000	ファンドはElectricite de France SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(14,747)	(77,058)
EUR 2,000,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(36,285)	53,075
USD 1,440,144	ファンドはThailand (Kingdom of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(9,955)	(10,454)
EUR (900,000)	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	17,407	(13,314)
USD 1,440,144	ファンドはThailand (Kingdom of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(9,298)	(10,454)
EUR 2,200,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	3,921	337,895
EUR 160,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(4,003)	2,668
EUR 596,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(8,560)	15,816

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 858,000	ファンドはLloyds Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(14,715)	22,769
USD 9,815,000	ファンドはVerizon Communications Incに 係るデフォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(1,328)	(228,496)
USD 3,600,000	ファンドはVerizon Communications Incに 係るデフォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(2,178)	(83,809)
EUR 2,700,000	ファンドはITRAXX.X0.25.V1に係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、5%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(57,417)	(250,077)
USD 1,296,224	ファンドはPhilippines (Republic of)に 係るデフォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(15,451)	(7,765)
JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(11,766)	(21,925)
USD (2,700,000)	ファンドはBHP Billiton Ltd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	20/6/2021	75,951	(20,148)
EUR 320,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(2,402)	(5,604)
EUR (630,000)	ファンドRolls-Royce Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固 定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	12,337	619
EUR (1,100,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	JP Morgan	20/6/2021	31,138	101,883
JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(27,126)	(43,849)
USD 607,271	ファンドはIndonesia (Republic of)に係 るデフォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(12,864)	12,164
USD (10,305,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	JP Morgan	20/6/2021	138,823	471,732
EUR (680,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固 定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	11,102	668
JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(13,563)	(21,925)
EUR 4,775,000	ファンドはCompagnie De Saint Gobain SA に係るデフォルト・プロテクションを受け 取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(13,869)	(99,070)
USD 18,938,000	ファンドはPhilippines (Republic of)に 係るデフォルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(253,816)	(113,446)
EUR 680,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、1%の 固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(5,808)	(11,909)
EUR (460,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、1%の固 定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	10,864	452
USD (10,302,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	JP Morgan	20/6/2021	123,959	471,594
EUR (13,565,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデ フォルト・プロテクションを提供し、1% の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2021	(26,306)	78,674

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 230,000	ファンドはBAE Systems Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(2,317)	(4,028)
EUR 2,641,000	ファンドはLanxess AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(52,767)	(61,228)
USD 3,739,171	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(43,124)	(22,399)
EUR 200,000	ファンドはLadbrokes Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	(11,694)	12,891
USD 590,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/9/2058	(33,931)	49,046
USD (522,175)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	22,517	(43,408)
USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	8,360	52,860
USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	8,360	52,860
EUR (18,186,000)	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Merrill Lynch	20/6/2021	(151,775)	1,684,405
EUR 2,606,000	ファンドはITRAXX.FINSR.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2021	(50,042)	(15,114)
EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(17,634)	(821)
USD 415,000	ファンドはHalliburton Companyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(15,489)	(3,601)
USD 553,160	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2021	(12,156)	4,424
USD (7,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Morgan Stanley	20/6/2021	25,428	320,439
USD (20,227,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	Morgan Stanley	20/6/2021	399,130	925,930
USD 850,000	ファンドはPrudential Financial Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2021	(7,672)	3,089
USD (270,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/10/2057	5,826	(18,065)
USD 1,700,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(78,783)	141,319
USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	11/5/2063	11,962	52,860
EUR (2,270,000)	ファンドはITRAXX.EUR.25.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	Societe Generale	20/6/2021	(796)	39,162
EUR 2,455,000	ファンドはHeidelbergcement AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Societe Generale	20/6/2021	(47,693)	(517,094)

クレジット・デフォルト・スワップ 2016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 1,136,000	ファンドはGalp Energia SGPS SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Societe Generale	20/6/2021	3,590	(199,144)
EUR 150,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Societe Generale	20/6/2021	(2,048)	(13,893)
EUR 400,000	ファンドはITRAXX.X0.25.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	Societe Generale	20/6/2021	(5,462)	(37,048)
EUR 200,000	ファンドはNew Look Senior Issuer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Societe Generale	20/6/2021	16,914	14,684
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,179,451,490米ドル)				3,630,094	36,104,578

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 2016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 (26,835)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR- 30bpsを受け取り、Lyondellbasell Industries NVを支払う	Bank of America	15/12/2016	(83,119)	(83,119)
USD (33,959)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR- 30bpsを受け取り、Lyondellbasell Industries NVを支払う	Bank of America	15/12/2016	(152,544)	(152,544)
USD (25,000)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR- 30bpsを受け取り、Chevron Corpを支払う	Bank of America	15/12/2016	17,555	17,555
USD (44,123)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 115bpsを受け取り、BHP Billiton Ltdを支払う	Bank of America	30/12/2016	(83,392)	(83,392)
USD 10,603,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yieldを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Citibank	20/9/2016	620,435	619,307
USD 11,000,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yieldを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Citibank	20/9/2016	608,690	605,352
USD 7,541,857	ファンドはIOS 2014 FN 30YR FR 3.5% Indexを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2045	4,072	4,072
USD 7,388,136	ファンドはIOS 2014 FN 30YR FR 3.5% Indexを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2045	(3,961)	(3,962)
USD 7,695,578	ファンドはIOS 2014 FN 30YR FR 3.5% Indexを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2045	(4,126)	(4,126)
USD 7,541,857	ファンドはIOS 2014 FN 30YR FR 3.5% Indexを受け取り、1ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Credit Suisse	12/1/2045	4,044	4,044
USD 10,933,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yieldを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2016	733,149	731,915
GBP 4,800,000	ファンドはIBOXX GBP Corporate Indexを受け取り、3ヶ月GBP BBA LIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/12/2016	(44,074)	(48,069)
USD 10,934,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yieldを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2016	733,216	731,981
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 91,215,376米ドル)				2,349,945	2,339,014

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 2016年8月31日現在

コールの対象 となる契約数	発行体 / 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)
(67,822,500)	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7	28/9/2016	297,198	(11,801)
(27,480,000)	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.35	27/10/2016	(32,262)	(128,634)
(25,600,000)	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.37	19/12/2016	(48,555)	(175,130)
(4,960,000)	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 67.6	6/9/2016	74,430	(5,997)
(8,880,000)	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.34	9/9/2016	67,897	(5,541)
(12,940,000)	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 109	9/9/2016	35,650	(2,265)
(35,480,000)	OTC USD/HKD	BNP Paribas	USD 8	27/9/2016	109,633	(355)
(11,145,000)	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 106	29/9/2016	(12,327)	(73,546)
(30,930,000)	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,160	15/11/2016	5,567	(276,700)
(42,800,000)	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0.9	18/11/2016	11,019	(136,071)
(22,000,000)	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.95	19/12/2016	(3,333)	(92,576)
(8,880,000)	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.31	9/9/2016	95,895	(55,953)
(34,200,000)	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 106.5	15/9/2016	(4,309)	(47,401)
(13,550,000)	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.7	23/9/2016	89,837	(62,059)
(14,000,000)	OTC EUR/CHF	Deutsche Bank	EUR 1.15	27/9/2016	86,778	(1,981)
(67,822,500)	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 7	28/9/2016	300,182	(11,801)
(18,300,000)	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.37	27/10/2016	82,442	(46,573)
(43,085,000)	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.37	3/11/2016	398,019	(132,788)
(21,250,000)	OTC EUR/PLN	Deutsche Bank	EUR 4.45	15/11/2016	(36,169)	(143,215)
(23,580,000)	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1.1	6/12/2016	207,645	(9,998)
(13,138,000)	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 7.1	15/12/2016	126,348	(26,053)
(68,895,000)	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 7	28/9/2016	315,884	(11,988)
(4,740,000)	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.5	20/10/2016	5,461	(32,189)
(12,990,000)	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20	27/10/2016	76,200	(70,367)
(16,120,000)	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20	8/11/2016	(25,679)	(125,430)
(12,750,000)	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20	16/11/2016	(40,201)	(122,999)
(42,500,000)	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.8	16/11/2016	(566,831)	(1,283,415)
(13,550,000)	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.8	23/9/2016	43,869	(13,983)
(13,550,000)	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.7	23/9/2016	66,124	(62,059)
(36,100,000)	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7	23/9/2016	161,042	(5,018)
(53,850,000)	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.7	28/9/2016	333,170	(274,527)
(16,120,000)	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,170	20/10/2016	21,980	(66,592)
(20,620,000)	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,200	15/11/2016	135,267	(79,593)
(4,170,000)	OTC USD/RUB	Societe Generale	USD 66.5	7/10/2016	36,646	(59,681)
(4,400,000)	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.1	27/9/2016	58,184	(14,141)
(4,997)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	21/9/2016	330,493	(374,775)
(10,383)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	21/9/2016	90,911	(389,362)
(217)	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 19,000	9/9/2016	507,969	(2,100)
(348)	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 17,250	9/9/2016	(27,049)	(168,376)
(425)	Pioneer Natural Resources Co	Exchange Traded	USD 195	16/9/2016	14,127	(35,062)
(1,700)	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 142	16/9/2016	87,009	(2,550)
(14,110)	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 140	30/9/2016	1,859,655	(112,880)
(7,045)	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 130	20/1/2017	1,406,595	(2,254,400)

売建コール・オプション 2016年8月31日現在(続き)

コールの対象 となる契約数	発行体/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)
(380)	United Continental Holdings Inc	Exchange Traded	USD 53	16/9/2016	8,853	(15,770)
(680)	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 132	2/9/2016	62,764	(31,875)
(85)	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 133	23/9/2016	1,205	(6,641)
(340)	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 132	23/9/2016	(16,549)	(85,000)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 212,369,897米ドル)					6,798,684	(7,147,211)

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 2016年8月31日現在

プットの対象 となる契約数	発行体/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)
(34,000,000)	OTC GBP/USD	Barclays	GBP 1.24	14/10/2016	80,624	(60,610)
(34,000,000)	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.71	19/12/2016	(82,919)	(213,466)
(4,960,000)	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 66.6	6/9/2016	(35,122)	(106,798)
(17,000,000)	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 62.5	9/9/2016	40,426	(14,450)
(17,000,000)	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 100	16/9/2016	118,303	(22,610)
(14,980,000)	OTC USD/RUB	Credit Suisse	USD 63.5	29/9/2016	13,332	(53,973)
(8,930,000)	OTC EUR/CHF	Credit Suisse	EUR 1.05	25/10/2016	28,953	(11,534)
(110,000,000)	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.24	10/10/2016	227,424	(153,731)
(111,555,000)	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.1	13/10/2016	(290,766)	(715,532)
(137,500,000)	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.24	18/11/2016	323,418	(733,357)
(84,190,000)	OTC AUD/USD	HSBC Bank Plc	AUD 0.745	9/9/2016	122,504	(263,120)
(9,200,000)	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 117.5	30/9/2016	(583,096)	(1,277,328)
(12,977,000)	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.69	7/10/2016	41,107	(4,601)
(17,000,000)	OTC USD/RUB	JP Morgan	USD 60	8/11/2016	12,937	(37,995)
(8,060,000)	OTC USD/INR	Morgan Stanley	USD 66.5	10/11/2016	9,164	(27,340)
(4,170,000)	OTC USD/RUB	Societe Generale	USD 65	7/10/2016	14,308	(48,660)
(4,400,000)	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.08	27/9/2016	63,980	(8,345)
(68,400,000)	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.24	18/11/2016	145,200	(364,812)
(4,470,000)	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.05	25/1/2017	17,291	(27,117)
(552)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 13	21/9/2016	14,295	(9,660)
(1,129)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 13.5	21/9/2016	(12,645)	(45,160)
(3,053)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 14	21/9/2016	65,267	(198,445)
(1,385)	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 14	19/10/2016	(21,052)	(62,325)
(1,389)	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 200	16/12/2016	21,243	(367,390)
(330)	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 129.5	23/9/2016	(479)	(61,875)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 154,583,788米ドル)					333,697	(4,890,234)

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 2016年8月31日現在

プットの対象 となる契約数	発行体 / 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)
84,190,000	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.745	9/9/2016	(289,641)	263,120
17,000,000	OTC USD/JPY	Barclays	USD 100	16/9/2016	(11,390)	22,610
17,000,000	OTC GBP/USD	Barclays	GBP 1.21	14/10/2016	(15,465)	10,354
17,000,000	OTC GBP/USD	Barclays	GBP 1.27	14/10/2016	(87,607)	89,155
17,000,000	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.69	19/12/2016	21,205	58,110
17,000,000	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.75	19/12/2016	121,066	321,221
8,500,000	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 64	9/9/2016	(72,820)	15,147
8,500,000	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 61.5	9/9/2016	(9,486)	4,862
17,000,000	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 96	16/9/2016	(11,781)	2,686
4,400,000	OTC EUR/CHF	BNP Paribas	EUR 1.08	27/9/2016	(54,191)	8,345
5,210,000	OTC GBP/USD	Citibank	GBP 1.305	6/9/2016	1,525	25,290
15,000,000	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.6	19/12/2016	(20,841)	72,300
9,980,000	OTC USD/RUB	Credit Suisse	USD 65	29/9/2016	(25,868)	106,946
8,930,000	OTC EUR/CHF	Credit Suisse	EUR 1.05	25/10/2016	(6,420)	11,533
44,475,000	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.73	6/9/2016	(35,068)	15,767
55,000,000	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.2	10/10/2016	(35,869)	17,866
55,000,000	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.27	10/10/2016	(246,053)	245,437
91,780,000	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 99	19/10/2016	(283,508)	518,649
68,750,000	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.27	18/11/2016	(294,385)	736,419
68,750,000	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.2	18/11/2016	(84,600)	138,225
111,555,000	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.1	15/12/2016	339,091	1,548,040
13,230,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.5	28/9/2016	(85,823)	86,908
12,977,000	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.69	7/10/2016	(20,264)	4,601
4,740,000	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.22	20/10/2016	(5,736)	73,484
9,200,000	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 115	30/9/2016	522,008	1,056,160
17,305,000	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.72	7/10/2016	(115,015)	37,797
17,000,000	OTC USD/RUB	JP Morgan	USD 62	8/11/2016	(83,147)	55,845
14,660,000	OTC USD/INR	Morgan Stanley	USD 67.8	10/11/2016	(21,096)	163,547
34,200,000	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.27	18/11/2016	(130,372)	366,335
34,200,000	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.2	18/11/2016	(35,459)	68,761
506	Bovespa Index	Bank of America	BRL 65,000	28/7/2017	(71,249)	765,234
40,000,000	KOSPI 200 Index	Citibank	KRW 244.2945	8/9/2016	(52,104)	1,425
506	Bovespa Index	Citibank	BRL 65,000	28/7/2017	(47,773)	765,234
1,129	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	21/9/2016	122,835	338,700
1,385	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	19/10/2016	73,899	294,312
1,250	Chevron Corp	Exchange Traded	USD 97.5	16/9/2016	(179,513)	63,125
149	Euro Stoxx 50	Exchange Traded	EUR 3,000	16/9/2016	(80,203)	42,921
62	Euro Stoxx 50	Exchange Traded	EUR 3,025	16/9/2016	(24,910)	23,594
49	Euro Stoxx 50	Exchange Traded	EUR 3,000	21/10/2016	(21,133)	36,693
695	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 210	21/10/2016	(20,294)	141,085
695	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 210	18/11/2016	(16,124)	227,960
1,199	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131	23/9/2016	(95,410)	749,375
330	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 130.5	23/9/2016	(3,056)	141,797
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 299,143,971米ドル)					(1,492,045)	9,736,975

