

【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】 2019年3月15日

【計算期間】 第27特定期間（自 2018年6月21日 至 2018年12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】 猪浦 純子

【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】 03-6703-7940

【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ないます。

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

<各分類および区分の定義>

．商品分類

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

．属性区分

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

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

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

ファンドの特色

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

主要投資対象ファンドの投資対象

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

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

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

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

■柔軟性の高い運用

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

■リスクコントロール

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

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

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

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

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

d．原則として、毎月分配を行いません。

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

【イメージ図】



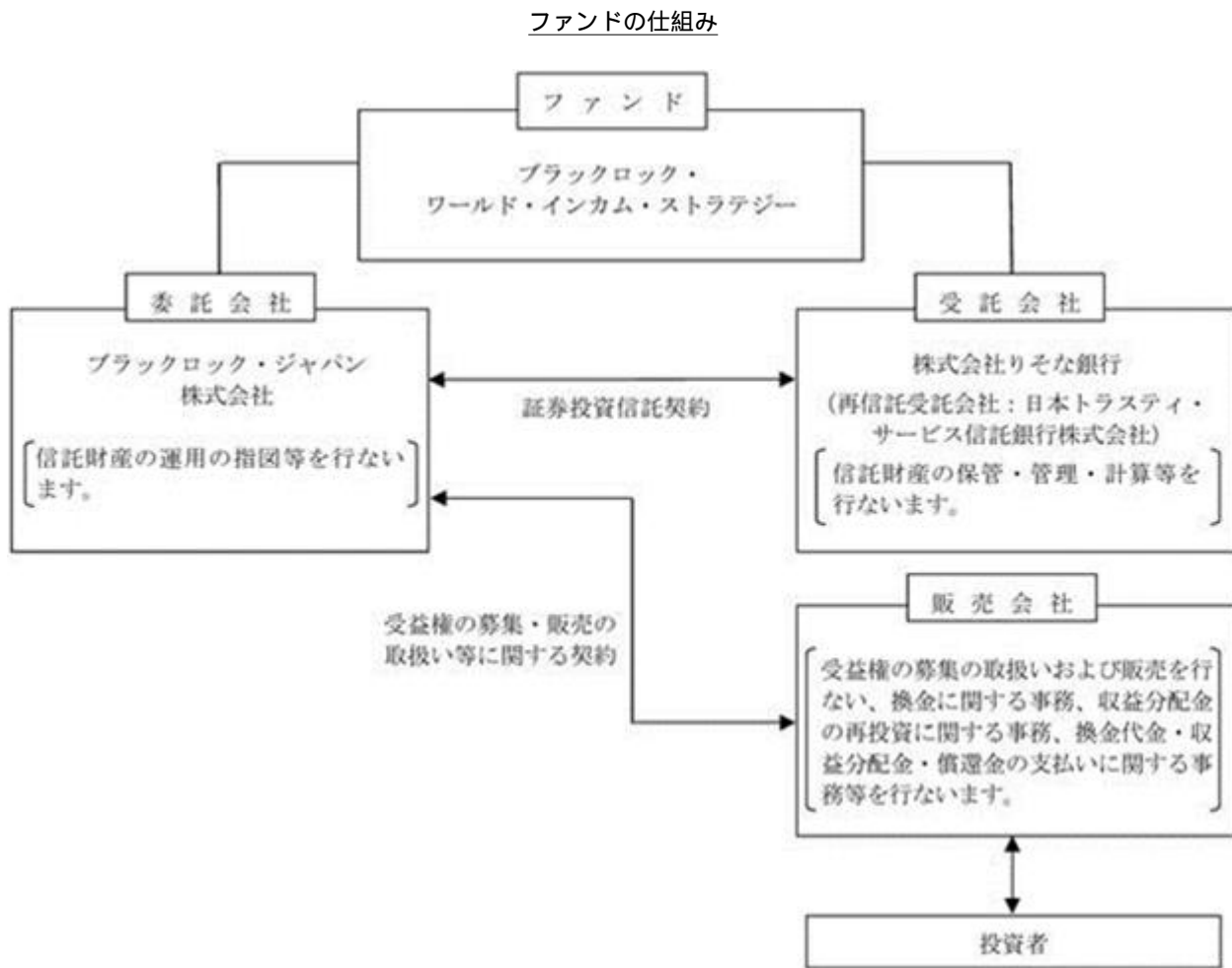
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3)【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

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

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2018年12月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

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

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

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

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

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

(b) BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

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

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

(3)【運用体制】

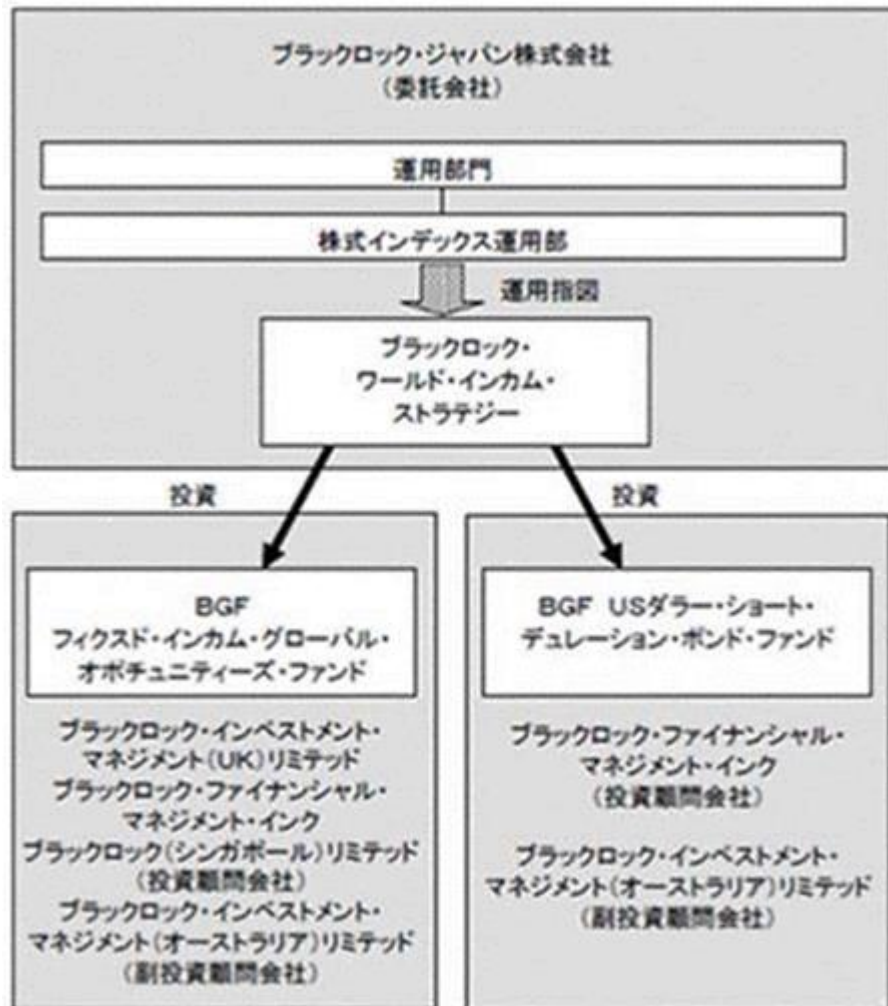
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：9名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

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

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

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

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

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



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約5.97兆ドル^{*}（約655兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

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

* 2018年12月末現在。(円換算レートは1ドル=109.715円を使用)

(4)【分配方針】

収益分配方針

月1回の毎決算時(原則として毎月20日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。

a. 分配対象額の範囲

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

b. 分配対象収益についての分配方針

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

c. 留保益の運用方針

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

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

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

b. 時効

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

収益分配金に関する留意事項

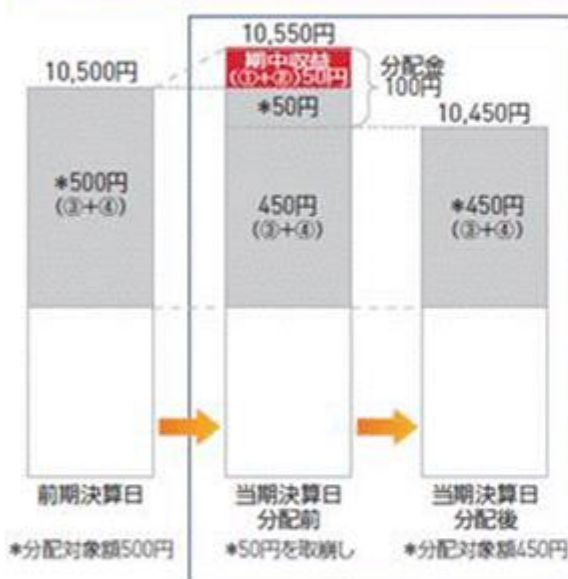
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



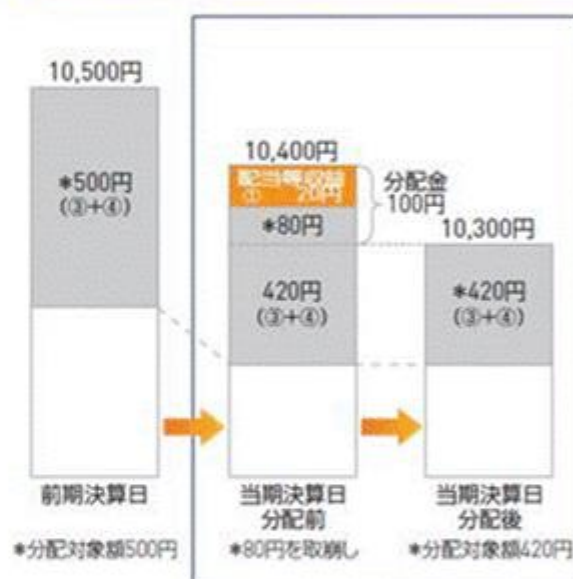
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

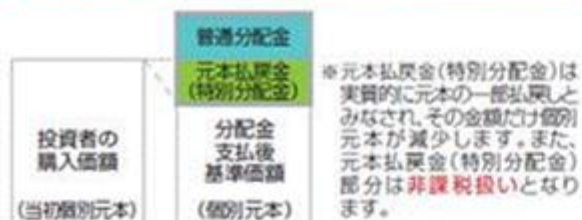


(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

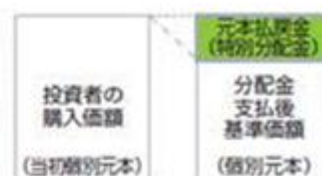
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

(5)【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

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

b．信用リスク

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

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

c．期限前償還リスク

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

d．為替変動リスク

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

e．カントリー・リスク

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

f. デリバティブ取引のリスク

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

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

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

b. ファンドの繰上償還

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

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

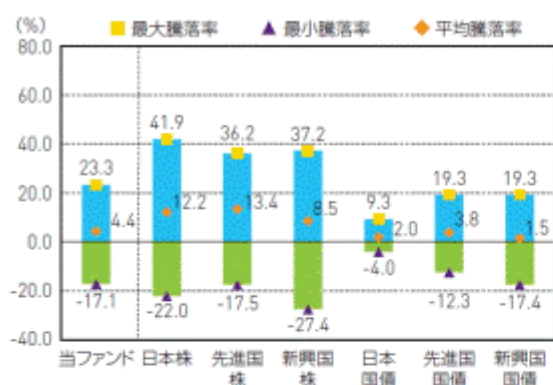
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

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

(2014年1月~2018年12月)



※上記グラフは、2014年1月~2018年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI国債

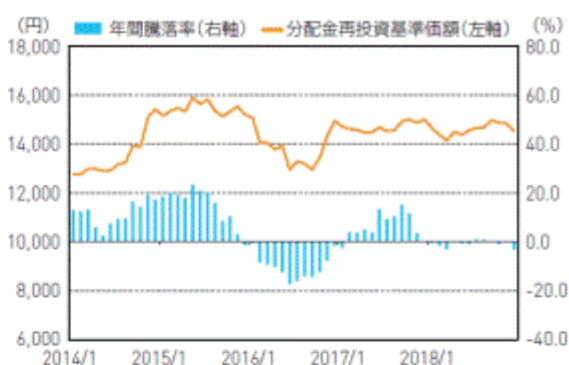
先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2014年1月~2018年12月)



※上記グラフは、2014年1月~2018年12月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

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

<各指数について>

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

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

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

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

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

- a. 個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

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

b. 法人の投資者に対する課税

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

上記は2018年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2018年12月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,576,190,851	96.98
内 ルクセンブルグ	1,576,190,851	96.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	49,052,941	3.02
純資産総額	1,625,243,792	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/ 地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,432,560	1,088.90	1,559,929,060	1,088.90	1,559,929,061	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	9,959	1,631.55	16,249,305	1,632.80	16,261,790	1.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.98

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

2018年12月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8特定期間	第40期(2009年1月20日)	19,034,354,837	19,139,727,309	0.7226	0.7266
	第41期(2009年2月20日)	19,513,893,830	19,593,054,633	0.7395	0.7425
	第42期(2009年3月23日)	18,538,961,270	18,611,926,067	0.7622	0.7652
	第43期(2009年4月20日)	18,364,027,254	18,433,643,934	0.7914	0.7944
	第44期(2009年5月20日)	17,662,594,042	17,730,704,246	0.7780	0.7810
	第45期(2009年6月22日)	16,706,815,281	16,770,956,599	0.7814	0.7844
第9特定期間	第46期(2009年7月21日)	16,459,175,020	16,522,406,387	0.7809	0.7839
	第47期(2009年8月20日)	16,539,085,565	16,601,108,801	0.8000	0.8030
	第48期(2009年9月24日)	16,495,357,752	16,557,085,526	0.8017	0.8047
	第49期(2009年10月20日)	16,368,225,399	16,429,411,038	0.8026	0.8056
	第50期(2009年11月20日)	15,855,289,033	15,915,097,990	0.7953	0.7983
第10特定期間	第51期(2009年12月21日)	15,727,275,360	15,786,916,559	0.7911	0.7941
	第52期(2010年1月20日)	15,879,099,243	15,938,976,920	0.7956	0.7986
	第53期(2010年2月22日)	15,622,514,310	15,682,374,624	0.7829	0.7859
	第54期(2010年3月23日)	15,153,523,145	15,211,297,623	0.7869	0.7899
	第55期(2010年4月20日)	14,712,789,821	14,767,653,188	0.8045	0.8075
	第56期(2010年5月20日)	14,149,503,857	14,203,706,884	0.7831	0.7861
第11特定期間	第57期(2010年6月21日)	13,688,423,551	13,724,013,776	0.7692	0.7712
	第58期(2010年7月20日)	11,953,075,578	11,984,914,441	0.7508	0.7528
	第59期(2010年8月20日)	11,308,909,494	11,339,059,482	0.7502	0.7522
	第60期(2010年9月21日)	10,792,419,166	10,821,365,833	0.7457	0.7477
	第61期(2010年10月20日)	9,719,515,608	9,733,187,683	0.7109	0.7119
	第62期(2010年11月22日)	8,197,751,787	8,209,183,400	0.7171	0.7181
第12特定期間	第63期(2010年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
	第64期(2011年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(2011年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(2011年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(2011年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(2011年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
第13特定期間	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
	第70期(2011年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
第14特定期間	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
	第76期(2012年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
第81期(2012年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849	

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15特定期間	第82期(2012年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(2013年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471
第18特定期間	第100期(2014年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年6月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412
第19特定期間	第106期(2014年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954
第20特定期間	第112期(2015年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年6月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722
第22特定期間	第124期(2016年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118

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23特定期間	第130期(2016年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
第27特定期間	第154期(2018年7月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年8月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年9月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596
	2017年12月末現在	1,594,141,452		1.0011	
	2018年1月末現在	1,493,578,167		0.9747	
	2018年2月末現在	1,471,520,944		0.9553	
	2018年3月末現在	1,449,625,133		0.9369	
	2018年4月末現在	1,480,558,104		0.9588	
	2018年5月末現在	1,470,656,513		0.9487	
	2018年6月末現在	1,480,742,419		0.9593	
	2018年7月末現在	1,474,542,440		0.9634	
	2018年8月末現在	1,478,542,859		0.9624	
	2018年9月末現在	1,491,234,339		0.9803	
	2018年10月末現在	1,438,290,221		0.9709	
	2018年11月末現在	1,420,652,398		0.9674	
	2018年12月末現在	1,625,243,792		0.9450	

【分配の推移】

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

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
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
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020

【収益率の推移】

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

特定期間	計算期間	収益率(%)
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
第25特定期間	第142期	0.5
	第143期	2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	0.8
	第147期	1.2
第26特定期間	第148期	1.0
	第149期	3.6
	第150期	1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	1.0
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	1.8
	第156期	1.5
	第157期	0.2
	第158期	0.1
	第159期	0.4

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

(4)【設定及び解約の実績】

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

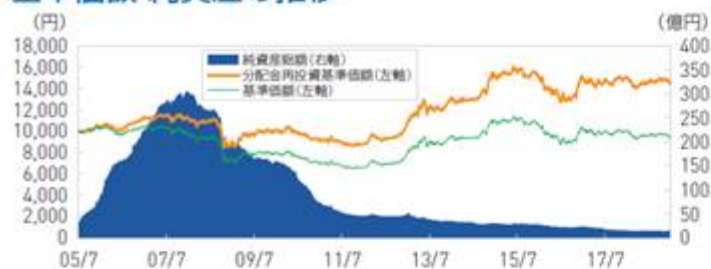
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252		1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446

(参考情報)

運用実績

2018年12月28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。

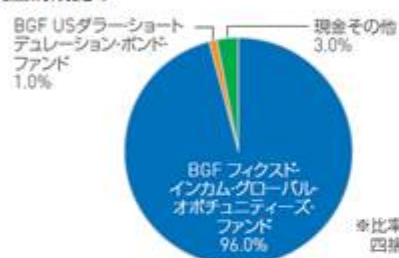
分配の推移

設定来累計		3,940円
直近1年間累計		240円
第155期	2018年8月	20円
第156期	2018年9月	20円
第157期	2018年10月	20円
第158期	2018年11月	20円
第159期	2018年12月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



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

組入上位10銘柄*(%)

	銘柄名	種別	比率
1	FNMA 30YR TBA(REG A) 4.5 02/13/2019	政府系不動産担保証券	13.5
2	GNMA2 30YR TBA(REG C) 4 01/23/2019	政府系不動産担保証券	6.9
3	FNMA 15YR 2017 PRODUCTION	政府系不動産担保証券	6.5
4	GNMA2 30YR TBA(REG C) 4.5 01/23/2019	政府系不動産担保証券	4.8
5	FNMA 30YR TBA(REG A) 4.5 01/14/2019	政府系不動産担保証券	4.5
6	FNMA 30YR TBA(REG A) 5 01/14/2019	政府系不動産担保証券	3.9
7	FNMA 15YR TBA(REG B) 3 01/17/2019	政府系不動産担保証券	3.5
8	FNMA 30YR TBA(REG A) 4 01/14/2019	政府系不動産担保証券	1.9
9	FNMA 15YR 2016 PRODUCTION	政府系不動産担保証券	1.9
10	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2020	国債	1.7

*当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の組入れ銘柄です。(2018年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。



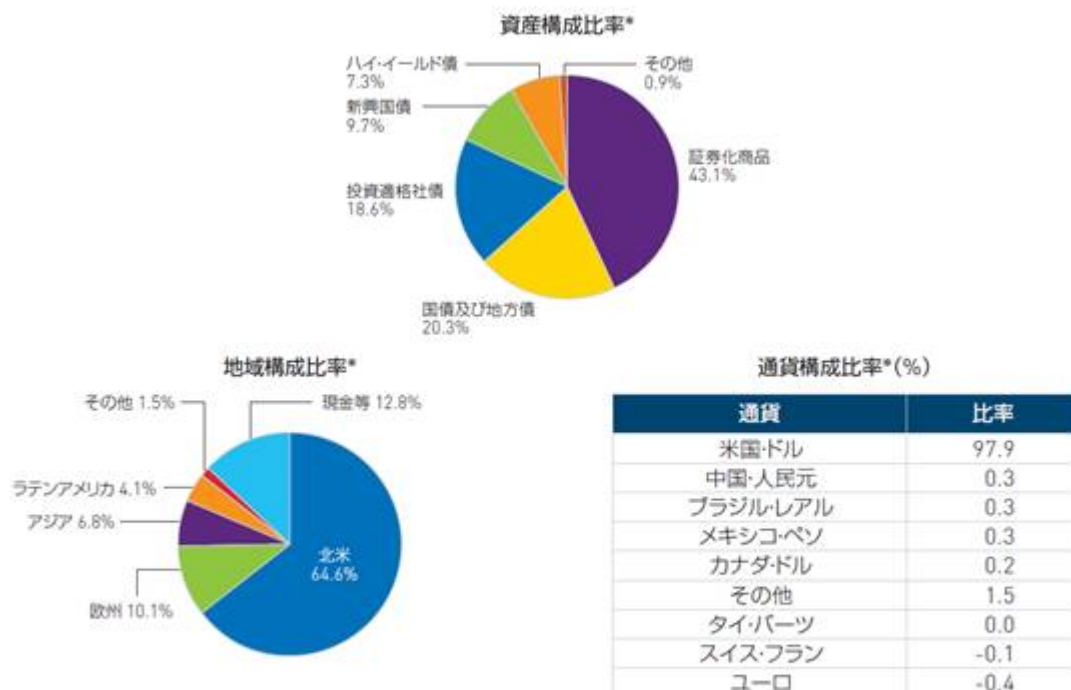
※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。

※ 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。

2018年12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 フィクスドインカム・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 フィクスドインカム・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。

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

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

(2) 申込期間

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

(3) 受付時間

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

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

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

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

- b . 累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

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

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

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

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

(2) 換金不可日

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

(3) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(4) 換金受付の制限

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

(5) 換金代金の支払い

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

(6) 換金の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回る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なうことが困難な場合には適用しません。
- h．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- i．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。
- j．i．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更d．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- k．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

信託約款の変更

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

運用報告書の作成

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

信託事務の委託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

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

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

(4) 反対者の買取請求権

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

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2018年6月21日から2018年12月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2018年6月20日現在)	当特定期間末 (2018年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	-	1,166
金銭信託	21,673,452	76,929,839
投資証券	1,460,237,217	1,522,837,317
派生商品評価勘定	-	19,629
流動資産合計	1,481,910,669	1,599,787,951
資産合計	1,481,910,669	1,599,787,951
負債の部		
流動負債		
未払金	-	23,265,975
未払収益分配金	3,087,056	3,281,832
未払受託者報酬	52,766	51,101
未払委託者報酬	1,847,029	1,788,880
その他未払費用	131,921	127,767
流動負債合計	5,118,772	28,515,555
負債合計	5,118,772	28,515,555
純資産の部		
元本等		
元本	1,543,528,354	1,640,916,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	66,736,457	69,644,050
(分配準備積立金)	248,089,058	224,146,397
元本等合計	1,476,791,897	1,571,272,396
純資産合計	1,476,791,897	1,571,272,396
負債純資産合計	1,481,910,669	1,599,787,951

(2)【損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	前特定期間 (自 2017年12月21日 至 2018年6月20日)	当特定期間 (自 2018年6月21日 至 2018年12月20日)
営業収益		
受取配当金	24,132,976	24,681,961
受取利息	7,404	6,133
有価証券売買等損益	21,055,985	25,589,618
為替差損益	38,103,993	32,204,140
営業収益合計	35,019,598	31,302,616
営業費用		
受託者報酬	321,593	317,536
委託者報酬	11,257,510	11,115,268
その他費用	1,187,252	1,075,011
営業費用合計	12,766,355	12,507,815
営業利益又は営業損失()	47,785,953	18,794,801
経常利益又は経常損失()	47,785,953	18,794,801
当期純利益又は当期純損失()	47,785,953	18,794,801
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()	173,252	178,466
期首剰余金又は期首欠損金()	589,543	66,736,457
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,513,469	4,320,626
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,513,469	4,320,626
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,698,465	7,752,408
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,698,465	7,752,408
分配金	18,528,303	18,449,078
期末剰余金又は期末欠損金()	66,736,457	69,644,050

(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 (2018年6月20日現在)	当特定期間末 (2018年12月20日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,543,528,354口	1,640,916,446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 66,736,457円	元本の欠損 69,644,050円
3 1口当たり純資産額	0.9568円	0.9576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 2017年12月21日 至 2018年6月20日)
分配金の計算過程	<p>第148期計算期間(2017年12月21日～2018年1月22日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,526,943円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(79,869,530円)、分配準備積立金(258,561,063円)により、分配対象収益は339,957,536円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,050,487円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第149期計算期間(2018年1月23日～2018年2月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,151,426円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(84,048,027円)、分配準備積立金(255,886,985円)により、分配対象収益は342,086,438円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,077,762円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第150期計算期間(2018年2月21日～2018年3月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,795,259円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(85,569,430円)、分配準備積立金(254,960,649円)により、分配対象収益は342,325,338円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,091,489円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第151期計算期間(2018年3月21日～2018年4月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,369,123円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(88,173,897円)、分配準備積立金(253,134,265円)により、分配対象収益は344,677,285円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,110,178円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第152期計算期間(2018年4月21日～2018年5月21日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,997,158円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,356,041円)、分配準備積立金(251,367,643円)により、分配対象収益は345,720,842円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,111,331円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第153期計算期間(2018年5月22日～2018年6月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,973,320円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,733,754円)、分配準備積立金(249,202,794円)により、分配対象収益は341,909,868円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,087,056円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 2018年6月21日 至 2018年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第154期計算期間(2018年6月21日～2018年7月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,694,367円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,919,261円)、分配準備積立金(247,684,633円)により、分配対象収益は342,298,261円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,085,061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155期計算期間(2018年7月21日～2018年8月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,141,109円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(89,768,459円)、分配準備積立金(243,659,827円)により、分配対象収益は335,569,395円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,032,448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156期計算期間(2018年8月21日～2018年9月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,671,234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)(95,411,972円)、分配準備積立金(242,444,623円)により、分配対象収益は341,527,829円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,080,870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157期計算期間(2018年9月21日～2018年10月22日)</p> <p>費用控除後の配当等収益(1,727,962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)(93,789,082円)、分配準備積立金(238,031,223円)により、分配対象収益は333,548,267円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,020,545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158期計算期間(2018年10月23日～2018年11月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,272,770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)(91,778,971円)、分配準備積立金(230,845,742円)により、分配対象収益は324,897,483円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,948,322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159期計算期間(2018年11月21日～2018年12月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,184,594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)(133,634,262円)、分配準備積立金(225,243,635円)により、分配対象収益は361,062,491円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,281,832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 (2018年6月20日現在)	当特定期間末 (2018年12月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 同左</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「（その他の注記）」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (2018年6月20日現在)	当特定期間末 (2018年12月20日現在)
期首元本額	1,595,954,729円	1,543,528,354円
期中追加設定元本額	62,354,310円	231,723,860円
期中一部解約元本額	114,780,685円	134,335,768円

2 有価証券関係

前特定期間末(2018年6月20日現在)

売買目的有価証券

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

当特定期間末(2018年12月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	6,868,718
合計	6,868,718

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

前特定期間末(2018年6月20日現在)

該当事項はありません。

区分	種類	当特定期間末(2018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 買建 アメリカドル	23,241,047	-	23,260,676	19,629
合計		23,241,047	-	23,260,676	19,629

(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はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券	1,365,623.850	13,396,769.960	
		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	8,676.200	127,540.140	
	アメリカドル	小計	1,374,300.050	13,524,310.100 (1,522,837,317)	
投資証券	合計			1,522,837,317 (1,522,837,317)	
合計				1,522,837,317 (1,522,837,317)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項は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、2018年2月28日に終了する中間計算期間(2017年9月1日から2018年2月28日まで)に係る中間財務書類であります。

(2)当該中間財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2018年2月28日現在の中間財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2018年2月28日現在（未監査）

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		9,916,022,572	2,129,707,440
未実現評価益 / (損)		30,936,030	(29,568,100)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	9,946,958,602	2,100,139,340
銀行預金	2 (a)	1,768,155,975	58,680,650
ブローカーに対する債権	15	68,132,774	1,131,564
未収利息および未収配当金	2 (a)	76,266,903	9,935,895
売却投資有価証券未収金	2 (a)	6,246,161,451*	426,520*
販売投資証券未収金	2 (a)	45,471,407	6,317,074
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	2,044,517	1,129,488
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	79,355,177
スワップの時価	2 (c)	-	4,662,733
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	115,578,138	253,634
その他の資産	2 (a, c)	11,703	-
資産合計		18,268,781,470	2,262,032,075
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	58,027	460,818
ブローカーに対する債務	15	37,199,082	5,939,001
未払収益分配金	2 (a)	1,150,768	155,759
購入投資有価証券未払金	2 (a)	6,004,930,835*	82,713,113*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	17,120,169	6,692,543
以下に係る未実現評価損：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	9,349,827	973,163
差金決済契約	2 (c)	93,008	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	293,953,230	-
スワップの時価	2 (c)	40,793,642	-
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	82,989,978	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	23,432,583	1,166,367
負債合計		6,511,071,149	98,100,764
純資産合計		11,757,710,321	2,163,931,311

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2018年2月28日現在(未監査)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	通貨	2018年 2月28日現在	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	11,757,710,321	9,265,244,959	7,839,045,320	9,072,127,942
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	10.11	9.94	9.80	9.90
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.96	9.91	9.95	10.15
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	10.16	10.11	9.97	10.07
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	10.15	10.10	9.96	10.07
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.19	10.15	10.01	10.08
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.26	7.31	7.34	7.47
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.80	14.80	14.66	14.68
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.58	9.61	9.59	9.77
クラスA 中国人民幣・ヘッジ金利差分配型投資証券	人民幣元	98.75	99.07	97.07	97.84
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	12.39	12.40	12.32	12.54
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	香港ドル	94.96	95.54	95.50	97.58
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.09	13.86	13.34	13.20
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.15	10.12	9.96	10.01
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.08	10.03	9.83	9.82
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,054.00	1,047.00	1,024.00	1,023.00
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	15.51	15.32	14.69	14.43
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	102.41	102.02	100.12	100.32
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	20.51	20.25	19.58	19.26
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.38	10.29	10.00	9.92
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	10.16	10.11	9.97	10.07
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.13	10.09	9.95	10.03
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.28	12.16	11.85	11.87
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.72	13.46	13.27	13.40
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	10.10	9.94	9.85	9.96
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.98	9.91	9.95	-
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.94	4.88	4.86	-
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.71	10.67	10.52	10.60
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.96	-	-	-

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2018年2月28日現在(未監査)(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

	通貨	2018年 2月28日現在	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
クラスDユーロ・ヘッジ毎四 半期分配型投資証券	ユーロ	7.28	7.33	7.36	7.49
クラスD無分配投資証券	米ドル	14.45	14.18	13.59	13.37
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	10.81	10.75	10.53	10.53
クラスDユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	ユーロ	10.60	10.53	10.26	10.21
クラスD英ポンド・ヘッジ無 分配投資証券	英ポンド	11.14	11.02	10.66	10.51
クラスDポーランド・ズロ チ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ ズロチ	15.93	15.70	14.98	14.64
クラスDシンガポール・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポ ール・ドル	21.06	20.74	19.95	19.53
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.29	13.11	12.68	12.61
クラスEユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	ユーロ	9.54	9.52	9.38	9.42
クラスIカナダ・ドル・ヘッ ジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.86	9.83	9.75	9.86
クラスI毎四半期分配型投資 証券	米ドル	9.97	9.94	9.80	9.87
クラスIユーロ・ヘッジ毎四 半期分配型投資証券	ユーロ	9.65	9.72	9.76	9.93
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.47	11.25	10.75	10.57
クラスIカナダ・ドル・ヘッ ジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.85	10.66	10.25	10.09
クラスIスイス・フラン・ ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラ ン	11.49	11.42	11.16	11.15
クラスIユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	ユーロ	10.90	10.81	10.52	10.45
クラスI英ポンド・ヘッジ無 分配投資証券	英ポンド	11.21	11.08	10.70	10.53
クラスI日本円ヘッジ無分配 投資証券	日本円	1,084.00	1,073.00	1,043.00	1,035.00
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	10.16	10.11	9.97	10.07
クラスX英ポンド・ヘッジ毎 四半期分配型投資証券	英ポンド	9.84	9.88	9.84	9.93
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	10.16	10.11	9.97	10.07
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月 分配型投資証券	豪ドル	10.73	10.67	10.45	10.39
クラスXユーロ・ヘッジ毎月 分配型投資証券	ユーロ	9.72	9.78	9.82	10.02
クラスXユーロ・ヘッジ毎四 半期分配型投資証券	ユーロ	9.98	-	-	-
クラスX無分配投資証券	米ドル	11.06	10.82	10.29	10.07
クラスX豪ドル・ヘッジ無分 配投資証券	豪ドル	11.67	11.41	10.78	10.39
クラスXカナダ・ドル・ヘッ ジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.81	10.60	10.14	9.93
クラスXスイス・フラン・ ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラ ン	11.76	11.66	11.35	11.28
クラスXユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	ユーロ	11.38	11.26	10.91	10.78
クラスX英ポンド・ヘッジ無 分配投資証券	英ポンド	10.93	10.78	10.36	10.14
クラスXスウェーデン・ク ローネ・ヘッジ無分配投資証 券	スウェーデ ン・クローネ	10.58	10.48	10.16	10.07

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2018年2月28日現在(未監査)(続き)