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 2016年8月31日現在

コールの対象 となる契約数	発行体 / 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)
50,060,000	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.7	28/9/2016	(286,073)	255,206
18,300,000	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.37	27/10/2016	22,052	46,574
14,280,000	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.32	27/10/2016	13,098	156,238
49,655,000	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.8	4/11/2016	(312,231)	217,638
17,000,000	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.32	19/12/2016	74,629	290,836
8,880,000	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.31	9/9/2016	(74,850)	55,953
12,940,000	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 105	9/9/2016	(108,580)	27,148
4,400,000	OTC EUR/CHF	BNP Paribas	EUR 1.1	27/9/2016	(15,871)	14,140
35,480,000	OTC USD/HKD	BNP Paribas	USD 7.8	27/9/2016	(146,178)	2,838
11,145,000	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 103.5	29/9/2016	25,522	164,667
8,500,000	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.8	4/11/2016	(49,104)	37,255
20,620,000	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,130	15/11/2016	8,269	339,385
34,200,000	OTC EUR/GBP	BNP Paribas	EUR 0.88	18/11/2016	(24,453)	241,049
8,820,000	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,115	2/9/2016	(40,890)	45,017
4,960,000	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 67.6	6/9/2016	(18,258)	5,997
8,880,000	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.34	9/9/2016	(62,835)	5,541
17,100,000	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 108	15/9/2016	1,180	10,243
17,100,000	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 104.5	15/9/2016	3,335	79,429
13,550,000	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.8	23/9/2016	(59,728)	13,984
50,060,000	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.7	28/9/2016	(281,050)	255,206
4,170,000	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 66.5	7/10/2016	(22,593)	59,681
13,200,000	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.32	27/10/2016	(40,907)	144,421
32,315,000	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.32	3/11/2016	(339,889)	382,997
17,000,000	OTC EUR/PLN	Deutsche Bank	EUR 4.35	15/11/2016	57,553	262,429
23,580,000	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1.05	6/12/2016	(387,419)	39,143
10,105,714	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 1.1	6/12/2016	(21,283)	4,285
13,138,000	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.75	15/12/2016	(143,585)	144,794
50,595,000	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.7	28/9/2016	(318,361)	257,933
8,900,000	OTC USD/TWD	Goldman Sachs	USD 31	7/10/2016	146,903	208,580
12,990,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19.15	27/10/2016	(95,840)	213,751
9,470,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19	14/11/2016	21,790	232,773
34,000,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.4	16/11/2016	637,194	1,443,198
7,970,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.75	16/11/2016	107,066	251,485
36,100,000	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7	23/9/2016	(31,032)	5,018
27,100,000	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.7	23/9/2016	(166,665)	124,118
14,000,000	OTC EUR/CHF	HSBC Bank Plc	EUR 1.15	27/9/2016	(188,130)	1,981
73,235,000	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 7	28/9/2016	(98,208)	12,743
8,050,000	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,135	20/10/2016	(25,293)	86,715
20,620,000	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,160	15/11/2016	(220,098)	184,466
48,000	Taiwan Stock Exchange Weighted Index	Citibank	TWD 9,243.75	21/9/2016	(7,775)	45,614
340	Abbvie Inc	Exchange Traded	USD 67.5	18/11/2016	(28,968)	33,660
138	Amgen Inc	Exchange Traded	USD 175	21/10/2016	(16,243)	40,641
3,569	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 18	21/9/2016	(173,021)	178,450
1,269	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	21/9/2016	(4,501)	76,140
552	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 24	21/9/2016	(18,209)	11,040

買建コール・オプション 2016年8月31日現在(続き)

コールの対象 となる契約数	発行体 / 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)
634	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 50	21/10/2016	18,110	63,083
207	Gilead Sciences Inc	Exchange Traded	USD 82.5	21/10/2016	(38,854)	23,080
634	Morgan Stanley	Exchange Traded	USD 33	21/10/2016	15,089	55,792
319	Mylan NV	Exchange Traded	USD 52.5	21/10/2016	(52,214)	1,755
805	Netflix Inc	Exchange Traded	USD 110	16/9/2016	(52,670)	9,660
220	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 16,875	9/9/2016	176,737	393,846
217	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 18,000	9/9/2016	(1,026,713)	4,200
425	Pioneer Natural Resources Co	Exchange Traded	USD 190	16/9/2016	(6,247)	62,688
32,511	SPDR Barclays High Yield Bond ETF	Exchange Traded	USD 36	16/9/2016	1,261,427	2,275,770
15,797	SPDR Barclays High Yield Bond ETF	Exchange Traded	USD 35	16/9/2016	1,726,610	2,645,997
1,960	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 125	16/9/2016	(759,779)	302,820
1,700	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 135	16/9/2016	(222,190)	7,650
14,110	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 135	30/9/2016	(3,057,637)	303,365
11,849	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 130	30/9/2016	(2,911,299)	847,203
425	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 135	20/1/2017	(91,460)	84,788
4,807	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 220	16/9/2016	(351,872)	264,385
354	Twitter Inc	Exchange Traded	USD 20	23/9/2016	(6,548)	28,320
973	Twitter Inc	Exchange Traded	USD 24	16/12/2016	(71,224)	82,705
4,718	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131.5	2/9/2016	(1,020,206)	663,469
340	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131.5	2/9/2016	(61,587)	45,156
1,539	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 131	23/9/2016	(154,882)	997,946
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 744,686,752米ドル)					(9,396,939)	15,874,078

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2016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 586,021,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4/1/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4/4/2017より1.18%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	30/9/2016	(2,349)	2,683,390
USD 126,450,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/2/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、22/5/2017より1.58%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	18/11/2016	(372,200)	965,572
USD 321,400,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2%の固定金利を17/4/2017より半年ごとに受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/1/2017より四半期毎に支払う。	Barclays	13/10/2016	(465,709)	1,060,941
USD 347,434,000	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23/4/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/7/2017より1.4%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	19/1/2017	(160,167)	1,933,123
USD 170,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、6/3/2017より1.8%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	2/9/2016	(174,558)	-
USD 63,985,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/3/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、5/6/2017より1.23%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	1/12/2016	(44,056)	437,337
USD 63,985,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.23%の固定金利を5/6/2017より半年ごとに受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/3/2017より四半期毎に支払う。	Citibank	1/12/2016	(4,530)	466,451
USD 136,020,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/4/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、30/7/2017より1.8%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	26/1/2017	(685,677)	932,961
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	(999,310)	(999,309)
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	2,176,345	2,176,345

買建スワップション 2016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 13,900,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/3/2017より1.65%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	26/9/2016	(19,727)	12,938
USD 42,400,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、28/3/2017より1.65%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	26/9/2016	(48,675)	50,965
USD 279,830,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/3/2017より1.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	6/9/2016	(1,268,419)	18,799
USD 112,025,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/3/2017より1.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	6/9/2016	(362,157)	7,526
USD 155,150,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/12/2016より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/3/2017より1.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	6/9/2016	(621,813)	10,423
JPY 2,146,565,000	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14/4/2017より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、14/4/2017より0.605%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/10/2016	(312,618)	81,301
USD 209,577,000	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21/2/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/5/2017より1.315%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	17/11/2016	(1,524,307)	926,121
USD 209,577,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.315%の固定金利を21/5/2017より半年ごとに受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/2/2017より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	17/11/2016	(203,801)	1,931,042
USD 93,072,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/4/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/7/2017より1.85%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	13/1/2017	(324,914)	475,505
USD 140,170,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/4/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、31/7/2017より1.8%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/1/2017	(532,085)	967,734

買建スワップション 2016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)
AUD 34,830,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/8/2017より6ヶ月AUD Australian Bank Bill Rateの変動金利を半年毎に受け取り、31/8/2017より2.37%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/2/2017	(50,309)	196,048
EUR 5,400,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/6/2016よりITRAXX.XO.25.V1の変動金利を四半期毎に受け取り、21/9/2016より5%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/9/2016	(124,513)	3,559
USD 10,910,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは26/8/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、26/11/2021より2.42%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	24/5/2021	(561,341)	947,512
USD 10,910,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.42%の固定金利を26/11/2021より半年ごとに受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を26/8/2021より四半期毎に支払う。	JP Morgan	24/5/2021	889,667	2,398,520
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,382,135,766米ドル)				(5,797,223)	17,684,804

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 2016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 (600,500,000)	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22/5/2017より1.15%の固定金利を半年毎に受け取り、22/2/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	18/11/2016	(105,662)	(912,160)
USD (321,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/1/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/4/2017より0.98%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	13/10/2016	652,121	(279,939)
USD (321,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/1/2017より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/4/2017より0.76%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	13/10/2016	500,500	(29,810)
EUR (42,500,000)	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12/12/2018より1%の固定金利を毎年受け取り、12/6/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/12/2017	419,221	(35,183)
EUR (21,250,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/12/2018より0.5%の固定金利を毎年受け取り、12/6/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/12/2017	136,033	(53,943)
USD (211,900,000)	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10/4/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、10/7/2018より0.88%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/1/2018	370,090	(707,534)
USD (211,900,000)	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10/7/2018より1.8825%の固定金利を半年毎に受け取り、10/4/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	8/1/2018	1,485,631	(363,197)
EUR (10,851,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/7/2019	8,926	(32,599)
EUR (115,580,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	8/7/2019	87,308	(341,438)
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25/10/2018より1%の固定金利を毎年受け取り、25/4/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	23/10/2017	214,897	(14,104)

売建スワップション 2016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 (10,290,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/4/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、25/10/2018より0.5%の固定金利を毎年支払う。	Citibank	23/10/2017	(222,526)	(323,060)
EUR (26,720,000)	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31/10/2018より0.5%の固定金利を毎年受け取り、30/4/2018より6ヶ月EUR BBA EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	27/10/2017	289,928	(56,513)
EUR (26,720,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/4/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、31/10/2018より0.1%の固定金利を毎年支払う。	Citibank	27/10/2017	(59,288)	(355,279)
EUR (53,440,000)	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31/10/2018より1%の固定金利を毎年受け取り、30/4/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	27/10/2017	542,205	(37,326)
EUR (31,180,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/12/2018より1%の固定金利を毎年受け取り、11/6/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	7/12/2017	313,464	(25,708)
USD (209,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/9/2018より1.55%の固定金利を半年毎に受け取り、16/6/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	14/3/2018	1,133,639	(765,357)
USD (209,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/6/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、16/9/2018より1.55%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	14/3/2018	(301,798)	(2,200,794)
USD (158,500,000)	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5/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、5/10/2018より0.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	3/4/2018	137,419	(624,965)
USD (158,500,000)	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5/10/2018より1.9%の固定金利を半年毎に受け取り、5/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	3/4/2018	420,025	(340,775)
EUR (36,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/4/2019より0.6%の固定金利を毎年受け取り、10/10/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Citibank	6/4/2018	298,691	(117,857)

売建スワップション 2016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 (205,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/11/2018より1.8%の固定金利を半年毎に受け取り、8/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	3/5/2018	479,961	(564,160)
USD (205,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、8/11/2018より0.8%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	3/5/2018	194,769	(700,895)
USD (383,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/11/2018より2%の固定金利を半年毎に受け取り、29/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	24/5/2018	963,149	(805,832)
USD (383,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/11/2018より1%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	24/5/2018	(134,146)	(1,903,127)
USD (134,500,000)	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23/10/2018より1.837%の固定金利を半年毎に受け取り、23/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	19/4/2018	312,578	(336,385)
USD (134,500,000)	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23/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/10/2018より0.837%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/4/2018	165,839	(483,124)
AUD (65,700,000)	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31/8/2017より2.07%の固定金利を半年毎に受け取り、31/8/2017より6ヶ月AUD Australian Bank Bill Rateの変動金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/2/2017	42,925	(192,453)
EUR (5,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/9/2016より5%の固定金利を半年毎に受け取り、20/6/2016よりITRAXX.XO.25.V1の変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/9/2016	65,139	(293)
EUR (5,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/6/2016よりITRAXX.XO.25.V1の変動金利を四半期毎に受け取り、21/9/2016より5%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/9/2016	(55,597)	(111,424)
EUR (10,775,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半期毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	10,002	(31,831)

売建スワップション 2016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 (32,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/11/2018より0.95%の固定金利を毎年受け取り、22/5/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	20/11/2017	334,104	(27,283)
EUR (16,150,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/5/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、22/11/2018より0.45%の固定金利を毎年支払う。	Morgan Stanley	20/11/2017	(302,065)	(463,738)
EUR (108,250,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/5/2019より0.75%の固定金利を毎年受け取り、29/11/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	25/5/2018	656,596	(296,865)
EUR (108,250,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/11/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、29/5/2019より0.05%の固定金利を毎年支払う。	Morgan Stanley	25/5/2018	(468,295)	(1,349,342)
USD (211,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/12/2018より1.9%の固定金利を半年毎に受け取り、6/9/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	4/6/2018	427,009	(536,727)
USD (211,810,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/9/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、6/12/2018より0.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	4/6/2018	57,824	(905,911)
USD (52,880,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/1/2019より1.5%の固定金利を半年毎に受け取り、2/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	28/6/2018	(1,771)	(250,968)
USD (218,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/11/2018より0.85%の固定金利を半年毎に支払う。	UBS	30/4/2018	144,098	(815,102)
USD (218,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/11/2018より1.85%の固定金利を半年毎に受け取り、2/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	30/4/2018	541,730	(548,270)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,682,766,453米ドル)				9,754,673	(17,941,271)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2016年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/(損) (米ドル)
フランス			
4,359	BNP Paribas SA	Merrill Lynch	8,622
1,952	Societe Generale SA	Merrill Lynch	2,643
			11,265
ギリシャ			
1,529,110	National Bank of Greece SA	Merrill Lynch	45,139
			45,139
イタリア			
128,074	UniCredit SpA	Merrill Lynch	25,975
70,050	Intesa Sanpaolo SpA	Merrill Lynch	9,991
			35,966
オランダ			
14,383	ING Groep NV	Merrill Lynch	11,380
			11,380
スペイン			
16,291	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Merrill Lynch	6,009
53,828	Banco Santander SA	Merrill Lynch	11,757
			17,766
英国			
(60,382)	Tullow Oil Plc	Merrill Lynch	9,120
(1,631,066)	Lloyds Banking Group Plc	Merrill Lynch	(116,859)
			(107,739)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,108,936米ドル)			13,777

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	36,104,578
金利スワップ	(9,892,828)
トータル・リターン・スワップ	2,339,014
スワップの時価	28,550,764
買建オプション/スワップション	
買建コール・オプション	15,874,078
買建プット・オプション	9,736,975
買建スワップション	17,684,804
買建オプション/スワップションの時価	43,295,857
売建オプション/スワップション	
売建コール・オプション	(7,147,211)
売建プット・オプション	(4,890,234)
売建スワップション	(17,941,271)
売建オプション/スワップションの時価	(29,978,716)
事後通告証券契約の時価	(715,445,265)
	未実現評価益/(損) (米ドル)
未決済上場先物取引	(20,819,465)
未決済先渡為替予約	(20,954,829)
差金決済取引	13,777