U S ダラ ー ・ ショ ー ト ・ デ ュ レ ー シ ョ ン ・ ボ ン ド ・ フ ァ ン ド

	通貨	2018年 2月28日現在	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在	2015年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	2,163,931,311	1,693,798,830	1,532,772,836	1,497,665,243
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	8.46	8.57	8.60	8.63
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	8.45	8.56	8.59	8.62
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	シンガポール・ドル	9.66	9.82	9.90	9.87
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.13	13.18	12.98	12.84
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.02	10.18	10.20	10.20
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	8.47	8.58	8.61	8.63
クラスC 無分配投資証券	米ドル	10.84	10.95	10.92	10.94
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.70	9.83	9.86	9.89
クラスD 無分配投資証券	米ドル	13.37	13.40	13.15	12.97
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.91	10.04	10.03	-
クラスE 無分配投資証券	米ドル	12.07	12.15	12.02	11.96
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.17	10.19	10.00	-
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.93	10.06	10.04	-
クラスX 無分配投資証券	米ドル	14.50	14.50	14.16	13.90

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2018年2月28日に終了した会計期間(未監査)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
期首純資産		9,265,244,959	1,693,798,830
収益			
預金利息	2 (b)	870,006	110,853
債券利息	2 (b)	185,396,028	25,536,806
スワップ利息	2 (c)	55,442,701	3,022,174
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	-	60,332
集団投資スキームによる収益	2 (b)	701,032	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	734,046	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	10,742	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	1,022,201	139,950
収益合計	2 (b)	244,176,756	28,870,115
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	12,039	-
スワップ利息	2 (c)	56,069,709	1,788,684
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	55,641	-
管理事務代行報酬、補助金控除後	7	4,517,557	540,575
保管および預託報酬	2 (h), 8	1,167,538	160,328
販売報酬	6	3,311,735	576,149
税金	9	1,628,396	323,810
投資運用報酬	5	28,392,057	3,697,711
費用合計		95,154,672	7,087,257
純利益		149,022,084	21,782,858
以下に係る実現純評価益/(損):			
投資有価証券	2 (a)	75,496,992	(3,925,267)
事後通告証券契約	2 (c)	25,317,302	(1,399,071)
差金決済取引	2 (c)	(662,164)	-
上場先物取引	2 (c)	54,820,903	9,932,855
オプション/スワップション契約	2 (c)	96,546,648	(304,401)
スワップ取引	2 (c)	(14,484,266)	(2,486,753)
先渡為替予約	2 (c)	116,705,202	2,005,298
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(15,691,161)	1,035,159
当期実現純評価益		338,049,456	4,857,820
以下に係る未実現評価益/(損)の純変動額:			
投資有価証券	2 (a)	(121,061,140)	(28,639,625)
事後通告証券契約	2 (c)	(324,528)	(753,252)
差金決済取引	2 (c)	199,750	-
上場先物取引	2 (c)	12,637,372	2,216,607
オプション/スワップション契約	2 (c)	(19,371,606)	34,361
スワップ取引	2 (c)	9,460,186	1,246,173
先渡為替予約	2 (c)	7,962,081	(1,730,113)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(1,131,987)	80,713
当期末実現評価益/(損)の純変動		(111,629,872)	(27,545,136)
運用成績による純資産の増加/(減少)		375,441,668	(904,458)

損益および純資産変動計算書 2018年2月28日に終了した会計期間(未監査)(続き)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		4,090,216,024	860,722,587
投資証券買戻しによる正味支払額		(1,946,699,625)	(388,640,639)
資本の変動による純資産の増加		2,143,516,399	472,081,948
配当金宣言額	16	(26,492,705)	(1,045,009)
期末純資産		11,757,710,321	2,163,931,311

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 2018年2月28日に終了した会計期間(未監査)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	111,166	25,947	5,120	131,993
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,853,518	349,906	706,976	1,496,448
クラスA 毎日分配型投資証券	4,287,136	895,364	814,407	4,368,093
クラスA 毎月分配型投資証券	437,596	61,637	9,784	489,449
クラスA 毎四半期分配型投資証券	8,268,365	1,135,881	902,606	8,501,640
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	633,802	862,472	85,170	1,411,104
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	219,380	98,821	55,186	263,015
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	200,024	24,119	68	224,075
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	308	40,424	-	40,732
クラスA 安定分配型投資証券	211,044	562,336	70,886	702,494
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	125,123	-	61,970	63,153
クラスA 無分配投資証券	57,688,811	14,060,932	10,814,540	60,935,203
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,847,863	1,063,460	251,638	4,659,685
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	30,182,699	28,117,277	10,110,972	48,189,004
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	500,954	1,253	-	502,207
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	17,781,375	17,300,340	16,447,331	18,634,384
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	1,042,412	50,898	99,388	993,922
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	3,073,974	1,141,286	299,695	3,915,565
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	227,910	129,103	27,307	329,706
クラスC 毎日分配型投資証券	677,090	83,327	180,202	580,215
クラスC 毎四半期分配型投資証券	1,194,663	84,636	158,660	1,120,639
クラスC 無分配投資証券	10,098,995	621,136	2,623,268	8,096,863
クラスD 毎年分配型投資証券	94,690	9,389	25,000	79,079
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	494,741	109,133	-	603,874
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,839,798	782,568	164,023	2,458,343
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	1,746,527	1,341,039	272,161	2,815,405
クラスD 毎四半期分配型投資証券	20,368,127	4,070,975	4,089,174	20,349,928
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	592,020	-	592,020
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	959,211	494,319	81,065	1,372,465
クラスD 無分配投資証券	61,912,646	24,155,079	9,301,999	76,765,726
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	7,521,461	3,498,557	847,116	10,172,902
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	59,113,852	44,849,853	32,893,908	71,069,797
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	3,401,457	1,918,874	493,173	4,827,158

発行済投資証券口数変動表 2018年2月28日に終了した会計期間(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド
(続き)

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	37	41,000	-	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	37,627	14,360	15,830	36,157
クラスE無分配投資証券	27,747,603	2,681,444	6,105,999	24,323,048
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	58,796,711	13,708,825	10,854,626	61,650,910
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	42,308,982	24,079,986	18,532	66,370,436
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,602,179	2,712,232	1,915,703	2,398,708
クラスI無分配投資証券	41,975,895	46,989,513	24,329,516	64,635,892
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	10,075	40,882	-	50,957
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	1,545,599	2,020,022	68,830	3,496,791
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	59,783,511	28,123,218	17,938,141	69,968,588
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	51,694,197	4,759,406	1,194,896	55,258,707
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	48,092,480	4,152,323	1,060,435	51,184,368
クラスJ毎月分配型投資証券	1,473,375	135,802	293,682	1,315,495
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	27,007,730	3,762,878	2,949,599	27,821,009
クラスX毎月分配型投資証券	1,965,036	34,817,189	476,512	36,305,713
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,797,207	41,284	200,913	1,637,578
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	230,758	4,105	13,181	221,682
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	4,995,429	-	4,995,429
クラスX無分配投資証券	5,944,343	658,153	127,753	6,474,743
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	11,980,552	538,156	1,991,791	10,526,917
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	50,031,450	4,653,084	-	54,684,534
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	881,847	2,967,297	-	3,849,144
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,301,125	4,839,508	500,711	5,639,922
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	34,879,935	13,800,292	58,024	48,622,203
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	132,011,682	22,028,734	51,870,795	102,169,621

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 2018年2月28日に終了した会計期間(未監査)(続き)

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	3,743,674	1,650,415	1,447,201	3,946,888
クラスA 毎月分配型投資証券	1,826,408	252,575	796,777	1,282,206
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	24,264	20,882	-	45,146
クラスA 無分配投資証券	34,218,017	10,021,937	8,952,319	35,287,635
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,413,454	684,885	935,487	2,162,852
クラスC 毎日分配型投資証券	409,818	107,777	128,488	389,107
クラスC 無分配投資証券	1,283,018	253,339	611,366	924,991
クラスD 毎月分配型投資証券	3,412,948	3,700,687	1,688,886	5,424,749
クラスD 無分配投資証券	21,129,612	6,598,331	6,149,531	21,578,412
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	958,523	574,264	771,793	760,994
クラスE 無分配投資証券	18,095,574	1,726,086	6,049,264	13,772,396
クラスI 無分配投資証券	3,925,873	224,303	394,502	3,755,674
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,033,821	12,548,887	3,337,283	10,245,425
クラスX 無分配投資証券	37,791,259	27,308,191	470,704	64,628,746

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2018年2月28日現在(未監査)

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
	米国		
80,000	SPDR S&P 500 Trust - ETF*	22,092,000	0.19
		22,092,000	0.19
ファンド合計			
普通/優先株式およびワラント			
	カナダ		
5,883	Norbord Inc	202,963	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	38,190	0.00
		241,153	0.00
	ケイマン諸島		
539,306	Sentinel Energy Services Inc	5,333,736	0.05
147,094	Vantage Drilling Co	736	0.00
		5,334,472	0.05
	中国		
807,000	Guotai Junan Securities Co Ltd 'H'	1,872,390	0.02
	フランス		
26,488	BNP Paribas SA	2,127,835	0.02
5,642	SMCP SA	142,376	0.00
		2,270,211	0.02
	ギリシャ		
1,588,502	Eurobank Ergasias SA*	1,566,005	0.01
	インドネシア		
46,754,889	Bumi Resources Tbk PT	1,074,629	0.01
	イタリア		
393,056	Telecom Italia SpA/Milano*	355,003	0.00
375,000	UniCredit SpA	8,047,548	0.07
375,000	UniCredit SpA (Right 1/4/2018)	1,610	0.00
		8,404,161	0.07
	日本		
322,100	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	2,292,915	0.02
1,354,500	Mizuho Financial Group Inc	2,522,177	0.02
56,700	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	2,481,171	0.02
61,500	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	2,487,337	0.02
3	Wessex Ltd (Wts 24/6/2019)	37,821	0.00
		9,821,421	0.08
	米国		
238,759	Altice USA Inc*	4,543,584	0.04
23,040	American Airlines Group Inc*	1,254,298	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)		
732,899	Bank of America Corp	23,951,139	0.20
179,063	Caesars Entertainment Corp*	2,283,053	0.02
15,490	Cardinal Health Inc	1,083,061	0.01
131,758	Citigroup Inc	10,112,426	0.09
8,010	CME Group Inc	1,341,355	0.01
28,280	Comcast Corp	1,023,736	0.01
103,038	Delta Air Lines Inc	5,545,505	0.05
46,252	DR Horton Inc	1,985,598	0.02
55,989	Energen Corp*	3,138,743	0.03
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp (Pref)	613,200	0.00
87,600	Federal National Mortgage Association (Pref)	613,200	0.00
268,337	FTS International Inc	5,508,959	0.05
6,610	Home Depot Inc/The	1,226,684	0.01
10,260	JB Hunt Transport Services Inc	1,232,534	0.01
165,389	JPMorgan Chase & Co	19,567,173	0.17
111,557	Leisure Acquisition Corp	1,104,414	0.01
116,438	Liberty Oilfield Services Inc	2,255,404	0.02
13,460	Lowe's Cos Inc	1,198,344	0.01
224,424	MGIC Investment Corp*	3,157,646	0.03
32,109	QUALCOMM Inc	2,133,643	0.02
100,948	Radian Group Inc*	2,108,804	0.02
22,530	Robert Half International Inc	1,297,953	0.01
17,360	Ross Stores Inc	1,389,494	0.01
12,584	Scientific Games Corp	582,010	0.00
97,460	SLM Corp	1,073,035	0.01
36,080	Synchrony Financial	1,349,031	0.01
59,230	Under Armour Inc 'A'*	993,287	0.01
9,310	Union Pacific Corp	1,239,627	0.01
17,930	United Continental Holdings Inc	1,215,295	0.01
9,903	United Rentals Inc	1,750,900	0.01
35,079	USG Corp*	1,177,602	0.01
71,445	Voya Financial Inc	3,728,000	0.03
29,116	William Lyon Homes 'A'*	739,838	0.01
348,678	Williams Cos Inc/The	9,867,587	0.08
103,197	Williams-Sonoma Inc	5,333,221	0.05
24,020	Zions Bancorporation	1,351,125	0.01
		130,070,508	1.11
普通/優先株式およびワラント合計		160,654,950	1.37

債券

アルゼンチン			
USD 1,143,000	Aerpuertos Argentina 2000 SA '144A' 6.875% 1/2/2027	1,200,162	0.01
USD 1,122,000	Arcor SAIC '144A' 6% 6/7/2023	1,164,075	0.01
ARS 15,983,000	Argentina Bonar Bonds FRN 11/3/2019	859,857	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 (%)
アルゼンチン(続き)			
ARS 31,967,000	Argentina Bonar Bonds FRN 1/3/2020	1,655,118	0.01
USD 2,887,333	Argentina Bonar Bonds 7.625% 18/4/2037	2,935,956	0.02
USD 8,161,494	Argentina Bonar Bonds 8% 8/10/2020	9,042,935	0.08
USD 23,885,627	Argentina Bonar Bonds 8.75% 7/5/2024*	27,426,774	0.23
USD 7,972,886	Argentina Bonar Bonds 9% 29/11/2018*	8,291,801	0.07
ARS 24,698,000	Argentine Bonos del Tesoro 22.75% 5/3/2018	1,229,173	0.01
USD 13,898,521	Argentine Republic Government International Bond (Step-up coupon) 2.5% 31/12/2038	9,277,263	0.08
CHF 1,290,000	Argentine Republic Government International Bond 3.375% 12/10/2020	1,408,261	0.01
EUR 3,186,000	Argentine Republic Government International Bond 5.25% 15/1/2028	3,792,392	0.03
USD 13,096,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	13,344,824	0.11
USD 29,362,000	Argentine Republic Government International Bond 5.875% 11/1/2028	27,614,961	0.23
USD 9,953,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019*	10,244,125	0.09
USD 26,978,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021	28,569,702	0.24
USD 7,193,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 11/1/2048*	6,595,981	0.06
USD 12,382,000	Argentine Republic Government International Bond 7.125% 28/6/2117*	11,540,024	0.10
ARS 120,373,000	Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	6,101,096	0.05
ARS 176,738,000	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 3.75% 8/2/2019	9,054,795	0.08
USD 1,115,000	Cablevision SA '144A' 6.5% 15/6/2021	1,170,750	0.01
USD 1,053,000	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios SA '144A' 9.5% 20/7/2023	1,095,331	0.01
USD 7,081,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023*	7,718,290	0.07
USD 7,081,000	Genneia SA '144A' 8.75% 20/1/2022	7,694,038	0.07
USD 2,593,000	Pampa Energia SA '144A' 7.375% 21/7/2023	2,748,580	0.02
USD 2,249,000	Pampa Energia SA '144A' 7.5% 24/1/2027	2,361,450	0.02
USD 3,600,000	Provincia de Rio Negro '144A' 7.75% 7/12/2025*	3,483,000	0.03
USD 5,666,000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	4,578,561	0.04
USD 3,544,000	Tecpetrol SA '144A' 4.875% 12/12/2022*	3,464,260	0.03
USD 2,994,000	YPF SA '144A' 6.95% 21/7/2027*	3,035,168	0.03
USD 4,111,000	YPF SA '144A' 8.5% 23/3/2021	4,505,656	0.04
USD 6,608,000	YPF SA '144A' 8.75% 4/4/2024	7,376,180	0.06
USD 3,204,000	YPF SA 8.75% 4/4/2024*	3,576,465	0.03
USD 4,426,000	YPF SA '144A' 8.875% 19/12/2018	4,614,105	0.04
		238,771,109	2.03
オーストラリア			
EUR 3,600,000	BHP Billiton Finance Ltd FRN 22/4/2076	4,920,606	0.04
EUR 400,000	BHP Billiton Finance Ltd FRN 22/10/2079	595,685	0.00
USD 3,320,000	BHP Billiton Finance USA Ltd '144A' FRN 19/10/2075	3,539,286	0.03
EUR 2,000,000	Cromwell SPV Finance Pty Ltd 2% 4/2/2020	2,447,807	0.02
USD 187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	65,625	0.00
USD 4,231,000	Macquarie Bank Ltd/London FRN 8/3/2027 (Perpetual)	4,315,620	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 (%)
	オーストラリア(続き)		
USD 3,374,000	Macquarie Group Ltd FRN 28/11/2023	3,287,103	0.03
USD 2,100,000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd 4.4% 29/9/2027	2,028,908	0.02
EUR 600,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074*	769,378	0.01
USD 777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	818,573	0.01
USD 2,798,000	Santos Finance Ltd 4.125% 14/9/2027	2,697,390	0.02
USD 4,420,000	Westpac Banking Corp/New Zealand FRN 21/9/2027 (Perpetual)	4,233,880	0.03
		29,719,861	0.25
	オーストリア		
EUR 3,300,000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 8.125% 30/10/2023	5,515,542	0.05
USD 3,534,000	Eldorado Intl. Finance GmbH '144A' 8.625% 16/6/2021	3,763,710	0.03
EUR 2,000,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)*	2,979,806	0.02
EUR 600,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)	852,547	0.01
EUR 7,000,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 15/12/2022 (Perpetual)	9,297,493	0.08
EUR 200,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	254,547	0.00
EUR 3,800,000	Volksbank Wien AG FRN 6/10/2027	4,684,747	0.04
		27,348,392	0.23
	バーレーン		
USD 1,662,000	Bahrain Government International Bond '144A' 6% 19/9/2044	1,389,847	0.01
USD 3,325,000	Bahrain Government International Bond '144A' 6.75% 20/9/2029	3,177,453	0.03
USD 4,800,000	Bahrain Government International Bond 6.75% 20/9/2029	4,587,000	0.04
USD 2,978,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047	2,821,655	0.03
USD 1,625,000	Oil and Gas Holding Co BSCC/The 7.5% 25/10/2027	1,645,313	0.01
		13,621,268	0.12
	ベルギー		
EUR 525,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 1.15% 22/1/2027	631,221	0.00
EUR 4,220,000	KBC Group NV FRN 19/3/2019 (Perpetual)	5,400,010	0.05
		6,031,231	0.05
	パミューダ		
USD 719,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 7.95% 15/2/2019*	702,823	0.01
USD 3,545,000	Digicel Group Ltd '144A' 7.125% 1/4/2022*	3,066,425	0.03
EUR 500,000	Fidelity International Ltd 2.5% 4/11/2026	636,045	0.00
USD 3,320,000	GCL New Energy Holdings Ltd 7.1% 30/1/2021	3,332,450	0.03
USD 3,118,000	Geopark Ltd '144A' 6.5% 21/9/2024	3,145,282	0.03
HKD 44,000,000	Haitong International Securities Group Ltd 25/10/2021 (Zero Coupon)	5,815,541	0.05
USD 2,921,000	Inkia Energy Ltd '144A' 5.875% 9/11/2027	2,897,661	0.02
CNH 6,000,000	IT Ltd 6.25% 15/5/2018	957,351	0.01
HKD 4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	441,234	0.00
HKD 348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	42,714	0.00
		21,037,526	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 (%)
	ブラジル		
BRL 777,630	Brazil Letras do Tesouro Nacional 1/1/2019 (Zero Coupon)	22,736,951	0.19
USD 1,006,000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island '144A' FRN 12/12/2022 (Perpetual)	1,020,335	0.01
USD 3,524,000	Samarco Mineracao SA (Defaulted) 4.125% 1/11/2022	2,775,150	0.03
		26,532,436	0.23
	英領バージン諸島		
USD 2,750,000	Asia View Ltd 1.5% 8/8/2019	3,083,437	0.03
USD 5,070,000	Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	4,930,575	0.04
USD 5,395,000	CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022*	5,234,586	0.04
USD 417,000	Central American Bottling Corp '144A' 5.75% 31/1/2027	430,557	0.00
USD 2,050,000	Chang Development International Ltd 3.625% 20/1/2020	2,023,934	0.02
USD 6,250,000	Charming Light Investments Ltd 4.375% 21/12/2027	6,002,235	0.05
USD 1,200,000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 4.4% 9/3/2027*	1,168,780	0.01
USD 6,688,000	China Cinda Finance 2017 I Ltd 4.75% 8/2/2028*	6,631,391	0.06
USD 4,176,000	China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022	4,047,586	0.03
USD 3,450,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022*	3,411,187	0.03
USD 1,600,000	Cosmos Boom Investment Ltd 0.5% 23/6/2020	1,589,600	0.01
USD 1,535,000	Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022*	1,485,819	0.01
USD 3,860,000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 4.25% 7/11/2027*	3,660,201	0.03
USD 1,800,000	Huarong Finance 2017 Co Ltd 4.75% 27/4/2027	1,780,191	0.02
EUR 2,875,000	Huarong Universe Investment Holding Ltd 1.625% 5/12/2022	3,440,679	0.03
USD 3,800,000	Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)*	3,790,500	0.03
USD 1,545,000	New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020*	1,556,858	0.01
USD 615,000	New Metro Global Ltd 5% 8/8/2022	588,862	0.00
USD 1,150,000	Oceanwide Holdings International 2017 Co Ltd 7.75% 27/7/2020	1,109,980	0.01
USD 3,218,000	Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	2,992,740	0.03
USD 1,840,000	Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	1,718,974	0.01
USD 988,000	Shandong Iron And Steel Xinheng International Co Ltd 6.5% 14/6/2021*	991,566	0.01
USD 7,500,000	Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	7,738,500	0.07
USD 3,000,000	Tsinghua Unic Ltd 5.375% 31/1/2023*	2,977,500	0.03
USD 1,550,000	Yingde Gases Investment Ltd 6.25% 19/1/2023*	1,558,819	0.01
USD 1,850,000	Yunnan Energy Investment Overseas Finance Co Ltd 4.25% 14/11/2022	1,791,248	0.02
		75,736,305	0.64
	カナダ		
USD 3,749,590	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5% 15/12/2023	3,871,451	0.03
USD 6,874,000	Canbriam Energy Inc '144A' 9.75% 15/11/2019	7,045,850	0.06
USD 2,985,000	Enbridge Inc FRN 1/3/2078	3,024,154	0.03
USD 5,685,000	Harvest Operations Corp 3% 21/9/2022	5,533,666	0.05
USD 3,080,000	Kinross Gold Corp '144A' 4.5% 15/7/2027	2,987,600	0.02
USD 3,502,000	Masonite International Corp '144A' 5.625% 15/3/2023	3,637,702	0.03
USD 4,578,000	Niska Gas Storage Ltd / Niska Gas Storage Canada Finance Corp 6.5% 1/4/2019	4,652,184	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 (%)
	カナダ(続き)		
USD 4,250,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.875% 1/6/2024	4,202,188	0.04
USD 1,060,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5% 1/5/2025	1,054,700	0.01
USD 6,147,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5.25% 1/8/2023	6,277,624	0.05
USD 6,428,000	Stoneway Capital Corp '144A' 10% 1/3/2027*	7,070,800	0.06
USD 3,812,000	Stoneway Capital Corp 10% 1/3/2027	4,193,200	0.04
USD 765,000	Suncor Energy Inc 4% 15/11/2047	735,701	0.01
USD 2,171,000	Transcanada Trust FRN 15/8/2076	2,339,253	0.02
USD 6,065,000	Transcanada Trust FRN 15/3/2077	6,121,859	0.05
EUR 206,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc 4.5% 15/5/2023	223,992	0.00
USD 568,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 5.5% 1/11/2025	566,086	0.00
USD 1,099,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 5.625% 1/12/2021	1,046,798	0.01
USD 5,774,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 7% 15/3/2024	6,106,005	0.05
USD 983,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 7.5% 15/7/2021	991,601	0.01
USD 3,985,000	Valeant Pharmaceuticals International Inc '144A' 9% 15/12/2025	4,029,831	0.03
		75,712,245	0.64
	ケイマン諸島		
USD 6,345,000	Alibaba Group Holding Ltd 3.4% 6/12/2027*	6,045,504	0.05
USD 720,000	Alibaba Group Holding Ltd 4% 6/12/2037*	687,079	0.01
USD 1,685,000	Alibaba Group Holding Ltd 4.2% 6/12/2047	1,605,967	0.01
USD 3,868,153	Ambac LSNI LLC '144A' FRN 12/2/2023	3,908,769	0.03
USD 3,000,000	Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 9.75% 5/12/2020*	3,157,590	0.03
USD 2,000,000	AYC Finance Ltd 0.5% 2/5/2019	2,095,000	0.02
USD 7,100,000	Azure Orbit IV International Finance Ltd 3.75% 25/1/2023*	7,024,967	0.06
USD 2,000,000	Bizlink Holding Inc 1/2/2023 (Zero Coupon)	2,070,000	0.02
USD 4,800,000	CDBL Funding 1 3% 24/4/2023	4,590,623	0.04
USD 4,055,000	CDBL Funding 1 3.5% 24/10/2027*	3,756,020	0.03
USD 4,400,000	CFLD Cayman Investment Ltd 6.5% 21/12/2020*	4,460,500	0.04
HKD 50,000,000	China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	6,063,689	0.05
USD 1,052,000	China Evergrande Group 6.25% 28/6/2021*	1,044,110	0.01
USD 5,421,000	China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023*	5,360,014	0.05
USD 4,263,000	China Evergrande Group 8.75% 28/6/2025*	4,300,301	0.04
USD 1,800,000	China Huiyuan Juice Group Ltd 6.5% 16/8/2020*	1,786,734	0.02
USD 2,274,000	China Lodging Group Ltd '144A' 0.375% 1/11/2022	2,543,474	0.02
USD 4,000,000	China Overseas Finance Investment Cayman V Ltd 5/1/2023 (Zero Coupon)	4,247,500	0.04
HKD 29,000,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 12/2/2019 (Zero Coupon)	3,650,776	0.03
USD 682,000	Ctrip.com International Ltd 1.25% 15/9/2022	710,460	0.01
USD 2,075,000	Emirates Reit Sukuk Ltd 5.125% 12/12/2022	2,071,109	0.02
USD 1,177,000	Energuate Trust '144A' 5.875% 3/5/2027	1,194,084	0.01
USD 1,835,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.25% 13/2/2019	1,841,881	0.02
USD 2,037,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.375% 4/10/2021	2,010,275	0.02
USD 1,981,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022*	1,953,761	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)		
HKD 21,800,000	Future Land Development Holdings Ltd 2.25% 10/2/2019	2,785,266	0.02
USD 1,275,000	Future Land Development Holdings Ltd 5% 16/2/2020*	1,263,844	0.01
USD 1,380,000	FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)	1,380,925	0.01
USD 3,474,000	Gol Finance Inc '144A' 7% 31/1/2025	3,430,575	0.03
USD 3,562,000	Gran Tierra Energy International Holdings Ltd ' 144A' 6.25% 15/2/2025	3,476,512	0.03
USD 2,800,000	Guorui Properties Ltd 7% 21/3/2020*	2,698,921	0.02
USD 2,250,000	Haitian International Holdings Ltd 2% 13/2/2019	2,551,207	0.02
HKD 41,000,000	Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	5,540,188	0.05
USD 360,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd FRN 5/2/2031	360,000	0.00
USD 1,453,000	Hilong Holding Ltd 7.25% 22/6/2020*	1,473,066	0.01
USD 1,080,000	Jiayuan International Group Ltd 8.25% 14/11/2018	1,090,800	0.01
USD 299,000	Kaisa Group Holdings Ltd 7.25% 30/6/2020	293,878	0.00
USD 1,598,000	Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022*	1,534,080	0.01
USD 3,000,000	King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	2,981,250	0.03
USD 2,670,000	Longfor Properties Co Ltd 4.5% 16/1/2028*	2,588,477	0.02
USD 2,410,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	2,401,592	0.02
USD 1,250,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 4.122% 21/1/2030	1,258,033	0.01
USD 5,370,000	Northwoods Capital XVII Ltd FRN 22/4/2031	5,370,000	0.05
USD 2,923,200	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6.35% 1/12/2021	2,867,381	0.02
USD 2,487,716	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 6.72% 1/12/2022	2,415,386	0.02
USD 60,550	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd '144A' 7.72% 1/12/2026	20,284	0.00
USD 337,306	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd '144A' 3/4/2018 (Perpetual) (Zero Coupon)	10,288	0.00
USD 7,105,000	OFSI Fund VI Ltd FRN 20/3/2025	7,105,000	0.06
USD 4,805,000	Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd FRN 10/10/2020 (Perpetual)	4,732,925	0.04
USD 1,690,000	Parallel 2015-1 Ltd 2.595% 20/7/2027	1,689,559	0.01
USD 580,000	Parallel 2015-1 Ltd 3.495% 20/7/2027	579,846	0.00
USD 3,250,000	Parallel 2015-1 Ltd 4.295% 20/7/2027	3,249,148	0.03
USD 2,200,000	Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	2,194,500	0.02
USD 2,000,000	Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	2,018,250	0.02
HKD 10,000,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 11/2/2019 (Zero Coupon)	1,258,599	0.01
USD 2,710,000	Redco Group 6.375% 27/2/2019	2,726,260	0.02
USD 900,000	Redco Group 7% 14/11/2018	909,450	0.01
USD 1,500,000	RR 3 Ltd 28/7/2026 (Zero Coupon)	1,018,423	0.01
USD 2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,185,000	0.02
USD 3,236,000	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	2,946,232	0.03
USD 2,601,000	Sunac China Holdings Ltd 6.875% 8/8/2020*	2,634,006	0.02
USD 2,610,000	Times China Holdings Ltd 6.25% 17/1/2021	2,602,131	0.02
USD 591,000	Times China Holdings Ltd 6.6% 2/3/2023	578,441	0.00
USD 6,000,000	TPK Holding Co Ltd 8/4/2020 (Zero Coupon)	6,249,360	0.05
GBP 800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	990,261	0.01
EUR 983,000	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027	1,252,139	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 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
EUR 400,000	UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029*	477,109	0.00
USD 1,345,000	VLL International Inc 5.75% 28/11/2024	1,345,000	0.01
USD 2,871,000	Weibo Corp '144A' 1.25% 15/11/2022	3,512,757	0.03
USD 500,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 8.125% 30/8/2019	502,581	0.00
USD 2,690,000	Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020*	2,667,002	0.02
USD 1,800,000	Zhen Ding Technology Holding Ltd 26/6/2019 (Zero Coupon)	1,817,766	0.02
		183,213,885	1.56
	中国		
USD 2,045,000	China Construction Bank Corp 4.65% 29/12/2049	2,045,603	0.02
CNH 10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,513,826	0.01
USD 947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	916,222	0.01
USD 3,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 29/1/2021 (Zero Coupon)	3,161,550	0.03
CNY 15,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 1.5% 21/12/2021	2,201,913	0.02
USD 5,500,000	CRRC Corp Ltd 5/2/2021 (Zero Coupon)	5,795,625	0.05
USD 2,000,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,985,000	0.02
USD 4,775,000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd/New York 3.538% 8/11/2027*	4,579,467	0.04
USD 687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	673,797	0.00
USD 1,305,000	Nanjing Yangzi State-owned Assets Investment Group Co Ltd 4.5% 5/12/2027*	1,253,229	0.01
USD 7,000,000	Postal Savings Bank of China Co Ltd FRN 27/9/2022 (Perpetual)	6,838,125	0.06
USD 1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	1,096,333	0.01
USD 1,663,000	Wuhan State-Owned Assets Management Ltd Co 3.8% 18/12/2020	1,652,081	0.01
EUR 5,700,000	Zhejiang Expressway Co Ltd 21/4/2022 (Zero Coupon)	6,815,293	0.06
		40,528,064	0.35
	コロンビア		
USD 11,194,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	11,613,775	0.10
USD 2,996,000	Credivalores-Crediservicios SAS '144A' 9.75% 27/7/2022*	3,087,618	0.03
		14,701,393	0.13
	キプロス		
GBP 600,000	Volcan Holdings II Plc 3.875% 10/10/2020	1,060,094	0.01
GBP 1,800,000	Volcan Holdings Plc 4.125% 11/4/2020	3,389,152	0.03
		4,449,246	0.04
	チェコ共和国		
EUR 672,000	RESIDOMO Sro 3.375% 15/10/2024	828,543	0.01
	デンマーク		
EUR 543,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2020 (Perpetual)	717,073	0.01
EUR 420,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2022 (Perpetual)	579,265	0.00
USD 2,400,000	Danske Bank A/S FRN 28/3/2024 (Perpetual)	2,536,272	0.02
DKK 34,009,784	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2% 1/10/2047	5,418,670	0.05
DKK 41,932,943	Nykredit Realkredit A/S 2% 1/10/2047	6,672,104	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 (%)
	デンマーク(続き)		
EUR 2,700,000	Orsted A/S FRN 6/11/3015*	3,479,244	0.03
DKK 52,940,906	Realkredit Danmark A/S 2% 1/10/2047	8,423,622	0.07
		27,826,250	0.24
	ドミニカ共和国		
USD 1,143,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	1,251,585	0.01
	エクアドル		
USD 3,850,000	Ecuador Government International Bond 7.875% 23/1/2028	3,853,253	0.03
USD 8,220,000	Ecuador Government International Bond '144A' 7.875% 23/1/2028*	8,184,095	0.07
		12,037,348	0.10
	エジプト		
USD 20,078,000	Egypt Government International Bond '144A' 5.577% 21/2/2023	20,416,816	0.17
USD 7,518,000	Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	7,748,239	0.07
USD 3,927,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	4,398,240	0.04
EGP 678,000,000	Egypt Treasury Bills 4/9/2018 (Zero Coupon)	35,240,995	0.30
EGP 91,725,000	Egypt Treasury Bills 16/10/2018 (Zero Coupon)	4,682,202	0.04
EGP 61,825,000	Egypt Treasury Bills 13/11/2018 (Zero Coupon)	3,132,369	0.03
EGP 29,100,000	Egypt Treasury Bills 27/11/2018 (Zero Coupon)	1,465,986	0.01
		77,084,847	0.66
	フィンランド		
EUR 200,000	Stora Enso OYJ 2.5% 7/6/2027	247,791	0.00
	フランス		
EUR 231,000	3AB Optique Developpement SAS 4% 1/10/2023	282,316	0.00
EUR 2,100,000	Altarea SCA 2.25% 5/7/2024	2,567,762	0.02
EUR 100,000	Autodis SA FRN 1/5/2022	123,512	0.00
EUR 150,000	Autodis SA 4.375% 1/5/2022	188,169	0.00
EUR 138,000	Banijay Group SAS 4% 1/7/2022	175,858	0.00
EUR 1,100,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	1,487,283	0.01
EUR 3,300,000	BNP Paribas Cardif SA 1% 29/11/2024	3,904,118	0.03
EUR 500,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)*	705,429	0.01
USD 1,800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)	2,010,375	0.02
USD 2,200,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 1/3/2033	2,176,262	0.02
USD 10,963,000	BNP Paribas SA '144A' 4.625% 13/3/2027*	11,195,120	0.10
EUR 371,000	Burger King France SAS FRN 1/5/2023	463,358	0.00
EUR 425,000	Burger King France SAS 6% 1/5/2024*	551,913	0.01
EUR 400,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024	530,890	0.00
EUR 400,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.561% 25/1/2023	543,030	0.00
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon SA 5.976% 26/5/2021*	280,872	0.00
EUR 471,000	CMA CGM SA 5.25% 15/1/2025	543,613	0.01
EUR 400,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	552,055	0.01
USD 4,400,000	Credit Agricole SA FRN 23/9/2019 (Perpetual)*	4,576,000	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 (%)
	フランス(続き)		
EUR 1,207,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,676,272	0.01
USD 7,600,000	Credit Agricole SA FRN 10/1/2033*	7,310,045	0.06
EUR 1,700,000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 25/10/2029	2,057,609	0.02
EUR 1,400,000	Credit Mutuel Arkea SA 3.5% 9/2/2029	1,877,306	0.02
EUR 334,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.25% 1/2/2023*	414,664	0.00
EUR 382,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.875% 1/2/2026	462,709	0.00
EUR 227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	288,878	0.00
EUR 1,100,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2020 (Perpetual)	1,424,856	0.01
EUR 400,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2022 (Perpetual)	520,571	0.00
EUR 300,000	Electricite de France SA 4.625% 26/4/2030	473,001	0.00
EUR 300,000	Elis SA 1.875% 15/2/2023	369,281	0.00
EUR 715,000	Europcar Groupe SA 4.125% 15/11/2024	878,989	0.01
EUR 160,000	Europcar Groupe SA 5.75% 15/6/2022*	202,787	0.00
EUR 180,000	Faurecia SA 3.625% 15/6/2023	231,016	0.00
EUR 400,000	Groupama SA FRN 28/5/2024 (Perpetual)	577,221	0.01
EUR 600,000	Groupama SA 6% 23/1/2027	904,955	0.01
EUR 520,000	Horizon Holdings I SAS 7.25% 1/8/2023	669,658	0.01
EUR 456,000	La Financiere Atalian SAS 4% 15/5/2024	577,663	0.01
EUR 167,000	Loxam SAS 3.5% 15/4/2022	211,611	0.00
EUR 200,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	252,665	0.00
EUR 452,000	Loxam SAS 4.25% 15/4/2024*	585,128	0.01
EUR 517,000	Loxam SAS 6% 15/4/2025*	680,873	0.01
EUR 233,000	Newco GB SAS 8% 15/12/2022	288,392	0.00
EUR 510,000	Orange SA FRN 7/2/2024 (Perpetual)	723,190	0.01
EUR 1,900,000	Orano SA 4.875% 23/9/2024	2,571,737	0.02
EUR 271,000	Paprec Holding SA 5.25% 1/4/2022	341,114	0.00
EUR 404,000	Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	494,625	0.00
EUR 450,000	Rexel SA 2.625% 15/6/2024	566,211	0.01
EUR 511,000	Rexel SA 3.5% 15/6/2023	656,589	0.01
EUR 903,000	SFR Group SA 5.375% 15/5/2022*	1,127,863	0.01
USD 4,960,000	SFR Group SA '144A' 6% 15/5/2022	4,828,312	0.04
USD 200,000	SFR Group SA 6% 15/5/2022*	194,690	0.00
USD 1,660,000	SFR Group SA '144A' 7.375% 1/5/2026	1,608,125	0.01
EUR 84,240	SMCP Group SAS 5.875% 1/5/2023	110,406	0.00
GBP 200,000	Societe Generale SA FRN 16/6/2018 (Perpetual)	280,541	0.00
USD 4,400,000	Societe Generale SA FRN 27/1/2020 (Perpetual)	4,504,896	0.04
USD 248,000	Societe Generale SA '144A' FRN 13/9/2021 (Perpetual)*	267,890	0.00
EUR 500,000	Societe Generale SA FRN 23/2/2028	611,192	0.01
EUR 510,000	Solvay Finance SA FRN 2/6/2021 (Perpetual)*	697,799	0.01
EUR 100,000	Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	143,402	0.00
EUR 300,000	Solvay Finance SA FRN 3/6/2024 (Perpetual)	438,847	0.00
EUR 300,000	SPIE SA 3.125% 22/3/2024*	379,715	0.00
EUR 600,000	TDF Infrastructure SAS 2.5% 7/4/2026	770,766	0.01
EUR 3,405,000	TOTAL SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	4,330,121	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 (%)
	フランス(続き)		
EUR 160,000	TOTAL SA FRN 5/5/2023 (Perpetual)	207,035	0.00
EUR 575,000	Verallia Packaging SASU 5.125% 1/8/2022	730,196	0.01
EUR 850,000	WFS Global Holding SAS 9.5% 15/7/2022	1,111,361	0.01
		83,490,708	0.71
	ドイツ		
EUR 420,000	Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% 1/4/2024	524,003	0.00
EUR 400,000	ADLER Real Estate AG 1.5% 6/12/2021	490,438	0.00
EUR 1,817,000	ADLER Real Estate AG 2.125% 6/2/2024	2,216,801	0.02
EUR 452,000	ADLER Real Estate AG 4.75% 8/4/2020*	574,370	0.01
EUR 3,500,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075	4,460,377	0.04
EUR 600,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075	758,149	0.01
EUR 15,762,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.25% 15/2/2027*	18,755,614	0.16
EUR 572,000	CTC BondCo GmbH 5.25% 15/12/2025*	699,724	0.01
EUR 1,900,000	Deutsche Bank AG 4.5% 19/5/2026*	2,567,353	0.02
USD 18,950,000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 1/12/2032	17,718,250	0.15
USD 1,255,000	Deutsche Bank AG/New York NY 2.7% 13/7/2020	1,238,820	0.01
EUR 12,472,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	17,001,344	0.14
EUR 100,000	Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	135,843	0.00
EUR 345,000	IHO Verwaltungs GmbH 2.75% 15/9/2021	429,851	0.00
EUR 696,423	IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/9/2023	881,496	0.01
EUR 1,400,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/9/2026*	1,807,411	0.02
EUR 8,200,000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028	10,125,559	0.09
EUR 500,000	Nidda BondCo GmbH 5% 30/9/2025*	605,896	0.01
EUR 400,000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	491,144	0.00
EUR 1,679,000	Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023*	2,038,628	0.02
EUR 112,000	ProGroup AG FRN 31/3/2024	138,122	0.00
EUR 390,000	ProGroup AG 5.125% 1/5/2022	490,478	0.00
EUR 400,000	Raffinerie Heide GmbH 6.375% 1/12/2022*	501,091	0.00
EUR 200,000	RWE AG FRN 21/4/2075	252,544	0.00
EUR 925,000	Senvion Holding GmbH 3.875% 25/10/2022*	1,049,944	0.01
EUR 675,000	thyssenkrupp AG 1.375% 3/3/2022	832,917	0.01
EUR 200,000	thyssenkrupp AG 2.5% 25/2/2025	259,583	0.00
EUR 100,000	thyssenkrupp AG 2.75% 8/3/2021	129,150	0.00
EUR 600,000	TLG Immobilien AG 1.375% 27/11/2024	727,153	0.01
EUR 2,110,000	Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027*	2,719,377	0.02
EUR 182,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027*	234,428	0.00
EUR 200,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4.625% 15/2/2026	267,469	0.00
USD 2,070,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH '144A' 5% 15/1/2025	2,126,718	0.02
EUR 631,400	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 5.625% 15/4/2023	798,816	0.01
EUR 952,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 6.25% 15/1/2029	1,320,747	0.01
EUR 510,000	Volkswagen Leasing GmbH 1.125% 4/4/2024	626,339	0.01
		95,995,947	0.82