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2016年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
アルゼンチン			
EUR 404,230	Argentine Republic Government International Bond FRN 31/12/2033	476,128	0.03
USD 2,061,000	Argentine Republic Government International Bond '144A' 6.25% 22/4/2019	2,209,392	0.14
EUR 727,615	Argentine Republic Government International Bond 7.82% 31/12/2033	867,570	0.06
		3,553,090	0.23
オーストラリア			
AUD 526,110	Apollo Series 2009-1 Trust '2009-1 A3' FRN 3/10/2040	398,100	0.03
AUD 422,909	Crusade ABS Series 2012-1 Trust '2012-1 A' FRN 12/7/2023	318,025	0.02
AUD 364,974	National Rmbs Trust '2012-2 A1' FRN 20/6/2044	273,604	0.02
AUD 2,372,216	TORRENS Series 2013-1 Trust '2013-1 A' FRN 12/4/2044	1,765,950	0.11
USD 2,327,173	Virgin Australia 2013-1A Trust '144A' 5% 23/10/2023	2,424,402	0.16
USD 2,446,405	Virgin Australia 2013-1B Trust '144A' 6% 23/10/2020	2,486,160	0.16
USD 10,000,000	Westpac Banking Corp '144A' 1.375% 30/5/2018	10,003,010	0.65
USD 2,750,000	Westpac Banking Corp 1.6% 19/8/2019	2,749,798	0.18
		20,419,049	1.33
オーストリア			
USD 10,120,000	Oesterreichische Kontrollbank AG 1.125% 26/4/2019	10,108,767	0.66
バミューダ			
USD 4,922,000	Aircastle Ltd 6.75% 15/4/2017	5,071,279	0.33
ブラジル			
EUR 101,000	Brazilian Government International Bond 2.875% 1/4/2021	115,225	0.00
USD 560,000	Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	596,960	0.04
USD 357,000	Brazilian Government International Bond 7.125% 20/1/2037	427,508	0.03
		1,139,693	0.07
カナダ			
USD 2,019,841	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	2,090,536	0.14
USD 7,955,000	Bank of Nova Scotia/The 1.875% 26/4/2021	7,989,652	0.52
USD 4,965,000	Export Development Canada '144A' 0.875% 27/8/2018	4,953,789	0.32
USD 13,030,000	Royal Bank of Canada 1.2% 19/9/2017	13,019,654	0.85
USD 5,595,000	Royal Bank of Canada 2.1% 14/10/2020	5,681,563	0.37
USD 1,314,000	Royal Bank of Canada 2.2% 23/9/2019	1,340,652	0.09
		35,075,846	2.29

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	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	キプロス		
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,385,521	0.16
EUR 3,230,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	3,865,016	0.25
		6,250,537	0.41
	エジプト		
USD 200,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/6/2025	190,500	0.01
	フランス		
EUR 610,791	AUTO ABS FCT Compartiment '2013-2 A' FRN 27/1/2023	683,856	0.04
	ドイツ		
USD 4,800,000	KFW 1.875% 30/6/2020	4,909,987	0.32
USD 5,830,000	KFW 1.875% 30/11/2020	5,960,038	0.39
		10,870,025	0.71
	インドネシア		
EUR 354,000	Indonesia Government International Bond '144A' 2.625% 14/6/2023	416,914	0.03
	国際機関		
USD 17,120,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.875% 15/8/2019	17,009,097	1.11
	アイルランド		
USD 2,000,000	Perrigo Co Plc 2.3% 8/11/2018	2,011,520	0.13
	イタリア		
EUR 260,128	Asset Backed European Securitisation Transaction Nine Srl FRN 10/12/2028	290,571	0.02
EUR 1,424,712	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl FRN 10/12/2028	1,591,171	0.10
EUR 409,176	Berica ABS Srl '2012-2 A1' FRN 30/11/2051	455,407	0.03
USD 4,252,000	Italy Government International Bond 5.25% 20/9/2016*	4,262,736	0.28
		6,599,885	0.43
	ジャージー		
USD 895,000	UBS Group Funding Jersey Ltd '144A' 2.65% 1/2/2022	897,798	0.06
	ルクセンブルグ		
USD 395,000	Actavis Funding SCS 2.45% 15/6/2019	402,615	0.03
	メキシコ		
USD 200,000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands '144A' FRN 11/8/2026	200,450	0.01
USD 1,487,000	Petroleos Mexicanos 3.5% 18/7/2018	1,522,688	0.10
		1,723,138	0.11

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ			
USD 8,776,000	Bank Nederlandse Gemeenten NV '144A' 1.125% 25/5/2018	8,780,493	0.57
USD 2,210,000	Mylan NV '144A' 2.5% 7/6/2019	2,241,713	0.15
USD 1,583,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.75% 1/6/2018	1,624,554	0.11
USD 180,000	Petrobras Global Finance BV 3% 15/1/2019	173,340	0.01
GBP 302,000	Petrobras Global Finance BV 6.25% 14/12/2026	362,091	0.02
USD 220,000	Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	243,100	0.02
USD 1,835,000	Shell International Finance BV 4.375% 25/3/2020	2,013,004	0.13
USD 2,980,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/7/2019	2,984,539	0.19
		18,422,834	1.20
パナマ			
USD 1,380,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,494,180	0.10
ポルトガル			
EUR 692,638	GAMMA Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Atlantes Finance FRN 20/3/2033	776,560	0.05
EUR 1,093,350	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta II Electricity Receivables 2.98% 16/2/2018	1,233,963	0.08
		2,010,523	0.13
トルコ			
TRY 2,360,000	Turkey Government Bond 8% 12/3/2025	723,582	0.05
TRY 2,360,000	Turkey Government Bond 10.6% 11/2/2026*	847,904	0.06
USD 1,072,000	Turkey Government International Bond 6.75% 3/4/2018	1,142,350	0.07
USD 200,000	Turkey Government International Bond 7% 11/3/2019	218,750	0.01
USD 500,000	Turkey Government International Bond 7.5% 7/11/2019	562,625	0.04
		3,495,211	0.23
英国			
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,262,267	0.21
USD 555,000	BAT International Finance Plc '144A' 2.125% 7/6/2017	559,049	0.04
USD 709,000	BP Capital Markets Plc 2.521% 15/1/2020	730,625	0.05
GBP 322,248	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	414,501	0.03
GBP 8,479	Gosforth Funding 2012-1 plc '2012-1 A' FRN 19/12/2047	11,123	0.00
GBP 794,630	Rochester Financing No1 Plc FRN 16/7/2046	1,043,520	0.07
USD 800,000	Santander UK Group Holdings Plc 2.875% 5/8/2021	798,029	0.05
GBP 125,304	Silk Road Finance Number Three Plc '2012-1 A' FRN 21/6/2055	164,274	0.01
USD 6,490,000	Sky Plc '144A' 2.625% 16/9/2019	6,591,783	0.43
USD 2,269,000	Sky Plc '144A' 6.1% 15/2/2018	2,405,477	0.16
EUR 2,461,102	Taurus 2013 GMF1 Plc '2013-GMF1 D' FRN 21/5/2024	2,784,310	0.18
GBP 687,600	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	965,904	0.06
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,397,552	0.09
		21,128,414	1.38
米国			
USD 1,960,000	AbbVie Inc 2.3% 14/5/2021	1,985,014	0.13
USD 730,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	748,215	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,990,000	Actavis Inc 1.875% 1/10/2017	1,999,384	0.13
USD 3,405,000	Aetna Inc 1.9% 7/6/2019	3,438,565	0.22
USD 5,545,000	Air Lease Corp 2.125% 15/1/2018	5,558,862	0.36
USD 3,280,000	Air Lease Corp 2.625% 4/9/2018	3,301,256	0.22
USD 104,030	Aircraft Lease Securitisation Ltd '2007-1A G3' '144A' FRN 10/5/2032	103,510	0.01
USD 2,500,000	Ally Financial Inc 3.25% 13/2/2018	2,537,550	0.17
USD 3,330,000	Ally Financial Inc 5.5% 15/2/2017	3,391,767	0.22
USD 696,000	Ally Financial Inc 6.25% 1/12/2017	730,800	0.05
USD 1,498,316	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	1,571,359	0.10
USD 600,000	American Capital Ltd '144A' 6.5% 15/9/2018	610,737	0.04
USD 3,459,000	American International Group Inc 2.3% 16/7/2019	3,523,374	0.23
USD 4,322,000	American International Group Inc 3.3% 1/3/2021*	4,541,359	0.30
USD 540,000	American International Group Inc 6.4% 15/12/2020	636,504	0.04
USD 4,550,000	Americredit Automobile Receivables Trust '2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	4,609,727	0.30
USD 7,200,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2016-3 A3' 1.46% 8/5/2021	7,184,836	0.47
USD 315,000	Anadarko Petroleum Corp 4.85% 15/3/2021	335,685	0.02
USD 4,195,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.65% 1/2/2021	4,328,829	0.28
USD 250,000	Anthem Inc 5.875% 15/6/2017	259,092	0.02
USD 1,000,000	Apidos CLO XV '2013-15A A1' '144A' FRN 20/10/2025	999,771	0.07
USD 2,580,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	2,580,000	0.17
USD 1,835,000	AT&T Inc 2.45% 30/6/2020	1,875,501	0.12
USD 6,000,000	Atrium V '144A' FRN 20/7/2020	5,912,412	0.39
USD 560,000	Avon International Operations Inc '144A' 7.875% 15/8/2022	582,747	0.04
USD 3,927,753	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	3,923,116	0.26
USD 3,500,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	3,576,293	0.23
USD 67,083	Banc of America Mortgage 2003-J Trust '2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	67,068	0.00
USD 12,600,000	Bank of America Corp 2.6% 15/1/2019	12,890,216	0.84
USD 12,115,000	Bank of America Corp 2.65% 1/4/2019	12,416,488	0.81
USD 558,033	BCAP LLC 2010-RR2 Trust '2010-RR2 1A3' '144A' FRN 26/6/2045	554,752	0.04
USD 38,334	Bear Stearns ALT-A Trust '2004-13 A1' FRN 25/11/2034	37,606	0.00
USD 3,150,000	BlueMountain CLO 2012-1 Ltd '2012-1A A' '144A' FRN 20/7/2023	3,154,224	0.21
USD 1,000,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A' '144A' FRN 22/11/2025	998,380	0.06
USD 10,000,000	BlueMountain CLO 2013-4 Ltd '2013-4A A' '144A' FRN 15/4/2025	10,037,021	0.65
USD 16,654	BNC Mortgage Loan Trust '2007-3 A2' FRN 25/7/2037	16,659	0.00
USD 380,000	Cablevision Systems Corp 8.625% 15/9/2017	403,275	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 600,000	CalAtlantic Group Inc 10.75% 15/9/2016	601,557	0.04
USD 5,500,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust '2015-A2 A2' 2.08% 15/3/2023	5,619,355	0.37
USD 13,195,000	Capital One NA/Mclean VA 2.35% 17/8/2018	13,381,590	0.87
USD 3,500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-2 Ltd '2012-2A B1R' '144A' FRN 20/7/2023	3,500,188	0.23
USD 4,980,000	CarMax Auto Owner Trust '2016-2 A3' 1.52% 16/2/2021	5,000,880	0.33
USD 8,000,000	CarMax Auto Owner Trust '2015-4 A3' 1.56% 16/11/2020	8,045,978	0.52
USD 3,250,000	CarMax Auto Owner Trust '2014-4 B' 2.2% 15/9/2020	3,278,040	0.21
USD 2,976,000	Case New Holland Industrial Inc 7.875% 1/12/2017	3,206,640	0.21
USD 1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,134,689	0.07
USD 1,305,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJ' FRN 15/11/2044	1,312,600	0.09
USD 2,085,000	CD 2007-CD5 Mortgage Trust '2007-CD5 AJA' FRN 15/11/2044	2,093,217	0.14
USD 1,769,920	CDGJ Commercial Mortgage Trust '2014-BXCH A' '144A' FRN 15/12/2027	1,775,312	0.12
USD 2,852,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital '144A' 3.579% 23/7/2020	2,987,190	0.19
USD 14,000,000	Chase Issuance Trust '2016-A2 A' 1.37% 15/6/2021	14,020,939	0.91
USD 10,100,000	Chesapeake Funding II LLC '2016-2A A1' '144A' 1.88% 15/6/2028	10,091,731	0.66
USD 1,900,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A B' '144A' FRN 7/3/2026	1,890,482	0.12
USD 500,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A C' '144A' FRN 7/3/2026	487,216	0.03
USD 1,150,000	Chesapeake Funding LLC '2014-1A D' '144A' FRN 7/3/2026	1,146,538	0.07
USD 352,430	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	305,401	0.02
USD 1,070,000	Chubb INA Holdings Inc 2.3% 3/11/2020	1,101,612	0.07
USD 5,000,000	CIFC Funding 2012-II Ltd '2012-2A A1R' '144A' FRN 5/12/2024	5,002,962	0.33
USD 1,000,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A1L' '144A' FRN 24/5/2026	1,000,594	0.07
USD 5,250,000	CIT Group Inc 5.25% 15/3/2018	5,486,250	0.36
USD 5,790,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP A' '144A' FRN 15/9/2027	5,766,656	0.38
USD 2,552,631	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2010-RR3 MLSR' '144A' FRN 14/6/2050	2,580,655	0.17
USD 3,860,000	Citigroup Inc FRN 1/9/2023	3,888,718	0.25
USD 2,005,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.3% 3/12/2018	2,030,200	0.13
USD 550,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.55% 13/5/2021	561,139	0.04
USD 5,130,000	CNH Equipment Trust '2016-B A3' 1.63% 15/8/2021	5,138,906	0.34
USD 1,665,000	CNH Industrial Capital LLC 6.25% 1/11/2016	1,676,105	0.11
USD 1,705,000	COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust '2007-C3 AM' FRN 15/5/2046	1,745,453	0.11
USD 2,991,188	Colony American Homes '2015-1A A' '144A' FRN 17/7/2032	2,999,751	0.20

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 12,141,911	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust '2013-CR7 XA' FRN 10/3/2046	737,371	0.05
USD 1,635,000	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust '2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	1,675,530	0.11
USD 1,168,323	COMM 2013-SFS Mortgage Trust '2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	1,168,791	0.08
USD 2,800,000	COMM 2014-FL5 Mortgage Trust '2014-FL5 B' '144A' FRN 15/10/2031	2,750,392	0.18
USD 5,500,000	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust '2015-CR22 A2' 2.856% 10/3/2048	5,686,020	0.37
USD 11,022,598	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	639,556	0.04
USD 36,028,260	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 XA' FRN 10/7/2048	1,738,153	0.11
USD 10,700,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	11,182,293	0.73
USD 998,060	Commercial Mortgage Trust '2007-GG11 A4' 5.736% 10/12/2049	1,027,316	0.07
USD 580,000	CommScope Inc '144A' 4.375% 15/6/2020	604,650	0.04
USD 1,190,000	ConocoPhillips 6% 15/1/2020	1,347,396	0.09
USD 172,367	Continental Airlines 1997-4 Class A Pass Through Trust 6.9% 2/1/2018	177,099	0.01
USD 19,825	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	20,507	0.00
USD 2,204,037	Continental Airlines 2009-2 Class B Pass Through Trust 9.25% 10/5/2017	2,303,219	0.15
USD 451,595	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	472,594	0.03
USD 2,250,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Thru Certificates 6.125% 29/4/2018	2,365,313	0.15
USD 42,580,000	Core Industrial Trust '2015-CALW XA' '144A' FRN 10/2/2034	1,686,807	0.11
USD 5,860,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A A' '144A' 2% 15/7/2022	5,867,521	0.38
USD 10,820,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-2A A' '144A' 2.42% 15/11/2023	10,819,682	0.71
USD 5,000,000	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C4 A1AM' FRN 15/9/2039	5,156,150	0.34
USD 33,935	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2007-C5 AAB' FRN 15/9/2040	34,023	0.00
USD 56,403	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2008-C1 A2' FRN 15/2/2041	56,632	0.00
USD 3,896,711	CSAIL 2016-C6 Commercial Mortgage Trust '2016-C6 XA' FRN 15/1/2049	498,279	0.03
USD 1,000,000	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	996,225	0.06
USD 5,395,000	CVS Health Corp 2.125% 1/6/2021	5,460,900	0.36
USD 800,000	DBRR 2011-C32 Trust '2011-C32 A3A' '144A' FRN 17/6/2049	810,895	0.05
USD 7,029,697	DBUBS 2011-LC2 Mortgage Trust '2011-LC2A A3FL' '144A' FRN 12/7/2044	7,069,807	0.46
USD 839,035	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' 6.875% 7/5/2019	905,671	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,000,000	Discover Card Execution Note Trust '2014-A4 A4' 2.12% 15/12/2021	5,103,492	0.33
USD 1,500,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	1,545,000	0.10
USD 710,000	DISH DBS Corp 4.625% 15/7/2017	727,750	0.05
USD 628,000	DR Horton Inc 3.75% 1/3/2019	649,195	0.04
USD 665,000	DR Horton Inc 4.75% 15/5/2017	679,481	0.04
USD 5,000,000	Dryden XXV Senior Loan Fund '2012- 25A A' '144A' FRN 15/1/2025	5,005,443	0.33
USD 3,000,000	Eaton Electric Holdings LLC 6.1% 1/7/2017	3,120,108	0.20
USD 1,435,000	Emera US Finance LP '144A' 2.15% 15/6/2019	1,450,506	0.09
USD 225,000	Energy Transfer Partners LP 4.15% 1/10/2020	236,386	0.02
USD 8,070,000	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A2' '144A' 1.74% 22/2/2022	8,050,759	0.53
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A3' '144A' 2.04% 22/2/2022	3,825,257	0.25
USD 320,000	Equifax Inc 2.3% 1/6/2021	322,289	0.02
USD 2,900,000	ERAC USA Finance LLC '144A' 6.375% 15/10/2017	3,052,507	0.20
USD 1,470,000	Exelon Corp 1.55% 9/6/2017	1,472,537	0.10
USD 808,022	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M1' FRN 25/5/2024	808,555	0.05
USD 22,814	Fannie Mae Pool '255316' 5% 1/7/2019	23,533	0.00
USD 78,315	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	80,884	0.01
USD 266,696	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	276,721	0.02
USD 3,137,494	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	3,287,977	0.21
USD 6,261,683	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	6,478,406	0.42
USD 9,148,078	Fannie Mae Pool 'AZ7701' FRN 1/10/2045	9,457,209	0.62
USD 36,022	Fannie Mae REMICS '2008-29 CA' 4.5% 25/9/2035	36,464	0.00
USD 5,458,939	Fannie Mae-Aces '2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	458,779	0.03
USD 262,101,020	Fannie Mae-Aces '2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	2,745,456	0.18
USD 100,558	Federal Express Corp 2012 Pass Through Trust '144A' 2.625% 15/1/2018	100,871	0.01
USD 14,695,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 1% 27/4/2018	14,677,035	0.96
USD 14,495,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 1.05% 26/4/2018	14,495,529	0.95
USD 14,695,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 1.05% 27/4/2018	14,669,688	0.96
USD 25,800,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 1.29% 3/5/2019	25,806,631	1.68
USD 5,030,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 1.3% 29/4/2019	5,032,155	0.33
USD 110,956,120	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/9/2024	5,492,084	0.36
USD 13,890,436	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2026	1,016,001	0.07
USD 13,912,500	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.78% 25/7/2019	14,038,471	0.92
USD 3,346,000	FHLMC Multifamily Structured Pass Through Certificates 2.158% 25/10/2021	3,411,659	0.22
USD 555,000	Fidelity National Information Services Inc 2.25% 15/8/2021	559,496	0.04
USD 1,575,000	Fidelity National Information Services Inc 2.85% 15/10/2018	1,614,358	0.11

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 8,867,000	Ford Credit Auto Owner Trust '2016-B A3' 1.33% 15/10/2020	8,893,162	0.58
USD 13,550,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.724% 6/12/2017	13,595,948	0.89
USD 1,015,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,016,497	0.07
USD 870,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.021% 3/5/2019	875,353	0.06
USD 800,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.943% 8/1/2019	821,596	0.05
USD 7,860,000	Forest Laboratories LLC '144A' 4.375% 1/2/2019	8,300,510	0.54
USD 11,624,055	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	12,068,287	0.79
USD 3,827,687	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3.5% 15/6/2050	4,065,692	0.27
USD 6,438,832	Freddie Mac REMICS '4446 MA' 3.5% 15/12/2050	6,800,620	0.44
USD 5,239,478	Freddie Mac REMICS '4286 MP' 4% 15/12/2043	5,658,476	0.37
USD 8,253,122	Freddie Mac REMICS '4593 MP' 4% 15/4/2054	8,549,309	0.56
USD 326,422	Freddie Mac REMICS '3817 MA' 4.5% 15/10/2037	343,786	0.02
USD 509,041	Freddie Mac REMICS '3986 M' 4.5% 15/9/2041	548,045	0.04
USD 434,569	Freddie Mac REMICS '3959 MA' 4.5% 15/11/2041	477,328	0.03
USD 3,789,460	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2016-HQA2 M1' FRN 25/11/2028	3,822,023	0.25
USD 1,275,000	Frontier Communications Corp 8.875% 15/9/2020	1,390,948	0.09
USD 2,700,000	GATX Corp 1.25% 4/3/2017	2,700,069	0.18
USD 3,500,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 10/4/2018	3,527,713	0.23
USD 635,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 9/5/2019	639,341	0.04
USD 917,000	General Motors Financial Co Inc 3% 25/9/2017	929,745	0.06
USD 2,580,000	General Motors Financial Co Inc 3.1% 15/1/2019	2,634,626	0.17
USD 910,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	925,863	0.06
USD 375,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 15/5/2018	382,396	0.02
USD 1,450,000	General Motors Financial Co Inc 3.7% 24/11/2020	1,512,379	0.10
USD 1,550,000	Genworth Holdings Inc 6.515% 22/5/2018	1,588,750	0.10
USD 828,000	Genworth Holdings Inc 7.7% 15/6/2020	817,650	0.05
USD 9,500,000	GoldenTree Loan Opportunities VII Ltd '2013-7A A' '144A' FRN 25/4/2025	9,453,786	0.62
USD 510,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 23/4/2020	521,218	0.03
USD 6,000,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.75% 15/9/2020	6,172,167	0.40
USD 12,661,209	Government National Mortgage Association '2012-120 IO' FRN 16/2/2053	742,318	0.05
USD 4,000,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	4,271,993	0.28
USD 400,000	Gramercy Park CLO Ltd '2012-1A CR' '144A' FRN 17/7/2023	402,165	0.03
USD 1,645,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GSFL D' '144A' FRN 15/7/2031	1,602,053	0.10
USD 5,323,989	GS Mortgage Securities Trust '2007-GG10 A1A' FRN 10/8/2045	5,430,134	0.35
USD 6,311,860	GS Mortgage Securities Trust '2007-GG10 A4' FRN 10/8/2045	6,440,824	0.42
USD 2,240,000	HCP Inc 6.7% 30/1/2018	2,397,334	0.16
USD 8,945,000	Hewlett Packard Enterprise Co '144A' 2.85% 5/10/2018	9,121,914	0.59
USD 2,785,000	Hilton USA Trust '2013-HLT EFX' '144A' FRN 5/11/2030	2,798,271	0.18

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 10,000	Hilton USA Trust '2013-HLT DFX' '144A' 4.407% 5/11/2030	10,050	0.00
USD 7,360,000	Honda Auto Receivables 2016-2 Owner Trust '2016-2 A3' 1.39% 15/4/2020	7,387,008	0.48
USD 1,350,000	Hyundai Capital America '144A' 2.4% 30/10/2018	1,370,590	0.09
USD 1,170,000	Hyundai Floorplan Master Owner Trust Series '2016-1A A2' '144A' 1.81% 15/3/2021	1,171,862	0.08
USD 1,330,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 3.5% 15/3/2017	1,333,325	0.09
USD 2,500,000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.875% 15/3/2019	2,506,250	0.16
USD 2,070,000	International Lease Finance Corp '144A' 6.75% 1/9/2016	2,070,000	0.13
USD 1,030,000	International Lease Finance Corp '144A' 7.125% 1/9/2018	1,135,668	0.07
USD 2,583,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 2.25% 15/11/2017	2,595,109	0.17
USD 3,959,515	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL6 A' '144A' FRN 15/11/2031	3,956,732	0.26
USD 7,585,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C5MO A' '144A' FRN 15/1/2032	7,589,191	0.49
USD 42,175	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2007-LD11 ASB' FRN 15/6/2049	42,267	0.00
USD 6,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C20 A2' 2.872% 15/7/2047	6,201,907	0.40
USD 5,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CBX A4' 3.483% 15/6/2045	5,385,036	0.35
USD 4,305,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-C16 ASB' 3.674% 15/12/2046	4,665,225	0.30
USD 6,995,000	JP Morgan Mortgage Trust '2016-2 A1' '144A' 2.69% 25/6/2046	7,065,770	0.46
USD 50,652,750	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C21 XA' FRN 15/8/2047	3,221,117	0.21
USD 965,000	JPMorgan Chase & Co 2.295% 15/8/2021	971,132	0.06
USD 9,145,000	JPMorgan Chase & Co 2.4% 7/6/2021	9,308,924	0.61
USD 2,786,000	Kansas City Southern FRN 28/10/2016	2,785,968	0.18
USD 780,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 6.5% 1/4/2020	872,909	0.06
USD 750,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.05% 1/12/2019	770,980	0.05
USD 971,000	Lam Research Corp 2.75% 15/3/2020	995,204	0.06
USD 530,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	544,405	0.04
USD 3,168,000	LB Commercial Mortgage Trust '2007-C3 AM' FRN 15/7/2044	3,245,718	0.21
USD 4,400,000	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C7 AM' FRN 15/9/2045	4,603,860	0.30
USD 972,977	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C1 A4' 5.424% 15/2/2040	979,253	0.06
USD 7,045,000	LCM XII LP '144A' FRN 19/10/2022	7,026,166	0.46
USD 2,378,640	Leek Finance Number Eighteen Plc FRN 21/9/2038	2,548,513	0.17
USD 1,618,000	Lennar Corp 4.75% 15/12/2017	1,674,630	0.11
USD 3,883,848	LFRF '2015-1' '144A' 3.5% 31/12/2049	3,879,405	0.25
USD 3,750,000	Maxim Integrated Products Inc 2.5% 15/11/2018	3,804,853	0.25

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,020,000	McDonald's Corp 2.75% 9/12/2020	2,106,060	0.14
USD 7,042,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	7,056,675	0.46
USD 1,370,139	Merrill Lynch Mortgage Trust '2007-C1 A1A' FRN 12/6/2050	1,394,739	0.09
USD 9,245,000	Mill City Mortgage Loan Trust '2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	9,310,502	0.61
USD 8,848,000	Morgan Stanley 2.375% 23/7/2019	9,004,163	0.59
USD 2,535,000	Morgan Stanley 2.5% 21/4/2021	2,575,744	0.17
USD 200,000	Morgan Stanley 5.45% 9/1/2017	203,091	0.01
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014- C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,892,611	0.45
USD 950,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-T27 AM' FRN 11/6/2042	972,947	0.06
USD 3,743,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ11 A4FL' FRN 12/2/2044	3,725,881	0.24
USD 450,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ12 AM' FRN 12/4/2049	451,889	0.03
USD 3,341,761	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ15 A4' FRN 11/6/2049	3,440,560	0.22
USD 2,980,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ13 AM' 5.406% 15/3/2044	3,020,448	0.20
USD 3,693,125	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-HQ13 A3' 5.569% 15/12/2044	3,792,850	0.25
USD 7,369,698	Morgan Stanley Capital I Trust '2007-IQ16 A4' 5.809% 12/12/2049	7,598,374	0.50
USD 2,000,000	Navient Corp 5% 15/6/2018	2,007,500	0.13
USD 475,144	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	472,875	0.03
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	1,995,949	0.13
USD 7,180,000	NextGear Floorplan Master Owner '2014-1A A' '144A' 1.92% 15/10/2019	7,157,468	0.47
USD 915,000	NextGear Floorplan Master Owner '2014-1A B' '144A' 2.61% 15/10/2019	907,191	0.06
USD 9,810,000	Nissan Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A3' 1.32% 15/1/2021	9,839,200	0.64
USD 7,610,000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2016-A A2' 1.54% 15/6/2021	7,590,630	0.50
USD 2,105,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' 2% 8/3/2019	2,122,254	0.14
USD 184,999	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	201,177	0.01
USD 3,514,790	OneMain Financial Issuance Trust '2014-1A A' '144A' 2.43% 18/6/2024	3,519,102	0.23
USD 7,613,312	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A A' '144A' 2.47% 18/9/2024	7,635,063	0.50
USD 6,600,000	Oracle Corp 1.9% 15/9/2021	6,619,170	0.43
USD 4,820,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A A1' '144A' FRN 22/1/2025	4,818,371	0.31
USD 500,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A A1' '144A' FRN 22/7/2025	496,141	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,643,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.875% 17/7/2018	7,790,949	0.51
USD 827,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.05% 9/1/2020	848,821	0.06
USD 555,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.75% 11/5/2017	563,742	0.04
USD 199,000	Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/1/2021	206,630	0.01
USD 1,505,000	PNC Bank NA 2.45% 5/11/2020	1,545,349	0.10
USD 1,750,000	Prestige Auto Receivables Trust '2013-1A B' '144A' 1.74% 15/5/2019	1,749,956	0.11
USD 1,915,000	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A C' '144A' 2.39% 15/5/2020	1,895,602	0.12
USD 4,091,000	QVC Inc 3.125% 1/4/2019	4,186,844	0.27
USD 1,785,000	Sabine Pass LNG LP 7.5% 30/11/2016	1,808,428	0.12
USD 2,590,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2016-2 A3' 1.56% 15/5/2020	2,593,320	0.17
USD 543,929	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-1 C' 1.76% 15/1/2019	544,692	0.04
USD 1,339,605	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-AA C' '144A' 1.78% 15/11/2018	1,341,122	0.09
USD 2,505,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-4 B' 1.82% 15/5/2019	2,509,101	0.16
USD 22,275	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-6 C' 1.94% 15/3/2018	22,286	0.00
USD 2,980,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-3 C' 2.13% 17/8/2020	2,996,314	0.20
USD 2,400,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-5 C' 2.25% 17/6/2019	2,409,637	0.16
USD 51,150	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-5 C' 2.7% 15/8/2018	51,267	0.00
USD 2,950,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2013-A C' '144A' 3.12% 15/10/2019	2,975,864	0.19
USD 5,420,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2012-2A E' '144A' 5.95% 15/4/2019	5,429,829	0.35
USD 2,770,036	Silver Bay Realty 2014-1 Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/9/2031	2,748,129	0.18
USD 119,462	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A2' FRN 15/6/2021	119,168	0.01
USD 138,661	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	137,265	0.01
USD 545,118	SLM Private Credit Student Loan Trust '2005-B A2' FRN 15/3/2023	543,509	0.04
USD 591,442	SLM Private Education Loan Trust '2013-C A1' '144A' FRN 15/2/2022	591,834	0.04
USD 2,255,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	2,263,194	0.15
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,653,345	0.11
USD 1,620,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	1,634,629	0.11
USD 1,403,430	SLM Private Education Loan Trust '2012-B A2' '144A' 3.48% 15/10/2030	1,430,967	0.09