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ギリシャ			
EUR 1,275,000	Alpha Bank AE 2.5% 5/2/2023	1,556,166	0.01
EUR 805,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.375% 15/2/2025	946,422	0.01
EUR 293,760	Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	357,861	0.00
EUR 1,037,658	Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028	1,206,202	0.01
EUR 1,084,012	Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	1,185,088	0.01
EUR 1,374,193	Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037	1,468,445	0.01
EUR 847,985	Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	906,549	0.01
EUR 1,487,000	National Bank of Greece SA 2.75% 19/10/2020	1,860,201	0.02
		9,486,934	0.08
ガーンジー			
USD 559,230	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	583,109	0.01
USD 2,525,000	EFG International Guernsey Ltd FRN 5/4/2027	2,543,708	0.02
EUR 236,000	Summit Germany Ltd 2% 31/1/2025	282,162	0.00
		3,408,979	0.03
ホンジュラス			
USD 1,319,000	Inversiones Atlantida SA '144A' 8.25% 28/7/2022	1,360,219	0.01
香港			
USD 4,600,000	Bagan Capital Ltd 23/9/2021 (Zero Coupon)	4,604,048	0.04
USD 1,834,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 2/12/2020 (Perpetual)	1,854,174	0.02
USD 1,200,000	Baosteel Hong Kong Investment Co Ltd 1/12/2018 (Zero Coupon)	1,442,250	0.01
USD 1,906,000	CGNPC International Ltd 3.75% 11/12/2027	1,831,358	0.02
USD 1,550,000	Chalieco Hong Kong Corp Ltd FRN 15/1/2020 (Perpetual)	1,575,187	0.01
CNH 917,253	China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	101,456	0.00
USD 2,205,000	Chong Hing Bank Ltd FRN 26/7/2027	2,151,883	0.02
USD 4,115,000	CITIC Ltd 4% 11/1/2028	3,943,575	0.03
USD 6,047,000	CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020	6,175,499	0.05
USD 950,000	Dah Sing Bank Ltd FRN 30/11/2026*	952,914	0.01
USD 2,825,000	HeSteel Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020	2,820,918	0.02
USD 1,100,000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/4/2018 (Perpetual)	1,019,095	0.01
USD 2,945,000	Hongkong Xiangyu Investment Co Ltd 4.5% 30/1/2023*	2,891,566	0.02
USD 2,350,000	Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd FRN 21/7/2021 (Perpetual)*	2,321,800	0.02
USD 4,165,000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.975% 9/11/2027*	3,985,791	0.03
USD 1,846,000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)*	1,791,774	0.02
USD 4,500,000	Wing Lung Bank Ltd FRN 22/11/2027*	4,379,171	0.04
		43,842,459	0.37
インド			
USD 2,402,000	Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,288,855	0.02
USD 480,000	Export-Import Bank of India 3.375% 5/8/2026	454,325	0.00
INR 400,000,000	Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	6,573,630	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 (%)
インド(続き)			
USD 250,000	Glenmark Pharmaceuticals Ltd 2% 28/6/2022	274,187	0.00
USD 2,400,000	Hindustan Petroleum Corp Ltd 4% 12/7/2027	2,327,243	0.02
INR 1,000,000,000	Housing Development Finance Corp Ltd 6.875% 30/4/2020	15,219,596	0.13
INR 268,830,000	India Government Bond 7.17% 8/1/2028	3,982,336	0.04
INR 1,479,000,000	India Government Bond 7.59% 20/3/2029	22,101,133	0.19
USD 4,105,000	Indian Railway Finance Corp Ltd 3.835% 13/12/2027	3,960,694	0.03
INR 458,000,000	LIC Housing Finance Ltd 7.2% 24/4/2020	7,003,329	0.06
INR 250,000,000	LIC Housing Finance Ltd 8.25% 23/10/2025	3,837,163	0.03
INR 458,000,000	LIC Housing Finance Ltd 8.6% 28/12/2020	7,109,217	0.06
USD 4,600,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027	4,349,510	0.04
INR 500,000,000	Power Finance Corp Ltd 7.44% 11/6/2027	7,339,337	0.06
USD 1,236,000	Rural Electrification Corp Ltd 3.875% 7/7/2027	1,181,807	0.01
USD 1,500,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) 5.75% 16/7/2019	1,436,250	0.01
USD 116,049	Videocon Industries Ltd 2.8% 31/12/2020	70,210	0.00
USD 4,900,000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3.75% 6/2/2023	4,831,692	0.04
		94,340,514	0.80
インドネシア			
USD 945,000	ABM Investama Tbk PT 7.125% 1/8/2022	974,531	0.01
USD 138,773	Bumi Resources Tbk PT 11/12/2022 (Zero Coupon)	52,734	0.00
USD 8,700,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028*	8,260,389	0.07
USD 2,054,000	Indonesia Government International Bond 4.125% 15/1/2025	2,065,461	0.02
IDR 165,937,000,000	Indonesia Treasury Bond 5.625% 15/5/2023	11,840,142	0.10
IDR 137,300,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	9,572,102	0.08
IDR 58,009,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	4,281,531	0.03
IDR 101,069,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	7,939,377	0.07
IDR 222,742,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	17,748,399	0.15
IDR 30,060,000,000	Jasa Marga Persero Tbk PT 7.5% 11/12/2020	2,201,507	0.02
USD 838,000	Pertamina Persero PT 5.625% 20/5/2043	861,355	0.01
USD 4,824,000	Pertamina Persero PT 6.45% 30/5/2044	5,491,714	0.04
USD 5,525,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.75% 1/3/2023	5,517,652	0.05
USD 5,525,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 1/3/2028	5,536,050	0.05
IDR 30,260,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	2,205,909	0.02
		84,548,853	0.72
国際機関			
INR 177,190,000	Asian Development Bank 5.9% 20/12/2022	2,651,882	0.02
アイルランド			
USD 1,922,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	1,916,985	0.02
USD 5,095,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.65% 21/7/2027	4,802,537	0.04
EUR 626,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)	864,561	0.01
EUR 743,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	980,902	0.01
EUR 1,025,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 2.75% 15/3/2024	1,271,188	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 (%)
	アイルランド(続き)		
EUR 575,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023	737,633	0.01
USD 2,192,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.25% 15/9/2022	2,194,740	0.02
USD 6,911,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.625% 15/5/2023	6,936,916	0.06
GBP 372,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027	500,564	0.00
USD 1,100,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 6% 30/6/2021	1,126,125	0.01
EUR 525,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	702,414	0.01
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	183,883	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	183,533	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	589,181	0.00
EUR 760,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	909,290	0.01
EUR 7,350,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)	10,073,381	0.08
EUR 832,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	1,063,250	0.01
GBP 1,370,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	1,870,172	0.01
USD 1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	1,899,105	0.02
EUR 1,120,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2029	1,223,236	0.01
EUR 462,000	eircom Finance DAC 4.5% 31/5/2022	580,232	0.00
USD 7,270,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.2% 23/9/2026	6,775,324	0.06
EUR 694,441	Taurus 2016-2 DEU DAC '2016-DE2 C' FRN 3/1/2027	860,146	0.01
EUR 737,972	Taurus 2016-2 DEU DAC '2016-DE2 D' FRN 3/1/2027	914,116	0.01
GBP 2,000,000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	2,812,503	0.02
		51,971,917	0.44
	マン島		
USD 5,489,000	Gohl Capital Ltd 4.25% 24/1/2027	5,433,499	0.05
	イタリア		
EUR 350,000	A2A SpA 1.625% 19/10/2027	419,887	0.00
EUR 277,329	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl FRN 10/12/2028	339,518	0.00
GBP 300,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	447,911	0.00
EUR 1,300,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 12/12/2042	2,022,197	0.02
EUR 303,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	433,222	0.00
EUR 700,000	Assicurazioni Generali SpA 4.125% 4/5/2026	963,045	0.01
EUR 800,000	Banca IFIS SpA FRN 17/10/2027	996,303	0.01
EUR 6,165,000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 18/1/2028*	7,440,032	0.06
EUR 600,000	Banco BPM SpA 2.75% 27/7/2020	765,943	0.01
EUR 200,000	Banco BPM SpA 4.25% 30/1/2019	252,670	0.00
EUR 500,000	Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023	636,540	0.01
EUR 453,000	Enel SpA FRN 10/1/2074	582,166	0.01
EUR 960,000	Enel SpA FRN 15/1/2075*	1,263,282	0.01
GBP 297,000	Enel SpA FRN 10/9/2075	469,809	0.00
EUR 5,720,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	7,766,654	0.07
USD 2,520,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 17/9/2025 (Perpetual)*	2,753,100	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	イタリア(続き)		
EUR 6,665,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)*	10,168,209	0.09
USD 5,380,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.125% 14/7/2022	5,231,525	0.05
USD 4,850,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 4.375% 12/1/2048	4,545,510	0.04
USD 10,824,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26/6/2024	10,804,652	0.09
EUR 150,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	202,175	0.00
USD 7,360,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.71% 15/1/2026	7,507,163	0.06
EUR 16,455,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.1% 15/9/2021	24,523,149	0.21
EUR 8,300,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.2% 1/6/2027	10,358,680	0.09
EUR 451,000	LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 1/4/2024*	592,120	0.01
EUR 1,404,000	Sisal Group SpA 7% 31/7/2023	1,791,895	0.02
EUR 320,000	Snaitech SpA 6.375% 7/11/2021	416,250	0.00
EUR 3,000,000	Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	3,630,947	0.03
EUR 1,600,000	Telecom Italia SpA/Milano 2.375% 12/10/2027	1,929,405	0.02
EUR 720,000	Telecom Italia SpA/Milano 3% 30/9/2025	921,421	0.01
EUR 1,155,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	1,535,221	0.01
EUR 267,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.625% 19/1/2024	358,937	0.00
USD 3,018,000	Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30/5/2024	3,115,149	0.03
GBP 200,000	Telecom Italia SpA/Milano 5.875% 19/5/2023	317,063	0.00
EUR 950,000	UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)	1,282,505	0.01
EUR 3,935,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	5,894,570	0.05
EUR 7,635,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)*	10,338,145	0.09
EUR 1,172,000	UniCredit SpA FRN 28/10/2025	1,587,951	0.01
EUR 3,740,000	UniCredit SpA FRN 3/1/2027	4,980,942	0.04
USD 11,328,000	UniCredit SpA '144A' FRN 19/6/2032*	11,645,943	0.10
EUR 900,000	UniCredit SpA 6.95% 31/10/2022	1,350,098	0.01
EUR 450,000	Wind Tre SpA 2.625% 20/1/2023	501,884	0.01
EUR 330,000	Wind Tre SpA 3.125% 20/1/2025*	361,719	0.00
		153,445,507	1.31
	日本		
JPY 20,000,000	ANA Holdings Inc 16/9/2022 (Zero Coupon)	195,546	0.00
JPY 160,000,000	ANA Holdings Inc 19/9/2024 (Zero Coupon)	1,575,197	0.01
JPY 20,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/ The 25/3/2020 (Zero Coupon)	184,844	0.00
JPY 210,000,000	Chugoku Electric Power Co Inc/ The 25/1/2022 (Zero Coupon)	2,014,517	0.02
JPY 200,000,000	CyberAgent Inc 17/2/2023 (Zero Coupon)	1,981,636	0.02
JPY 290,000,000	Daio Paper Corp 17/9/2020 (Zero Coupon)	2,886,459	0.02
JPY 40,000,000	Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	383,807	0.00
JPY 380,000,000	HIS Co Ltd 30/8/2019 (Zero Coupon)	3,726,881	0.03
JPY 160,000,000	HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	1,598,850	0.01
JPY 80,000,000	Hosiden Corp 20/9/2024 (Zero Coupon)	804,034	0.01
JPY 290,000,000	Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,793,097	0.02
JPY 360,000,000	Iwatani Corp 22/10/2020 (Zero Coupon)	3,826,586	0.03
JPY 11,530,400,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2027	115,254,319	0.98
JPY 70,000,000	Kandenko Co Ltd 31/3/2021 (Zero Coupon)	761,597	0.01
JPY 250,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2019 (Zero Coupon)	2,574,170	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 230,000,000	Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	2,319,653	0.02
JPY 90,000,000	Kyushu Electric Power Co Inc 31/3/2022 (Zero Coupon)	860,310	0.01
JPY 230,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,163,924	0.02
JPY 100,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	955,900	0.01
JPY 490,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,933,289	0.04
JPY 140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,433,907	0.01
USD 11,710,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.665% 25/7/2022	11,369,274	0.10
USD 2,961,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.998% 22/2/2022	2,930,337	0.03
USD 900,000	Mitsui OSK Lines Ltd 24/4/2020 (Zero Coupon)	865,125	0.01
USD 11,443,000	Mizuho Financial Group Inc 2.953% 28/2/2022	11,239,475	0.10
JPY 370,000,000	Nagoya Railroad Co Ltd 11/12/2024 (Zero Coupon)	3,747,578	0.03
JPY 380,000,000	Resorttrust Inc 1/12/2021 (Zero Coupon)	3,677,201	0.03
JPY 90,000,000	SBI Holdings Inc/Japan 14/9/2022 (Zero Coupon)	1,253,041	0.01
JPY 150,000,000	Shimizu Corp 16/10/2020 (Zero Coupon)	1,476,565	0.01
USD 1,700,000	Shizuoka Bank Ltd/The 25/4/2018 (Zero Coupon)	1,690,531	0.01
USD 600,000	Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	637,800	0.01
USD 280,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)	271,615	0.00
USD 600,000	SoftBank Group Corp 4.75% 19/9/2024	583,500	0.01
EUR 781,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	1,006,480	0.01
EUR 200,000	SoftBank Group Corp 5.25% 30/7/2027	262,908	0.00
JPY 240,000,000	T&D Holdings Inc 5/6/2020 (Zero Coupon)	2,330,007	0.02
JPY 80,000,000	Takashimaya Co Ltd 11/12/2018 (Zero Coupon)	747,817	0.01
JPY 50,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2018 (Zero Coupon)	464,029	0.00
JPY 320,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,971,098	0.03
JPY 140,000,000	Toray Industries Inc 30/8/2019 (Zero Coupon)	1,627,516	0.01
JPY 120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,138,815	0.01
USD 5,745,633	Universal Entertainment Corp '144A' 8.5% 24/8/2020	5,858,420	0.05
USD 3,000,000	Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	3,176,250	0.03
		212,553,905	1.81
	ジャージー		
GBP 3,277,000	AA Bond Co Ltd 2.75% 31/7/2023	4,211,557	0.04
EUR 881,000	Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15/8/2024	1,107,267	0.01
USD 214,000	Aptiv Plc 4.25% 15/1/2026	218,520	0.00
EUR 250,000	Avis Budget Finance Plc 4.125% 15/11/2024*	311,940	0.00
GBP 5,938,000	CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	8,305,069	0.07
GBP 533,000	CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025*	740,842	0.01
EUR 2,000,000	Glencore Finance Europe Ltd 1.875% 13/9/2023*	2,527,590	0.02
USD 1,400,000	HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/6/2018 (Perpetual)	1,436,750	0.01
EUR 1,691,501	LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024	2,101,851	0.02
EUR 442,000	Lincoln Finance Ltd 6.875% 15/4/2021	560,607	0.00
EUR 900,000	Mercury Bondco Plc 7.125% 30/5/2021	1,143,376	0.01
EUR 606,912	Mercury Bondco Plc 8.25% 30/5/2021*	778,856	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 (%)
	ジャージー(続き)		
USD 600,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	709,788	0.01
		24,154,013	0.21
	レバノン		
USD 11,286,000	Lebanon Government International Bond 6.1% 4/10/2022	10,926,259	0.09
USD 6,093,000	Lebanon Government International Bond 6.25% 4/11/2024	5,780,734	0.05
USD 3,475,000	Lebanon Government International Bond 6.65% 22/4/2024	3,366,406	0.03
USD 11,165,000	Lebanon Government International Bond 6.85% 23/3/2027*	10,571,859	0.09
		30,645,258	0.26
	ルクセンブルグ		
USD 8,802,000	Allergan Funding SCS 3.8% 15/3/2025	8,669,028	0.07
USD 1,759,000	Altice Financing SA '144A' 6.625% 15/2/2023	1,759,000	0.02
USD 1,860,000	Altice Financing SA '144A' 7.5% 15/5/2026	1,879,763	0.02
EUR 850,000	Altice Finco SA 4.75% 15/1/2028*	936,224	0.01
USD 450,000	Altice Finco SA '144A' 8.125% 15/1/2024	463,500	0.00
EUR 956,000	Altice Luxembourg SA 6.25% 15/2/2025	1,097,106	0.01
EUR 822,000	Altice Luxembourg SA 7.25% 15/5/2022	970,448	0.01
EUR 100,000	ArcelorMittal 3% 9/4/2021	131,446	0.00
EUR 100,000	ArcelorMittal 3.125% 14/1/2022	132,748	0.00
EUR 200,000	ARD Finance SA 6.625% 15/9/2023*	260,203	0.00
EUR 500,000	Aroundtown SA 1.5% 18/1/2021	750,976	0.01
EUR 800,000	Aroundtown SA 1.875% 19/1/2026	982,761	0.01
GBP 200,000	B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022	284,981	0.00
EUR 1,200,000	Bevco Lux Sarl 1.75% 9/2/2023	1,464,733	0.01
EUR 125,000	BMBG Bond Finance SCA 3% 15/6/2021	154,903	0.00
GBP 100,000	Cabot Financial Luxembourg SA 6.5% 1/4/2021	139,867	0.00
GBP 554,000	Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023*	811,417	0.01
EUR 100,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.75% 15/5/2021	126,888	0.00
EUR 730,000	Cirsa Funding Luxembourg SA 5.875% 15/5/2023	925,926	0.01
EUR 325,000	CNH Industrial Finance Europe SA 1.75% 12/9/2025	400,195	0.00
EUR 1,524,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 1/11/2021*	1,945,885	0.02
USD 420,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA '144A' 7.625% 1/11/2021	422,218	0.00
EUR 276,000	ContourGlobal Power Holdings SA 5.125% 15/6/2021	347,380	0.00
EUR 350,000	CPI Property Group SA 2.125% 4/10/2024	426,005	0.00
EUR 380,000	DEA Finance SA 7.5% 15/10/2022	512,905	0.00
USD 3,239,609	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	3,186,642	0.03
EUR 8,515,000	European Financial Stability Facility 0.4% 17/2/2025	10,288,529	0.09
EUR 17,980,000	European Financial Stability Facility 0.875% 26/7/2027	22,020,715	0.19
EUR 3,380,000	European Financial Stability Facility 0.95% 14/2/2028	4,141,726	0.04
EUR 2,907,000	European Financial Stability Facility 1.8% 10/7/2048	3,699,884	0.03
EUR 819,000	Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/7/2022	1,126,874	0.01
EUR 460,000	Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023*	536,056	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ルクセンブルグ(続き)		
EUR 265,000	Gestamp Funding Luxembourg SA 3.5% 15/5/2023	338,489	0.00
EUR 400,000	Grand City Properties SA FRN 18/2/2022 (Perpetual)	520,000	0.00
EUR 700,000	Grand City Properties SA 1.5% 22/2/2027	835,932	0.01
EUR 241,000	Hercule Debtco Sarl 6.75% 30/6/2024	295,133	0.00
USD 3,544,000	Hidrovias International Finance SARL '144A' 5.95% 24/1/2025	3,552,895	0.03
EUR 325,000	Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/2/2022	420,825	0.00
EUR 600,000	INEOS Group Holdings SA 5.375% 1/8/2024	776,007	0.01
EUR 600,000	JH-Holding Finance SA 8.25% 1/12/2022	778,366	0.01
EUR 240,000	Kleopatra Holdings 1 SCA 8.5% 30/6/2023	271,762	0.00
EUR 67,000	Matterhorn Telecom SA FRN 1/2/2023	82,206	0.00
EUR 505,000	Matterhorn Telecom SA 3.875% 1/5/2022	628,731	0.01
EUR 1,475,000	Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027*	1,770,323	0.02
USD 2,354,000	Nexa Resources SA '144A' 5.375% 4/5/2027	2,426,091	0.02
USD 5,770,000	Puma International Financing SA '144A' 5% 24/1/2026*	5,678,661	0.05
USD 4,290,000	Rede D'or Finance Sarl '144A' 4.95% 17/1/2028*	4,150,146	0.04
USD 3,903,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025*	3,861,531	0.03
USD 4,451,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 7.375% 9/2/2024	4,770,916	0.04
EUR 170,000	Schmolz+Bickenbach Luxembourg Finance SA 5.625% 15/7/2022	215,569	0.00
EUR 300,000	SELP Finance Sarl 1.5% 20/11/2025*	362,316	0.00
EUR 2,300,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)*	2,973,109	0.03
EUR 300,000	SES SA FRN 29/1/2024 (Perpetual)	398,768	0.00
EUR 313,000	Swissport Financing Sarl 6.75% 15/12/2021*	398,543	0.00
EUR 960,000	Swissport Financing Sarl 9.75% 15/12/2022*	1,232,201	0.01
USD 1,020,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	1,122,000	0.01
EUR 276,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	502,756	0.00
EUR 729,000	Telenet Finance V Luxembourg SCA 6.75% 15/8/2024	945,768	0.01
EUR 630,000	Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027	834,659	0.01
USD 1,498,000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC ' 144A' 5.75% 15/7/2025	1,535,450	0.01
		112,676,085	0.96
	マレーシア		
USD 3,200,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	3,412,800	0.03
USD 1,000,000	Cahaya Capital Ltd 18/9/2021 (Zero Coupon)	1,027,500	0.01
USD 8,874,000	Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	9,128,360	0.08
MYR 120,000,000	Malaysia Government Bond 3.844% 15/4/2033	28,592,279	0.24
		42,160,939	0.36
	モルディブ		
USD 2,900,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	2,760,698	0.02
	モーリシャス		
USD 4,475,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023*	4,318,375	0.04
USD 650,000	Lodha Developers International Ltd 12% 13/3/2020	693,063	0.00
		5,011,438	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 1,231,000	Alpha Holding SA de CV '144A' 10% 19/12/2022	1,214,493	0.01
USD 3,295,000	Axtel SAB de CV '144A' 6.375% 14/11/2024	3,356,781	0.03
USD 3,139,000	Cydsa SAB de CV '144A' 6.25% 4/10/2027	3,143,363	0.03
USD 1,569,000	Docuformas SAPI de CV '144A' 9.25% 11/10/2022	1,506,255	0.01
USD 1,995,000	Grupo KUO SAB De CV '144A' 5.75% 7/7/2027	2,024,925	0.02
MXN 2,283,000	Mexican Bonos 4.75% 14/6/2018	12,028,547	0.10
MXN 3,311,262	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	15,663,323	0.13
USD 2,380,000	Mexichem SAB de CV '144A' 5.5% 15/1/2048	2,255,050	0.02
USD 15,709,000	Petroleos Mexicanos '144A' 5.35% 12/2/2028	15,438,020	0.13
USD 1,135,000	Trust F/1401 6.95% 30/1/2044*	1,196,018	0.01
USD 2,301,000	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR '144A' FRN 29/1/2025 (Perpetual)*	2,296,559	0.02
		60,123,334	0.51
	モンゴル		
USD 1,044,068	Energy Resources LLC FRN 30/9/2022	1,093,694	0.01
USD 2,850,000	Mongolia Government International Bond 5.625% 1/5/2023	2,833,926	0.02
CNH 5,000,000	Mongolia Government International Bond 7.5% 30/6/2018	794,221	0.01
		4,721,841	0.04
	オランダ		
EUR 3,800,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	5,108,773	0.04
EUR 5,700,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2027 (Perpetual)	7,379,169	0.06
EUR 1,580,000	Achmea BV FRN 4/2/2025 (Perpetual)	2,043,243	0.02
USD 74,359	AE-Rotor Holding BV 4.969% 28/3/2018	74,638	0.00
USD 4,500,000	AT Securities BV FRN 21/7/2023 (Perpetual)	4,480,920	0.04
EUR 900,000	ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)	1,160,847	0.01
EUR 623,000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025*	799,860	0.01
EUR 300,000	Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	362,593	0.00
EUR 1,300,000	Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	1,587,107	0.01
EUR 500,000	Capital Stage Finance BV FRN 13/9/2023 (Perpetual)	683,982	0.01
EUR 749,000	Constellium NV 4.25% 15/2/2026	928,610	0.01
EUR 907,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2020 (Perpetual)	1,210,813	0.01
EUR 400,000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2021 (Perpetual)	563,408	0.00
EUR 100,000	Darling Global Finance BV 4.75% 30/5/2022	125,786	0.00
EUR 798,000	Diamond BC BV 5.625% 15/8/2025*	953,323	0.01
EUR 2,025,000	ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 29/9/2047	2,597,665	0.02
USD 4,840,000	Enel Finance International NV '144A' 2.75% 6/4/2023	4,678,993	0.04
USD 415,000	Enel Finance International NV '144A' 3.625% 25/5/2027	400,152	0.00
EUR 540,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/3/2024	719,256	0.01
EUR 200,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	262,642	0.00
EUR 1,200,000	Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)	1,500,358	0.01
EUR 200,000	Goodyear Dunlop Tires Europe BV 3.75% 15/12/2023	255,119	0.00
USD 2,250,000	Greenko Dutch BV 5.25% 24/7/2024*	2,205,000	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 (%)
	オランダ(続き)		
USD 2,605,000	ING Groep NV FRN 16/4/2020 (Perpetual)	2,687,839	0.02
USD 867,000	Jababeka International BV 6.5% 5/10/2023	850,770	0.01
EUR 832,000	Koninklijke KPN NV FRN 14/9/2018 (Perpetual)	1,047,557	0.01
GBP 420,000	Koninklijke KPN NV FRN 14/3/2073	628,020	0.01
USD 767,000	Marfrig Holdings Europe BV '144A' 8% 8/6/2023	793,853	0.01
USD 4,150,000	Minejesa Capital BV 4.625% 10/8/2030	4,065,608	0.03
EUR 1,150,000	NN Group NV FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	1,541,120	0.01
USD 2,141,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	2,151,063	0.02
USD 10,173,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	10,356,114	0.09
EUR 1,578,000	Nyrstar Netherlands Holdings BV 6.875% 15/3/2024	1,978,324	0.02
EUR 175,000	OI European Group BV 3.125% 15/11/2024	219,189	0.00
USD 1,212,000	Petrobras Global Finance BV '144A' 5.299% 27/1/2025	1,191,396	0.01
USD 8,050,000	Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/1/2021	8,301,482	0.07
USD 11,520,000	Petrobras Global Finance BV 5.75% 1/2/2029	11,153,894	0.10
USD 1,235,000	Petrobras Global Finance BV '144A' 5.999% 27/1/2028*	1,224,120	0.01
USD 47,349,000	Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022*	49,882,171	0.42
USD 4,056,000	Petrobras Global Finance BV 6.85% 5/6/2115	3,837,990	0.03
USD 1,218,000	Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	1,332,480	0.01
USD 6,783,000	Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/5/2021	7,613,917	0.06
EUR 5,686,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)	7,448,059	0.06
EUR 704,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075	950,864	0.01
USD 538,000	Royal Capital BV FRN 5/5/2024 (Perpetual)	532,179	0.00
USD 3,100,000	Royal Capital BV 5.875% 5/5/2022 (Perpetual)	3,072,875	0.03
EUR 6,800,000	Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	8,771,548	0.07
GBP 400,000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	611,506	0.01
EUR 800,000	Telefonica Europe BV FRN 18/9/2021 (Perpetual)	1,174,850	0.01
EUR 1,400,000	Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)	1,799,959	0.02
EUR 400,000	Telefonica Europe BV FRN 7/6/2023 (Perpetual)	481,660	0.00
EUR 400,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	568,568	0.01
EUR 1,100,000	TenneT Holding BV FRN 1/6/2024 (Perpetual)	1,382,513	0.01
EUR 660,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.125% 15/10/2024	672,509	0.01
EUR 630,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.25% 31/3/2023	688,950	0.01
USD 1,107,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/7/2019	1,081,284	0.01
EUR 200,000	Unilever NV 1.125% 12/2/2027	245,060	0.00
EUR 874,000	United Group BV FRN 1/7/2023*	1,077,012	0.01
EUR 258,000	United Group BV 4.375% 1/7/2022	320,835	0.00
EUR 1,054,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024	1,311,394	0.01
EUR 720,000	UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029	824,831	0.01
USD 4,125,000	VIVAT NV FRN 16/11/2022 (Perpetual)	4,119,844	0.04
EUR 3,920,000	Volkswagen International Finance NV FRN 24/3/2021 (Perpetual)	5,143,017	0.04
EUR 1,400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,764,074	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 (%)