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,660,000	SLM Private Education Loan Trust '2012-A A2' '144A' 3.83% 17/1/2045	1,718,785	0.11
USD 1,626,289	SLM Private Education Loan Trust '2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	1,705,534	0.11
USD 2,231,916	SLM Student Loan Trust '2013-4 A' FRN 25/6/2027	2,159,314	0.14
USD 2,762,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	2,771,366	0.18
USD 2,430,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	2,451,977	0.16
USD 2,040,353	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC '2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	2,049,825	0.13
USD 3,091,782	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC '2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	3,099,599	0.20
USD 1,130,000	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC '2016-C A2B' '144A' 2.36% 25/12/2032	1,130,322	0.07
USD 1,000,000	Sound Point CLO I Ltd '2012-1A C' '144A' FRN 20/10/2023	1,001,340	0.07
USD 670,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	670,639	0.04
USD 158,835	Soundview Home Loan Trust '2003-2 A2' FRN 25/11/2033	157,640	0.01
USD 2,780,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	2,805,993	0.18
USD 3,685,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	4,076,531	0.27
USD 3,655,000	St Jude Medical Inc 2% 15/9/2018	3,709,799	0.24
USD 79,378	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A A' '144A' 1.5% 25/12/2044	79,378	0.00
USD 1,375,000	Stryker Corp 2% 8/3/2019	1,393,144	0.09
USD 3,591,408	SWAY Residential 2014-1 Trust '2014-1 A' '144A' FRN 17/1/2032	3,601,350	0.23
USD 16,075,000	Synchrony Credit Card Master Note Trust '2016-2 A' 2.21% 15/5/2024	16,395,921	1.07
USD 1,610,000	Synchrony Financial 1.875% 15/8/2017	1,614,273	0.11
USD 2,120,000	Synchrony Financial 2.6% 15/1/2019	2,143,984	0.14
USD 402,000	T-Mobile USA Inc 6.633% 28/4/2021	424,612	0.03
USD 510,000	Toll Brothers Finance Corp 8.91% 15/10/2017	552,712	0.04
USD 5,821,318	Towd Point Mortgage Trust '2016-3 A1' '144A' FRN 25/8/2055	5,825,141	0.38
USD 3,440,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A3' 1.3% 15/4/2020	3,443,804	0.22
USD 3,810,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A4' 1.52% 16/8/2021	3,827,240	0.25
USD 122,750	UAL 2009-1 Pass Through Trust 10.4% 1/11/2016	124,278	0.01
USD 163,699	UAL 2009-2A Pass Through Trust 9.75% 15/1/2017	168,405	0.01
USD 7,700,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2026 †	8,145,171	0.53
USD 49,345,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 31/1/2018*	49,351,746	3.22
USD 53,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 31/7/2018	52,963,769	3.46
USD 11,200,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 15/2/2019*	11,173,750	0.73
USD 44,200,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 15/7/2019	44,018,711	2.87

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 15,350,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 15/8/2019	15,285,842	1.00
USD 25,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/10/2017	25,054,199	1.63
USD 29,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 31/3/2018*	29,050,977	1.90
USD 14,900,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/4/2019	14,904,656	0.97
USD 45,970,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 15/5/2019*	45,977,183	3.00
USD 3,515,651	US Airways 2011-1 Class B Pass Through Trust 9.75% 22/10/2018	3,926,384	0.26
USD 1,641,553	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,824,176	0.12
USD 4,000,000	Ventas Realty LP / Ventas Capital Corp 2% 15/2/2018	4,027,880	0.26
USD 2,190,000	Verizon Communications Inc 4.5% 15/9/2020	2,418,644	0.16
USD 2,220,000	Verizon Communications Inc 6.1% 15/4/2018	2,391,781	0.16
USD 3,284,000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 1.65% 22/5/2018	3,281,174	0.21
USD 3,484,813	Voya CLO 2012-1 Ltd '2012-1A A1R' '144A' FRN 14/3/2022	3,488,953	0.23
USD 5,115,000	Voya Financial Inc 2.9% 15/2/2018	5,217,111	0.34
USD 2,229,458	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C34 A1A' FRN 15/5/2046	2,271,306	0.15
USD 135,536	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 A4FL' '144A' FRN 15/10/2048	135,411	0.01
USD 2,390,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2006-C28 AM' FRN 15/10/2048	2,390,638	0.16
USD 2,174,980	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 A1A' FRN 15/6/2049	2,216,981	0.14
USD 1,135,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C33 AM' FRN 15/2/2051	1,160,905	0.08
USD 3,098,248	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C34 A3' 5.678% 15/5/2046	3,163,850	0.21
USD 4,300,000	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007-C32 AMFX' '144A' 5.703% 15/6/2049	4,385,046	0.29
USD 1,030,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust '2016-BOCA A' '144A' FRN 15/6/2029	1,029,999	0.07
USD 775,000	Walgreens Boots Alliance Inc 2.6% 1/6/2021	793,628	0.05
USD 1,895,000	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc '144A' 1.75% 15/9/2017	1,897,446	0.12
USD 1,499	Wells Fargo Resecuritization Trust '2012-10 A' '144A' 1.75% 20/8/2021	1,499	0.00
USD 3,330,000	Welltower Inc 2.25% 15/3/2018	3,362,439	0.22
USD 2,400,000	Westbrook CLO Ltd '2006-1A A2' '144A' FRN 20/12/2020	2,395,527	0.16
USD 2,000,000	Westbrook CLO Ltd '2006-1X B' FRN 20/12/2020	1,985,336	0.13
USD 2,599,962	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 XA' '144A' FRN 15/8/2045	187,791	0.01
USD 31,491,324	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2013-C15 XA' FRN 15/8/2046	822,117	0.05
USD 1,140,000	Wheels SPV 2 LLC '2016-1A A2' '144A' 1.59% 20/5/2025	1,140,699	0.07
USD 7,540,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2016-A A' 2.03% 15/4/2025	7,608,683	0.50

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,080,000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2% 1/4/2018	1,087,228	0.07
		1,306,469,238	85.24
	債券合計	1,475,444,009	96.26
	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合計	1,475,444,009	96.26
	投資有価証券合計	1,475,444,009	96.26
	その他の純資産	57,328,827	3.74
	純資産合計(米ドル)	1,532,772,836	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。

未決済先渡為替予約 2016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)
MXN	9,545,898	USD	520,000	Goldman Sachs	1/9/2016	(13,093)
MXN	8,502,713	USD	456,000	Morgan Stanley	1/9/2016	(4,488)
USD	406,000	MXN	7,429,556	Deutsche Bank	1/9/2016	11,475
USD	285,000	MXN	5,403,750	Goldman Sachs	1/9/2016	(1,950)
USD	285,000	MXN	5,404,598	Morgan Stanley	1/9/2016	(1,995)
BRL	7,833,249	USD	2,466,000	Morgan Stanley	2/9/2016	(41,445)
BRL	1,085,982	USD	339,348	State Street	2/9/2016	(3,214)
BRL	7,050,121	USD	2,126,894	RBS Plc	2/9/2016	55,267
TWD	16,530,069	USD	519,977	Bank of America	2/9/2016	975
USD	4,932,242	BRL	15,859,623	Goldman Sachs	2/9/2016	23,356
USD	519,977	TWD	16,342,877	Standard Chartered Bank	2/9/2016	4,925
INR	17,472,000	USD	260,000	BNP Paribas	6/9/2016	738
INR	7,715,054	USD	114,790	Citibank	6/9/2016	343
INR	11,768,813	USD	173,326	HSBC Bank Plc	6/9/2016	2,302
INR	33,324,340	USD	491,861	JP Morgan	6/9/2016	5,444
MXN	10,438,125	USD	570,000	Deutsche Bank	6/9/2016	(15,925)
USD	2,783,780	AUD	3,714,000	Westpac	6/9/2016	(5,499)
USD	12,973,389	EUR	11,651,000	RBS Plc	6/9/2016	(12,183)
USD	229,055	GBP	176,000	Morgan Stanley	6/9/2016	(1,494)
USD	3,808,196	GBP	2,890,000	HSBC Bank Plc	6/9/2016	22,479
USD	570,000	MXN	10,437,840	UBS	6/9/2016	15,940
USD	340,000	ZAR	4,778,768	Morgan Stanley	6/9/2016	14,095
ZAR	4,570,083	USD	340,000	Deutsche Bank	6/9/2016	(28,327)
AUD	5,040,000	NZD	5,264,582	HSBC Bank Plc	7/9/2016	(31,198)
AUD	5,130,000	USD	3,874,294	HSBC Bank Plc	7/9/2016	(21,675)
CAD	5,023,262	USD	3,820,000	JP Morgan	7/9/2016	9,948
USD	3,849,193	AUD	5,130,000	Goldman Sachs	7/9/2016	(3,426)
USD	3,820,000	CAD	5,046,136	HSBC Bank Plc	7/9/2016	(27,388)
RUB	26,945,200	USD	410,000	Deutsche Bank	8/9/2016	2,490
MXN	5,638,327	USD	312,000	Goldman Sachs	9/9/2016	(12,793)
MXN	9,839,960	USD	520,000	Morgan Stanley	9/9/2016	2,174
RUB	109,056,959	USD	1,671,602	Deutsche Bank	9/9/2016	(2,548)
USD	416,000	MXN	7,755,518	Morgan Stanley	9/9/2016	4,440
USD	416,000	MXN	7,734,147	Bank of America	9/9/2016	5,574
TWD	10,953,750	USD	345,000	JP Morgan	12/9/2016	304
TWD	10,631,175	USD	345,000	Deutsche Bank	12/9/2016	(9,864)
USD	690,000	TWD	21,548,700	Deutsche Bank	12/9/2016	10,702
USD	400,000	CAD	526,578	Citibank	16/9/2016	(1,506)
USD	519,113	GBP	400,000	Citibank	16/9/2016	(4,998)
USD	355,000	TRY	1,057,665	Deutsche Bank	16/9/2016	(1,593)
CAD	327,056	USD	253,000	Morgan Stanley	21/9/2016	(3,618)
EUR	718,000	USD	803,501	Citibank	21/9/2016	(2,714)
GBP	340,000	USD	450,647	Citibank	21/9/2016	(5,095)
JPY	28,124,762	USD	280,760	Morgan Stanley	21/9/2016	(8,357)
RUB	38,745,000	USD	600,000	BNP Paribas	21/9/2016	(8,921)

未決済先渡為替予約 2016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	570,000	CAD	742,261	Goldman Sachs	21/9/2016	4,022
USD	802,706	EUR	718,000	Citibank	21/9/2016	1,919
USD	400,886	EUR	358,286	Goldman Sachs	21/9/2016	1,289
USD	964,627	GBP	740,000	Goldman Sachs	21/9/2016	(5,106)
USD	125,694	GBP	96,934	Bank of America	21/9/2016	(1,332)
USD	254,777	GBP	196,208	RBS Plc	21/9/2016	(2,343)
USD	280,760	JPY	28,406,325	Citibank	21/9/2016	5,630
USD	368,400	KRW	404,429,520	JP Morgan	21/9/2016	6,320
USD	519,977	TWD	16,519,669	Bank of America	21/9/2016	(913)
COP	252,354,908	USD	85,486	BNP Paribas	26/9/2016	(154)
COP	782,468,245	USD	264,514	Credit Suisse	26/9/2016	74
RUB	34,635,500	USD	530,000	Deutsche Bank	26/9/2016	(2,318)
RUB	26,112,000	USD	400,000	Societe Generale	26/9/2016	(2,176)
USD	350,000	COP	1,018,885,000	Credit Suisse	26/9/2016	5,469
USD	410,000	ZAR	5,655,253	BNP Paribas	26/9/2016	25,879
ZAR	5,810,069	USD	410,000	JP Morgan	26/9/2016	(15,363)
MXN	10,393,893	USD	570,000	Goldman Sachs	30/9/2016	(19,535)
USD	696,000	CLP	470,224,560	Credit Suisse	3/10/2016	3,552
BRL	9,840,269	USD	3,036,242	Goldman Sachs	4/10/2016	(20,169)
USD	115,634	EUR	103,341	Goldman Sachs	14/10/2016	261
USD	200,444	EUR	177,284	Morgan Stanley	14/10/2016	2,521
USD	1,081,691	EUR	961,950	Bank of America	14/10/2016	7,753
USD	98,203	EUR	87,717	Citibank	14/10/2016	274
TRY	1,894,714	USD	635,286	Citibank	18/10/2016	(873)
USD	1,121,251	TRY	3,330,675	Citibank	18/10/2016	6,032
USD	1,157,418	TRY	3,439,758	Morgan Stanley	18/10/2016	5,675
CNY	1,471,375	USD	220,000	BNP Paribas	7/11/2016	(825)
CNY	10,788,778	USD	1,617,800	Goldman Sachs	7/11/2016	(10,707)
USD	2,872,000	CNH	18,959,795	Deutsche Bank	7/11/2016	47,727
未実現純評価損						(39,753)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	23,017,494	USD	25,557,824	BNY Mellon	14/9/2016	105,449
USD	1,365,080	EUR	1,217,602	BNY Mellon	14/9/2016	7,512
未実現純評価益						112,961
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	6,884	USD	5,108	BNY Mellon	14/9/2016	(59)
未実現純評価損						(59)
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 - 114,190,924米ドル)						73,149