	オランダ(続き)		
EUR 3,700,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/6/2027 (Perpetual)	4,691,739	0.04
EUR 900,000	Volkswagen International Finance NV FRN 20/3/2030 (Perpetual)	1,094,490	0.01
EUR 300,000	Vonovia Finance BV 0.75% 15/1/2024	361,240	0.00
EUR 300,000	Vonovia Finance BV 1.5% 14/1/2028	358,075	0.00
EUR 753,000	Ziggo Bond Co BV 7.125% 15/5/2024	995,677	0.01
EUR 841,000	Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/1/2025	1,045,063	0.01
EUR 1,220,000	Ziggo Secured Finance BV 4.25% 15/1/2027	1,507,446	0.01
USD 8,437,000	Ziggo Secured Finance BV '144A' 5.5% 15/1/2027*	8,120,612	0.07
		213,156,897	1.81
	ナイジェリア		
USD 1,790,000	Nigeria Government International Bond 7.143% 23/2/2030	1,843,700	0.01
USD 2,025,000	Nigeria Government International Bond 7.696% 23/2/2038	2,105,636	0.02
		3,949,336	0.03
	ノルウェー		
USD 4,700,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2020 (Perpetual)	4,808,288	0.04
USD 600,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2022 (Perpetual)	633,630	0.01
		5,441,918	0.05
	オマーン		
USD 1,854,000	Oman Government International Bond 5.625% 17/1/2028*	1,847,048	0.02
USD 1,552,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048	1,546,180	0.01
		3,393,228	0.03
	パキスタン		
USD 1,500,000	Pakistan Government International Bond 6.875% 5/12/2027	1,482,923	0.01
	パナマ		
USD 553,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA '144A' 5.625% 18/5/2036	594,597	0.00
USD 624,000	AES Panama SRL '144A' 6% 25/6/2022	653,646	0.01
USD 4,277,000	Avianca Holdings SA / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd 8.375% 10/5/2020	4,383,925	0.04
		5,632,168	0.05
	ペルー		
USD 2,351,000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5.625% 28/4/2027	2,268,715	0.02
	フィリピン		
USD 4,100,000	Union Bank of the Philippines 3.369% 29/11/2022	4,024,150	0.03
	ポルトガル		
EUR 200,000	Banco Espirito Santo SA (Defaulted) 8/5/2017 (Zero Coupon)	75,693	0.00
EUR 10,700,000	Banco Espirito Santo SA (Defaulted) 4% 21/1/2019	3,788,302	0.03
EUR 1,800,000	Banco Espirito Santo SA 4% 21/1/2019	637,285	0.01
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Defaulted) 4.75% 15/1/2018	683,677	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ポルトガル(続き)		
EUR 500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	623,528	0.00
EUR 900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,117,305	0.01
EUR 10,249,906	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta IV 2.423% 12/2/2021	12,858,839	0.11
EUR 18,709,540	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta V 0.85% 12/2/2022	22,926,542	0.19
		<hr/>	
		42,711,171	0.36
	ロシア連邦		
RUB 1,595,970,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/5/2020	28,484,273	0.24
RUB 332,947,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	5,990,958	0.05
RUB 162,964,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.4% 7/12/2022	3,009,214	0.03
RUB 1,179,792,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/8/2021	21,690,931	0.18
RUB 425,823,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.75% 16/9/2026	8,029,856	0.07
RUB 1,047,022,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 3/2/2027	20,293,965	0.17
USD 8,400,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	8,499,750	0.07
USD 8,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	9,042,900	0.08
		<hr/>	
		105,041,847	0.89
	サウジアラビア		
USD 7,327,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028	6,986,331	0.06
	シンガポール		
USD 2,594,000	ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/7/2024*	2,693,837	0.02
USD 885,145	Eterna Capital Pte Ltd 8% 11/12/2022	893,040	0.01
USD 1,750,000	Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30/1/2025*	1,721,562	0.02
USD 3,200,000	Medco Straits Services Pte Ltd 8.5% 17/8/2022*	3,436,089	0.03
USD 1,600,000	Modernland Overseas Pte Ltd 6.95% 13/4/2024	1,602,400	0.01
USD 3,855,000	SSMS Plantation Holdings Pte Ltd 7.75% 23/1/2023*	3,883,103	0.03
SGD 4,750,000	Suntec Real Estate Investment Trust 1.75% 30/11/2024	3,578,200	0.03
USD 3,325,000	United Overseas Bank Ltd FRN 19/10/2023 (Perpetual)	3,250,188	0.03
		<hr/>	
		21,058,419	0.18
	南アフリカ		
ZAR 212,449,000	Republic of South Africa Government Bond 6.25% 31/3/2036	13,757,314	0.12
ZAR 114,635,921	Republic of South Africa Government Bond 6.5% 28/2/2041	7,365,315	0.06
ZAR 75,690,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 28/2/2048	6,226,040	0.05
USD 5,628,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.875% 14/4/2026*	5,656,140	0.05
USD 21,289,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.5% 9/3/2020	22,113,949	0.19
USD 4,435,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	4,789,800	0.04
		<hr/>	
		59,908,558	0.51
	韓国		
USD 2,810,000	Daegu Bank Ltd/The 3.75% 13/8/2023	2,808,649	0.02
USD 2,400,000	GS Engineering & Construction Corp 4.5% 21/7/2021	2,560,896	0.02
USD 2,970,000	Hankook Tire Co Ltd 3.5% 30/1/2023	2,931,390	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 (%)
	韓国(続き)		
USD 1,994,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2047	1,933,215	0.02
USD 3,800,000	Hyundai Capital Services Inc 3% 29/8/2022	3,690,143	0.03
USD 600,000	Hyundai Heavy Industries Co Ltd 29/6/2020 (Zero Coupon)	592,998	0.00
KRW 3,600,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	3,710,038	0.03
USD 7,900,000	Korea Housing Finance Corp 3% 31/10/2022*	7,770,750	0.07
KRW 45,000,000,000	Korea Monetary Stabilization Bond 1.46% 2/4/2018	41,551,730	0.35
USD 3,249,000	Woori Bank FRN 27/9/2021 (Perpetual)	3,218,134	0.03
USD 6,500,000	Woori Bank FRN 16/5/2022 (Perpetual)*	6,535,750	0.06
USD 3,100,000	Woori Bank 4.75% 30/4/2024*	3,180,626	0.03
		80,484,319	0.68
	スペイン		
EUR 4,000,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19/2/2019 (Perpetual)	5,155,119	0.04
EUR 4,400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)	6,452,166	0.06
EUR 2,800,000	Banco de Sabadell SA 5.625% 6/5/2026	4,074,424	0.04
EUR 4,200,000	Banco Santander SA FRN 12/3/2019 (Perpetual)	5,383,596	0.05
EUR 1,900,000	Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)	2,661,994	0.02
EUR 4,400,000	Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	5,789,400	0.05
EUR 900,000	Bankia SA FRN 22/5/2024	1,147,453	0.01
EUR 6,500,000	Bankia SA FRN 15/3/2027*	8,422,142	0.07
EUR 9,400,000	CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	13,298,280	0.11
EUR 4,400,000	CaixaBank SA FRN 15/2/2027	5,755,612	0.05
EUR 2,600,000	CaixaBank SA FRN 14/7/2028*	3,287,660	0.03
EUR 100,000	Cellnex Telecom SA 1.5% 16/1/2026	124,153	0.00
EUR 700,000	Cellnex Telecom SA 2.375% 16/1/2024*	870,454	0.01
EUR 200,000	Grifols SA 3.2% 1/5/2025	247,296	0.00
EUR 316,000	Grupo-Antolin Irausa SA 3.25% 30/4/2024	397,961	0.00
EUR 400,000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 28/11/2025	481,443	0.00
EUR 500,000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.5% 28/11/2029	609,168	0.01
EUR 960,000	Masaria Investments SAU 5% 15/9/2024*	1,188,930	0.01
EUR 210,000	NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	268,870	0.00
EUR 33,834,000	Spain Government Bond '144A' 1.5% 30/4/2027*	41,772,297	0.36
EUR 5,825,000	Spain Government Bond '144A' 2.7% 31/10/2048	7,191,669	0.06
EUR 400,000	SRF 2017-1 FT FRN 26/4/2063	492,740	0.00
EUR 900,000	SRF 2017-1 FT FRN 26/4/2063	1,101,956	0.01
EUR 200,000	SRF 2017-1 FT '2017-1 C' FRN 26/4/2063	245,744	0.00
USD 2,950,000	Telefonica Emisiones SAU 4.665% 6/3/2038	2,943,126	0.03
USD 7,550,000	Telefonica Emisiones SAU 4.895% 6/3/2048	7,541,846	0.06
		126,905,499	1.08
	スリランカ		
LKR 1,500,000,000	Sri Lanka Government Bonds 10.75% 15/1/2019	9,784,798	0.08
LKR 398,010,000	Sri Lanka Government Bonds 11% 1/8/2021	2,651,275	0.02
LKR 1,500,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.5% 15/12/2021	10,133,406	0.09
LKR 98,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.75% 15/6/2027	683,713	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 (%)
	スリランカ(続き)		
USD 2,500,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 3/11/2025*	2,627,112	0.02
USD 300,000	SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	302,052	0.00
		26,182,356	0.22
	スウェーデン		
SEK 6,295,383	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd FRN 10/11/2055	769,241	0.01
EUR 460,000	Fastighets AB Balder FRN 7/3/2078	555,102	0.00
EUR 934,000	Intrum Justitia AB 2.75% 15/7/2022*	1,125,121	0.01
EUR 640,000	Intrum Justitia AB 3.125% 15/7/2024*	762,444	0.01
USD 360,000	Nordea Bank AB FRN 23/9/2019 (Perpetual)	366,750	0.00
EUR 4,425,000	Nordea Bank AB FRN 12/3/2025 (Perpetual)*	5,410,102	0.05
EUR 1,200,000	Ovako AB 5% 5/10/2022	1,494,820	0.01
USD 4,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB FRN 13/5/2022 (Perpetual)	4,083,928	0.04
USD 400,000	Swedbank AB FRN 17/3/2022 (Perpetual)	413,400	0.00
EUR 300,000	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 1.875% 1/3/2024	352,655	0.00
EUR 641,000	Unilabs Subholding AB 5.75% 15/5/2025	790,878	0.01
EUR 202,500	Verisure Holding AB 6% 1/11/2022	260,530	0.00
EUR 360,000	Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023	440,201	0.00
		16,825,172	0.14
	スイス		
USD 11,655,000	Credit Suisse AG 6.5% 8/8/2023	12,866,234	0.11
USD 3,645,000	Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	3,904,378	0.03
USD 2,700,000	Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	3,010,500	0.03
USD 2,600,000	Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)*	2,746,250	0.02
USD 2,865,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 12/1/2029	2,783,820	0.02
USD 8,570,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	8,567,078	0.07
USD 400,000	UBS Group AG FRN 22/3/2021 (Perpetual)	424,927	0.00
USD 220,000	UBS Group AG FRN 10/8/2021 (Perpetual)	233,648	0.00
EUR 1,100,000	UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	1,513,892	0.01
USD 1,800,000	UBS Group AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	1,988,136	0.02
USD 13,905,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 31/1/2023 (Perpetual)	13,443,396	0.12
USD 3,008,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 4.253% 23/3/2028	3,050,341	0.03
		54,532,600	0.46
	台湾		
USD 2,400,000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,408,400	0.02
USD 2,100,000	Neo Solar Power Corp 27/10/2019 (Zero Coupon)	2,123,625	0.02
		4,532,025	0.04
	タイ		
THB 79,000,000	Bangkok Dusit Medical Services PCL 18/9/2019 (Zero Coupon)	2,765,251	0.02
USD 2,800,000	PTTEP Treasury Center Co Ltd FRN 17/7/2022 (Perpetual)	2,790,714	0.02
USD 2,900,000	Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,975,748	0.03
		8,531,713	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 (%)
	チュニジア		
EUR 2,327,000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 4.5% 22/6/2020*	2,972,314	0.03
	トルコ		
USD 1,129,000	Coca-Cola Icecek AS '144A' 4.215% 19/9/2024*	1,124,766	0.01
USD 3,127,000	Petkim Petrokimya Holding AS '144A' 5.875% 26/1/2023	3,142,635	0.03
TRY 12,754,400	Turkey Government Bond 10.7% 17/2/2021	3,218,768	0.03
TRY 20,853,000	Turkey Government Bond 11% 2/3/2022	5,284,619	0.04
USD 11,803,000	Turkey Government International Bond 4.875% 9/10/2026	11,293,996	0.09
USD 1,397,000	Turkey Government International Bond 5.125% 25/3/2022	1,431,052	0.01
USD 5,204,000	Turkey Government International Bond 5.625% 30/3/2021	5,415,413	0.05
USD 53,693,000	Turkey Government International Bond 6.25% 26/9/2022*	57,283,719	0.49
USD 14,272,000	Turkey Government International Bond 7% 5/6/2020	15,208,600	0.13
USD 9,474,000	Turkey Government International Bond 7.375% 5/2/2025	10,646,407	0.09
USD 1,722,877	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	1,650,652	0.01
		115,700,627	0.98
	アラブ首長国連邦		
USD 6,100,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 3.65% 2/11/2029	5,825,500	0.05
USD 11,075,000	Abu Dhabi Government International Bond 4.125% 11/10/2047	10,515,712	0.09
USD 2,800,000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC FRN 12/1/2023	2,786,000	0.02
		19,127,212	0.16
	英国		
USD 4,690,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4% 11/9/2027	4,560,181	0.04
USD 1,848,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14/5/2025	1,914,936	0.02
USD 2,190,000	Aon Plc 4.75% 15/5/2045	2,297,187	0.02
GBP 1,400,000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.375% 15/7/2023*	1,976,223	0.02
EUR 254,000	Arrow Global Finance Plc FRN 1/4/2025*	304,825	0.00
GBP 305,000	Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	427,496	0.00
GBP 782,258	Auburn Securities 5 Plc FRN 1/12/2041	1,056,299	0.01
EUR 3,500,000	Barclays Plc FRN 15/9/2019 (Perpetual)	4,563,030	0.04
EUR 2,800,000	Barclays Plc FRN 15/12/2020 (Perpetual)	3,930,629	0.03
USD 527,000	Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	570,248	0.00
GBP 1,780,000	Barclays Plc FRN 15/3/2023 (Perpetual)	2,687,462	0.02
EUR 5,404,000	Barclays Plc FRN 7/2/2028	6,544,504	0.06
GBP 625,000	Barclays Plc 3.25% 17/1/2033	832,644	0.01
EUR 2,800,000	BAT International Finance Plc 2.25% 16/1/2030	3,473,352	0.03
GBP 186,187	Brass No 3 Plc FRN 16/4/2051	257,834	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,223,830	0.01
GBP 4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	5,381,453	0.05
GBP 1,325,475	Castell 2017-1 Plc '2017-1 X' FRN 25/10/2044	1,830,911	0.02
EUR 4,400,000	Centrica Plc FRN 10/4/2076*	5,577,431	0.05
EUR 3,925,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,888,686	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 (%)
	英国(続き)		
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,519,706	0.02
EUR 2,625,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,324,560	0.03
GBP 200,000	Cognita Financing Plc 7.75% 15/8/2021	285,834	0.00
GBP 3,200,000	Coventry Building Society FRN 1/11/2019 (Perpetual)*	4,604,268	0.04
GBP 1,482,243	Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	2,153,318	0.02
GBP 350,000	Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	492,408	0.00
EUR 388,000	EC Finance Plc 2.375% 15/11/2022	480,893	0.00
GBP 1,430,000	E-CARAT 5 Plc FRN 18/4/2023	1,987,056	0.02
GBP 10,240,000	EI Group Plc 6% 6/10/2023	15,518,138	0.13
GBP 425,000	EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	620,194	0.01
GBP 390,000	EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	597,883	0.01
GBP 360,409	Eurosail 2006-4np Plc '2006-4X A3C' FRN 10/12/2044	492,682	0.00
GBP 2,318,008	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A3' FRN 13/6/2045	3,213,992	0.03
GBP 1,103,185	Eurosail-UK 2007-4bl Plc '2007-4X A4' FRN 13/6/2045	1,412,280	0.01
GBP 1,325,000	Finsbury Square 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 16/2/2058	1,867,366	0.02
GBP 781,000	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 B' FRN 16/8/2058	1,095,671	0.01
GBP 967,000	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 C' FRN 16/8/2058	1,362,825	0.01
GBP 214,420	Finsbury Square 2016-2 Plc '2016-2 X' FRN 16/8/2058	296,916	0.00
GBP 949,979	Finsbury Square 2017-1 Plc '2017-1 C' FRN 12/3/2059	1,331,913	0.01
GBP 888,000	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,227,362	0.01
GBP 1,298,000	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,794,046	0.02
GBP 1,386,000	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,915,670	0.02
GBP 455,000	Gengarto 2015-2 Plc '2015-2 B' FRN 16/2/2054	629,956	0.01
GBP 615,000	Gosforth Funding 2014-1 Plc '2014-1 A2' FRN 19/10/2056	853,416	0.01
GBP 5,390,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc '2007-2X BA' FRN 18/6/2039	6,783,340	0.06
GBP 10,181,583	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	14,408,111	0.12
GBP 1,357,447	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	2,011,405	0.02
GBP 3,220,000	Hawksmoor Mortgages 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 25/5/2053	4,486,533	0.04
USD 800,000	HSBC Holdings Plc FRN 17/9/2024 (Perpetual)	840,872	0.01
USD 600,000	HSBC Holdings Plc FRN 30/3/2025 (Perpetual)	637,500	0.01
USD 1,937,000	HSBC Holdings Plc FRN 22/5/2027 (Perpetual)	1,984,457	0.02
EUR 2,987,000	HSBC Holdings Plc FRN 4/7/2029 (Perpetual)	3,907,093	0.03
EUR 561,000	INEOS Finance Plc 4% 1/5/2023	702,887	0.01
EUR 380,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	515,322	0.00
GBP 280,000	Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	369,033	0.00
EUR 200,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 2.2% 15/1/2024*	245,054	0.00
GBP 1,094,000	Jerrold Finco Plc 6.125% 15/1/2024	1,522,240	0.01
GBP 1,042,000	Jerrold Finco Plc 6.25% 15/9/2021*	1,475,413	0.01
EUR 2,324,875	Kensington Mortgage Securities Plc '2007-1X A3B' FRN 14/6/2040	2,782,114	0.02
GBP 330,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023	490,547	0.00
GBP 3,100,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 27/6/2019 (Perpetual)	4,528,306	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 (%)
	英国(続き)		
USD 300,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 1/10/2035 (Perpetual)	347,250	0.00
USD 87,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	101,138	0.00
USD 513,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 21/5/2037 (Perpetual)	596,363	0.01
USD 15,325,000	Lloyds Banking Group Plc 4.344% 9/1/2048	14,469,919	0.12
EUR 927,770	Ludgate Funding Plc '2007-1 BB' FRN 1/1/2061	983,581	0.01
EUR 795,232	Ludgate Funding Plc '2007-1 MB' FRN 1/1/2061	889,951	0.01
USD 7,068,000	MARB BondCo Plc '144A' 6.875% 19/1/2025	6,776,445	0.06
GBP 161,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2016-1 Plc '2016-1 B' FRN 20/10/2024	224,839	0.00
GBP 669,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2017-1 Plc FRN 20/12/2027	925,630	0.01
GBP 599,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2017-1 Plc FRN 20/12/2027	830,052	0.01
GBP 2,137,000	Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,967,230	0.03
GBP 426,000	Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	585,737	0.01
GBP 355,000	Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	481,120	0.00
USD 1,000,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/5/2018 (Perpetual)	918,000	0.01
GBP 34,213	Nationwide Building Society 10.25% 29/6/2049*	7,522,089	0.06
GBP 3,900,000	Nationwide Building Society FRN 20/6/2019 (Perpetual)	5,671,110	0.05
GBP 1,750,000	Newday Funding 2017-1 Plc FRN 15/7/2025	2,440,554	0.02
GBP 2,200,000	Newday Funding 2017-1 Plc '2017-1 C' FRN 15/7/2025	3,040,616	0.03
EUR 502,000	OTE Plc 3.5% 9/7/2020	651,877	0.01
EUR 107,827	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	125,492	0.00
EUR 399,024	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	463,947	0.00
EUR 475,000	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	555,317	0.00
EUR 1,165,000	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,338,246	0.01
EUR 2,795,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	3,089,171	0.03
EUR 1,171,362	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A1' FRN 15/1/2043	1,435,881	0.01
GBP 1,264,980	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A2' FRN 15/1/2043	1,751,603	0.01
GBP 1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'C' FRN 15/1/2043	1,641,712	0.01
GBP 282,000	PCL Funding II Plc '2017-1 B' FRN 15/6/2022	390,522	0.00
GBP 179,000	PCL Funding II Plc '2017-1 C' FRN 15/6/2022	247,887	0.00
GBP 470,000	PCL Funding III Plc '2017-2 C' FRN 15/6/2023	653,640	0.01
GBP 1,062,000	PCL Funding III Plc '2017-2 B' FRN 15/6/2023	1,472,195	0.01
GBP 563,000	Pinnacle Bidco Plc 6.375% 15/2/2025	789,007	0.01
GBP 580,000	Pizzaexpress Financing 2 Plc 6.625% 1/8/2021*	763,673	0.01
GBP 271,861	Precise Mortgage Funding 2014-1 Plc '2014-1 A' FRN 12/9/2047	376,316	0.00
GBP 100,000	Provident Financial Plc 8% 23/10/2019	144,356	0.00
GBP 2,981,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	4,164,770	0.04
GBP 799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'C' FRN 20/12/2046	1,120,284	0.01
GBP 180,000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 20/3/2050	251,469	0.00
GBP 15,000,000	Ripon Mortgages Plc 'C1' FRN 20/8/2056	20,793,296	0.18
EUR 71,442	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	83,036	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 1,065,042	RMAC Securities No 1 Plc '2007-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	1,226,022	0.01
USD 489,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2020 (Perpetual)	512,839	0.00
USD 3,572,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/8/2021 (Perpetual)	3,955,990	0.03
USD 1,700,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2025 (Perpetual)	1,906,125	0.02
GBP 300,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 24/6/2022 (Perpetual)	467,241	0.00
GBP 1,450,000	Shop Direct Funding Plc 7.75% 15/11/2022	1,846,855	0.02
GBP 5,124,995	Silverstone Master Issuer Plc '2015-1X 1A' FRN 21/1/2070	7,083,528	0.06
EUR 3,000,000	Sky Plc 2.25% 17/11/2025	3,929,475	0.03
EUR 800,000	Sky Plc 2.5% 15/9/2026	1,059,382	0.01
GBP 475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	694,556	0.01
GBP 4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	6,242,148	0.05
USD 1,795,000	Standard Chartered Plc FRN 2/4/2020 (Perpetual)	1,854,126	0.02
GBP 209,000	Stanlington No 1 Plc FRN 12/6/2046	300,136	0.00
GBP 1,875,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022*	2,592,663	0.02
GBP 425,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% 15/3/2022*	583,393	0.01
EUR 302,000	Synlab Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	386,424	0.00
EUR 183,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	240,306	0.00
EUR 2,485,401	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 A' FRN 1/2/2026	3,039,252	0.03
EUR 1,821,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 D' FRN 1/2/2026	2,238,577	0.02
EUR 2,309,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd '2015-DE2 E' FRN 1/2/2026	2,844,993	0.02
GBP 3,661,000	Taurus 2017-2 UK DAC '2017-UK2 B' FRN 17/11/2027	5,063,222	0.04
GBP 1,751,000	Taurus 2017-2 UK DAC '2017-UK2 C' FRN 17/11/2027	2,422,265	0.02
GBP 1,791,000	Taurus 2017-2 UK DAC '2017-UK2 D' FRN 17/11/2027	2,478,812	0.02
GBP 938,144	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,713,014	0.01
GBP 2,162,741	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,404,724	0.03
GBP 978,636	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,560,634	0.01
EUR 480,000	Titan Global Finance Plc 2.375% 16/11/2024	582,200	0.01
EUR 100,000	Titan Global Finance Plc 3.5% 17/6/2021	129,349	0.00
GBP 360,000	Trinity Square 2015-1 Plc '2015-1X B' FRN 15/7/2051	487,752	0.00
USD 660,000	Tullow Oil Plc 6% 1/11/2020*	667,590	0.01
USD 203,000	Tullow Oil Plc '144A' 6% 1/11/2020	205,335	0.00
GBP 4,038,160	Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	6,242,448	0.05
GBP 12,850,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	17,487,319	0.15
GBP 3,151,360	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	4,631,061	0.04
GBP 1,084,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,682,715	0.01
GBP 1,950,000	United Kingdom Gilt 1.5% 22/7/2047†	2,449,579	0.02
USD 2,000,000	Vedanta Resources Plc 7.125% 31/5/2023*	2,127,044	0.02
GBP 532,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027	735,948	0.01
GBP 100,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.125% 15/1/2025	143,043	0.00
GBP 378,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.5% 15/1/2025	539,135	0.00
GBP 2,434,000	Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029*	3,596,077	0.03
EUR 100,000	Viridian Group FinanceCo Plc/Viridian Power and Energy 4% 15/9/2025	115,094	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 200,000	Viridian Group FinanceCo Plc/Viridian Power and Energy 4.75% 15/9/2024*	260,389	0.00
GBP 900,000	Vodafone Group Plc 26/11/2020 (Zero Coupon)	1,211,787	0.01
GBP 510,000	Vue International Bidco Plc 7.875% 15/7/2020	717,942	0.01
GBP 6,289,043	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'A' FRN 21/9/2049	8,742,680	0.07
GBP 6,200,000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'B' FRN 21/9/2049	8,540,001	0.07
GBP 3,700,000	Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc 'C' FRN 21/9/2049	5,083,715	0.04
GBP 550,000	Wellcome Trust Ltd/The 2.517% 7/2/2118	744,812	0.01
GBP 4,795,000	Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	6,644,008	0.06
GBP 527,000	ZPG Plc 3.75% 15/7/2023	723,211	0.01
		378,279,998	3.22
	米国		
USD 4,630,000	245 Park Avenue Trust '2017-245P E' '144A' FRN 5/6/2037	4,186,971	0.04
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust '2017-245P XA' '144A' FRN 5/6/2037	111,545	0.00
USD 9,750,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust '2017-280P E' '144A' FRN 15/9/2034	9,777,449	0.08
USD 7,140,000	Abbott Laboratories 3.75% 30/11/2026	7,061,571	0.06
USD 4,440,000	Accredited Mortgage Loan Trust '2006-1 M2' FRN 25/4/2036	2,331,325	0.02
USD 2,490,334	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2007-HE4 A2A' FRN 25/5/2037	821,905	0.01
USD 1,468,482	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2003-MH1 B2' '144A' 15/8/2030 (Zero Coupon)	1,140,266	0.01
USD 2,060,000	Adams Mill CLO Ltd '2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	2,066,433	0.02
USD 1,154,000	AHS Hospital Corp 5.024% 1/7/2045	1,323,144	0.01
USD 250,000	AIMCO CLO Series '2014-AA DR' '144A' FRN 20/7/2026	252,117	0.00
USD 11,057,636	Ajax Mortgage Loan Trust '2017-D A' '144A' FRN 25/12/2057	11,057,636	0.09
USD 1,737,777	Ajax Mortgage Loan Trust '2017-D B' '144A' FRN 25/12/2057	1,078,305	0.01
USD 1,690,929	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-C A' '144A' 4% 25/10/2057	1,698,232	0.01
USD 2,428,952	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-B A' '144A' 4% 25/9/2065	2,432,031	0.02
USD 1,955,665	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-1 A' '144A' 4.25% 25/7/2047	1,930,499	0.02
USD 3,524,559	Ajax Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2016-A A' '144A' 4.25% 25/8/2064	3,555,322	0.03
USD 7,847,992	AJAX Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2017-A A' '144A' 3.47% 25/4/2057	7,816,292	0.07
USD 1,050,000	Allegro CLO II Ltd '2014-1A CR' '144A' FRN 21/1/2027	1,053,909	0.01
USD 280,000	Allegro CLO II Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 21/1/2027	280,692	0.00
USD 250,000	Allegro CLO IV Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 15/1/2029	255,361	0.00
USD 700,000	Allegro CLO V Ltd '2017-1A A' '144A' FRN 16/10/2030	703,708	0.01
USD 2,590,000	Allegro CLO VI Ltd '2017-2A A' '144A' FRN 17/1/2031	2,603,071	0.02
USD 2,080,000	ALM V Ltd '2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	2,082,291	0.02
USD 1,700,000	ALM V Ltd '2012-5A BR3' '144A' FRN 18/10/2027	1,703,836	0.01
USD 811,000	ALM VI Ltd '2012-6A A2RR' '144A' FRN 15/7/2026	812,267	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 2,620,000	ALM VI Ltd '2012-6A CRR' '144A' FRN 15/7/2026	2,660,795	0.02
USD 3,100,000	ALM VI Ltd '2012-6A DRR' '144A' FRN 15/7/2026	3,131,673	0.03