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 2016年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 5,250,000	Fannie Mae Pool '2 9/16' 2% TBA	5,317,676	0.35
USD 27,290,000	Fannie Mae Pool '2.5 9/16' 2.5% TBA	28,204,641	1.84
USD 10,940,000	Fannie Mae Pool '3 9/16' 3% TBA	11,459,314	0.75
USD 5,855,000	Fannie Mae Pool '4 9/16' 4% TBA	6,055,059	0.39
USD 5,000,000	Fannie Mae Pool '4.5 9/16' 4.5% TBA	5,117,652	0.33
USD 11,065,000	Freddie Mac Gold Pool '3 9/16' 3% TBA	11,602,258	0.76
USD 13,130,000	Freddie Mac Gold Pool '3.5 9/16' 3.5% TBA	13,889,956	0.91
T B A 合計		81,646,556	5.33

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。

未決済上場先物取引 2016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)
(5)	EUR	Euro BOBL	2016年9月	744,604	(4,881)
(6)	EUR	Euro Bund	2016年9月	1,120,852	(3,120)
(2)	GBP	Long Gilt	2016年12月	345,211	(812)
1,486	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2016年12月	324,435,592	(28,106)
2	USD	US Ultra Bond (CBT)	2016年12月	374,563	(63)
(2)	USD	US Long Bond (CBT)	2016年12月	340,813	(167)
(98)	USD	US Ultra 10 Year Note	2016年12月	14,156,406	(8,673)
(232)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2016年12月	30,395,625	(41,854)
(962)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2016年12月	116,702,625	(97,670)
609	USD	90 Day Euro \$	2017年12月	150,552,413	(251,203)
(609)	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	150,377,325	190,303
合計				789,546,029	(246,246)

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 2016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 4,275,351	ファンドは12.02%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	2/1/2019	(3,777)	(3,777)
BRL 4,398,876	ファンドは12.03%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	2/1/2019	(3,604)	(3,604)
BRL 8,197,782	ファンドは12.24%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	2/1/2019	(2,790)	(2,790)
BRL 3,993,758	ファンドは12.285%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	2/1/2019	(1,416)	(1,416)
BRL 4,002,241	ファンドは12.462%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	2/1/2019	3,074	3,074
CNY 1,650,000	ファンドは2.725%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	12/5/2021	111	111
CNY 2,650,000	ファンドは2.74%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	12/5/2021	444	444
CNY 3,305,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	774	774
CNY 1,650,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	386	386
CNY 2,649,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	620	620
CNY 3,305,000	ファンドは2.75%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	12/5/2021	774	774
CNY 4,130,000	ファンドは2.772%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	12/5/2021	1,574	1,574
BRL 305,734	ファンドは12.62%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	3,488	3,488
BRL 262,787	ファンドは12.73%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	3,572	3,572
BRL 1,147,681	ファンドは12.915%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	19,860	19,860
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	(3,107)	(3,107)
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	(3,107)	(3,107)
USD 37,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	(8,506)	(8,506)
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	(26,247)	(26,247)
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	(13,206)	(13,206)
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	12,166	12,166
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	18,615	18,615
BRL 1,221,256	ファンドは12.75%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2021	11,268	11,268
BRL 1,002,622	ファンドは12.365%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	6,697	6,697
BRL 267,573	ファンドは12.75%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	3,744	3,744
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	3,419	3,419
MXN 9,181,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、3.3099984%の固定金利を支払う	Citibank	6/8/2025	10,299	10,299

金利スワップ 2016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)
COP 2,440,101,307	ファンドは6.84%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	Citibank	29/7/2026	8,602	8,602
KRW 846,158,536	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	5,546	5,546
KRW 846,158,536	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.69%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/11/2017	(3,482)	(3,482)
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	686,091	686,091
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	(642,663)	(642,663)
MXN 11,053,204	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIE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	(11,414)	(11,414)
BRL 2,237,090	ファンドは12.305%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	306	306
BRL 3,999,600	ファンドは12.52%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	4,863	4,863
BRL 835,000	ファンドは12.7375%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	7,559	7,559
BRL 4,946,117	ファンドは12.5%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	45,237	45,237
COP 2,528,599,856	ファンドは6.9%の固定金利を受け取り、1日IBRCOLの変動金利を支払う	JP Morgan	29/7/2026	12,740	12,740
MXN 6,176,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIE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	6,742	6,742
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 129,494,087米ドル)				155,252	155,252

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 2016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)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	5,361	(1,926)
USD 575,434	ファンドはMexico (United Mexican States)に係るデフォルト・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	(3,015)	3,950
USD 33,606	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(357)	(201)
USD 245,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(8,376)	16,675
USD 13,720,000	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	(490,118)	(926,360)
USD (15,815,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	Barclays	20/6/2021	73,093	204,759
USD 278,626	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,446)	(1,669)
USD 282,333	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,506)	(1,691)
USD 278,625	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,446)	(1,669)
USD 280,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(8,076)	19,057
USD 278,626	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(3,695)	(1,669)
USD 738,000	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(14,961)	5,902
USD 338,800	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(4,055)	(2,030)
USD 702,000	ファンドはMalaysia (Federation of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(14,162)	5,614
USD 225,867	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(2,703)	(1,353)
USD 580,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(22,145)	39,476
USD 229,798	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(2,839)	(1,377)
USD 344,696	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(4,258)	(2,065)
USD 229,798	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(2,735)	(1,377)
USD 574,494	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(6,838)	(3,441)
USD 145,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(5,418)	9,869

クレジット・デフォルト・スワップ(続き) 2016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 673,000	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(7,253)	(4,032)
USD 2,475,500	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(31,346)	168,488
USD (14,835,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	BNP Paribas	20/6/2021	56,575	192,071
USD 140,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(4,773)	9,529
USD 251,000	ファンドはGenworth Holdings Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2020	15,724	37,894
USD 319,963	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(3,685)	(1,917)
USD 5,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(165)	340
USD 181,397	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(1,952)	12,346
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	39	(4,582)
USD 153,500	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(4,606)	10,447
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	426	(4,582)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	232	(4,582)
USD (693,104)	ファンドはMalaysia (Federation of)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	20/6/2021	10,903	(5,543)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(183)	(4,582)
USD 312,442	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(3,860)	(1,872)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(562)	(4,582)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	426	(4,582)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	(371)	(4,582)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	426	(4,582)
USD 88,250	ファンドはArgentina (Republic of)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	20/6/2021	426	(4,582)
USD 512,000	ファンドはGenworth Holdings Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	4,745	20,551

クレジット・デフォルト・スワップ(続き) 2016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 533,000	ファンドはGenworth Holdings Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	1,417	21,394
USD 512,000	ファンドはGenworth Holdings Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2018	4,905	20,551
USD (13,622,000)	ファンドはCDX.NA.HY.24.V3に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2020	258,471	919,743
USD (15,880,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	103,231	205,601
USD (19,035,000)	ファンドはCDX.NA.IG.26.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	20/6/2021	(20,194)	246,449
USD 145,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(5,429)	9,869
USD 160,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(5,910)	10,890
USD 160,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2021	(6,096)	10,890
USD 582,000	ファンドはGenworth Holdings Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	35,393	87,865
USD 575,434	ファンドはMexico (United Mexican States)に係るデフォルト・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	(3,008)	1,926
USD (575,434)	ファンドはMexico (United Mexican States)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	4,087	(3,950)
USD 355,000	ファンドはSouth Africa (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(11,726)	24,162
USD 639,000	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(8,564)	(3,828)
USD 295,159	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(3,404)	(1,768)
USD 89,160	ファンドはPhilippines (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(1,063)	(534)
USD (15,500,000)	ファンドはCDX.NA.HY.26.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	JP Morgan	20/6/2021	(18,096)	709,543
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 134,520,999米ドル)				(170,515)	2,014,341

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 2016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)
400,000	OTC GBP/USD	Citibank	1.305英ポンド	6/9/2016	117	1,942
1,030,000	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	18.5米ドル	28/9/2016	(6,682)	6,766
1,140,000	OTC USD/INR	Morgan Stanley	67.8米ドル	10/11/2016	(1,640)	12,718
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,084,762米ドル)					(8,205)	21,426

買建コール・オプション 2016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)
680,000	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	1,115米ドル	2/9/2016	(3,153)	3,471
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 381,937米ドル)					(3,153)	3,471

買建スワップション 2016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)	
USD 195,860,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/1/2019より1.1%の固定金利を半年毎に受け取り、17/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う	Citibank	13/7/2018	(331,787)	1,187,107	
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 86,176,273米ドル)					(331,787)	1,187,107

売建スワップション 2016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)	
USD (195,860,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/1/2019より0.76%の固定金利を半年毎に支払う	Citibank	13/7/2018	230,919	(689,623)	
USD (195,860,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、17/1/2019より0.41%の固定金利を半年毎に支払う	Citibank	13/7/2018	224,847	(300,058)	
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 94,541,995米ドル)					455,766	(989,681)

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	2,014,341
金利スワップ	155,252
スワップの時価	2,169,593
買建オプション/スワップション	
買建コール・オプション	3,471
買建プット・オプション	21,426
買建スワップション	1,187,107
買建オプション/スワップションの時価	1,212,004
売建スワップション	
売建スワップション	(989,681)
売建スワップションの時価	(989,681)
事後通告証券契約の時価	81,646,556
	未実現評価益/(損) (米ドル)
未決済上場先物取引	(246,246)
未決済先渡為替予約	73,149

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団投資事業（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。

2016年8月31日現在、当社は70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。

ファンドの併合と閉鎖

2015年9月25日付で、グローバル・エクイティ・ファンドはグローバル・オポチュニティーズ・ファンドと併合した。損益および純資産変動計算書、発行済投資証券口数変動表ならびに3会計年度末における純資産価額の概要は、グローバル・エクイティ・ファンドについて表示されている。当該ファンドの純資産計算書は、資産および負債が新たに併合された事業体であるグローバル・オポチュニティーズ・ファンドに移転されたため、表示されていない。

2015年12月21日付で、エマージング・マーケッツ・インベストメント・グレード・ボンド・ファンドは終了した。

2016年8月31日終了会計年度に生じた重要な事象

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18日付で、43のファンドが市場リスクの計測手法をVaRからコミットメント・アプローチに変更した。詳細についてはアペンディクスを参照のこと。

2016年1月18日付で、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッドが、ブラックロック（チャンネル・アイランズ）リミテッドに代わって当社の主要販売会社になった。2016年1月18日付で、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッドは、ブラックロック（チャンネル・アイランズ）リミテッドに一部の管理事務代行を任命した。

2016年1月20日付で、米ドル建のアジアン・マルチアセット・グロース・ファンドが設定された。

2016年6月23日に行われた国民投票により、英国の有権者は欧州連合からの離脱を決定した。国民投票の結果の影響に関する詳細については、投資顧問会社の報告書を参照のこと。

2016年6月30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。

2016年6月30日付で、アジアン・ローカル・ボンド・ファンドのパフォーマンス・ベンチマークが、HSBCアジアン・ローカル・ボンド・インデックスからマークイット・アイボックス・ALBI・インデックスに、および中国人民元ボンド・ファンドのパフォーマンス・ベンチマークが、HSBCオフショア人民元インデックスからマークイット・アイボックス・ALBI・チャイナ・オフショア・インデックスに変更された。

2016年7月19日付で、米ドル建のグローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンドが設定された。

2016年7月21日付で、米ドル建のストラテジック・グローバル・ボンド・ファンドが設定された。

2015年12月18日付で、以下のサブファンドは、ストック・コネクトを通じて上海証券取引所の中国A株式に投資することができる。フレキシブル・マルチアセット・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、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド、ニュー・エネルギー・ファンド、ワールド・アグリカルチャー・ファンド、ワールド・エネルギー・ファンド、ワールド・ゴールド・ファンド、ワールド・マイニング・ファンド、ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンドおよびワールド・テクノロジー・ファンド。同様に、2016年8月1日付で、グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンドおよびグローバル・エクイティ・インカム・ファンドもストック・コネクトを通じて中国A株式に投資することができる（以下総称して「ストック・コネクト・ファンド」という。）。

当期において、当社は信用供与契約を締結した。詳細については、注記18「信用供与」を参照のこと。

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 1 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、ルクセンブルグ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）および評価額が入り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、要求払手形ならびにその他の債務および前払費用は、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、それらの額面金額で評価される。

(b) 投資有価証券からの収益 / 費用

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利益 / 損失は未実現評価益 / (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。

当期において、フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドは差金決済取引契約(以下「CFD」という。)を締結した。CFDにより、投資家は変動証拠金でシンセティック・ロングポジションまたはシンセティック・ショートポジションを取ることができる。株式と違い、CFDにおいては、購入者は証拠金として支払った金額を上回る金額について責任を負う可能性がある。そのため、当ファンドは投資主から受け取った現金を様々な金融機関に預け入れており、これは英文目論見書にも記載されている。CFDポジションは、該当するベンチマーク以上またはそれ以下の事前に合意されたレートを適用する日次の金融費用に従って、締結される。関連する受取利息または支払利息は、損益および純資産変動計算書に源泉徴収税控除後の金額で開示される。

CFDの時価は、原証券や原資産が取引されるまたは取引を認められる証券取引所における取引価格により決定される。評価時刻後の立会時間外に取引される原証券については、その時点またはその他の時点における直近の周知の価格が使用される場合がある。時価の変動は(もしあれば)、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。CFDの満期または解約時における実現損益は損益および純資産変動計算書上に表示される。

CFDの売却損益は先入先出法(以下「FIFO」という。)を用いた原価法に基づき決定されている。

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ことになる。

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・ローンプールを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。

2016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、2016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。

2016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0.10%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)
アジア・マルチアセット・グロース・ファンド ⁽¹⁾	ブラックロック・グローバル・ファンズ・インディア・ファンド	1,469,689
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	66,808,000
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・タイガー・債券・ファンド	609
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	54,155,919

⁽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。

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、2016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	0.8974	0.7635	103.3400	0.9826	6.6935

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	0.9002	0.6951	113.2563	0.9824	6.5288

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。

損益および純資産変動計算書の結合数値は、期中の平均為替レートをを用いて算定されている。その結果生じる為替換算調整額154,343,612米ドルは、2015年8月31日と2016年8月31日の間の為替レートの変動を表す。これは想定金額であり、個々のファンドの純資産に対する影響はない。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2016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	0.2079	0.2723	0.2443	28.1344	0.2675	1.8223
アルゼンチン・ペソ(公式レート)	0.0512	0.0671	0.0602	6.9333	0.0659	0.4491
豪ドル	0.5734	0.7511	0.6740	77.6183	0.7380	5.0275
ブラジル・リアル	0.2363	0.3095	0.2778	31.9859	0.3041	2.0718
カナダ・ドル	0.5821	0.7624	0.6842	78.7885	0.7491	5.1033
スイス・フラン	0.7770	1.0177	0.9133	105.1707	1.0000	6.8121
チリ・ペソ	0.0011	0.0015	0.0013	0.1526	0.0015	0.0099
オフショア中国人民元	0.1141	0.1494	0.1341	15.4389	0.1468	1.0000
中国人民元	0.1143	0.1497	0.1344	15.4740	0.1471	1.0023
コロンビア・ペソ	0.0003	0.0003	0.0003	0.0351	0.0003	0.0023
チェコ・コルナ	0.0315	0.0412	0.0370	4.2609	0.0405	0.2760
デンマーク・クローネ	0.1143	0.1497	0.1344	15.4730	0.1471	1.0022
エジプト・ポンド	0.0860	0.1126	0.1011	11.6375	0.1107	0.7538
ユーロ	0.8508	1.1143	1.0000	115.1563	1.0949	7.4589
英ポンド	1.0000	1.3098	1.1754	135.3548	1.2870	8.7672
ガーナ・セディ	0.1919	0.2513	0.2255	25.9703	0.2469	1.6821
香港ドル	0.0984	0.1289	0.1157	13.3224	0.1267	0.8629
ハンガリー・フォリント	0.0027	0.0036	0.0032	0.3716	0.0035	0.0241
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0078	0.0001	0.0005
イスラエル・シェケル	0.2014	0.2639	0.2368	27.2670	0.2593	1.7661
インド・ルピー	0.0114	0.0149	0.0134	1.5431	0.0147	0.0999
アイスランド・クローナ	0.0065	0.0086	0.0077	0.8848	0.0084	0.0573
日本円	0.0074	0.0097	0.0087	1.0000	0.0095	0.0648
ケニア・シリング	0.0075	0.0099	0.0089	1.0196	0.0097	0.0660
韓国ウォン	0.0007	0.0009	0.0008	0.0927	0.0009	0.0060
クウェート・ディナール	2.5278	3.3109	2.9712	342.1505	3.2533	22.1617
スリランカ・ルピー	0.0052	0.0069	0.0062	0.7104	0.0068	0.0460
モロッコ・ディルハム	0.0782	0.1024	0.0919	10.5841	0.1006	0.6856