USD 5,070,000	ALM VII Ltd '2012-7A A1R' '144A' FRN 15/10/2028	5,122,365	0.04
USD 6,275,000	ALM VII Ltd '2012-7A SUB' '144A' FRN 15/10/2028	3,722,506	0.03
USD 13,709,000	ALM XI Ltd '2014-11A A1R' '144A' FRN 17/10/2026	13,721,670	0.12
USD 1,440,000	ALM XII Ltd '2015-12A A1R' '144A' FRN 16/4/2027	1,441,557	0.01
USD 1,293,000	ALM XII Ltd '2015-12A BR' '144A' FRN 16/4/2027	1,303,556	0.01
USD 950,000	ALM XII Ltd '2015-12A C1R' '144A' FRN 16/4/2027	957,016	0.01
USD 460,000	ALM XII Ltd '2015-12A C2R' '144A' FRN 16/4/2027	466,994	0.00
USD 3,970,000	ALM XIV Ltd '144A' 28/7/2026 (Zero Coupon)	2,634,258	0.02
USD 750,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A BR' '144A' FRN 15/7/2027	756,531	0.01
USD 2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A C2R' '144A' FRN 15/7/2027	2,287,222	0.02
USD 340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '2015-16A D' '144A' FRN 15/7/2027	342,392	0.00
USD 720,000	ALM XVII Ltd '2015-17A C1' '144A' FRN 15/1/2028	731,158	0.01
USD 275,000	ALM XVIII Ltd '2016-18A D' '144A' FRN 15/7/2027	281,443	0.00
USD 3,629,955	Alternative Loan Trust '2005-22T1 A1' FRN 25/6/2035	3,310,506	0.03
USD 3,223,500	Alternative Loan Trust '2005-J4 B1' FRN 25/7/2035	3,242,970	0.03
USD 1,441,853	Alternative Loan Trust '2005-38 A3' FRN 25/9/2035	1,355,066	0.01
USD 3,581,602	Alternative Loan Trust '2005-72 A3' FRN 25/1/2036	2,949,965	0.03
USD 1,183,343	Alternative Loan Trust '2005-76 2A1' FRN 25/2/2036	1,080,149	0.01
USD 2,276,658	Alternative Loan Trust '2006-23CB 2A5' FRN 25/8/2036	971,004	0.01
USD 1,517,097	Alternative Loan Trust '2006-0C10 2A3' FRN 25/11/2036	1,210,440	0.01
USD 2,874,855	Alternative Loan Trust '2006-0A6 1A2' FRN 25/7/2046	2,741,993	0.02
USD 809,838	Alternative Loan Trust '2006-0A8 1A1' FRN 25/7/2046	760,439	0.01
USD 6,292,540	Alternative Loan Trust '2006-0C7 2A3' FRN 25/7/2046	5,085,219	0.04
USD 966,640	Alternative Loan Trust '2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046	829,763	0.01
USD 3,648,744	Alternative Loan Trust '2006-0A16 A4C' FRN 25/10/2046	2,151,001	0.02
USD 1,294,308	Alternative Loan Trust '2006-J7 2A1' FRN 20/11/2046	892,714	0.01
USD 5,919,773	Alternative Loan Trust '2006-0A14 1A1' FRN 25/11/2046	5,160,655	0.04
USD 7,286,317	Alternative Loan Trust '2007-0A2 1A1' FRN 25/3/2047	6,040,312	0.05
USD 1,648,987	Alternative Loan Trust '2007-0A3 1A1' FRN 25/4/2047	1,526,685	0.01
USD 300,474	Alternative Loan Trust '2007-0A3 2A2' FRN 25/4/2047	19,259	0.00
USD 451,547	Alternative Loan Trust '2007-0A8 2A1' FRN 25/6/2047	361,661	0.00
USD 691,898	Alternative Loan Trust '2007-0H2 A2A' FRN 25/8/2047	528,256	0.00
USD 9,294,491	Alternative Loan Trust '2007-0H3 A1A' FRN 25/9/2047	8,363,035	0.07
USD 8,301,157	Alternative Loan Trust '2007-3T1 1A1' 6% 25/4/2037	6,390,151	0.05
USD 4,819,306	Alternative Loan Trust '2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	3,642,722	0.03
USD 5,522,974	Alternative Loan Trust '2006-11CB 3A1' 6.5% 25/5/2036	4,308,848	0.04
USD 1,526,169	Alternative Loan Trust '2006-15CB A1' 6.5% 25/6/2036	1,120,828	0.01
USD 5,006,622	Alternative Loan Trust '2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	3,769,824	0.03
USD 4,500,000	Altice US Finance I Corp '144A' 5.375% 15/7/2023	4,580,235	0.04
USD 808,672	Ambac Assurance Corp '144A' 5.1% 7/6/2020	1,073,512	0.01
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc '144A' 4.625% 1/3/2020	2,398,445	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 1,323,105	American Home Mortgage Assets Trust '2006-3 2A11' FRN 25/10/2046	1,164,033	0.01
USD 2,966,620	American Home Mortgage Assets Trust '2006-4 1A12' FRN 25/10/2046	2,180,263	0.02
USD 4,408,806	American Home Mortgage Assets Trust '2006-5 A1' FRN 25/11/2046	2,490,900	0.02
USD 843,224	American Home Mortgage Assets Trust '2007-1 A1' FRN 25/2/2047	551,873	0.00
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust '2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	2,082,936	0.02
USD 725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	952,570	0.01
USD 4,715,000	American Tower Corp 3.55% 15/7/2027	4,492,978	0.04
USD 5,445,000	American Tower Corp 5% 15/2/2024	5,808,250	0.05
USD 550,000	Americold 2010 LLC '2010-ARTA C' '144A' 6.811% 14/1/2029	590,804	0.01
USD 3,747,000	Amgen Inc 4.4% 1/5/2045	3,704,307	0.03
USD 530,000	AMMC CLO 15 Ltd '2014-15A D' '144A' FRN 9/12/2026	542,499	0.00
USD 1,365,000	AMMC CLO 17 Ltd '2015-17A B' '144A' FRN 15/11/2027	1,379,252	0.01
USD 670,000	AMMC CLO 17 Ltd '2015-17A C' '144A' FRN 15/11/2027	672,118	0.01
USD 450,000	AMMC CLO 18 Ltd '2016-18A D' '144A' FRN 26/5/2028	457,920	0.00
USD 625,000	AMMC CLO 18 Ltd '2016-18A E1' '144A' FRN 26/5/2028	633,220	0.01
USD 260,000	Ammc Clo 19 Ltd '2016-19A C' '144A' FRN 15/10/2028	264,539	0.00
USD 750,000	Ammc Clo 20 Ltd '2017-20A E' '144A' FRN 17/4/2029	762,260	0.01
USD 530,000	AMMC CLO 21 Ltd '2017-21A A' '144A' FRN 2/11/2030	535,499	0.00
USD 1,675,000	AMMC CLO XII Ltd '2013-12A AR' '144A' FRN 10/11/2030	1,691,222	0.01
USD 3,100,000	AMMC CLO XIII Ltd '2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,124,545	0.03
USD 2,160,000	AMMC CLO XIV Ltd '2014-14A A1LR' '144A' FRN 25/7/2029	2,179,592	0.02
USD 5,763,000	Analog Devices Inc 3.5% 5/12/2026	5,620,884	0.05
USD 250,000	Anchorage Capital CLO 2012-1 Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 13/1/2027	251,807	0.00
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1R' '144A' FRN 13/10/2030	847,712	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A BR' '144A' FRN 13/10/2030	344,048	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A CR' '144A' FRN 13/10/2030	426,443	0.00
USD 390,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd '2013-1A DR' '144A' FRN 13/10/2030	402,491	0.00
USD 1,050,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,049,627	0.01
USD 770,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA B' '144A' FRN 28/1/2031	771,268	0.01
USD 2,375,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA C' '144A' FRN 28/1/2031	2,384,728	0.02
USD 1,000,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA D' '144A' FRN 28/1/2031	1,002,481	0.01
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA E' '144A' FRN 28/1/2031	1,503,919	0.01
USD 1,560,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd '2014-4RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,562,679	0.01
USD 1,830,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd '2014-4RA C' '144A' FRN 28/1/2031	1,833,344	0.02
USD 1,750,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd '2014-4RA D' '144A' FRN 28/1/2031	1,753,285	0.02
USD 4,890,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd '2014-5RA B' '144A' FRN 15/1/2030	4,888,768	0.04
USD 1,040,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd '2014-5RA C' '144A' FRN 15/1/2030	1,044,603	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 1,460,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd '2014-5RA E' '144A' FRN 15/1/2030	1,463,416	0.01
USD 1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A AR' '144A' FRN 15/7/2030	1,587,058	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A DR' '144A' FRN 15/7/2030	599,833	0.01
USD 500,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd '2015-6A ER' '144A' FRN 15/7/2030	507,142	0.00
USD 12,950,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A AR' '144A' FRN 15/10/2027	12,961,798	0.11
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A B1R' '144A' FRN 15/10/2027	1,502,839	0.01
USD 2,688,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A CR' '144A' FRN 15/10/2027	2,695,470	0.02
USD 2,125,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A DR' '144A' FRN 15/10/2027	2,146,111	0.02
USD 2,250,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd '2015-7A ER' '144A' FRN 15/10/2027	2,242,630	0.02
USD 650,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd '2016-8A D' '144A' FRN 28/7/2028	657,299	0.01
USD 2,770,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd '2016-8A E' '144A' FRN 28/7/2028	2,819,520	0.02
USD 640,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd '2016-9A D' '144A' FRN 15/1/2029	654,717	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd '2016-9A E' '144A' FRN 15/1/2029	610,587	0.01
USD 5,260,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.2% 1/12/2047	5,115,971	0.04
USD 3,162,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/1/2025	3,252,908	0.03
USD 3,538,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	3,710,478	0.03
USD 1,270,819	Angel Oak Mortgage Trust I LLC (Step-up coupon) '2016-1 A1' '144A' 3.5% 25/7/2046	1,280,455	0.01
USD 198,842	Angel Oak Mortgage Trust LLC (Step-up coupon) '2015-1 A' '144A' FRN 25/11/2045	198,308	0.00
USD 45,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.65% 1/2/2026	44,589	0.00
USD 250,000	Annisa CLO Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/7/2028	254,993	0.00
USD 390,000	Antero Resources Corp 5.375% 1/11/2021	400,725	0.00
USD 23,367,000	Apidos CLO XII '2013-12A AR' '144A' FRN 15/4/2031	23,434,297	0.20
USD 1,037,421	Apidos CLO XV '2013-15A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	1,038,937	0.01
USD 1,120,000	Apidos CLO XV '2013-15A D' '144A' FRN 20/10/2025	1,122,589	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI '2013-16A CR' '144A' FRN 19/1/2025	477,446	0.00
USD 675,000	Apidos CLO XVII '2014-17A A1R' '144A' FRN 17/4/2026	676,148	0.01
USD 1,030,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A A1R' '144A' FRN 22/7/2026	1,031,734	0.01
USD 420,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A CR' '144A' FRN 22/7/2026	425,986	0.00
USD 1,845,000	Apidos CLO XVIII '2014-18A D' '144A' FRN 22/7/2026	1,849,832	0.02
USD 290,000	Apidos CLO XX '2015-20A A1R' '144A' FRN 16/1/2027	290,080	0.00
USD 500,000	Apidos CLO XXI '2015-21A C' '144A' FRN 18/7/2027	505,862	0.00
USD 380,000	Apidos CLO XXII '2015-22A D' '144A' FRN 20/10/2027	387,397	0.00
USD 1,070,000	Apidos CLO XXIII '2015-23A D2' '144A' FRN 15/1/2027	1,073,204	0.01
USD 597,000	Apple Inc 3.85% 4/8/2046	577,507	0.01
USD 6,444,106	APS Resecuritization Trust '2016-33A' '144A' FRN 27/9/2046	6,843,493	0.06
USD 1,807,439	APS Resecuritization Trust '2016-34A' '144A' FRN 27/4/2047	1,890,262	0.02
USD 5,911,732	APS Resecuritization Trust '2016-11MZ' '144A' FRN 31/7/2057	1,730,272	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 3,460,000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017-FL3 Ltd '2017-FL3 A' '144A' FRN 15/12/2027	3,468,110	0.03
USD 3,160,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	3,170,870	0.03
USD 1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd '2017-FL2 A' '144A' FRN 15/8/2027	1,333,411	0.01
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,618,800	0.01
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027	8,143,200	0.07
USD 7,515,000	Ares Capital Corp 4.25% 1/3/2025	7,360,153	0.06
USD 940,000	Ares XL CLO Ltd '2016-40A C' '144A' FRN 15/10/2027	954,432	0.01
USD 530,000	Ares XL CLO Ltd '2016-40A D' '144A' FRN 15/10/2027	543,277	0.00
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd '2016-41A D' '144A' FRN 15/1/2029	413,776	0.00
USD 870,000	Ares XLIII CLO Ltd '2017-43A E' '144A' FRN 15/10/2029	896,637	0.01
USD 255,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A BR' '144A' FRN 15/11/2025	257,067	0.00
USD 515,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A CR' '144A' FRN 15/11/2025	516,404	0.00
USD 460,000	Ares XXXII CLO Ltd '2014-32A D' '144A' FRN 15/11/2025	461,806	0.00
USD 380,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A A2R' '144A' FRN 5/12/2025	384,400	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A B2R' '144A' FRN 5/12/2025	253,623	0.00
USD 1,125,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A CR' '144A' FRN 5/12/2025	1,154,767	0.01
USD 800,000	Ares XXXIII CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 5/12/2025	824,768	0.01
USD 840,000	Ares XXXIX CLO Ltd '2016-39A E' '144A' FRN 18/7/2028	872,425	0.01
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd '2015-4A A1R' '144A' FRN 15/10/2030	1,509,928	0.01
USD 1,445,000	Ares XXXVII CLO Ltd '2015-4A CR' '144A' FRN 15/10/2030	1,457,576	0.01
USD 1,335,000	Ares XXXVII CLO Ltd '2015-4A DR' '144A' FRN 15/10/2030	1,363,176	0.01
USD 280,000	Ares XXXVIII CLO Ltd '2015-38A D' '144A' FRN 20/1/2027	280,089	0.00
USD 5,448,803	Argent Mortgage Loan Trust '2005-W1 A2' FRN 25/5/2035	5,175,418	0.04
USD 2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,800,000	0.02
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,761,125	0.02
USD 1,117,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.875% 15/2/2021	1,137,944	0.01
USD 263,226	Asset Securitization Corp '1997-D5 B2' 6.93% 14/2/2043	268,820	0.00
USD 7,255,000	AT&T Inc '144A' 4.1% 15/2/2028	7,092,281	0.06
USD 820,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A2LR' '144A' FRN 17/2/2026	820,941	0.01
USD 300,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A3LR' '144A' FRN 17/2/2026	301,762	0.00
USD 1,655,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd '2017-8A E' '144A' FRN 16/1/2030	1,627,649	0.01
USD 5,170,000	Atrium Hotel Portfolio Trust '2017-ATRM D' '144A' FRN 15/11/2019	5,142,625	0.04
USD 2,230,000	Atrium Hotel Portfolio Trust '2017-ATRM E' '144A' FRN 15/11/2019	2,215,650	0.02
USD 1,710,000	Atrium VIII '144A' FRN 23/10/2024	1,740,780	0.01
USD 1,110,000	Atrium VIII '144A' FRN 23/10/2024	1,142,913	0.01
USD 1,680,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	1,681,725	0.01
USD 1,130,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	1,133,014	0.01
USD 830,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	832,654	0.01
USD 1,000,000	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	1,002,165	0.01
USD 520,000	Atrium XI '144A' FRN 23/10/2025	520,920	0.00
USD 1,135,000	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	1,137,430	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 5,390,000	Autodesk Inc 3.5% 15/6/2027	5,133,576	0.04
EUR 420,000	Avantor Inc 4.75% 1/10/2024	511,865	0.00
USD 5,000,000	Aventura Mall Trust '2013-AVM D' '144A' FRN 5/12/2032	5,024,258	0.04
USD 1,310,000	Aventura Mall Trust '2013-AVM E' '144A' FRN 5/12/2032	1,312,292	0.01
USD 2,160,000	Avery Point V CLO Ltd '2014-5A AR' '144A' FRN 17/7/2026	2,160,798	0.02
USD 520,000	Avery Point V CLO Ltd '2014-5A BR' '144A' FRN 17/7/2026	522,534	0.00
USD 1,330,000	Avery Point VII CLO Ltd '2015-7A A1' '144A' FRN 15/11/2028	1,342,079	0.01
USD 780,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 7.125% 15/10/2020	856,662	0.01
USD 15,370,027	B2R Mortgage Trust '2015-2 XA' '144A' FRN 15/11/2048	651,766	0.01
USD 762,316	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	753,735	0.01
USD 1,283,033	B2R Mortgage Trust '2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	1,281,860	0.01
USD 790,000	Babson CLO Ltd '2014-3A AR' '144A' FRN 15/1/2026	794,228	0.01
USD 260,000	Babson CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 23/4/2027	261,581	0.00
USD 690,000	Babson CLO Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/7/2028	706,601	0.01
USD 1,250,000	Babson CLO Ltd '2015-2A AR' '144A' FRN 20/10/2030	1,258,579	0.01
USD 1,110,000	Babson CLO Ltd '2015-1A AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,110,000	0.01
USD 1,150,000	Babson CLO Ltd '2015-1A BR' '144A' FRN 20/1/2031	1,150,000	0.01
USD 5,560,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 3.337% 15/12/2027	5,301,263	0.05
USD 4,535,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 4.08% 15/12/2047	4,240,710	0.04
EUR 201,000	Ball Corp 4.375% 15/12/2023	277,611	0.00
USD 2,320,000	Ballyrock CLO 2014-1 LLC '2014-1A CR' '144A' FRN 20/10/2026	2,320,813	0.02
USD 2,030,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSMZ M' '144A' FRN 15/9/2018	2,033,786	0.02
USD 2,430,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSNY A' '144A' FRN 15/9/2026	2,431,685	0.02
USD 2,667,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2013-DSNY F' '144A' FRN 15/9/2026	2,666,077	0.02
USD 3,820,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2017-SCH CL' '144A' FRN 15/11/2032	3,828,800	0.03
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2017-SCH DL' '144A' FRN 15/11/2032	1,782,041	0.02
USD 2,657,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2015-200P F' '144A' FRN 14/4/2033	2,480,562	0.02
USD 5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust '2016-ISQ E' '144A' FRN 14/8/2034	4,401,528	0.04
USD 4,119,230	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2015-UBS7 XA' FRN 15/9/2048	210,299	0.00
USD 406,757	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-1 AMFX' FRN 15/1/2049	412,582	0.00
USD 2,030,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2016-UB10 C' FRN 15/7/2049	2,084,555	0.02
USD 19,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2017-BNK3 XB' FRN 15/2/2050	925,205	0.01
USD 4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2017-BNK3 XD' '144A' FRN 15/2/2050	348,700	0.00
USD 299,015	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	298,925	0.00
USD 727,512	Banc of America Funding 2006-A Trust '2006-A 3A2' FRN 20/2/2036	690,625	0.01
USD 16,724,831	Banc of America Funding 2014-R2 Trust '2014-R2 1C' '144A' FRN 26/11/2036	2,609,154	0.02
USD 410,000	BANK '2017-BNK9 A4' 3.538% 15/11/2054	408,784	0.00
USD 9,155,000	Bank of America Corp FRN 1/10/2021	9,000,120	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 4,380,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	4,818,000	0.04
USD 3,240,000	Bank of America Corp FRN 20/1/2028	3,222,674	0.03
USD 5,130,000	Bank of America Corp 3.248% 21/10/2027	4,871,784	0.04
USD 6,535,000	Bank of America Corp 4.183% 25/11/2027*	6,546,688	0.06
USD 15,620,000	Bank of America Corp 4.25% 22/10/2026	15,775,153	0.13
USD 19,705,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	20,194,472	0.17
USD 317,000	Bank of New York Mellon Corp/The FRN 20/9/2026 (Perpetual)	318,585	0.00
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust '1998-2 B1' FRN 10/12/2025	1,729,174	0.01
USD 250,000	Battalion CLO VII Ltd '2014-7A C' '144A' FRN 17/10/2026	250,873	0.00
USD 1,000,000	Battalion CLO X Ltd '2016-10A C' '144A' FRN 24/1/2029	1,024,505	0.01
USD 1,250,000	Battalion CLO X Ltd '2016-10A D' '144A' FRN 24/1/2029	1,286,254	0.01
USD 1,710,000	Battalion CLO XI Ltd '2017-11A E' '144A' FRN 24/10/2029	1,739,992	0.01
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	4,916,266	0.04
USD 2,275,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	3,404,640	0.03
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	1,806,693	0.02
USD 336,720	Bayview Commercial Asset Trust '2005-4A A1' '144A' ' FRN 25/1/2036	316,506	0.00
USD 94,755	Bayview Commercial Asset Trust '2005-4A A2' '144A' ' FRN 25/1/2036	89,536	0.00
USD 250,425	Bayview Commercial Asset Trust '2005-4A M1' '144A' ' FRN 25/1/2036	235,041	0.00
USD 384,545	Bayview Commercial Asset Trust '2006-1A A2' '144A' ' FRN 25/4/2036	368,430	0.00
USD 1,105,566	Bayview Commercial Asset Trust '2006-1A M2' '144A' ' FRN 25/4/2036	1,035,884	0.01
USD 266,032	Bayview Commercial Asset Trust '2006-1A M3' '144A' ' FRN 25/4/2036	249,017	0.00
USD 1,454,168	Bayview Commercial Asset Trust '2006-1A M4' '144A' ' FRN 25/4/2036	1,365,715	0.01
USD 1,471,091	Bayview Commercial Asset Trust '2006-3A A1' '144A' ' FRN 25/10/2036	1,411,249	0.01
USD 659,539	Bayview Commercial Asset Trust '2006-3A A2' '144A' ' FRN 25/10/2036	633,965	0.01
USD 8,147,443	Bayview Commercial Asset Trust '2006-4A A1' '144A' ' FRN 25/12/2036	7,849,497	0.07
USD 5,205,990	Bayview Commercial Asset Trust '2007-1 A1' '144A' FRN 25/3/2037	5,005,942	0.04
USD 26,883,947	Bayview Commercial Asset Trust '2007-4A A1' '144A' ' FRN 25/9/2037	25,861,646	0.22
USD 8,573,339	Bayview Commercial Asset Trust '2007-5A A3' '144A' ' FRN 25/10/2037	8,541,336	0.07
USD 1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust '2007-6A A4A' '144A' ' FRN 25/12/2037	1,192,626	0.01
USD 44,120	Bayview Commercial Asset Trust '2008-4 A3' '144A' FRN 25/7/2038	52,354	0.00
USD 8,194,027	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2004-B A1' ' '144A' FRN 28/5/2039	7,600,866	0.06
USD 2,807,385	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2004-B A2' ' '144A' FRN 28/5/2039	2,626,095	0.02
USD 5,486,250	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2005-A A1' ' '144A' FRN 28/2/2040	5,306,184	0.05
USD 1,332,929	Bayview Financial Revolving Asset Trust '2005-E A1' ' '144A' FRN 28/12/2040	1,258,225	0.01
USD 100,000	BBCMS Trust '2015-STP E' '144A' FRN 10/9/2028	96,088	0.00
USD 20,840,000	BBCMS Trust '2015-SRCH XA' '144A' FRN 10/8/2035	1,465,781	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 11,710,000	BBCMS Trust '2015-SRCH XB' '144A' FRN 10/8/2035	205,920	0.00
USD 934,628	BCAP LLC 2010-RR11-I Trust '2010-RR11 4A1' '144A' FRN 27/3/2047	851,732	0.01
USD 1,627,548	BCMSC Trust '2000-A A2' FRN 15/6/2030	629,711	0.01
USD 1,510,990	BCMSC Trust '2000-A A3' FRN 15/6/2030	614,093	0.01
USD 2,587,019	BCMSC Trust '2000-A A4' FRN 15/6/2030	1,112,582	0.01
USD 1,007,724	Bear Stearns ALT-A Trust '2006-61A1' FRN 25/11/2036	1,011,096	0.01
USD 178,530	Bear Stearns ARM Trust '2004-5 2A' FRN 25/7/2034	177,391	0.00
USD 216,631	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2004-HE7 M2' FRN 25/8/2034	214,823	0.00
USD 1,270,513	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,311,355	0.01
USD 1,576,139	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE1 1M4' FRN 25/12/2035	1,802,174	0.02
USD 2,429,751	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-EC2 M2' FRN 25/2/2036	2,394,519	0.02
USD 5,063,879	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	6,063,991	0.05
USD 867,614	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	851,745	0.01
USD 867,295	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 1A4' FRN 25/3/2037	637,780	0.01
USD 1,167,772	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	1,126,165	0.01
USD 2,671,718	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE2 23A' FRN 25/3/2037	2,640,982	0.02
USD 952,750	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE3 1A3' FRN 25/4/2037	978,055	0.01
USD 5,476,086	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust '2007-HE3 1A4' FRN 25/4/2037	4,367,649	0.04
USD 3,825,707	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2005-AC9 A5' 6.25% 25/12/2035	3,780,880	0.03
USD 4,512,034	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust (Step-up coupon) '2006-AC1 1A2' 6.25% 25/2/2036	3,609,303	0.03
USD 284,617	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust '2005-4 M2' FRN 25/1/2036	281,033	0.00
USD 1,294,515	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2006-SL1 A1' FRN 25/8/2036	1,303,803	0.01
USD 690,514	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR2 A1' FRN 25/3/2037	621,758	0.01
USD 1,057,208	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR3 1A1' FRN 25/3/2037	1,005,516	0.01
USD 845,851	Bear Stearns Mortgage Funding Trust '2007-AR4 2A1' FRN 25/6/2037	810,400	0.01
USD 1,330,000	Bear Stearns Second Lien Trust '2007-SV1A M1' '144A' FRN 25/1/2036	1,298,015	0.01
USD 2,893,000	Beazer Homes USA Inc 8.75% 15/3/2022	3,122,126	0.03
USD 1,135,000	Becton Dickinson and Co 2.894% 6/6/2022	1,107,077	0.01
EUR 420,000	Belden Inc 2.875% 15/9/2025	507,697	0.00
EUR 410,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	532,244	0.00
EUR 223,000	Belden Inc 5.5% 15/4/2023	281,923	0.00
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd '2013-IIA CR' '144A' FRN 15/7/2029	511,503	0.00
USD 3,415,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd '2014-IVA A1R' '144A' FRN 20/1/2029	3,440,160	0.03
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO IX Ltd '2016-9A E' '144A' FRN 20/7/2028	508,889	0.00
USD 5,972,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA A1R' '144A' FRN 18/10/2029	6,020,961	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 1,440,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA A2R' '144A' FRN 18/10/2029	1,451,936	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd '2015-VIA CR' '144A' FRN 18/10/2029	628,140	0.01
USD 2,370,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd '2015-VIIA D' '144A' FRN 18/7/2027	2,376,532	0.02
USD 1,110,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd '2015-8A A1AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,116,375	0.01
USD 370,000	Benefit Street Partners Clo XII Ltd '2017-12A D' '144A' FRN 15/10/2030	379,614	0.00
USD 600,000	Betony CLO Ltd '2015-1A CR' '144A' FRN 15/4/2027	602,955	0.01
USD 460,000	Betony CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	465,191	0.00
USD 2,400,000	BHMS 2014-ATLS Mortgage Trust '2014-ATLS AFL' '144A' FRN 5/7/2033	2,411,606	0.02
USD 280,000	Birchwood Park CLO Ltd '2014-1A D1' '144A' FRN 15/7/2026	280,098	0.00
USD 1,820,000	BlueLine Rental Finance Corp / BlueLine Rental LLC '144A' 9.25% 15/3/2024	1,970,150	0.02
USD 330,000	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 20/11/2028	336,693	0.00
USD 1,020,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	1,028,091	0.01
USD 450,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A B1R' '144A' FRN 29/10/2025	450,328	0.00
USD 1,940,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A CR' '144A' FRN 29/10/2025	1,946,508	0.02
USD 790,000	BlueMountain CLO 2014-2 Ltd '2014-2A AR' '144A' FRN 20/7/2026	791,512	0.01
USD 1,593,000	BlueMountain CLO 2014-3 Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 15/10/2026	1,602,703	0.01
USD 840,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd '2014-4A A1R' '144A' FRN 30/11/2026	840,409	0.01
USD 530,000	BlueMountain CLO 2014-4 Ltd '2014-4A E' '144A' FRN 30/11/2026	532,797	0.00
USD 480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	483,790	0.00
USD 889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	897,010	0.01
USD 280,000	BlueMountain CLO 2015-4 Ltd '2015-4A D2' '144A' FRN 20/1/2027	280,866	0.00
USD 250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 20/8/2028	255,432	0.00
USD 250,000	BlueMountain CLO 2016-3 Ltd '2016-3A E' '144A' FRN 15/11/2027	257,637	0.00
USD 4,875,000	Boyd Gaming Corp 6.875% 15/5/2023	5,167,500	0.04
USD 3,758,000	Brinker International Inc '144A' 5% 1/10/2024	3,711,025	0.03
USD 750,000	Bristol Park CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	783,429	0.01
USD 3,181,000	Bristow Group Inc '144A' 8.75% 1/3/2023	3,240,644	0.03
USD 3,680,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.2% 15/1/2021	3,565,937	0.03
USD 11,080,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	10,949,439	0.09
USD 6,350,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	6,219,330	0.05
USD 4,710,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.125% 15/1/2025	4,423,255	0.04
USD 2,797,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.625% 15/1/2024	2,736,595	0.02
USD 4,741,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15/1/2027	4,550,307	0.04
USD 3,010,000	BSPRT 2017-FL2 Issuer Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	3,025,914	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 4,430,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	4,236,276	0.04
USD 250,000	Burnham Park Clo Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/10/2029	256,891	0.00
USD 3,962,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 F' '144A' ' FRN 10/3/2033	3,763,496	0.03
USD 2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 D' '144A' ' 3.633% 10/3/2033	2,655,364	0.02
USD 14,000,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust '2013-1515 E' '144A' ' 3.717% 10/3/2033	13,483,262	0.11
USD 2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust '2015-1740 E' '144A' ' FRN 10/1/2035	1,907,492	0.02
USD 4,552,000	BWAY Holding Co '144A' 5.5% 15/4/2024	4,647,364	0.04
USD 1,340,000	BXP Trust '2017-CC D' '144A' FRN 13/8/2037	1,278,494	0.01
USD 4,820,000	BXP Trust '2017-CC E' '144A' FRN 13/8/2037	4,384,325	0.04
USD 7,180,000	BXP Trust '2017-GM D' '144A' FRN 13/6/2039	6,712,690	0.06
USD 1,650,000	BXP Trust '2017-GM E' '144A' FRN 13/6/2039	1,490,123	0.01
USD 1,890,000	Caesars Palace Las Vegas Trust '2017-VICI D' '144A' ' FRN 15/10/2034	1,916,772	0.02
USD 1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,161,428	0.01
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority ' 144A' 5% 21/11/2045	2,097,548	0.02
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,545,401	0.02
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023*	1,495,300	0.01
USD 2,184,000	Calpine Corp 5.5% 1/2/2024	2,060,473	0.02
USD 1,070,000	Calpine Corp 5.75% 15/1/2025	1,007,137	0.01
USD 1,930,000	Calpine Corp '144A' 5.875% 15/1/2024	1,975,837	0.02
USD 2,170,000	Calpine Corp '144A' 6% 15/1/2022	2,237,812	0.02
USD 518,144	Canyon Capital CLO 2006-1 Ltd '2006-1A A1' '144A' FRN 15/12/2020	518,021	0.00
USD 580,000	Canyon Capital CLO 2012-1 Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 15/1/2026	582,341	0.01
USD 250,000	Canyon Capital CLO 2016-1 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2028	255,392	0.00
USD 930,000	Canyon Capital CLO 2016-2 Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 15/10/2028	949,966	0.01
USD 3,075,000	Carlson Travel Inc '144A' 6.75% 15/12/2023*	3,113,437	0.03
USD 210,000	Carlson Travel Inc '144A' 9.5% 15/12/2024	202,912	0.00
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-3 Ltd ' 2012-3A CR' '144A' FRN 14/10/2028	1,482,315	0.01
USD 870,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-4 Ltd ' 2012-4X INC' FRN 20/1/2029	743,552	0.01
USD 2,260,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd ' 2013-2A AR' '144A' FRN 18/1/2029	2,265,474	0.02
USD 660,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ' 2014-1A CR' '144A' FRN 17/4/2025	660,167	0.01
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A C1R' '144A' FRN 27/7/2026	253,448	0.00
USD 1,618,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd ' 2014-3A D1' '144A' FRN 27/7/2026	1,629,255	0.01
USD 1,310,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A CR' '144A' FRN 20/4/2027	1,315,309	0.01
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A DR' '144A' FRN 20/4/2027	527,190	0.00
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd ' 2015-1A E1' '144A' FRN 20/4/2027	488,861	0.00
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ' 2015-2A C' '144A' FRN 27/4/2027	251,151	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	282,104	0.00
USD 630,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ' 2015-3A D ' ' 144A ' FRN 28/7/2028	639,539	0.01
USD 370,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A D ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	378,320	0.00
USD 546,764	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ' 2015-4A SBB1 ' ' 144A ' FRN 20/10/2027	564,459	0.00
USD 1,500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-1 Ltd ' 2016-1A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2027	1,517,341	0.01
USD 4,750,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd ' 2017-4A A1 ' ' 144A ' FRN 15/1/2030	4,785,879	0.04
USD 4,787,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	4,825,145	0.04
USD 1,841,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2005-FRE1 M1 ' FRN 25/12/2035	1,836,194	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC1 M2 ' FRN 25/1/2036	355,973	0.00
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE1 A4 ' FRN 25/4/2036	1,533,611	0.01
USD 683,062	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC2 A3 ' FRN 25/6/2036	677,044	0.01
USD 1,197,204	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A2 ' FRN 25/10/2036	886,956	0.01
USD 3,407,834	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A3 ' FRN 25/10/2036	2,536,212	0.02
USD 3,165,833	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-FRE2 A5 ' FRN 25/10/2036	2,334,550	0.02
USD 1,077,013	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC4 A3 ' FRN 25/10/2036	971,679	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2007-RFC1 A4 ' FRN 25/10/2036	1,194,426	0.01
USD 2,629,110	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2006-NC5 A3 ' FRN 25/1/2037	1,906,362	0.02
USD 853,103	Carrington Mortgage Loan Trust Series ' 2007-HE1 A2 ' FRN 25/6/2037	847,333	0.01
USD 1,175,000	Carrizo Oil & Gas Inc 7.5% 15/9/2020	1,199,969	0.01
EUR 200,000	Catalent Pharma Solutions Inc 4.75% 15/12/2024	258,506	0.00
USD 1,100,000	Catamaran CLO 2012-1 Ltd ' 2012-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/12/2023	1,101,324	0.01
USD 1,285,000	Catholic Health Initiatives 4.35% 1/11/2042	1,183,430	0.01
USD 780,000	CBAM 2017-2 Ltd ' 2017-2A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	789,188	0.01
USD 1,050,000	CBAM 2017-3 Ltd ' 2017-3A A ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	1,056,590	0.01
USD 250,000	CBAM 2017-3 Ltd ' 2017-3A B1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	252,033	0.00
USD 470,000	CBAM 2017-3 Ltd ' 2017-3A E1 ' ' 144A ' FRN 17/10/2029	479,850	0.00
USD 7,500,000	CBAM Ltd ' 2017-1A A1 ' ' 144A ' FRN 20/7/2030	7,587,439	0.06
USD 1,091,988	C-BASS 2006-CB9 TRUST ' 2006-CB9 A2 ' FRN 25/11/2036	695,106	0.01
USD 182,551	C-BASS 2006-CB9 TRUST ' 2006-CB9 A4 ' FRN 25/11/2036	118,143	0.00
USD 5,519,499	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) ' 2007-CB1 AF2 ' 3.666% 25/1/2037	2,729,455	0.02
USD 377,273	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) ' 2007-CB1 AF4 ' 3.666% 25/1/2037	186,514	0.00
USD 1,081,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.125% 1/5/2027	1,044,192	0.01
USD 3,245,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	3,309,900	0.03
USD 6,270,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A ' 5.75% 15/2/2026	6,364,050	0.05
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust ' 2016-HEAT D ' ' 144A ' FRN 10/4/2029	525,374	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 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT X' '144A' FRN 10/4/2029	580,800	0.01
USD 1,442,000	CCUBS Commercial Mortgage Trust '2017-C1 A4' FRN 15/11/2050	1,433,508	0.01
USD 1,534,388	CD 2006-CD3 Mortgage Trust '2006-CD3 AM' 5.648% 15/10/2048	1,592,849	0.01
USD 7,363,420	CD 2017-CD3 Mortgage Trust '2017-CD3 XA' FRN 10/2/2050	526,681	0.00
USD 1,724,000	CDK Global Inc 3.8% 15/10/2019	1,729,051	0.01
USD 1,157,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	1,174,355	0.01
USD 8,870,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A A1' '144A' FRN 17/10/2030	8,954,706	0.08
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A B' '144A' FRN 17/10/2030	584,834	0.01
USD 890,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A C' '144A' FRN 17/10/2030	894,086	0.01
USD 700,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd '2017-8A D' '144A' FRN 17/10/2030	713,005	0.01
USD 6,615,000	Celgene Corp 2.75% 15/2/2023	6,425,103	0.05
USD 306,000	Cent CLO 24 Ltd '2015-24A D2' '144A' FRN 15/10/2026	311,128	0.00
USD 8,363,000	Centennial Resource Production LLC '144A' 5.375% 15/1/2026	8,363,000	0.07
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	810,211	0.01
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	808,550	0.01
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C3 XD' '144A' FRN 10/1/2048	573,164	0.01
USD 2,270,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 C' FRN 10/5/2058	2,325,286	0.02
USD 5,589,894	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	598,248	0.01
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C4 XB' FRN 10/5/2058	277,144	0.00
USD 330,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2016-C3 A3' 3.865% 10/1/2048	336,699	0.00
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust '2018-TAN C' '144A' 5.295% 15/2/2033	1,110,505	0.01
USD 3,990,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust '2015-SMRT E' '144A' FRN 10/4/2028	3,973,540	0.03
USD 118,000	CGDB Commercial Mortgage Trust '2017-B10 D' '144A' FRN 15/5/2030	118,224	0.00
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-B10C A' '144A' FRN 15/7/2032	3,159,742	0.03
USD 4,100,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-B10C D' '144A' FRN 15/7/2032	4,107,139	0.04
USD 4,960,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-B10C E' '144A' FRN 15/7/2032	4,959,065	0.04
USD 730,000	CGMS Commercial Mortgage Trust '2017-B1 A4' 3.458% 15/8/2050	723,248	0.01
USD 1,500,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 1/5/2047	1,475,803	0.01
USD 15,304,283	Chase Mortgage Finance Trust Series '2007-S6 1A1' 6% 25/12/2037	2,796,855	0.11
EUR 330,000	Chemours Co/The 6.125% 15/5/2023	425,358	0.00
USD 8,531,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30/6/2027	8,669,629	0.07
USD 4,044,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/6/2024	4,544,445	0.04
USD 4,831,000	Cheniere Energy Inc '144A' 4.875% 28/5/2021	4,992,597	0.04
USD 8,930,000	Cheniere Energy Partners LP '144A' 5.25% 1/10/2025	9,041,625	0.08
USD 730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	812,990	0.01
USD 575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	634,665	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 1,908,000	Chesapeake Energy Corp 5.5% 15/9/2026	1,677,311	0.01
USD 6,437,000	Chesapeake Energy Corp '144A' 8% 15/12/2022	6,871,497	0.06
USD 3,479,000	Chesapeake Energy Corp '144A' 8% 15/1/2025	3,461,605	0.03
USD 1,310,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY D' '144A' FRN 15/2/2030	1,318,731	0.01
USD 2,810,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY E' '144A' FRN 15/2/2030	2,829,712	0.02
USD 360,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY F' '144A' FRN 15/2/2030	362,551	0.00
USD 2,853,457	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2006-OA4 A1' FRN 25/4/2046	1,523,066	0.01
USD 729,000	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2006-OA5 3A1' FRN 25/4/2046	669,389	0.01
USD 8,539,594	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2007-15 2A2' 6.5% 25/9/2037	6,624,987	0.06
USD 730,000	CHT 2017-COSMO Mortgage Trust '2017-CSMO A' '144A' ' FRN 15/11/2036	732,598	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd '2013-1A A2R' '144A' FRN 16/7/2030	252,865	0.00
USD 7,500,000	CIFC Funding 2013-II Ltd '2013-2A A1LR' '144A' FRN 18/10/2030	7,537,652	0.06
USD 772,000	CIFC Funding 2013-II Ltd '2013-2A B1LR' '144A' FRN 18/10/2030	782,213	0.01
USD 440,000	CIFC Funding 2013-IV Ltd '2013-4A DR' '144A' FRN 27/11/2024	442,086	0.00
USD 2,020,000	CIFC Funding 2014 Ltd '2014-1A A1R2' '144A' FRN 18/1/2031	2,029,303	0.02
USD 4,750,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A1LR' '144A' FRN 24/5/2026	4,763,556	0.04
USD 1,390,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A B1L' '144A' FRN 24/5/2026	1,401,436	0.01
USD 280,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A B1R' '144A' FRN 22/7/2026	280,915	0.00
USD 1,013,000	CIFC Funding 2014-III Ltd '2014-3A C1R' '144A' FRN 22/7/2026	1,014,395	0.01
USD 745,000	CIFC Funding 2014-IV Ltd '2014-4A D' '144A' FRN 17/10/2026	748,631	0.01
USD 4,825,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A A1R' '144A' FRN 17/1/2027	4,839,759	0.04
USD 280,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A CR' '144A' FRN 17/1/2027	282,010	0.00
USD 990,000	CIFC Funding 2015-I Ltd '2015-1A ARR' '144A' FRN 22/1/2031	997,366	0.01
USD 3,370,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	3,368,613	0.03
USD 1,940,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A CR' '144A' FRN 15/4/2027	1,938,769	0.02
USD 750,000	CIFC Funding 2015-III Ltd '2015-3A E' '144A' FRN 19/10/2027	750,539	0.01
USD 280,000	CIFC Funding 2015-V Ltd '2015-5A D' '144A' FRN 25/10/2027	281,881	0.00
USD 940,000	CIFC Funding 2016-I Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 21/10/2028	972,511	0.01
USD 3,480,000	CIFC Funding 2018-I Ltd '2018-1A A' '144A' FRN 18/4/2031	3,477,030	0.03
USD 20,818,347	CIM Trust '2017-6 A1' '144A' FRN 25/6/2057	20,506,866	0.17
USD 3,233,797	Citicorp Mortgage Securities Trust Series '2008-2 1A1' 6.5% 25/6/2038	2,838,717	0.02
USD 2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series (Step-up coupon) '2007-2 M1' 5.215% 25/6/2037	2,215,999	0.02
USD 300,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SHP2 F' '144A' FRN 15/7/2027	302,734	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 563,500	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP D' '144A' FRN 15/9/2027	566,262	0.00
USD 190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P D' '144A' FRN 10/5/2035	185,883	0.00
USD 3,434,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P E' '144A' FRN 10/5/2035	3,237,885	0.03
USD 1,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC19 C' FRN 10/3/2047	1,728,354	0.01
USD 2,420,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2014-GC25 XE' '144A' FRN 10/10/2047	153,831	0.00
USD 4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-GC27 C' FRN 10/2/2048	4,153,103	0.04
USD 6,672,107	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-GC27 XA' FRN 10/2/2048	491,259	0.00
USD 50,647,489	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-P1 XA' FRN 15/9/2048	2,242,868	0.02
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P3 C' FRN 15/4/2049	103,613	0.00
USD 8,215,585	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P3 XA' FRN 15/4/2049	824,496	0.01
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-C1 C' FRN 10/5/2049	1,231,355	0.01
USD 18,779,767	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-P6 XA' FRN 10/12/2049	861,509	0.01
USD 5,930,040	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2017-P8 XA' FRN 15/9/2050	405,836	0.00
USD 1,340,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-GC37 D' '144A' 2.788% 10/4/2049	1,027,035	0.01
USD 260,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-SMPL D' '144A' 3.52% 10/9/2031	256,475	0.00
USD 500,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2016-SMPL E' '144A' 4.509% 10/9/2031	496,726	0.00
USD 17,515,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2028	17,132,823	0.15
USD 11,738,000	Citigroup Inc 4.125% 25/7/2028	11,660,500	0.10
USD 12,620,000	Citigroup Inc 4.45% 29/9/2027*	12,865,188	0.11
USD 4,230,000	Citigroup Mortgage Loan Trust '2006-NC1 A2D' FRN 25/8/2036	4,105,988	0.04
USD 6,294,838	Citigroup Mortgage Loan Trust '2007-AHL2 A3B' FRN 25/5/2037	4,656,633	0.04
USD 2,157,845	Citigroup Mortgage Loan Trust '2007-AHL2 A3C' FRN 25/5/2037	1,607,563	0.01
USD 2,610,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc '2006-WFH4 M3' FRN 25/11/2036	2,233,337	0.02
USD 530,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2046	598,222	0.01
USD 715,000	City of Houston TX Airport System Revenue 5% 1/7/2024	787,337	0.01
USD 990,000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 5% 15/11/2035	1,134,951	0.01
USD 500,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	552,963	0.00
USD 200,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2047	220,352	0.00
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,600,012	0.01
USD 220,000	Clark County School District 5% 15/6/2026	253,817	0.00
USD 860,000	Clark County School District 5% 15/6/2027	989,598	0.01
USD 835,000	Clark County School District 5% 15/6/2028	956,434	0.01
USD 1,375,000	Clear Creek CLO Ltd '2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2030	1,367,790	0.01
USD 1,195,000	CLNS Trust '2017-IKPR E' '144A' FRN 11/6/2032	1,205,804	0.01
USD 1,017,000	Cobalt International Energy Inc (Defaulted) 7.75% 1/12/2023	1,006,830	0.01
EUR 355,000	Colfax Corp 3.25% 15/5/2025	440,289	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 720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	760,975	0.01
USD 340,496	COLT 2015-1 LLC '2015-1 A1V' '144A' FRN 26/12/2045	342,586	0.00
USD 640,000	COMM '2013-GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	636,778	0.01
USD 390,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust '2005-C6 F' '144A' FRN 10/6/2044	397,421	0.00
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust '2013-300P D' '144A' ' FRN 10/8/2030	101,405	0.00
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust '2013-WWP D' '144A' 3.898% 10/3/2031	1,810,058	0.02
USD 1,500,000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust '2014-CR15 C' FRN 10/2/2047	1,559,008	0.01
USD 1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT D' '144A' FRN 13/8/2027	1,447,108	0.01
USD 1,020,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT E' '144A' FRN 13/8/2027	1,033,087	0.01
USD 8,430,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT F' '144A' FRN 13/8/2027	8,435,185	0.07
USD 4,145,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust '2014-PAT G' '144A' FRN 13/8/2027	4,020,505	0.03
USD 1,155,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC E' '144A' FRN 13/2/2032	1,168,910	0.01
USD 1,090,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust '2015-3BP F' '144A' FRN 10/2/2035	977,223	0.01
USD 550,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 C' FRN 10/5/2048	535,028	0.00
USD 5,150,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 CMD' ' 144A' FRN 10/5/2048	5,083,609	0.04
USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 CME' ' 144A' FRN 10/5/2048	1,904,350	0.02
USD 5,320,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 D' FRN 10/5/2048	4,525,950	0.04
USD 41,134,602	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	1,865,185	0.02
USD 1,680,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 E' ' 144A' 3.234% 10/5/2048	1,085,038	0.01
USD 62,656,419	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust '2015-CR24 XA' FRN 10/8/2048	2,935,121	0.03
USD 880,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust '2015-CR25 C' FRN 10/8/2048	877,352	0.01
USD 1,055,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust '2015-CR25 D' FRN 10/8/2048	864,082	0.01
USD 23,340,727	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust '2015-CR25 XA' FRN 10/8/2048	1,233,622	0.01
USD 2,890,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 C' FRN 10/2/2048	2,867,532	0.02
USD 3,816,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust '2015-LC19 D' '144A' ' FRN 10/2/2048	3,152,836	0.03
USD 1,500,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 C' FRN 10/7/2048	1,462,078	0.01
USD 9,660,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 XD' '144A' ' FRN 10/7/2048	674,606	0.01
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust '2016-667M D' '144A' ' FRN 10/10/2036	998,282	0.01
USD 116,665,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust '2016-667M XA' '144A' ' FRN 10/10/2036	682,490	0.01
USD 10,954,442	COMM 2016-DC2 Mortgage Trust '2016-DC2 XA' FRN 10/2/2049	664,261	0.01
USD 6,529,422	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust '2017-COR2 XA' FRN 10/9/2050	573,055	0.00
USD 740,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust '2017-COR2 D' '144A' ' 3% 10/9/2050	595,075	0.01
USD 1,660,000	COMM 2017-DLTA Mortgage Trust '2017-DLTA E' '144A' ' FRN 15/8/2035	1,643,375	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 1,520,000	COMM 2017-DLTA Mortgage Trust '2017-DLTA F' '144A' ' FRN 15/8/2035	1,508,641	0.01
USD 1,497,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	1,523,197	0.01
USD 5,416,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,456,620	0.05
USD 104,224	Commercial Mortgage Trust '2006-GG7 AM' FRN 10/7/2038	104,354	0.00
USD 2,100,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	2,061,066	0.02
USD 1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	1,477,480	0.01
USD 1,640,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/11/2042	1,873,454	0.02
USD 3,955,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035	1,226,050	0.01
USD 1,040,000	Concho Resources Inc 3.75% 1/10/2027	1,008,829	0.01
USD 1,335,000	Concho Resources Inc 4.875% 1/10/2047	1,381,481	0.01
USD 2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,276,099	0.02
USD 1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,493,646	0.01
USD 2,088,509	Conseco Finance Corp '1997-3 M1' FRN 15/3/2028	2,077,191	0.02
USD 1,227,977	Conseco Finance Corp '1997-6 M1' FRN 15/1/2029	1,231,286	0.01
USD 1,478,854	Conseco Finance Corp '1999-5 A5' FRN 1/3/2030	1,160,006	0.01
USD 1,082,181	Conseco Finance Corp '1999-5 A6' FRN 1/3/2030	822,325	0.01
USD 285,158	Conseco Finance Corp '1998-4 M1' FRN 1/4/2030	255,186	0.00
USD 703,111	Conseco Finance Corp '1998-6 M1' FRN 1/6/2030	654,221	0.01
USD 2,242,654	Conseco Finance Corp '1998-8 M1' FRN 1/9/2030	1,891,238	0.02
USD 1,294,888	Conseco Finance Corp '1998-8 A1' 6.28% 1/9/2030	1,362,743	0.01
USD 1,350,981	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-1 A5' FRN 1/9/2029	734,509	0.01
USD 1,668,160	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-4 A6' FRN 1/5/2032	890,756	0.01
USD 2,009,762	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-5 A6' 7.96% 1/5/2031	1,324,047	0.01
USD 4,651,796	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-4 A5' 7.97% 1/5/2032	2,385,158	0.02
USD 3,657,796	Conseco Finance Securitizations Corp '2000-5 A7' 8.2% 1/5/2031	2,472,799	0.02
USD 143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	156	0.00
USD 202,591	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	206,390	0.00
USD 850,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Through Trust 6.125% 29/4/2018	855,397	0.01
USD 890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,110,404	0.01
USD 8,992,000	Core Industrial Trust '2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	8,547,301	0.07
USD 2,480,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW D' '144A' FRN 10/2/2034	2,488,815	0.02
USD 1,269,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW E' '144A' FRN 10/2/2034	1,251,808	0.01
USD 5,140,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW F' '144A' FRN 10/2/2034	4,962,107	0.04
USD 13,340,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	362,648	0.00
USD 424,000	Core Industrial Trust '2015-WEST E' '144A' FRN 10/2/2037	414,027	0.00
USD 27,660,000	Core Industrial Trust '2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	1,511,481	0.01
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates '2006-BC4 M1' FRN 25/11/2036	4,020,893	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 2,909,449	Countrywide Asset-Backed Certificates '2007-S3 A3' FRN 25/5/2037	2,655,386	0.02
USD 2,134,451	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) '2006-S3 A4' 6.902% 25/1/2029	2,200,279	0.02
USD 1,430,000	County of Clark Department of Aviation 5% 1/7/2021	1,565,214	0.01
USD 1,000,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2034	1,141,710	0.01
USD 910,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2035	1,036,804	0.01
USD 2,015,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.504% 1/10/2024	1,900,770	0.02
USD 455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	430,369	0.00
USD 835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	809,612	0.01
USD 780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	756,545	0.01
USD 1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	2,000,837	0.02
USD 14,131,000	Cox Communications Inc '144A' 3.5% 15/8/2027	13,516,464	0.12
USD 1,969,000	Cox Communications Inc '144A' 4.6% 15/8/2047	1,892,263	0.02
USD 250,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2015-1A C' ' 144A' 3.3% 17/7/2023	250,171	0.00
USD 1,363,216	Credit Suisse ABS Repackaging Trust '2013-A B' ' 144A' 2.5% 25/1/2030	1,257,356	0.01
USD 1,450,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C3 C' FRN 15/7/2037	1,486,471	0.01
USD 510,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2004-C4 F' '144A' FRN 15/10/2039	516,286	0.00
USD 107,425	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C2 AMFX' 4.877% 15/4/2037	106,220	0.00
USD 111,005	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp '2005-C3 B' 4.882% 15/7/2037	110,842	0.00
USD 7,558,013	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates '2009- 12R 3A1' '144A' 6.5% 27/10/2037	4,964,624	0.04
USD 2,552,979	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' 2007-CB6 A4' '144A' FRN 25/7/2037	1,729,337	0.01
USD 881,994	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' 2007-RP1 A' '144A' FRN 25/5/2046	785,074	0.01
USD 442,130	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) '2006-CB2 AF4' 3.46% 25/12/2036	373,593	0.00
USD 4,036,412	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) '2006-SL1 A2' '144A' 5.556% 25/9/2036	809,887	0.01
USD 705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) '2006-MH1 B1' '144A' 6.25% 25/10/2036	714,639	0.01
USD 11,880,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	11,387,105	0.10
USD 2,120,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15/10/2025	2,088,200	0.02
USD 21,734,025	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust '2016-C5 XA' ' FRN 15/11/2048	1,168,435	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2027	331,091	0.00
USD 5,452,000	CSC Holdings LLC '144A' 6.625% 15/10/2025	5,741,637	0.05
USD 1,990,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.125% 15/1/2023	2,229,039	0.02
USD 4,162,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.875% 15/10/2025	4,911,992	0.04
USD 1,219,316	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-10 10A1' FRN 25/11/2035	507,123	0.00
USD 532,923	CSMC '2016-MFF A' '144A' FRN 15/11/2033	536,381	0.00
USD 770,000	CSMC '2017-TIME A' '144A' 3.646% 13/11/2039	768,407	0.01
USD 122,260,000	CSMC 2014-USA OA LLC '2014-USA X2' '144A' FRN 15/9/2037	773,906	0.01
USD 18,779,039	CSMC 2017-1 TR 4.5% 25/3/2021	18,899,668	0.16