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
メキシコ・ペソ	0.0405	0.0531	0.0477	5.4876	0.0522	0.3554
メキシコU D I	0.2204	0.2886	0.2590	29.8260	0.2836	1.9319
マレーシア・リンギット	0.1883	0.2466	0.2213	25.4814	0.2423	1.6505
ナイジェリア・ナイラ	0.0024	0.0032	0.0028	0.3278	0.0031	0.0212
ノルウェー・クローネ	0.0917	0.1201	0.1078	12.4082	0.1180	0.8037
ニュージーランド・ドル	0.5536	0.7250	0.6507	74.9265	0.7124	4.8531
ペルー・新ソル	0.2254	0.2952	0.2649	30.5063	0.2901	1.9759
フィリピン・ペソ	0.0164	0.0215	0.0193	2.2178	0.0211	0.1437
パキスタン・ルピー	0.0073	0.0095	0.0086	0.9868	0.0094	0.0639
ポーランド・ズロチ	0.1956	0.2562	0.2299	26.4729	0.2517	1.7147
カタール・リアル	0.2097	0.2746	0.2464	28.3795	0.2698	1.8382
ルーマニア・レイ	0.1909	0.2500	0.2244	25.8357	0.2457	1.6734
ロシア・ルーブル	0.0117	0.0153	0.0138	1.5845	0.0151	0.1026
サウジ・リアル	0.2036	0.2666	0.2393	27.5543	0.2620	1.7847
スウェーデン・クローネ	0.0892	0.1168	0.1048	12.0735	0.1148	0.7820
シンガポール・ドル	0.5599	0.7334	0.6581	75.7887	0.7206	4.9090
スロバキア・コルナ	0.0282	0.0370	0.0332	3.8225	0.0363	0.2476
タイ・バーツ	0.0221	0.0289	0.0259	2.9854	0.0284	0.1934
新トルコ・リラ	0.2582	0.3382	0.3035	34.9524	0.3323	2.2639
台湾ドル	0.0241	0.0315	0.0283	3.2568	0.0310	0.2109
ウルグアイ・ペソ	0.0267	0.0350	0.0314	3.6164	0.0344	0.2342
米ドル	0.7635	1.0000	0.8974	103.3400	0.9826	6.6935
ベネズエラ・ボリバル・フェルテ	0.0012	0.0016	0.0014	0.1604	0.0015	0.0104
ベトナム・ドン	0.0000	0.0000	0.0000	0.0046	0.0000	0.0003
南アフリカ・ランド	0.0521	0.0683	0.0613	7.0533	0.0671	0.4569
ザンビア・クワチャ	0.0799	0.1046	0.0939	10.8096	0.1028	0.7002

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「C N H」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「C N Y」という。）に関連するものではない。C N H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、C N Y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18.3に従い、2016年8月31日現在、かかる希薄化調整はユーロ・コーポレート・債券・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・債券・ファンドおよびワールド・フィナンシャルズ・ファンドに適用されている。

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、預託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。預託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預託報酬に含まれており、注記19にも開示されている。

(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。

(j) 公正価値評価

特定の価値が上記の方法で確認できない場合、または、当社の取締役会が、当該目的上、その他の評価方法が該当する証券またはその他の資産の公正価値をより正確に反映すると考える場合、当該証券または資産の評価方法は当社の取締役会が完全な裁量権をもって決定した評価方法となる。例えば、特定のファンドの純資産価額を算定する際に、対象となる市場が取引終了となっている場合、または、政府が外国投資に係る財政上の費用または取引費用を課すことを選択した場合には、証券の価値が異なる可能性がある。当社の取締役会は特定の基準値を設定することができ、それを超えると、特定のインデックス調整を適用することにより、当該証券の公正価値への調整が行われる場合がある。

2016年8月31日現在、以下のとおり公正価値調整が行われた。

	通貨	公正価値評価された証券の時価	純資産比率(%)
アジアン・ドラゴン・ファンド	米ドル	40,230,039	1.87
アジアン・グロース・リーダーズ・ファンド	米ドル	23,070,620	1.68
アジアン・マルチアセット・グロース・ファンド ⁽¹⁾	米ドル	276,769	0.49
チャイナ・ファンド	米ドル	43,439,556	2.41
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	17,414,439	0.81
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	945,001	0.04
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	486,000	0.38
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	-	0.00
ヨーロピアン・フォーカス・ファンド	ユーロ	36,147,838	1.70
ヨーロピアン・ファンド	ユーロ	36,068,584	0.99
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	17,435,286	0.22
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	ユーロ	274,754	0.08
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	246,169,823	1.24
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	27,079	0.00
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	17,837,487	2.50
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	7,420,435	0.98
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	54,016,457	2.29
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	57,663,945	2.82
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	649,488	0.02
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド ⁽²⁾	米ドル	1,633,210	0.60

	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
グローバル・スモールキャップ・ファンド	米ドル	-	0.00
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	19,698,781	1.42
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	224,182	1.08
ニュー・エネルギー・ファンド	米ドル	848,074	0.09
パシフィック・エクイティ・ファンド	米ドル	3,065,105	1.93
USドル・コア・ボンド・ファンド	米ドル	1,555,845	0.31
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	121,382,051	2.81
USガバメント・モーゲージ・ファンド	米ドル	259,891	0.13
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	6,206,987	1.65
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	米ドル	364,920	0.34
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	680,460	0.04
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	40,632,217	0.80
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	10,458,526	0.33
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	11,127	0.00
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	2,804,726	1.44

(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。

(2) ファンドの併合。詳細については注記1を参照のこと。

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・エクイティーズ(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%(2015年:20.6%)のインドの源泉徴収税が課される。

2016年5月10日、インド税務委員会は、インド・モーリシャス租税条約に基づく現行のキャピタル・ゲイン税に係る免税措置の段階的廃止を公表した。変更は2017年4月1日に発効し、これによりインドは、2017年4月1日以降にモーリシャスの事業体が取得したインド法人の株式に対して、その売却から生じるキャピタル・ゲインに対する課税権を得ることになる。2017年4月1日より前に取得した株式はインドにおける課税権から保護される。ただし、段階的措置により、2017年4月1日から2019年3月31日の移行期間は税率がインド国内の税率の50%に制限される。インド国内の税率での課税は2019年会計年度以降に適用される。取締役会は引き続き、当該変更による影響を監視・評価していく。

子会社については、英文目論見書および577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、C S S F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。

リザーブ・ファンドの投資目的達成に貢献するため、特定の状況下において、例えば、市況がファンドの原投資にマイナス利回りを引き起こす場合には、運用会社は、特定の日付または特定の日数にわたって支払われる投資運用報酬全額を受け取る権利を放棄することができる。運用会社は自由裁量で権利を放棄することができ、これにより将来発生する投資運用報酬全額を受け取る権利が損なわれることはない。

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

2016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、S、XおよびZ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、S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18.3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。2016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、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。

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現在は払っておらず、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、2015年7月20日以降は、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に支払われる報酬に充てるために使われる。2016年8月31日終了会計年度において、当該報酬は1,128,654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対する報酬)、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は、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)。

2016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. 預託報酬

当期における当社の預託銀行は、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。預託銀行は、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。

預託報酬はファンドに直接請求される。2016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。

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JおよびクラスX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。2016年8月31日終了会計年度において、ルクセンブルグの税金に関連する49,156,325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。2016年8月31日終了会計年度において、ベルギーの税金に関連する3,539,756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、<https://www.gov.uk/government/publications/offshore-fundslist-of-reporting-funds>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「FTT」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FTT）。

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（UK）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「BLK Jap」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・マルチアセット・グロース・ファンド ⁽¹⁾	BSL、BIMUK、 BIMLLC	BAMNA、 BLKAus
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

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
コンチネンタル・ヨーロピアン・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・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	-
ヨーロピアン・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロピアン・フォーカス・ファンド	BIMUK	-
ヨーロピアン・ファンド	BIMUK	-
ヨーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロピアン・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロピアン・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・インカム・ファンド	BIMUK	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	BLKAus
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	BFM	BLKAus
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド ⁽¹⁾	BIMUK	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド ⁽²⁾	BIMUK、BIMLLC	-
グローバル・スモールキャップ・ファンド	BIMLLC	-
インドア・ファンド	BIMUK	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA
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	BIMUK	BLKJap
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMLLC	-
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	BIMLLC、BIMUK	-
ニュー・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	BIMLLC	-
パシフィック・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA
中国人民元ボンド・ファンド	BSL、BIMUK	BAMNA
ストラテジック・グローバル・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	BSL、BIMUK、 BFM	BLKAus
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	BIMUK	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
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・パリュール・ファンド	B I M L L C	-
USドル・コア・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K、 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 U K、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 U K、B I M L L C	-
ワールド・マイニング・ファンド	B I M U K	-
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。

(2) ファンドの併合。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・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。

投資運用会社、または共通管理・支配により投資運用会社と関係している会社、もしくは実質的な直接・間接保有により投資運用会社と関係している会社が管理するその他のUCITSおよび/またはその他の集団投資事業(以下「UCI」という。)のユニットに当ファンドが投資している場合、かかるその他のUCITSおよび/またはUCIのユニットに対する投資について、当社は発行手数料または償還手数料を請求されることはない。当ファンドは、可能な場合、投資運用報酬の対象ではないクラスX投資証券に投資する。

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(UK)リミテッドである。ブラックロック・アドバイザーズ(UK)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。当ファンドの一部は、投資目的でデリバティブ戦略を利用する場合がある。詳細は、英文目論見書に含まれる個々のファンドの投資目的および方針に関するセクションに記載されている。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(UK)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(UK)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(UK)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・マーケッツ・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、ゴールドマン・サックス、香港上海銀行Plc、JPモルガン、マッコリー銀行リミテッド、メリルリンチ、モルガン・スタンレー、野村インターナショナルPlc、RBS 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。この担保は預託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。

2016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。

2016年8月31日現在、貸付有価証券の評価額合計は8,757,641,258米ドルであり、有価証券担保の時価は9,714,241,001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
A S E A Nリーダーズ・ファンド	239,381	269,865
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	50,766,591	54,721,933
アジア・ドラゴン・ファンド	57,552,415	72,237,766
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	29,524,436	32,869,267
アジア・ローカル・ボンド・ファンド	22,154	67,822
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	211,329,537	240,901,155
チャイナ・ファンド	246,830,096	275,091,655
コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンド	90,286,269	98,190,626
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	81,299,836	88,529,701
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	224,261,357	244,126,470
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	3,545,728	4,009,578
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	21,629,440	24,055,388
エマージング・マーケット・ファンド	40,772,188	50,518,714
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	76,346,755	82,214,386
ユーロ・ボンド・ファンド	969,930,213	1,059,585,183
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	111,091,848	124,698,684
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	1,242,382,054	1,375,194,912
ユーロ・マーケット・ファンド	247,405,718	265,585,248
ヨーロピアン・エクイティ・インカム・ファンド	89,062,930	112,358,683
ヨーロピアン・フォーカス・ファンド	46,253,908	50,676,400
ヨーロピアン・ファンド	227,255,235	253,130,082
ヨーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	593,941	660,713
ヨーロピアン・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	67,396,633	73,055,473
ヨーロピアン・バリュー・ファンド	107,457,199	114,923,167
フィクسد・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	513,533,365	563,556,788
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	11,961,347	13,342,146
グローバル・アロケーション・ファンド	1,331,742,228	1,488,636,321
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	80,390,998	87,690,617
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	57,551,660	63,834,422
グローバル・エンハンスト・エクイティ・イールド・ファンド	52,358,322	57,376,747
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	164,510,940	178,700,592
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	88,544,686	97,738,980
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	84,357,532	92,605,775
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	16,129,551	17,700,834
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	46,134,361	54,503,479
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド ⁽¹⁾	25,273,964	28,736,218
グローバル・スモールキャップ・ファンド	59,613,775	66,140,630
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	52,162,420	61,801,638
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	114,358,665	124,690,819
ラテン・アメリカン・ファンド	46,980,598	51,531,440
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	1,301,672	1,354,254
ニュー・エネルギー・ファンド	68,854,806	75,337,676
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	2,301,263	2,828,708
パシフィック・エクイティ・ファンド	24,724,021	29,452,937
中国人民元ボンド・ファンド	4,123,256	4,470,664

(単位:米ドル)

ファンド	貸付有価証券の評価額	担保の時価
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 ⁽²⁾	61,182,782	65,763,532
ユナイテッド・キングダム・ファンド	31,732,364	34,113,851
USベーシック・バリュー・ファンド	155,102,280	172,170,949
USドル・コア・ボンド・ファンド	6,340,777	7,826,916
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	123,245,775	136,837,204
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	120,288,413	132,282,860
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	41,274,938	45,109,557
USグロース・ファンド	40,188,749	44,563,608
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	56,231,809	61,340,721
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	19,135,686	22,026,131
ワールド・ボンド・ファンド	107,442,699	118,260,979
ワールド・エネルギー・ファンド	65,697,592	72,204,684
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	23,219,436	24,419,007
ワールド・ゴールド・ファンド	190,883,221	211,963,129
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	185,857,386	203,783,259
ワールド・マイニング・ファンド	413,839,640	472,538,716
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	1,753,811	2,180,328
ワールド・テクノロジー・ファンド	24,078,608	27,151,014

(1) ファンドの併合。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 販売中止になったファンド。詳細については注記1を参照のこと。

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、2016年8月31日現在、その評価額は60,794,858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(UK)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、2016年8月31日現在、その評価額は474,556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。2016年8月31日現在、これらの有価証券の評価額は14,987,935米ドルである。