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 118,711	CSMC Series '2010-20R 9A1' '144A' FRN 27/1/2036	119,831	0.00
USD 870,000	CSMC Series '2014-4R 16A3' '144A' FRN 27/2/2036	802,896	0.01
USD 940,021	CSMC Series '2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	930,670	0.01
USD 2,708,147	CSMC Series '2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	1,534,903	0.01
USD 1,696,376	CSMC Series '2014-9R 9A1' '144A' FRN 27/8/2036	1,538,273	0.01
USD 1,650,000	CSMC Series '2015-4R 1A4' '144A' FRN 27/10/2036	1,139,311	0.01
USD 570,000	CSMC Series '2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	494,998	0.00
USD 1,843,017	CSMC Series '2014-9R 3A1' '144A' FRN 27/11/2037	1,829,974	0.02
USD 4,451,545	CSMC Series '2014-11R 16A1' '144A' FRN 27/9/2047	4,477,294	0.04
USD 2,202,347	CSMC Trust '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	2,204,575	0.02
USD 1,390,000	CSMC Trust '2015-DEAL D' '144A' FRN 15/4/2029	1,393,289	0.01
USD 790,000	CSMC Trust '2017-PFHP A' '144A' FRN 15/12/2030	790,345	0.01
USD 1,689,000	CSMC Trust '2017-CHOP E' '144A' FRN 15/7/2032	1,698,730	0.01
USD 5,600,000	CSMC Trust '2013-5R 1A6' '144A' FRN 27/2/2036	5,455,232	0.05
USD 250,000	Cumberland Park CLO Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2026	250,699	0.00
USD 8,153,431	CWABS Asset-Backed Certificates Trust '2005-16 1AF' FRN 25/5/2036	8,037,341	0.07
USD 1,991,514	CWABS Asset-Backed Certificates Trust '2005-16 2AF3' FRN 25/5/2036	1,951,013	0.02
USD 272,676	CWABS Asset-Backed Certificates Trust '2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	269,084	0.00
USD 5,395,191	CWABS Asset-Backed Certificates Trust (Step-up coupon) '2005-17 1AF4' 4.503% 25/5/2036	4,827,475	0.04
USD 1,058,610	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series '2004-U 2A' FRN 15/3/2034	960,061	0.01
USD 1,353,862	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2007-S1 A3' FRN 25/11/2036	1,369,296	0.01
USD 219,943	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S2 A3' 5.841% 25/7/2027	297,888	0.00
USD 460,584	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A4' 5.842% 25/6/2035	464,507	0.00
USD 680,307	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series '2006-S5 A5' 6.155% 25/6/2035	676,363	0.01
USD 11,504,640	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series '2006-RES 5B1A' '144A' FRN 15/5/2035	11,020,376	0.09
USD 366,429	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series '2006-RES 5B1B' '144A' FRN 15/5/2035	359,384	0.00
USD 1,901,498	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series '2006-RES 5F1A' '144A' FRN 15/12/2035	1,768,626	0.02
USD 1,164,199	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series '2005-B 2A' FRN 15/5/2035	1,091,028	0.01
USD 2,143,691	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series '2006-H 1A' FRN 15/11/2036	1,749,764	0.02
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,648,676	0.01
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,215,915	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	361,966	0.00
USD 8,561,000	DaVita Inc 5.125% 15/7/2024	8,488,874	0.07
USD 2,150,000	DaVita Inc 5.75% 15/8/2022	2,207,781	0.02
USD 2,322,000	DBJPM 16-C3 Mortgage Trust '2016-C3 D' '144A' FRN 10/9/2049	1,914,538	0.02
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust '2017-C6 XD' FRN 10/6/2050	312,041	0.00
USD 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust '2011-LC1A E' '144A' FRN 10/11/2046	928,685	0.01
USD 10,210,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust '2017-BRBK E' '144A' FRN 10/10/2034	9,571,952	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 2,040,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust '2017-BRBK F' '144A' 'FRN 10/10/2034	1,842,475	0.02
USD 2,170,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust '2017-BRBK A' '144A' '3.452% 10/10/2034	2,171,219	0.02
USD 8,249,241	DCP Rights LLC '2014-1A A' '144A' 5.463% 25/10/2044	8,568,305	0.07
USD 1,683,686	Deephaven Residential Mortgage Trust '2016-1A A1' '144A' 4% 25/7/2046	1,681,937	0.01
USD 2,116,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 8.35% 15/7/2046	2,673,114	0.02
USD 2,217,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,214,028	0.02
USD 3,163,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	3,170,499	0.03
USD 359,701	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT '2007-RS1 A2' ' 144A' FRN 27/1/2037	722,020	0.01
USD 762,102	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2007-OA4 1A1B' FRN 25/8/2047	723,898	0.01
USD 11,717,341	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series '2007-OA4 A2A' FRN 25/8/2047	8,123,522	0.07
USD 610,943	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series '2006-AB3 A3' FRN 25/7/2036	551,888	0.00
USD 389,974	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series '2006-AB3 A8' FRN 25/7/2036	352,319	0.00
USD 944,000	Discover Bank 3.45% 27/7/2026	893,230	0.01
USD 3,620,000	Discovery Communications LLC 5.2% 20/9/2047	3,567,479	0.03
USD 2,050,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	2,057,687	0.02
USD 1,525,000	DISH DBS Corp 5.875% 15/7/2022	1,493,204	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,059,203	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,057,110	0.01
USD 1,470,000	District of Columbia 5.591% 1/12/2034	1,744,309	0.01
USD 655,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	646,676	0.01
USD 250,000	Dryden 31 Senior Loan Fund '2014-31A DR' '144A' FRN 18/4/2026	251,208	0.00
USD 450,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A CR' '144A' FRN 15/10/2026	450,702	0.00
USD 340,000	Dryden 34 Senior Loan Fund '2014-34A DR' '144A' FRN 15/10/2026	341,648	0.00
USD 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A CR' '144A' FRN 15/1/2028	253,424	0.00
USD 500,000	Dryden 36 Senior Loan Fund '2014-36A DR' '144A' FRN 15/1/2028	511,339	0.00
USD 250,000	Dryden 41 Senior Loan Fund '2015-41A E' '144A' FRN 15/1/2028	250,043	0.00
USD 250,000	Dryden 43 Senior Loan Fund '2016-43A E' '144A' FRN 20/7/2029	255,361	0.00
USD 26,050,000	Dryden 53 CLO Ltd '2017-53A A' '144A' FRN 15/1/2031	26,122,067	0.22
USD 1,430,000	Dryden XXV Senior Loan Fund '2012-25A ARR' '144A' FRN 15/10/2027	1,427,788	0.01
USD 500,000	Dryden XXV Senior Loan Fund '2012-25A CRR' '144A' FRN 15/10/2027	503,054	0.00
USD 3,065,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund '2013-28A A1LR' ' 144A' FRN 15/8/2030	3,091,151	0.03
USD 5,890,000	Duke Energy Corp 3.75% 1/9/2046	5,356,183	0.05
USD 3,190,000	Duke University 3.299% 1/10/2046	2,864,968	0.02
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,403,984	0.02
USD 720,000	Elevation CLO 2016-5 Ltd '2016-5AD' '144A' FRN 15/7/2028	732,615	0.01
USD 650,000	Elevation CLO 2016-5 Ltd '2016-5AE' '144A' FRN 15/7/2028	661,956	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 1,560,000	Elevation CLO 2017-8 Ltd '2017-8AA1' '144A' FRN 25/10/2030	1,559,504	0.01
USD 2,375,000	Elevation CLO 2017-8 Ltd '2017-8AC' '144A' FRN 25/10/2030	2,375,547	0.02
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust '2015-11MD A' '144A' FRN 10/9/2035	966,121	0.01
USD 1,099,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.5% 30/1/2026	1,090,757	0.01
USD 11,093,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	11,037,535	0.09
USD 4,110,000	EnLink Midstream Partners LP FRN 15/12/2022 (Perpetual)*	3,929,530	0.03
USD 1,835,000	Enterprise Products Operating LLC FRN 15/2/2078	1,769,502	0.02
EUR 960,000	Equinix Inc 2.875% 1/10/2025	1,162,477	0.01
USD 2,351,000	Equinix Inc 5.375% 1/4/2023	2,424,469	0.02
USD 3,030,000	Exelon Corp 3.497% 1/6/2022	3,024,135	0.03
USD 2,705,000	Extraction Oil & Gas Inc '144A' 7.375% 15/5/2024	2,874,062	0.02
USD 610,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C02 1M2' FRN 25/9/2028	732,257	0.01
USD 3,746,971	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C04 1M2' FRN 25/1/2029	4,255,968	0.04
USD 3,395,727	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2016-C06 1M2' FRN 25/4/2029	3,878,221	0.03
USD 1,366,931	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C01 1B1' FRN 25/7/2029	1,628,330	0.01
USD 2,579,861	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C01 1M2' FRN 25/7/2029	2,816,194	0.02
USD 2,240,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C03 1B1' FRN 25/10/2029	2,509,074	0.02
USD 236,698	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C03 1M2' FRN 25/10/2029	253,074	0.00
USD 3,060,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C05 1B1' FRN 25/1/2030	3,139,587	0.03
USD 1,789,604	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C05 1M2' FRN 25/1/2030	1,823,065	0.02
USD 5,000,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C07 1B1' FRN 25/5/2030	5,269,821	0.04
USD 13,601,966	Fannie Mae Pool '890751' 4% 1/9/2046	14,020,752	0.12
USD 1,210,337	Fannie Mae Pool 'AB0002' 3.5% 1/2/2039	1,210,557	0.01
USD 1,832,377	Fannie Mae Pool 'AB8742' 4% 1/3/2043	1,898,578	0.02
USD 947,177	Fannie Mae Pool 'AB8900' 3.5% 1/4/2043	949,012	0.01
USD 2,491,859	Fannie Mae Pool 'AB9076' 4% 1/4/2043	2,579,139	0.02
USD 9,623,533	Fannie Mae Pool 'AB9727' 2.5% 1/6/2028	9,445,998	0.08
USD 4,619,845	Fannie Mae Pool 'AE0625' 4% 1/12/2040	4,791,305	0.04
USD 5,877,414	Fannie Mae Pool 'AJ9300' 4% 1/1/2042	6,065,790	0.05
USD 623,142	Fannie Mae Pool 'AK8634' 3.5% 1/4/2042	624,768	0.01
USD 337,277	Fannie Mae Pool 'AK9393' 3.5% 1/4/2042	338,174	0.00
USD 5,363,677	Fannie Mae Pool 'AL2463' 4% 1/7/2042	5,527,142	0.05
USD 5,923,116	Fannie Mae Pool 'AL5624' 4.5% 1/8/2044	6,309,052	0.05
USD 6,962,399	Fannie Mae Pool 'AL8195' 4.5% 1/2/2046	7,415,443	0.06
USD 13,970,047	Fannie Mae Pool 'AL9235' 4.5% 1/7/2046	14,905,314	0.13
USD 2,947,141	Fannie Mae Pool 'AL9276' 4% 1/9/2046	3,040,129	0.03
USD 6,123,336	Fannie Mae Pool 'AL9281' 4.5% 1/9/2046	6,472,977	0.06
USD 25,254,147	Fannie Mae Pool 'AL9470' 4% 1/7/2046	26,033,158	0.22
USD 7,810,160	Fannie Mae Pool 'AL9520' 4% 1/2/2046	8,052,203	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 21,276,600	Fannie Mae Pool 'AL9980' 4% 1/2/2046	21,934,225	0.19
USD 175,013	Fannie Mae Pool 'A08031' 3.5% 1/7/2042	175,460	0.00
USD 3,206,039	Fannie Mae Pool 'AP6347' 4% 1/9/2042	3,329,027	0.03
USD 1,164,194	Fannie Mae Pool 'AQ4032' 3.5% 1/11/2042	1,166,850	0.01
USD 1,261,911	Fannie Mae Pool 'AS3707' 4% 1/11/2044	1,299,680	0.01
USD 6,879,181	Fannie Mae Pool 'AS4067' 4% 1/12/2044	7,127,163	0.06
USD 5,908,130	Fannie Mae Pool 'AS6016' 4% 1/10/2045	6,084,664	0.05
USD 3,371,612	Fannie Mae Pool 'AS6220' 4% 1/11/2045	3,476,052	0.03
USD 3,521,103	Fannie Mae Pool 'AS6840' 4% 1/3/2046	3,625,863	0.03
USD 9,339,728	Fannie Mae Pool 'AS6991' 4% 1/4/2046	9,627,913	0.08
USD 9,395,471	Fannie Mae Pool 'AS7756' 4% 1/8/2046	9,689,301	0.08
USD 6,782,486	Fannie Mae Pool 'AS7867' 4% 1/9/2046	6,994,553	0.06
USD 4,885,262	Fannie Mae Pool 'AS7940' 4% 1/9/2046	5,032,486	0.04
USD 12,682,368	Fannie Mae Pool 'AS8139' 4% 1/10/2046	13,047,765	0.11
USD 12,452,829	Fannie Mae Pool 'AS8375' 4% 1/11/2046	12,842,481	0.11
USD 5,341,731	Fannie Mae Pool 'AS8376' 4% 1/11/2046	5,502,793	0.05
USD 7,770,010	Fannie Mae Pool 'AS8377' 4% 1/11/2046	8,004,245	0.07
USD 6,701,172	Fannie Mae Pool 'AS8386' 2.5% 1/11/2031	6,533,121	0.06
USD 247,812	Fannie Mae Pool 'AS8703' 2.5% 1/2/2032	241,597	0.00
USD 856,126	Fannie Mae Pool 'AS8760' 2.5% 1/2/2032	834,656	0.01
USD 4,805,508	Fannie Mae Pool 'AS9410' 4% 1/4/2047	4,980,818	0.04
USD 11,289,285	Fannie Mae Pool 'AS9920' 4% 1/7/2047	11,630,567	0.10
USD 5,340,963	Fannie Mae Pool 'AT5860' 3.5% 1/6/2043	5,350,760	0.05
USD 2,297,544	Fannie Mae Pool 'AV0022' 4% 1/11/2043	2,358,499	0.02
USD 2,032,139	Fannie Mae Pool 'BC0170' 4% 1/1/2046	2,092,663	0.02
USD 2,445,264	Fannie Mae Pool 'BC0878' 4% 1/5/2046	2,513,883	0.02
USD 2,678,076	Fannie Mae Pool 'BC0908' 4% 1/5/2046	2,755,060	0.02
USD 2,435,302	Fannie Mae Pool 'BC1211' 4.5% 1/7/2046	2,569,105	0.02
USD 4,746,673	Fannie Mae Pool 'BC1222' 4% 1/7/2046	4,909,214	0.04
USD 911,952	Fannie Mae Pool 'BC6961' 4.5% 1/3/2046	964,887	0.01
USD 2,164,988	Fannie Mae Pool 'BD2383' 4.5% 1/12/2046	2,310,443	0.02
USD 1,726,069	Fannie Mae Pool 'BD2444' 4.5% 1/1/2047	1,828,196	0.02
USD 290,194	Fannie Mae Pool 'BD6043' 4% 1/8/2046	300,244	0.00
USD 1,805,036	Fannie Mae Pool 'BE1856' 2.5% 1/11/2031	1,759,770	0.02
USD 3,200,234	Fannie Mae Pool 'BE1857' 2.5% 1/11/2031	3,119,978	0.03
USD 395,872	Fannie Mae Pool 'BE2555' 2.5% 1/11/2031	385,944	0.00
USD 3,422,972	Fannie Mae Pool 'BE3193' 4% 1/2/2047	3,530,110	0.03
USD 23,269,392	Fannie Mae Pool 'BE3696' 4% 1/6/2047	23,971,214	0.20
USD 77,706	Fannie Mae Pool 'BE4879' 2.5% 1/12/2031	75,757	0.00
USD 4,283,090	Fannie Mae Pool 'BE5013' 4% 1/2/2045	4,414,977	0.04
USD 6,472,458	Fannie Mae Pool 'BE5588' 4% 1/1/2047	6,675,038	0.06
USD 478,470	Fannie Mae Pool 'BE5966' 4.5% 1/2/2047	504,981	0.00
USD 2,785,273	Fannie Mae Pool 'BE8203' 4.5% 1/4/2047	2,973,098	0.03
USD 3,180,166	Fannie Mae Pool 'BE8818' 4% 1/7/2047	3,279,706	0.03
USD 11,002,770	Fannie Mae Pool 'BF0155' 4% 1/10/2046	11,416,191	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 12,124,004	Fannie Mae Pool 'BF0182' 4% 1/1/2057	12,528,796	0.11
USD 5,495,656	Fannie Mae Pool 'BF0186' 4.5% 1/2/2057	5,777,499	0.05
USD 13,319,053	Fannie Mae Pool 'BF0196' 3.5% 1/2/2041	13,424,587	0.11
USD 2,929,716	Fannie Mae Pool 'BH0948' 4.5% 1/5/2047	3,127,295	0.03
USD 2,304,882	Fannie Mae Pool 'BH1036' 4.5% 1/5/2047	2,460,322	0.02
USD 2,888,861	Fannie Mae Pool 'BH2193' 4.5% 1/6/2047	3,083,685	0.03
USD 1,888,087	Fannie Mae Pool 'BH2539' 4.5% 1/9/2047	2,018,475	0.02
USD 2,205,537	Fannie Mae Pool 'BH2624' 4% 1/8/2047	2,286,000	0.02
USD 485,727	Fannie Mae Pool 'BH3653' 4.5% 1/6/2047	517,136	0.00
USD 2,195,853	Fannie Mae Pool 'BH4087' 4.5% 1/10/2047	2,340,379	0.02
USD 247,556	Fannie Mae Pool 'BH5140' 4.5% 1/9/2047	264,653	0.00
USD 2,953,794	Fannie Mae Pool 'BH5276' 4.5% 1/8/2047	3,148,204	0.03
USD 2,078,196	Fannie Mae Pool 'BH5562' 4.5% 1/7/2047	2,199,386	0.02
USD 1,665,553	Fannie Mae Pool 'BH5759' 4.5% 1/11/2047	1,775,177	0.02
USD 1,547,643	Fannie Mae Pool 'BH5766' 4.5% 1/11/2047	1,655,601	0.01
USD 3,114,548	Fannie Mae Pool 'BH5980' 4.5% 1/8/2047	3,296,158	0.03
USD 2,040,706	Fannie Mae Pool 'BH9218' 4% 1/1/2048	2,116,582	0.02
USD 1,133,498	Fannie Mae Pool 'BH9670' 4.5% 1/9/2047	1,212,565	0.01
USD 541,777	Fannie Mae Pool 'BJ0355' 4.5% 1/10/2047	575,489	0.01
USD 476,131	Fannie Mae Pool 'BJ0718' 4.5% 1/10/2047	509,344	0.00
USD 2,753,497	Fannie Mae Pool 'BJ0726' 4.5% 1/10/2047	2,920,268	0.02
USD 972,990	Fannie Mae Pool 'BJ1792' 4.5% 1/11/2047	1,031,926	0.01
USD 908,810	Fannie Mae Pool 'BJ2046' 4.5% 1/11/2047	972,202	0.01
USD 768,550	Fannie Mae Pool 'BJ2086' 4.5% 1/11/2047	819,132	0.01
USD 2,071,140	Fannie Mae Pool 'BJ5006' 4.5% 1/12/2047	2,207,460	0.02
USD 1,490,404	Fannie Mae Pool 'BJ5029' 4.5% 1/12/2047	1,594,373	0.01
USD 5,377,223	Fannie Mae Pool 'BM1043' 4.5% 1/4/2047	5,719,741	0.05
USD 9,159,451	Fannie Mae Pool 'BM1262' 4.5% 1/5/2047	9,774,278	0.08
USD 5,078,592	Fannie Mae Pool 'BM1347' 4.5% 1/5/2047	5,403,094	0.05
USD 10,315,656	Fannie Mae Pool 'BM1396' 4.5% 1/3/2047	10,911,838	0.09
USD 9,454,700	Fannie Mae Pool 'BM1549' 4.5% 1/7/2047	10,013,977	0.09
USD 1,755,402	Fannie Mae Pool 'BM1833' 4.5% 1/10/2047	1,877,851	0.02
USD 946,725	Fannie Mae Pool 'BM1834' 4.5% 1/10/2047	1,009,036	0.01
USD 10,742,845	Fannie Mae Pool 'BM1876' 5.049% 1/9/2044	11,419,273	0.10
USD 12,987,708	Fannie Mae Pool 'BM1890' 2.5% 1/1/2032	12,669,740	0.11
USD 6,499,076	Fannie Mae Pool 'BM1892' 2.5% 1/9/2028	6,361,538	0.05
USD 8,703,311	Fannie Mae Pool 'BM1895' 2.5% 1/2/2032	8,511,066	0.07
USD 3,904,362	Fannie Mae Pool 'BM1896' 2.5% 1/11/2031	3,807,944	0.03
USD 1,801,918	Fannie Mae Pool 'BM1898' 2.5% 1/9/2032	1,758,395	0.02
USD 4,499,472	Fannie Mae Pool 'BM1899' 2.5% 1/9/2032	4,389,495	0.04
USD 5,701,022	Fannie Mae Pool 'BM1907' 4% 1/11/2046	5,904,992	0.05
USD 3,386,868	Fannie Mae Pool 'BM1918' 4.5% 1/10/2047	3,576,886	0.03
USD 4,629,611	Fannie Mae Pool 'BM1923' 3.5% 1/12/2046	4,639,528	0.04
USD 3,050,547	Fannie Mae Pool 'BM1953' 3.5% 1/8/2045	3,057,557	0.03
USD 3,464,136	Fannie Mae Pool 'BM3036' 3.5% 1/4/2046	3,472,164	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 5,850,753	Fannie Mae Pool 'BM3047' 4% 1/10/2047	6,065,004	0.05
USD 3,521,000	Fannie Mae Pool 'BM3096' 3.5% 1/12/2045	3,531,377	0.03
USD 6,580,177	Fannie Mae Pool 'BM3110' 4.5% 1/11/2047	7,000,624	0.06
USD 2,120,296	Fannie Mae Pool 'BM3270' 2.5% 1/4/2030	2,081,301	0.02
USD 714,138	Fannie Mae Pool 'BM3310' 4.5% 1/12/2047	763,955	0.01
USD 664,499	Fannie Mae Pool 'BM3313' 4.5% 1/1/2048	702,055	0.01
USD 2,488,277	Fannie Mae Pool 'BM3402' 2.5% 1/6/2030	2,441,355	0.02
USD 2,469,288	Fannie Mae Pool 'BM3411' 3% 1/2/2032	2,468,491	0.02
USD 2,579,735	Fannie Mae Pool 'BM3412' 3% 1/2/2032	2,577,745	0.02
USD 6,696,346	Fannie Mae Pool 'BM3486' 3.5% 1/2/2045	6,711,671	0.06
USD 4,494,971	Fannie Mae Pool 'CA0307' 4.5% 1/9/2047	4,767,209	0.04
USD 9,287,631	Fannie Mae Pool 'CA0343' 4.5% 1/9/2047	9,893,549	0.08
USD 13,648,054	Fannie Mae Pool 'CA0422' 2.5% 1/9/2032	13,305,790	0.11
USD 7,288,040	Fannie Mae Pool 'CA0704' 4% 1/11/2047	7,555,921	0.06
USD 9,227,716	Fannie Mae Pool 'CA0710' 4.5% 1/11/2047	9,835,046	0.08
USD 14,325,236	Fannie Mae Pool 'CA0712' 4.5% 1/11/2047	15,192,855	0.13
USD 10,920,964	Fannie Mae Pool 'CA0715' 4.5% 1/11/2047	11,682,742	0.10
USD 2,304,923	Fannie Mae Pool 'CA0856' 3.5% 1/12/2042	2,308,915	0.02
USD 6,624,355	Fannie Mae Pool 'CA1004' 4% 1/1/2048	6,856,962	0.06
USD 3,603,199	Fannie Mae Pool 'CA1013' 4% 1/1/2048	3,736,623	0.03
USD 8,832,957	Fannie Mae Pool 'CA1022' 4.5% 1/1/2048	9,332,136	0.08
USD 3,987,451	Fannie Mae Pool 'CA1121' 4% 1/2/2048	4,127,992	0.04
USD 3,977,369	Fannie Mae Pool 'CA1122' 4% 1/2/2048	4,103,545	0.04
USD 3,981,871	Fannie Mae Pool 'CA1123' 4% 1/2/2048	4,129,922	0.04
USD 3,983,141	Fannie Mae Pool 'CA1126' 4.5% 1/2/2048	4,217,011	0.04
USD 2,798,910	Fannie Mae Pool 'CA1128' 4.5% 1/2/2048	2,994,283	0.03
USD 2,438,840	Fannie Mae Pool 'CA1185' 3.5% 1/2/2043	2,442,309	0.02
USD 2,487,163	Fannie Mae Pool 'MA2382' 4.5% 1/8/2045	2,646,568	0.02
USD 2,584,111	Fannie Mae Pool 'MA2410' 4.5% 1/8/2045	2,748,289	0.02
USD 1,332,728	Fannie Mae Pool 'MA2990' 4.5% 1/4/2047	1,427,755	0.01
USD 274,636	Fannie Mae Pool 'MA3052' 4.5% 1/6/2047	292,630	0.00
USD 5,330,000	Fannie Mae-Aces '2017-M7 A2' FRN 25/2/2027	5,183,360	0.04
USD 940,000	Fannie Mae-Aces '2017-M8 A2' FRN 25/5/2027	922,887	0.01
USD 1,600,000	Fannie Mae-Aces '2017-M12 A2' FRN 25/6/2027	1,572,181	0.01
USD 14,731,370	Fannie Mae-Aces '2017-M12 X' FRN 25/6/2027	210,880	0.00
USD 1,453,000	Fannie Mae-Aces '2018-M1 A2' FRN 25/12/2027	1,408,327	0.01
USD 6,756,199	Fannie Mae-Aces '2016-M4 X2' FRN 25/1/2039	649,913	0.01
USD 1,949,276	Federal Home Loan Mortgage Corp 3.5% 1/6/2047	1,953,236	0.02
USD 10,799,000	First Data Corp '144A' 5% 15/1/2024	10,906,990	0.09
USD 640,000	First Data Corp '144A' 5.375% 15/8/2023	654,400	0.01
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust '2004-FFH3 M3' FRN 25/10/2034	715,404	0.01
USD 2,711,420	First Franklin Mortgage Loan Trust '2006-FFH1 M2' FRN 25/1/2036	1,661,369	0.01
USD 1,079,215	First Franklin Mortgage Loan Trust '2006-FF5 2A3' FRN 25/4/2036	1,027,774	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 649,869	FirstKey Lending 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 A' '144A' 2.553% 9/3/2047	646,708	0.01
USD 1,481,000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15/11/2025	1,506,917	0.01
USD 1,400,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd '2015-1A AR' '144A' FRN 15/4/2027	1,402,491	0.01
USD 6,050,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.25% 20/9/2022	6,172,546	0.05
USD 1,734,314	Freddie Mac Gold Pool 'A94055' 4% 1/9/2040	1,789,860	0.02
USD 562,490	Freddie Mac Gold Pool 'A94585' 4% 1/10/2040	580,480	0.01
USD 3,228,532	Freddie Mac Gold Pool 'C04180' 3.5% 1/8/2042	3,235,637	0.03
USD 970,629	Freddie Mac Gold Pool 'C04276' 3.5% 1/10/2042	972,758	0.01
USD 2,633,163	Freddie Mac Gold Pool 'C09007' 3.5% 1/8/2042	2,638,958	0.02
USD 798,601	Freddie Mac Gold Pool 'C09032' 3.5% 1/2/2043	800,357	0.01
USD 19,376	Freddie Mac Gold Pool 'E09015' 2.5% 1/12/2027	19,014	0.00
USD 258,334	Freddie Mac Gold Pool 'G06231' 4% 1/12/2040	266,612	0.00
USD 836,905	Freddie Mac Gold Pool 'G06922' 3.5% 1/2/2042	838,747	0.01
USD 7,681,364	Freddie Mac Gold Pool 'G07818' 4.5% 1/9/2044	8,174,844	0.07
USD 3,332,710	Freddie Mac Gold Pool 'G07996' 4% 1/1/2040	3,438,458	0.03
USD 244,970	Freddie Mac Gold Pool 'G14606' 2.5% 1/11/2027	240,451	0.00
USD 49,777,179	Freddie Mac Gold Pool 'G15601' 2.5% 1/1/2029	48,831,688	0.42
USD 7,471,235	Freddie Mac Gold Pool 'G15887' 2.5% 1/1/2031	7,285,911	0.06
USD 12,249,552	Freddie Mac Gold Pool 'G15963' 2.5% 1/10/2031	11,945,703	0.10
USD 1,656,323	Freddie Mac Gold Pool 'G16164' 2.5% 1/1/2030	1,622,487	0.01
USD 5,795,007	Freddie Mac Gold Pool 'G16178' 2.5% 1/11/2028	5,686,272	0.05
USD 1,637,990	Freddie Mac Gold Pool 'G16390' 3% 1/11/2030	1,632,400	0.01
USD 2,179,606	Freddie Mac Gold Pool 'G18449' 2.5% 1/11/2027	2,138,877	0.02
USD 545,526	Freddie Mac Gold Pool 'G18461' 2.5% 1/4/2028	535,158	0.00
USD 850,513	Freddie Mac Gold Pool 'G60262' 3.5% 1/1/2044	852,384	0.01
USD 3,307,170	Freddie Mac Gold Pool 'G60691' 4% 1/6/2046	3,409,418	0.03
USD 1,191,513	Freddie Mac Gold Pool 'G60871' 4.5% 1/7/2046	1,266,008	0.01
USD 4,769,416	Freddie Mac Gold Pool 'G60884' 4% 1/2/2047	4,915,933	0.04
USD 398,226	Freddie Mac Gold Pool 'G60963' 3.5% 1/12/2044	399,103	0.00
USD 9,148,704	Freddie Mac Gold Pool 'G60971' 4.5% 1/1/2047	9,686,421	0.08
USD 7,934,247	Freddie Mac Gold Pool 'G61007' 4.5% 1/8/2046	8,430,303	0.07
USD 5,037,855	Freddie Mac Gold Pool 'G61012' 4% 1/4/2044	5,198,521	0.04
USD 6,439,979	Freddie Mac Gold Pool 'G61075' 4% 1/7/2044	6,645,703	0.06
USD 8,819,185	Freddie Mac Gold Pool 'G61119' 4.5% 1/8/2047	9,349,643	0.08
USD 5,103,994	Freddie Mac Gold Pool 'G61197' 4.5% 1/11/2047	5,412,385	0.05
USD 9,836,337	Freddie Mac Gold Pool 'G61206' 4.5% 1/11/2047	10,472,990	0.09
USD 68,295,103	Freddie Mac Gold Pool 'G67702' 4% 1/1/2047	70,382,539	0.60
USD 2,202,172	Freddie Mac Gold Pool 'J20465' 2.5% 1/9/2027	2,161,382	0.02
USD 3,597,155	Freddie Mac Gold Pool 'J23930' 2.5% 1/5/2028	3,528,817	0.03
USD 644,430	Freddie Mac Gold Pool 'J34888' 2.5% 1/7/2031	628,445	0.01
USD 3,471,486	Freddie Mac Gold Pool 'J35138' 2.5% 1/8/2031	3,385,377	0.03
USD 2,330,625	Freddie Mac Gold Pool 'J35215' 2.5% 1/9/2031	2,272,814	0.02
USD 2,362,402	Freddie Mac Gold Pool 'Q04688' 4% 1/11/2041	2,438,209	0.02
USD 1,130,704	Freddie Mac Gold Pool 'Q05692' 4% 1/1/2042	1,166,979	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 1,295,580	Freddie Mac Gold Pool ' Q09307 ' 3.5% 1/7/2042	1,298,431	0.01
USD 3,378,099	Freddie Mac Gold Pool ' Q09342 ' 3.5% 1/6/2042	3,385,533	0.03
USD 373,664	Freddie Mac Gold Pool ' Q09850 ' 4% 1/8/2042	385,585	0.00
USD 781,480	Freddie Mac Gold Pool ' Q10053 ' 3.5% 1/8/2042	783,199	0.01
USD 622,512	Freddie Mac Gold Pool ' Q11908 ' 3.5% 1/10/2042	621,824	0.01
USD 1,028,252	Freddie Mac Gold Pool ' Q12052 ' 3.5% 1/10/2042	1,030,505	0.01
USD 1,565,394	Freddie Mac Gold Pool ' Q13670 ' 3.5% 1/11/2042	1,568,839	0.01
USD 71,293	Freddie Mac Gold Pool ' Q23935 ' 3.5% 1/12/2043	71,400	0.00
USD 1,425,096	Freddie Mac Gold Pool ' Q39445 ' 4.5% 1/3/2046	1,518,425	0.01
USD 2,323,463	Freddie Mac Gold Pool ' Q40648 ' 4% 1/5/2046	2,387,248	0.02
USD 4,109,982	Freddie Mac Gold Pool ' Q42608 ' 4.5% 1/8/2046	4,379,335	0.04
USD 753,656	Freddie Mac Gold Pool ' Q44616 ' 4.5% 1/11/2046	792,382	0.01
USD 141,435	Freddie Mac Gold Pool ' Q44955 ' 4.5% 1/11/2046	150,770	0.00
USD 1,203,462	Freddie Mac Gold Pool ' Q45398 ' 4.5% 1/4/2046	1,280,729	0.01
USD 1,643,074	Freddie Mac Gold Pool ' Q45754 ' 4.5% 1/1/2047	1,741,900	0.01
USD 1,285,604	Freddie Mac Gold Pool ' Q45755 ' 4.5% 1/1/2047	1,370,389	0.01
USD 2,260,605	Freddie Mac Gold Pool ' Q46931 ' 3.5% 1/3/2042	2,265,575	0.02
USD 3,633,198	Freddie Mac Gold Pool ' Q47409 ' 4% 1/4/2047	3,744,807	0.03
USD 9,491,721	Freddie Mac Gold Pool ' Q47934 ' 4.5% 1/5/2047	10,062,587	0.09
USD 1,628,753	Freddie Mac Gold Pool ' Q47958 ' 4.5% 1/5/2047	1,726,715	0.01
USD 2,180,031	Freddie Mac Gold Pool ' Q48235 ' 4.5% 1/5/2047	2,322,065	0.02
USD 3,966,223	Freddie Mac Gold Pool ' Q49708 ' 4.5% 1/8/2047	4,205,867	0.04
USD 803,617	Freddie Mac Gold Pool ' Q49807 ' 4.5% 1/8/2047	858,369	0.01
USD 837,002	Freddie Mac Gold Pool ' Q49868 ' 4.5% 1/8/2047	887,350	0.01
USD 1,396,532	Freddie Mac Gold Pool ' Q50025 ' 4.5% 1/8/2047	1,475,779	0.01
USD 301,034	Freddie Mac Gold Pool ' Q50525 ' 4.5% 1/9/2047	319,224	0.00
USD 5,124,774	Freddie Mac Gold Pool ' Q50686 ' 4.5% 1/8/2047	5,433,024	0.05
USD 2,035,297	Freddie Mac Gold Pool ' Q50871 ' 4% 1/9/2047	2,110,004	0.02
USD 1,507,709	Freddie Mac Gold Pool ' Q51668 ' 4.5% 1/11/2047	1,598,806	0.01
USD 162,721	Freddie Mac Gold Pool ' Q51933 ' 4.5% 1/11/2047	172,509	0.00
USD 19,512	Freddie Mac Gold Pool ' Q51952 ' 4.5% 1/11/2047	20,715	0.00
USD 2,064,365	Freddie Mac Gold Pool ' Q52318 ' 4.5% 1/11/2047	2,198,741	0.02
USD 615,541	Freddie Mac Gold Pool ' Q53752 ' 4.5% 1/1/2048	657,777	0.01
USD 648,382	Freddie Mac Gold Pool ' Q53762 ' 4.5% 1/1/2048	690,618	0.01
USD 2,589,818	Freddie Mac Gold Pool ' U20070 ' 4.5% 1/5/2047	2,751,881	0.02
USD 306,225	Freddie Mac Gold Pool ' U64853 ' 4.5% 1/3/2046	324,878	0.00
USD 5,241,770	Freddie Mac Gold Pool ' V61221 ' 2.5% 1/6/2031	5,111,748	0.04
USD 221,237	Freddie Mac Gold Pool ' V61746 ' 2.5% 1/10/2031	215,749	0.00
USD 7,724,056	Freddie Mac Gold Pool ' V83460 ' 4.5% 1/9/2047	8,190,752	0.07
USD 5,078,286	Freddie Mac Gold Pool ' V83513 ' 4.5% 1/10/2047	5,385,123	0.05
USD 8,375,675	Freddie Mac Gold Pool ' V83603 ' 4.5% 1/11/2047	8,881,750	0.08
USD 920,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K040 A2 ' 3.241% 25/9/2024	928,196	0.01
USD 9,741,638	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K044 X1 ' FRN 25/1/2025	412,105	0.00
USD 20,914,543	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' K045 X1 ' FRN 25/1/2025	559,057	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 8,002,623	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K056 X1' FRN 25/5/2026	661,167	0.01
USD 970,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K058 A2' 2.653% 25/8/2026	927,514	0.01
USD 1,400,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K059 A2' FRN 25/9/2026	1,385,444	0.01
USD 230,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K060 A2' 3.3% 25/10/2026	230,605	0.00
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K061 A2' FRN 25/11/2026	633,382	0.01
USD 187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K062 A2' 3.413% 25/12/2026	189,025	0.00
USD 21,074,859	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K064 X1' FRN 25/3/2027	985,306	0.01
USD 36,958,660	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K065 X1' FRN 25/4/2027	1,925,731	0.02
USD 1,030,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K069 A2' FRN 25/9/2027	1,016,059	0.01
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K072 A2' 3.444% 25/12/2027	636,134	0.01
USD 6,893,333	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K718 X1' FRN 25/1/2022	146,974	0.00
USD 15,065,651	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K721 X1' FRN 25/8/2022	194,103	0.00
USD 36,152,634	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KC01 X1' FRN 25/12/2022	785,192	0.01
USD 24,284,684	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KIR1 X' FRN 25/3/2026	1,667,930	0.01
USD 20,785,740	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KW01 X1' FRN 25/1/2026	1,213,755	0.01
USD 6,262,476	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KW03 X1' FRN 25/6/2027	369,078	0.00
USD 396,250	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2015-DN1 B' FRN 25/1/2025	581,680	0.01
USD 416,584	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2015-HQ2 B' FRN 25/5/2025	511,703	0.00
USD 2,600,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2016-DNA4 M3' FRN 25/3/2029	2,923,711	0.02
USD 2,710,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA1 M2' FRN 25/7/2029	2,942,360	0.03
USD 1,800,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 B1' FRN 25/10/2029	2,052,072	0.02
USD 3,271,259	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 M2' FRN 25/10/2029	3,585,226	0.03
USD 3,210,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA3 B1' FRN 25/3/2030	3,500,783	0.03
USD 6,340,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA3 M2' FRN 25/3/2030	6,567,789	0.06
USD 7,000,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2018-DNA1 B1' FRN 25/7/2030	6,890,757	0.06
USD 17,000,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2018-DNA1 M2' FRN 25/7/2030	16,932,301	0.14
USD 750,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-HRP1 M2' FRN 25/12/2042	776,317	0.01
USD 107,862,855	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust '2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	338,625	0.00
USD 1,840,000	FREMF 2018-K73 Mortgage Trust '2018-K73 B' '144A' FRN 25/1/2028	1,764,688	0.02
USD 598,333	FREMF Mortgage Trust '2017-K64 B' '144A' FRN 25/3/2027	591,217	0.01
USD 11,201,800	Fremont Home Loan Trust '2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	9,051,469	0.08
USD 1,875,000	Frontier Communications Corp 7.125% 15/3/2019	1,907,587	0.02
USD 1,400,000	Frontier Communications Corp 8.125% 1/10/2018	1,424,500	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 223,634	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2034	223,811	0.00
USD 5,458,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF EFX' '144A' FRN 15/12/2034	5,393,960	0.05
USD 1,060,000	GAHR Commercial Mortgage Trust '2015-NRF FFX' '144A' FRN 15/12/2034	1,042,217	0.01
USD 330,000	Galaxy XIV CLO Ltd '2012-14A DR' '144A' FRN 15/11/2026	334,013	0.00
USD 1,330,000	Galaxy XV CLO Ltd '2013-15A AR' '144A' FRN 15/10/2030	1,341,203	0.01
USD 500,000	Galaxy XXII CLO Ltd '2016-22A E1' '144A' FRN 16/7/2028	509,311	0.00
USD 2,878,756	GCAT 2017-4 LLC (Step-up coupon) '2017-4 A1' '144A' '3.228% 25/5/2022	2,870,269	0.02
GBP 400,000	General Electric Co 4.875% 18/9/2037	656,829	0.01
USD 7,450,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022	7,294,608	0.06
USD 9,270,000	General Motors Financial Co Inc 4.35% 17/1/2027	9,241,388	0.08
USD 491,854	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	495,577	0.00
USD 4,187,781	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series '2005-2 M1' FRN 25/12/2035	2,510,410	0.02
USD 310,000	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2A' FRN 25/8/2036	195,910	0.00
USD 11,380,398	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2B' FRN 25/8/2036	7,369,107	0.06
USD 1,202,344	GE-WMC Mortgage Securities Trust '2006-1 A2C' FRN 25/8/2036	793,856	0.01
USD 1,500,000	Gilbert Park CLO Ltd '2017-1A E' '144A' FRN 15/10/2030	1,543,318	0.01
USD 1,912,400	Ginnie Mae II Pool '784233' 3.5% 20/11/2044	1,923,095	0.02
USD 6,390,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 1/11/2023	6,701,512	0.06
USD 160,929	GMACM Home Equity Loan Trust '2006-HE4 A2' FRN 25/12/2036	156,684	0.00
USD 3,660,000	Golden State Tobacco Securitization Corp 5.125% 1/6/2047	3,635,057	0.03
USD 703,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd '2014-9A D' '144A' FRN 29/10/2026	708,094	0.01
USD 2,630,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd '2015-11A AR2' '144A' FRN 18/1/2031	2,641,568	0.02
USD 4,640,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 31/10/2038	4,485,804	0.04
USD 16,360,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 16/11/2026	15,779,253	0.13
USD 28,730,000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.25% 21/10/2025	29,018,507	0.25
USD 2,654,824	Government National Mortgage Association '2013-145 SI' FRN 16/4/2040	196,497	0.00
USD 5,261,579	Government National Mortgage Association '2015-48 IO' FRN 16/2/2050	257,787	0.00
USD 20,006,979	Government National Mortgage Association '2013-63 IO' FRN 16/9/2051	1,070,876	0.01
USD 3,040,935	Government National Mortgage Association '2012-23 IO' FRN 16/6/2053	74,791	0.00
USD 2,365,003	Government National Mortgage Association '2013-191 IO' FRN 16/11/2053	82,787	0.00
USD 18,244,575	Government National Mortgage Association '2015-22 IO' FRN 16/3/2055	982,608	0.01
USD 6,145,044	Government National Mortgage Association '2015-173 IO' FRN 16/9/2055	395,978	0.00
USD 10,549,112	Government National Mortgage Association '2015-171 IO' FRN 16/11/2055	681,175	0.01
USD 4,376,639	Government National Mortgage Association '2016-128 IO' FRN 16/9/2056	341,937	0.00
USD 29,827,747	Government National Mortgage Association '2017-151 IO' FRN 16/9/2057	2,043,052	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 7,626,991	Government National Mortgage Association '2016-125 IO' FRN 16/12/2057	560,216	0.00
USD 16,742,097	Government National Mortgage Association '2016-26 IO' FRN 16/2/2058	1,226,387	0.01
USD 8,321,559	Government National Mortgage Association '2016-119 IO' FRN 16/4/2058	669,718	0.01
USD 5,237,210	Government National Mortgage Association '2016-110 IO' FRN 16/5/2058	417,966	0.00
USD 5,608,200	Government National Mortgage Association '2016-158 IO' FRN 16/6/2058	427,844	0.00
USD 15,130,257	Government National Mortgage Association '2016-152 IO' FRN 15/8/2058	1,143,232	0.01
USD 8,156,903	Government National Mortgage Association '2016-87 IO' FRN 16/8/2058	623,125	0.01
USD 16,597,051	Government National Mortgage Association '2017-111 IO' FRN 16/2/2059	1,206,357	0.01
USD 7,077,863	Government National Mortgage Association '2017-100 IO' FRN 16/5/2059	469,085	0.00
USD 4,858,210	Government National Mortgage Association '2017-86 IO' FRN 16/5/2059	328,439	0.00
USD 4,523,544	Government National Mortgage Association '2017-69 IO' FRN 16/7/2059	311,860	0.00
USD 17,917,172	Government National Mortgage Association '2017-173 IO' FRN 16/9/2057	1,682,154	0.01
USD 2,530,000	GP Portfolio Trust 2014-GGP '2014-GPP E' '144A' FRN 15/2/2027	2,494,475	0.02
USD 9,330,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE E' '144A' FRN 10/6/2028	9,226,991	0.08
USD 15,210,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE F' '144A' FRN 10/6/2028	14,924,234	0.13
USD 730,000	Grant County Public Utility District No 2 4.584% 1/1/2040	725,605	0.01
USD 466,000	Great Lakes Dredge & Dock Corp 8% 15/5/2022	485,805	0.00