ファンド	額面金額	銘柄	評価額 (単位:米ドル)
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	371,000	United States Treasury Note 1.5% 28/2/2019	365,424
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	35,000	France Government Bond 0.5% 25/5/2025	39,015
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	3,318,000	United States Treasury Note 0.125% 15/4/2020	3,379,507
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	105,000	United States Treasury Note 1.125% 28/2/2021	103,812
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	1,818,000	United States Treasury Note 1.5% 28/2/2019	1,828,153
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	515,000	United States Treasury Note 4.5% 31/10/2019	510,193
グローバル・アロケーション・ファンド	1,378,000	United States Treasury Note 0.75% 31/12/2017	1,352,441
グローバル・アロケーション・ファンド	3,437,000	United States Treasury Note 1.75% 30/9/2022	3,396,508
グローバル・アロケーション・ファンド	53,000	United States Treasury Note 1.875% 30/9/2017	53,009
グローバル・アロケーション・ファンド	241,000	United States Treasury Note 2.125% 30/9/2021	240,835
グローバル・アロケーション・ファンド	497,000	United States Treasury Note 3.5% 15/5/2020	529,346
グローバル・アロケーション・ファンド	1,654,000	United States Treasury Note 4.5% 15/5/2017	1,721,207
ワールド・ボンド・ファンド	825,000	United Kingdom Gilt 4.5% 7/3/2019	1,176,113
ワールド・ボンド・ファンド	138,000	United Kingdom Gilt 4.75% 7/12/2038	292,372

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、バークレイズ、BNPパリバ、BNYメロン、ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー、シティバンク、シティグループ、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、香港上海銀行Plc、JPモルガン、メリルリンチ、モルガン・スタンレー、野村、ノーザン・トラスト、RBS Plc、ソシエテ・ジェネラル、スタンダードチャータード銀行、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。

2016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・ローカル・ボンド・ファンド	米ドル	28,000	-	-	-
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	4,853,000	-	-	-
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	-	-	609,000	(85,376)
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	13,900,000	(9,170,311)	5,079,083	-
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	-	-	44,758	-
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	-	-	261,000	(87,452)
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	-	(10,000)	8,981,000	-
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	-	(725,000)	2,589,631	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	ユーロ	-	(1,340,000)	22,513,091	-
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	1,804,000	(42,679,120)	81,913,557	(82,757)
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	ユーロ	-	(1,930,000)	2,295,977	(51,738)
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	19,007,000	(124,882,678)	43,995,224	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	700,000	(50,000)	11,607,892	(279,057)
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	1,200,365	(2,609,000)	2,481,521	(387,572)
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	-	-	35,855,757	(173,618)
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	米ドル	-	-	1,596,000	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	510,000	(2,654,885)	5,361,263	-
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	-	(560,000)	367,702	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	15,080,000	-	15,334,651	(5,499,138)
インド・ファンド	米ドル	-	-	7,385,270	-
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	-	-	125,000	-
中国人民元ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	-	-	642	(768)
ストラテジック・グローバル・ボンド・ ファンド ⁽¹⁾	米ドル	-	-	979,157	(46,249)
USドル・コア・ボンド・ファンド	米ドル	-	(602,860)	597,503	(125,608)
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	-	(9,430,000)	10,800,570	-
USドル・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	米ドル	-	(2,481,283)	897,641	-
USガバメント・モーゲージ・ファンド	米ドル	-	-	88,727	-
ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	(600,000)	4,835,501	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	150,000	-	-	-

(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、金利差分配型投資証券および基準額以上分配型投資証券）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る。配当金の支払に関する詳細については、英文目論見書に記載されている。

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. 信用供与

2016年4月、BGFはJPモルガン・チェース銀行・エヌ・イー（以下「JPモルガン」という。）と、JPモルガンがその他のシンジケート・ローンの貸手と共に、当ファンドに775百万米ドルの信用供与を行う契約を締結した。当ファンドは、この信用供与枠を一時的な資金調達目的で利用し、その目的には、例えば、投資家に対する償還資金を含むがこれに限定されない。かかる信用供与枠からの引出に関連する利息や未使用枠の手数料は、運用会社に支払われる管理事務代行報酬から負担される。2016年8月31日現在、当ファンドについて、かかる信用供与枠の未返済残高はない。

19. 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、2016年8月31日終了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
ASEANリーダーズ・ファンド	米ドル	585,608
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	2,612,614
アジア・ドラゴン・ファンド	米ドル	5,455,649
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	米ドル	4,625,230
アジア・ローカル・ボンド・ファンド	米ドル	38,006
アジア・マルチアセット・グロース・ファンド ⁽¹⁾	米ドル	133,964
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	523,198
チャイナ・ファンド	米ドル	5,428,702
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	5,467,099
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	2,028,475
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	10,501
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	8,747
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	1,054,727
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	1,692,036
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 ⁽²⁾	米ドル	6,319
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	8,134

ファンド	通貨	取引費用
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	37,639
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	30,386
ユーロ・リザーブ・ファンド	ユーロ	6,341
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	ユーロ	32,663
ユーロ・マーケッツ・ファンド	ユーロ	11,283,340
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	ユーロ	13,770,318
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド	ユーロ	8,120,905
ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	14,463,070
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	4,738
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	ユーロ	5,944,054
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	ユーロ	8,680,378
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	957,245
フレキシブル・マルチアセット・ファンド	ユーロ	299,024
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	15,665,160
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	24,783
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	1,170,783
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	969,493
グローバル・エクイティ・ファンド ⁽³⁾	米ドル	19,088
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	1,514,993
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	米ドル	14,432
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	176,250
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	9,211
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド ⁽¹⁾	米ドル	3,772
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	1,436,492
グローバル・オポチュニティーズ・ファンド ⁽³⁾	米ドル	312,393
グローバル・スモールキャップ・ファンド	米ドル	798,267
インド・ファンド	米ドル	1,387,631
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	日本円	22,668,910
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	88,897,086
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	2,695,945
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	66,741
ニュー・エネルギー・ファンド	米ドル	128,226
ノースアメリカン・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	73,794
パシフィック・エクイティ・ファンド	米ドル	543,849
中国人民元ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	55,707
ストラテジック・グローバル・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	米ドル	1,451
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 ⁽⁴⁾	スイス・ フラン	710,586
ユナイテッド・キングダム・ファンド	英ポンド	850,919
USベシック・バリュー・ファンド	米ドル	876,053
USドル・コア・ボンド・ファンド	米ドル	59,427
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	448,740
USドル・リザーブ・ファンド	米ドル	5,205
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	米ドル	16,667
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	米ドル	292,462
USガバメント・モーゲージ・ファンド	米ドル	67,310
USグロース・ファンド	米ドル	214,716

ファンド	通貨	取引費用
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	312,697
ワールド・アグリカルチャー・ファンド	米ドル	235,207
ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	17,468
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	1,388,752
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	643,773
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	2,994,375
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	1,769,751
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	4,835,364
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	379,087
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	320,926

(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。

(2) ファンドの終了。詳細については注記1を参照のこと。

(3) ファンドの併合。詳細については注記1を参照のこと。

(4) 販売中止になったファンド。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。

20. 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なかった。

21. 後発事象

2016年10月6日付で、アレクサンダー C. ホクター・ダンカンとブルーノ・ロベリィが当社の取締役を退任した。

2016年10月17日付で、バリー・オドワイヤーとロバート・ヘイズが当社の取締役に任命された。

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29年6月末現在)

【純資産額計算書】

資産総額	1,842,205,648円
負債総額	862,138円
純資産総額(-)	1,841,343,510円
発行済数量	1,857,312,896口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9914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会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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カ年における主な資本金の額の増減
該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

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

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門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2017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	69本	910,172百万円
	単位型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		65本	4,066,045百万円
合計		134本	4,976,217百万円

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30期事業年度(自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第29期 (平成27年12月31日現在)	第30期 (平成28年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	14,514	12,415
立替金	6	49
前払費用	146	127
未収入金	2	207
未収委託者報酬	1,077	1,163
未収運用受託報酬	2,742	2,771
未収収益	2	1,467
繰延税金資産	882	845
関係会社短期貸付金	2	130
その他流動資産	4	5
流動資産計	21,179	18,573
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,223
器具備品	1	292
有形固定資産計	1,515	1,536
無形固定資産		
ソフトウェア	0	8
のれん	154	98
無形固定資産計	155	106
投資その他の資産		
投資有価証券	-	0
長期差入保証金	967	972
前払年金費用	409	501
長期前払費用	17	8
繰延税金資産	9	-
投資その他の資産計	1,404	1,483
固定資産計	3,075	3,127
資産合計	24,255	21,701

	第29期 (平成27年12月31日現在)	第30期 (平成28年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	80	86
未払金	2	
未払収益分配金	3	3
未払償還金	75	75
未払手数料	346	392
その他未払金	947	1,385
未払費用	2	
未払消費税等	238	52
未払法人税等	561	263
賞与引当金	1,875	1,884
役員賞与引当金	150	141
早期退職慰労引当金	7	37
流動負債計	5,377	5,465
固定負債		
退職給付引当金	53	60
資産除去債務	254	258
繰延税金負債	-	29
固定負債計	308	348
負債合計	5,685	5,813
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	9,634	6,953
利益剰余金合計	9,971	7,290
株主資本合計	18,569	15,887
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	-	0
評価・換算差額等合計	-	0
純資産合計	18,569	15,887
負債・純資産合計	24,255	21,701

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第29期		第30期	
	(自 平成27年 1月 1日 至 平成27年12月31日)		(自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	
営業収益				
委託者報酬		4,339		3,977
運用受託報酬	1	10,063		9,036
その他営業収益	1	9,911		10,533
営業収益計		24,315		23,546
営業費用				
支払手数料		1,478		1,296
広告宣伝費		262		237
調査費				
調査費		398		383
委託調査費	1	4,371		4,020
調査費計		4,770		4,404
委託計算費		124		114
営業雑経費				
通信費		61		53
印刷費		74		63
諸会費		27		31
営業雑経費計		163		148
営業費用計		6,799		6,201
一般管理費				
給料				
役員報酬		548		604
給料・手当		3,631		3,809
賞与		2,231		2,232
給料計		6,411		6,646
退職給付費用		227		256
福利厚生費		731		822
事務委託費	1	1,954		2,216
交際費		54		51
寄付金		5		2
旅費交通費		208		241
租税公課		107		142
不動産賃借料		735		732
水道光熱費		75		64
固定資産減価償却費		214		229
のれん償却額		530		56
クライアント・リレーションシップ資産償却費		230		-
資産除去債務利息費用		3		3
諸経費		376		414
一般管理費計		11,869		11,881
営業利益		5,645		5,463

	第29期 (自 平成27年 1月 1日 至 平成27年12月31日)	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
営業外収益		
受取利息	6	3
為替差益	-	12
雑益	28	0
営業外収益計	34	16
営業外費用		
支払利息	-	0
有価証券売却損	-	0
為替差損	32	-
固定資産除却損	34	1
営業外費用計	66	1
経常利益	5,613	5,479
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	26	163
特別損失計	26	163
税引前当期純利益	5,586	5,315
法人税、住民税及び事業税	2,366	1,920
法人税等調整額	37	76
当期純利益	3,182	3,318

(3)【株主資本等変動計算書】

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

第30期（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

(単位：百万円)

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

【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) 連結納税制度の適用

前事業年度より、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27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
建物附属設備	1,039 百万円	1,191 百万円
器具備品	649 百万円	717 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27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
未収入金	200 百万円	- 百万円
未収収益	379 百万円	484 百万円
短期貸付金	130 百万円	- 百万円
未払金	930 百万円	1,361 百万円
未払費用	201 百万円	173 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27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成27年 1月 1日 至 平成27年12月31日)	当事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
その他営業収益	4,286 百万円	4,730 百万円
委託調査費	467 百万円	377 百万円
事務委託費	613 百万円	630 百万円
運用受託報酬	1 百万円	4 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

	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28年1月1日至平成28年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

	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

配当支払額

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

（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	-

当事業年度(平成28年12月31日)

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

(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

当事業年度(平成28年12月31日)

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

(有価証券関係)

前事業年度(平成27年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(平成28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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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。

	前事業年度 (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

	前事業年度 (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。

当事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

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

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

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

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、68百万円でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	155	196
賞与引当金	619	581
資産除去債務	82	79
資産調整勘定	46	24
未払事業税	105	55
早期退職慰労引当金	2	11
退職給付引当金	17	18
有形固定資産	0	5
その他	15	9
繰延税金資産合計	1,046	983
繰延税金負債		
無形固定資産	-	-
退職給付引当金	132	153
資産除去債務に対応する除去費用	21	13
繰延税金負債合計	153	167
繰延税金資産の純額	892	815

(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 (平成27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
流動資産 - 繰延税金資産	882	845
固定資産 - 繰延税金資産	9	-
固定負債 - 繰延税金負債	-	29

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

	前事業年度 (平成27年12月31日)	当事業年度 (平成28年12月31日)
法定実効税率	35.6 %	33.1 %
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.0	3.3
損金不算入ののれん償却額	3.3	0.3
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.2	0.8
その他	0.2	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	43.0 %	37.5 %

(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

当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自平成27年1月1日 至平成27年12月31日)	当事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)
期首残高	293	254
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	42	-
期末残高	254	258

(セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

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

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(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・ファイナンシャル・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
								0	未収収益	0
								0	短期貸付金	130
								0	その他未払金	930

当事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

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

(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。

当事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

該当事項はありません。

(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	1,723百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	543	未収収益	49
							委託調査費	1,449	未払費用	142
							事務委託費	74		

当事業年度 (自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	2,815	未収収益	267
							委託調査費	40	未払費用	3
							事務委託費	0		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	87百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	425	未収収益	35
							委託調査費	1,556	未払費用	135
							事務委託費	81		

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)

ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)

ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自平成27年1月1日 至平成27年12月31日)	当事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)
1株当たり純資産額	1,828,038 円 62 銭	1,564,056 円 75 銭
1株当たり当期純利益金額	313,321 円 29 銭	326,685 円 49 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いません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自平成27年1月1日 至平成27年12月31日)	当事業年度 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)
当期純利益 (百万円)	3,182	3,318
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	3,182	3,318
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28年1月1日 至平成28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
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行いました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行いました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行いました。
2007年12月27日	事業を営むことの目的を変更するため、定款変更を行いました。
2008年7月1日	グループ会社の1つであるパークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社を吸収合併し、それに伴い資本金の額を変更いたしました。
2008年7月1日	株式取扱規則に関する記述を追加するため、定款変更を行いました。
2009年6月22日	本店所在地変更のため、定款変更を行いました。
2009年12月2日	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 商号変更(「ブラックロック・ジャパン株式会社」に変更)および定款変更を行いました。
2011年4月1日	グループ会社であるブラックロック証券株式会社を吸収合併し、それに先立ち定款変更および資本金の額の変更を行いました。
2013年10月5日	MGPA Japan LLCより不動産投資関連の事業を譲受し、それに先立ち定款変更を行いました。
2014年12月1日	決算期を3月31日から12月31日に変更するため、定款変更を行いました。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(2017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(2017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) (2017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	
株式会社伊予銀行*	20,948	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。

* 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。

2017年1月10日	臨時報告書
2017年3月17日	有価証券報告書、有価証券届出書
2017年4月6日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成29年2月24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28年1月1日から平成28年12月31日までの第30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28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29年8月9日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 辻村 和之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの平成28年12月21日から平成29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29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。