USD 500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	583,187	0.01
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing '1999-5 M1B' FRN 15/12/2029	1,103,876	0.01
USD 1,231,445	Greenpoint Manufactured Housing '1999-5 M2' FRN 15/12/2029	1,062,876	0.01
USD 1,865,959	GreenPoint Mortgage Funding Trust '2006-AR2 4A1' FRN 25/3/2036	1,752,593	0.02
USD 820,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd '2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	821,888	0.01
USD 630,000	Greywolf CLO IV Ltd '2014-2A BR' '144A' FRN 17/1/2027	633,251	0.01
USD 5,000,000	GS Mortgage Securities Corp II '2013-KING E' '144A' FRN 10/12/2027	4,914,796	0.04
USD 680,000	GS Mortgage Securities Corp II '2018-CHLL E' '144A' FRN 15/2/2037	681,275	0.01
USD 160,000	GS Mortgage Securities Corp II '2005-ROCK H' '144A' 5.713% 3/5/2032	179,530	0.00
USD 1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2016-RENT C' '144A' FRN 10/2/2029	1,067,816	0.01
USD 1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2017-500K D' '144A' FRN 15/7/2032	1,455,737	0.01
USD 2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2017-500K E' '144A' FRN 15/7/2032	2,008,714	0.02
USD 2,189,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2017-500K F' '144A' FRN 15/7/2032	2,200,292	0.02
USD 1,130,000	GS Mortgage Securities Corp Trust '2017-500K G' '144A' FRN 15/7/2032	1,136,456	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Securities Trust '2014-GC20 B' FRN 10/4/2047	109,878	0.00
USD 1,458,104	GS Mortgage Securities Trust '2014-GC20 XA' FRN 10/4/2047	69,434	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 930,000	GS Mortgage Securities Trust '2014- GC22 D' '144A' ' FRN 10/6/2047	787,701	0.01
USD 4,000,494	GS Mortgage Securities Trust '2016- GS3 XA' FRN 10/10/2049	312,701	0.00
USD 1,129,000	GS Mortgage Securities Trust '2017- GS7 D' '144A' 3% 10/8/2050	930,577	0.01
USD 780,000	GS Mortgage Securities Trust '2017- GS7 E' '144A' 3% 10/8/2050	609,176	0.01
USD 280,000	GS Mortgage Securities Trust '2015- GC32 D' 3.345% 10/7/2048	230,675	0.00
USD 820,000	GS Mortgage Securities Trust '2017- GS7 A4' 3.43% 10/8/2050	806,712	0.01
USD 510,318	GSAA Home Equity Trust '2007-2 AF3' FRN 25/3/2037	213,978	0.00
USD 2,840,000	GSAA Home Equity Trust '2007-4 A3B' FRN 25/3/2037	397,020	0.00
USD 1,332,702	GSAMP Trust '2007-H1 A1B' FRN 25/1/2047	905,251	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust '2007-HS1 M6' FRN 25/2/2047	2,105,928	0.02
USD 1,468,435	GSMPs Mortgage Loan Trust '2005- RP1 1AF' '144A' FRN 25/1/2035	1,324,016	0.01
USD 1,768,801	GSMPs Mortgage Loan Trust '2005- RP2 1AF' '144A' FRN 25/3/2035	1,632,851	0.01
USD 1,350,133	GSMPs Mortgage Loan Trust '2006- RP1 1AF1' '144A' FRN 25/1/2036	1,173,921	0.01
USD 737,283	GT Loan Financing I Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 28/10/2024	739,040	0.01
USD 699,930	HarborView Mortgage Loan Trust '2007-3 2A1B' FRN 19/5/2047	557,252	0.00
USD 948,634	HarborView Mortgage Loan Trust '2007-4 2A2' FRN 19/7/2047	833,344	0.01
USD 685,000	HCA Healthcare Inc 6.25% 15/2/2021	723,959	0.01
USD 2,171,000	HCA Inc 5% 15/3/2024	2,214,268	0.02
USD 2,140,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	2,198,850	0.02
USD 8,487,000	HCA Inc 6.5% 15/2/2020	8,932,567	0.08
USD 3,620,000	HD Supply Inc '144A' 5.75% 15/4/2024	3,799,914	0.03
USD 4,295,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.086% 15/9/2051	3,616,819	0.03
USD 3,885,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.652% 15/8/2057	3,685,583	0.03
USD 785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	894,221	0.01
USD 1,930,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.5% 1/6/2022	2,077,162	0.02
USD 1,104,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.75% 1/6/2024	1,197,840	0.01
USD 3,370,000	Hess Corp 5.8% 1/4/2047	3,577,484	0.03
USD 250,000	Highbridge Loan Management 2013-2 Ltd '2013-2A DR' '144A' FRN 20/10/2029	257,241	0.00
USD 750,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd '4A-2014 BR' '144A' FRN 28/1/2030	750,416	0.01
USD 920,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 C1R' '144A' FRN 29/1/2026	926,356	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 C2R' '144A' FRN 29/1/2026	251,113	0.00
USD 1,030,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 D1R' '144A' FRN 29/1/2026	1,033,987	0.01
USD 250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 D2R' '144A' FRN 29/1/2026	250,968	0.00
USD 1,750,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5A-2015 E' '144A' FRN 29/1/2026	1,755,779	0.02
USD 670,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd '5X-2015 E' FRN 29/1/2026	672,213	0.01
USD 360,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 A' '144A' FRN 5/5/2027	360,208	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 430,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 D' '144A' FRN 5/5/2027	430,293	0.00
USD 380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 E1' '144A' FRN 5/5/2027	380,203	0.00
USD 380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '6A-2015 DR' '144A' FRN 5/2/2031	380,000	0.00
USD 330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd '7A-2015 C' '144A' FRN 15/11/2026	332,243	0.00
USD 340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd '7A-2015 D' '144A' FRN 15/11/2026	342,227	0.00
USD 760,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd '7A-2015 E' '144A' FRN 15/11/2026	761,575	0.01
USD 440,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd '8A-2016 D' '144A' FRN 20/4/2027	448,892	0.00
USD 250,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd '8A-2016 E' '144A' FRN 20/4/2027	253,166	0.00
USD 2,350,000	Hilton Orlando Trust '2018-ORL E' '144A' FRN 15/12/2034	2,357,250	0.02
USD 1,980,000	Home Equity Asset Trust '2007-1 2A3' FRN 25/5/2037	1,648,787	0.01
USD 10,515,161	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS '2006-E 2A3' FRN 25/4/2037	7,788,700	0.07
USD 4,166,152	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS '2007-B 2A3' FRN 25/7/2037	2,756,865	0.02
USD 640,382	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD '2004-A M2' FRN 25/7/2034	646,900	0.01
USD 3,408,193	Home Equity Mortgage Trust (Step-up coupon) '2006-2 1A1' 5.867% 25/7/2036	1,339,352	0.01
USD 1,583,012	Home Loan Mortgage Loan Trust '2005-1 A3' FRN 15/4/2036	1,467,458	0.01
USD 1,338,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd '10A-16 C' '144A' FRN 20/1/2028	1,355,764	0.01
USD 1,000,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd '10A-16 D' '144A' FRN 20/1/2028	1,024,504	0.01
USD 780,000	HPS Loan Management 9-2016 Ltd '9A-2016 D2' '144A' 'FRN 19/7/2027	793,257	0.01
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,652,069	0.01
USD 5,147,937	Impac CMB Trust Series '2005-7 A1' FRN 25/11/2035	4,263,657	0.04
USD 1,210,000	IMT Trust '2017-APTS AFX' '144A' FRN 15/6/2034	1,203,968	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust '2017-APTS BFX' '144A' FRN 15/6/2034	2,737,074	0.02
USD 5,890,000	IMT Trust '2017-APTS DFX' '144A' FRN 15/6/2034	5,589,757	0.05
USD 2,000,000	IMT Trust '2017-APTS EFX' '144A' FRN 15/6/2034	1,876,934	0.02
USD 2,210,756	IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust '2007-A2 3A1' 7% 25/10/2037	1,569,705	0.01
USD 6,689,094	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust '2007-H0A1 AXPP' FRN 25/7/2047	282,982	0.00
USD 1,694,528	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2007-FLX2 A1A' FRN 25/4/2037	1,634,591	0.01
USD 1,219,557	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2007-FLX5 2A2' FRN 25/8/2037	1,110,376	0.01
USD 8,675,810	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust '2007-AR19 3A1' FRN 25/9/2037	6,171,235	0.05
USD 684,000	Invitation Homes 2015-SFR1 Trust '2015-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2032	689,154	0.01
USD 1,295,000	Invitation Homes 2015-SFR3 Trust '2015-SFR3 E' '144A' FRN 17/8/2032	1,310,382	0.01
USD 8,000,000	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust '2018-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2037	8,081,240	0.07
USD 3,200,000	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust '2018-SFR1 F' '144A' FRN 17/3/2037	3,236,591	0.03
EUR 410,000	Iron Mountain Inc 3% 15/1/2025	500,489	0.00
USD 638,000	Iron Mountain Inc 6% 15/8/2023	663,520	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 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc '144A' 5.375% 1/6/2026	1,123,650	0.01
USD 689,009	Irwin Home Equity Loan Trust '2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	623,256	0.01
USD 2,307,205	Irwin Home Equity Loan Trust (Step-up coupon) '2006- 3 2A3' '144A' 6.03% 25/9/2037	2,243,944	0.02
USD 11,972,599	IXIS Real Estate Capital Trust '2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	4,599,639	0.04
USD 1,850,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-WPT A' '144A' FRN 15/10/2033	1,854,605	0.02
USD 1,770,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2017-MAUI D' '144A' FRN 15/7/2034	1,779,555	0.02
USD 10,000,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2017- MAUI E' '144A' FRN 15/7/2034	10,063,131	0.09
USD 2,900,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2017-MAUI F' '144A' FRN 15/7/2034	2,920,169	0.02
USD 1,440,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2018-ASH8 E' '144A' FRN 15/2/2035	1,444,615	0.01
USD 3,710,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016- NINE A' '144A' FRN 6/10/2038	3,515,938	0.03
USD 12,241,000	Jamestown CLO III Ltd '2013-3A A1AR' '144A' FRN 15/1/2026	12,267,944	0.10
USD 770,000	Jay Park CLO Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 20/10/2027	791,832	0.01
USD 490,717	JP Morgan Alternative Loan Trust '2007-A2 2A1' FRN 25/5/2037	487,490	0.00
USD 1,170,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-PHH B' '144A' FRN 15/8/2027	1,170,797	0.01
USD 970,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-CBM E' '144A' FRN 15/10/2029	972,061	0.01
USD 1,595,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	1,598,812	0.01
USD 3,100,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-UES D' '144A' FRN 5/9/2032	3,098,834	0.03
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-UES E' '144A' FRN 5/9/2032	4,895,991	0.04
USD 61,422	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2002-CIB4 C' '144A' FRN 12/5/2034	61,523	0.00
USD 821,209	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-SGP A' '144A' FRN 15/7/2036	823,994	0.01
USD 883,386	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2003-PM1A G' '144A' FRN 12/8/2040	1,053,195	0.01
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2015-JP1 D' FRN 15/1/2049	2,048,058	0.02
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP3 XC' '144A' FRN 15/8/2049	441,633	0.00
USD 2,975,371	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	128,521	0.00
USD 55,662	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2008-C2 A4FL' FRN 12/2/2051	55,654	0.00
USD 920,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-DSTY A' '144A' 3.429% 10/6/2027	921,406	0.01
USD 1,102,469	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series ' 2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	1,200,478	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust '2006-CW1 M1' FRN 25/5/2036	915,661	0.01
USD 961,219	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A3A' 5.83% 25/7/2036	502,160	0.00
USD 727,027	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A6' 6% 25/7/2036	379,724	0.00
USD 2,830,111	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust (Step-up coupon) '2006-WF1 A5' 6.41% 25/7/2036	1,477,321	0.01
USD 6,848,638	JP Morgan Mortgage Trust '2017-2 A6' '144A' FRN 25/5/2047	6,757,950	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 19,021,189	JP Morgan Mortgage Trust '2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	18,918,016	0.16
USD 2,642,935	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 XA' FRN 15/9/2047	117,889	0.00
USD 1,468,518	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	42,595	0.00
USD 2,246,906	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C26 XA' FRN 15/1/2048	104,381	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	201,037	0.00
USD 2,558,760	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C29 XA' FRN 15/5/2048	85,430	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2015-C33 D1' '144A' FRN 15/12/2048	1,381,291	0.01
USD 450,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C22 A4' 3.801% 15/9/2047	462,655	0.00
USD 1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust '2017-JP5 D' '144A' FRN 15/3/2050	1,296,564	0.01
USD 2,410,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust '2017-JP7 B' 4.05% 15/9/2050	2,426,472	0.02
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust '2016-C4 XC' '144A' FRN 15/12/2049	215,696	0.00
USD 10,200,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/11/2022 (Perpetual)	9,919,500	0.08
USD 14,200,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/10/2024 (Perpetual)	15,123,000	0.13
USD 7,675,000	JPMorgan Chase & Co FRN 24/7/2038	7,433,303	0.06
USD 12,260,000	JPMorgan Chase & Co 4.125% 15/12/2026	12,396,779	0.11
USD 6,008,000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10% 15/7/2022	6,571,250	0.06
USD 1,557,000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10.5% 15/7/2024*	1,716,592	0.01
USD 4,810,000	Kaiser Aluminum Corp 5.875% 15/5/2024	5,026,450	0.04
USD 3,009,000	Kaiser Foundation Hospitals 4.15% 1/5/2047	3,060,789	0.03
USD 690,000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5.25% 1/6/2050	736,613	0.01
USD 4,406,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 5% 1/6/2024	4,455,567	0.04
USD 520,000	KKR CLO 12 Ltd '144A' FRN 15/7/2027	522,636	0.00
USD 522,000	KLA-Tencor Corp 4.65% 1/11/2024	549,761	0.00
EUR 232,000	Kronos International Inc 3.75% 15/9/2025	292,344	0.00
USD 906,000	LafargeHolcim Finance US LLC '144A' 3.5% 22/9/2026	868,666	0.01
USD 1,673,000	LafargeHolcim Finance US LLC '144A' 4.75% 22/9/2046	1,683,960	0.01
USD 361,095	LB-UBS Commercial Mortgage Trust '2007-C6 AMFL' '144A' 6.114% 15/7/2040	360,956	0.00
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust '2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	3,865,331	0.03
USD 4,770,000	LCM 26 Ltd '144A' FRN 20/1/2031	4,802,809	0.04
USD 463,851	LCM XIV LP '144A' FRN 15/7/2025	465,048	0.00
USD 670,000	LCM XVI LP '144A' FRN 15/7/2026	672,749	0.01
USD 440,000	LCM XVII LP '144A' FRN 15/10/2026	440,553	0.00
USD 830,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	831,963	0.01
USD 580,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	585,103	0.01
USD 570,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	573,075	0.00
USD 480,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2027	311,566	0.00
USD 400,000	LCM Xxiv Ltd '144A' FRN 20/3/2030	401,629	0.00
USD 437,425	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2002-A C' 15/6/2033 (Zero Coupon)	358,180	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 5,630,000	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust '2001-B M1' FRN 15/4/2040	6,024,053	0.05
USD 455,349	Lehman ABS Mortgage Loan Trust '2007-1 2A1' '144A' FRN 25/6/2037	321,155	0.00
USD 530,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust '2006-2A M2' '144A' FRN 25/9/2036	513,419	0.00
USD 1,515,424	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust '2007-1A 1A' '144A' FRN 25/3/2037	1,411,731	0.01
USD 1,300,111	Lehman XS Trust Series '2007-20N A1' FRN 25/12/2037	1,292,719	0.01
USD 147	Lehman XS Trust Series '2006-12N A2A2' FRN 25/8/2046	147	0.00
USD 17,040,000	Lendmark Funding Trust '2017-2A A' '144A' 2.8% 20/5/2026	16,952,111	0.14
USD 14,918,000	Lendmark Funding Trust '2017-1A A' '144A' 2.83% 22/12/2025	14,846,447	0.13
USD 620,000	Lendmark Funding Trust '2017-2A B' '144A' 3.38% 20/5/2026	614,376	0.01
USD 2,200,000	Lendmark Funding Trust '2017-1A B' '144A' 3.77% 22/12/2025	2,209,380	0.02
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.125% 1/12/2018	1,414,000	0.01
USD 8,953,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	9,053,721	0.08
USD 1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,044,162	0.01
USD 162,000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 7.375% 15/7/2039	200,880	0.00
EUR 325,000	Levi Strauss & Co 3.375% 15/3/2027	410,608	0.00
USD 840,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	920,044	0.01
USD 5,533,907	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	5,513,431	0.05
USD 161,632	Lime Street CLO Ltd '2007-1A B' '144A' FRN 20/6/2021	161,614	0.00
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC '2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,176,765	0.02
USD 569,074	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP A1A2' '144A' FRN 15/9/2028	570,241	0.00
USD 4,556,209	Lone Star Portfolio Trust '2015-LSP E' '144A' FRN 15/9/2028	4,619,472	0.04
USD 3,765,689	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-1 1A' FRN 25/2/2036	3,654,449	0.03
USD 11,899,089	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-4 2A3' FRN 25/5/2036	5,672,259	0.05
USD 1,442,880	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-5 2A3' FRN 25/6/2036	825,701	0.01
USD 5,326,904	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-7 2A3' FRN 25/8/2036	3,147,704	0.03
USD 2,615,450	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-8 2A3' FRN 25/9/2036	1,131,875	0.01
USD 1,400,579	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-9 2A2' FRN 25/10/2036	655,333	0.01
USD 5,379,243	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-9 2A3' FRN 25/10/2036	2,531,840	0.02
USD 1,704,507	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-9 2A4' FRN 25/10/2036	808,615	0.01
USD 380,871	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	195,134	0.00
USD 3,917,307	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	2,022,032	0.02
USD 1,393,534	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	716,609	0.01
USD 17,016,263	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-2 2A3' FRN 25/3/2046	8,234,938	0.07
USD 7,237,573	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-2 2A4' FRN 25/3/2046	3,540,327	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 5,342,011	Long Beach Mortgage Loan Trust '2006-3 2A3' FRN 25/5/2046	2,285,320	0.02
USD 2,400,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	3,361,668	0.03
USD 2,330,000	Los Angeles County Metropolitan Transportation Authority 5% 1/7/2042	2,694,494	0.02
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,503,675	0.05
USD 1,285,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.603% 1/7/2050	1,860,629	0.02
USD 2,991,545	LSTAR Commercial Mortgage Trust '2017-5 X' '144A' FRN 10/3/2050	149,353	0.00
USD 13,020,000	LSTAR Securities Investment Ltd '2018-1 A' '144A' FRN 1/2/2023	12,997,427	0.11
USD 4,148,648	LSTAR Securities Investment Ltd 2017-8 LLC '2017-8 A' '144A' FRN 1/11/2022	4,148,039	0.04
USD 4,200,000	MAD Mortgage Trust '2017-330M D' '144A' FRN 15/8/2034	4,115,711	0.04
USD 6,600,000	MAD Mortgage Trust '2017-330M E' '144A' FRN 15/8/2034	6,294,915	0.05
USD 1,430,000	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust '2002-A B2' FRN 25/3/2032	1,473,322	0.01
USD 6,600,000	Madison Avenue Trust '2013-650M D' '144A' FRN 12/10/2032	6,607,088	0.06
USD 1,240,000	Madison Avenue Trust '2013-650M E' '144A' FRN 12/10/2032	1,208,481	0.01
USD 520,000	Madison Park Funding X Ltd '2012-10A ER' '144A' FRN 20/1/2029	540,750	0.00
USD 380,000	Madison Park Funding XI Ltd '2013-11A ER' '144A' FRN 23/7/2029	387,055	0.00
USD 360,000	Madison Park Funding XII Ltd '2014-12A E' '144A' FRN 20/7/2026	360,877	0.00
USD 2,066,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A CR' '144A' FRN 19/1/2025	2,069,347	0.02
USD 1,250,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A DR' '144A' FRN 19/1/2025	1,263,200	0.01
USD 2,990,000	Madison Park Funding XIII Ltd '2014-13A E' '144A' FRN 19/1/2025	2,997,207	0.03
USD 4,301,000	Madison Park Funding XIV Ltd '2014-14A A2R' '144A' FRN 20/7/2026	4,308,091	0.04
USD 854,000	Madison Park Funding XIV Ltd '2014-14A DR' '144A' FRN 20/7/2026	862,094	0.01
USD 500,000	Madison Park Funding XIV Ltd '2014-14A E' '144A' FRN 20/7/2026	501,247	0.00
USD 250,000	Madison Park Funding XIX Ltd '2015-19A D' '144A' FRN 22/1/2028	251,049	0.00
USD 340,000	Madison Park Funding XV Ltd '2014-15A CR' '144A' FRN 27/1/2026	341,657	0.00
USD 300,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A C' '144A' FRN 20/4/2026	302,735	0.00
USD 1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd '2015-16A D' '144A' FRN 20/4/2026	1,225,043	0.01
USD 7,820,000	Madison Park Funding XVIII Ltd '2015-18A A1R' '144A' FRN 21/10/2030	7,880,906	0.07
USD 510,000	Madison Park Funding XX Ltd '2016-20A E' '144A' FRN 27/4/2027	515,637	0.00
USD 2,350,000	Madison Park Funding XXVI Ltd '2017-26A AR' '144A' FRN 29/7/2030	2,363,959	0.02
USD 4,500,000	Marble Point CLO XI Ltd '2017-2A A' '144A' FRN 18/12/2030	4,519,476	0.04
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	936,970	0.01
USD 790,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2039	905,293	0.01
USD 835,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2040	955,411	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 880,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2041	1,006,135	0.01
USD 920,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2042	1,051,072	0.01
USD 740,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2043	844,784	0.01
USD 1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,159,829	0.01
USD 500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	544,257	0.00
USD 211,000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 4.9% 1/4/2077	216,197	0.00
USD 5,105,148	Mastr Asset Backed Securities Trust '2006-HE2 A3' FRN 25/6/2036	2,988,955	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust '2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	1,210,773	0.01
USD 782,725	MASTR Resecuritization Trust '2008-3 A1' '144A' FRN 25/8/2037	602,760	0.01
USD 634,654	Mastr Specialized Loan Trust '2006-3 A' '144A' FRN 25/6/2046	599,654	0.01
USD 878,000	Matador Resources Co 6.875% 15/4/2023	920,802	0.01
USD 3,074,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	3,220,015	0.03
USD 2,202,998	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series ' 2007-OAR2 A2' FRN 25/4/2037	1,858,725	0.02
USD 6,760,628	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series '2007-2 A2C' FRN 25/5/2037	4,744,691	0.04
USD 941,317	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series '2006- RM3 A2B' FRN 25/6/2037	312,778	0.00
USD 1,070,000	Merrill Lynch Mortgage Trust '2005- MKB2 F' '144A' ' FRN 12/9/2042	1,122,301	0.01
USD 161,009	Merrill Lynch Mortgage Trust '2008- C1 AJ' FRN 12/2/2051	160,853	0.00
USD 1,400,000	Mesquite Independent School District 5% 15/8/2042	1,589,819	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,532,573	0.01
USD 1,350,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2042	1,552,095	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2042	1,597,106	0.01
USD 1,720,000	Metropolitan Transportation Authority 5.25% 15/11/2057	1,968,162	0.02
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	1,840,352	0.02
USD 2,350,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2032	2,657,709	0.02
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,064,420	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	1,851,885	0.02
USD 2,162,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	2,248,480	0.02
USD 1,565,000	MHGE Parent LLC / MHGE Parent Finance Inc '144A' 8.5% 1/8/2019	1,565,000	0.01
USD 1,680,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5.073% 1/4/2050	1,764,143	0.02
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	969,232	0.01
USD 700,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	770,997	0.01
USD 1,205,000	Microsoft Corp 4% 12/2/2055	1,200,584	0.01
USD 1,200,000	Microsoft Corp 4.25% 6/2/2047	1,284,166	0.01
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd '2016-1A C' '144A' FRN 20/4/2028	505,500	0.00
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/4/2028	505,958	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,330,000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,410,279	0.01
USD 2,416,000	Morgan Stanley 3.125% 27/7/2026	2,287,154	0.02
USD 12,585,000	Morgan Stanley 3.875% 27/1/2026	12,610,050	0.11
USD 11,340,000	Morgan Stanley 3.95% 23/4/2027	11,173,926	0.10
USD 30,725,000	Morgan Stanley 4.35% 8/9/2026	31,238,645	0.27
USD 3,543,315	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust '2005-HE5 M4 ' FRN 25/9/2035	1,638,068	0.01
USD 11,825,962	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust '2007-NC1 A1 ' FRN 25/11/2036	7,632,972	0.07
USD 11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2014-C19 XD ' '144A' FRN 15/12/2047	757,215	0.01
USD 3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2014-C19 XF ' '144A' FRN 15/12/2047	226,717	0.00
USD 3,317,900	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C20 XA ' FRN 15/2/2048	217,592	0.00
USD 3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C21 XB ' '144A' FRN 15/3/2048	73,487	0.00
USD 7,769,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C21 XFG ' '144A' FRN 15/3/2048	441,066	0.00
USD 25,656,427	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C22 XA ' FRN 15/4/2048	1,421,836	0.01
USD 990,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C25 C ' FRN 15/10/2048	999,258	0.01
USD 10,774,878	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 XA ' FRN 15/10/2048	657,701	0.01
USD 5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 XD ' '144A' FRN 15/10/2048	466,440	0.00
USD 3,474,411	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C28 XA ' FRN 15/1/2049	251,154	0.00
USD 8,700,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C29 XB ' FRN 15/5/2049	595,283	0.01
USD 2,210,677	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2016-C31 XA ' FRN 15/11/2049	191,235	0.00
USD 660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2017-C33 C ' FRN 15/5/2050	661,952	0.01
USD 480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C23 D ' '144A' FRN 15/7/2050	418,496	0.00
USD 2,600,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C26 D ' '144A' 3.06% 15/10/2048	2,073,886	0.02
USD 166,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust ' 2015-C25 D ' 3.068% 15/10/2048	133,196	0.00
USD 13,903,635	Morgan Stanley Capital I '2017-HR2 XA' FRN 15/12/2050	866,544	0.01
USD 380,000	Morgan Stanley Capital I '2017-HR2 D' 2.73% 15/12/2050	293,369	0.00
USD 2,570,000	Morgan Stanley Capital I '2017-HR2 A4' 3.587% 15/12/2050	2,571,204	0.02
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Inc '2017-JWDR D' '144A' FRN 15/11/2034	921,813	0.01
USD 1,710,000	Morgan Stanley Capital I Inc '2017-JWDR E' '144A' FRN 15/11/2034	1,714,487	0.01
USD 700,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2015-XLF2 AFSB' ' 144A' FRN 15/8/2026	701,312	0.01
USD 200,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT E' '144A' ' FRN 13/7/2029	196,529	0.00
USD 4,363,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT F' '144A' ' FRN 13/7/2029	4,269,963	0.04
USD 1,750,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-CPT G' '144A' ' FRN 13/7/2029	1,690,478	0.01
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-150E F' '144A' ' FRN 9/9/2032	1,342,897	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 560,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-PRME D' '144A ' FRN 15/2/2034	560,781	0.00
USD 5,480,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017- CLS F' '144A ' FRN 15/11/2034	5,490,275	0.05
USD 1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2006-IQ11 C' FRN 15/10/2042	1,527,876	0.01
USD 360,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2015-MS1 C' FRN 15/5/2048	347,391	0.00
USD 250,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2015-MS1 D' '144A ' FRN 15/5/2048	212,228	0.00
USD 510,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 C' FRN 15/6/2050	498,320	0.00
USD 2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 XD' '144A ' FRN 15/6/2050	394,324	0.00
USD 2,180,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2017-H1 D' '144A' 2.546% 15/6/2050	1,750,573	0.02
USD 173,914	Morgan Stanley Capital I Trust '2005- IQ9 AJ' 4.77% 15/7/2056	173,289	0.00
USD 1,081,942	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust '2006- 2 A2' FRN 25/11/2036	564,549	0.00
USD 1,294,211	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust '2007-9SL A' FRN 25/7/2037	1,175,243	0.01
USD 2,150,449	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2006-15XS A2B' 5.507% 25/11/2036	1,245,059	0.01
USD 1,137,326	Morgan Stanley Resecuritization Trust '2014-R8 3B1' '144A' FRN 26/6/2047	1,107,457	0.01
USD 8,847,629	Mortgage Loan Resecuritization Trust '2009-RS1 A85' '144A' FRN 16/4/2036	7,585,552	0.06
USD 1,630,000	Mountain Hawk I CLO Ltd '2013-1A B1' '144A' FRN 20/1/2024	1,649,549	0.01
USD 1,428,911	Mountain Hawk II CLO Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 22/7/2024	1,430,071	0.01
USD 2,470,000	MP CLO III Ltd '2013-1A AR' '144A' FRN 20/10/2030	2,488,222	0.02
USD 400,000	MP CLO VII Ltd '2015-1A A1R' '144A' FRN 18/4/2027	399,842	0.00
USD 1,000,000	MP CLO VII Ltd '2015-1A DR' '144A' FRN 18/4/2027	1,000,710	0.01
USD 3,665,000	MPLX LP 4.7% 15/4/2048	3,553,547	0.03
USD 327,800	Nationstar Home Equity Loan Trust '2007-C 2AV3' FRN 25/6/2037	326,285	0.00
USD 540,000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust '2018- TECH F' '144A' FRN 15/11/2034	543,152	0.00
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA B' '144A' FRN 17/10/2044	4,973,695	0.04
USD 2,150,000	Navient Private Education Loan Trust '2016-AA B' ' 144A' FRN 16/12/2058	2,008,526	0.02
USD 1,760,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-CA B' ' 144A' 3.25% 15/5/2040	1,764,970	0.02
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA B' ' 144A' 3.5% 15/8/2044	2,873,886	0.02
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust '2015-AA B' ' 144A' 3.5% 15/12/2044	2,169,312	0.02
USD 1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc '144A' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,478,437	0.01
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,130,190	0.01
USD 2,125,000	Neuberger Berman CLO XIV Ltd '2013-14A ER' '144A' FRN 28/1/2030	2,170,670	0.02
USD 400,000	Neuberger Berman CLO XV '2013-15A DR' '144A' FRN 15/10/2029	403,585	0.00
USD 599,000	Neuberger Berman CLO XVII Ltd '2014-17A DR' '144A' ' FRN 22/4/2029	612,908	0.01
USD 640,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A CR' '144A' ' FRN 14/11/2027	658,606	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd '2014-18A DR' '144A' ' FRN 14/11/2027	258,261	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 780,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd '2017-16SA A' '144A' ' FRN 15/1/2028	781,107	0.01
USD 350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd '2017-16SA D' '144A' ' FRN 15/1/2028	349,985	0.00
USD 260,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd '2015-20A ER' '144A' FRN 15/1/2028	260,596	0.00
USD 580,000	Neuberger Berman CLO XXI Ltd '2016-21A E' '144A' FRN 20/4/2027	584,601	0.01
USD 390,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd '2016-23A E' '144A' ' FRN 17/10/2027	398,403	0.00
USD 5,730,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 '2017-26A A' ' 144A' FRN 18/10/2030	5,741,892	0.05
USD 7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series '2005-B M1' ' FRN 25/10/2035	7,034,103	0.06
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	857,622	0.01
USD 3,615,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6.104% 15/12/2028	3,771,439	0.03
USD 1,360,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,486,426	0.01
USD 1,159,000	New York and Presbyterian Hospital/The 3.563% 1/8/2036	1,097,025	0.01
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	872,237	0.01
USD 1,050,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.28% 1/5/2026	959,952	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	3,562,109	0.03
USD 400,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/8/2031	462,326	0.00
USD 860,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/2/2035	973,907	0.01
USD 820,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/5/2036	929,716	0.01
USD 4,245,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2047	4,812,259	0.04
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	2,025,724	0.02
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	878,011	0.01
USD 1,950,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2046	2,202,125	0.02
USD 900,000	New York Liberty Development Corp 5.25% 1/10/2035	1,106,829	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2027	874,639	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2028	869,115	0.01
USD 650,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2031	753,812	0.01
USD 1,225,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,412,401	0.01
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2036	1,843,232	0.02
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2037	1,840,408	0.02
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2038	850,538	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2039	847,929	0.01
USD 1,550,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2040	1,773,347	0.02
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2041	1,829,152	0.02
USD 2,160,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2042	2,467,454	0.02
USD 2,980,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2043	3,401,581	0.03
USD 4,505,000	New York State Urban Development Corp 2.86% 15/3/2024	4,433,010	0.04
USD 2,400,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	2,371,128	0.02
USD 3,655,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	3,524,882	0.03
USD 1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,915,326	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 620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	673,491	0.01
USD 3,290,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	3,604,524	0.03
USD 1,175,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	1,216,125	0.01
USD 6,570,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 7.768% 15/12/2037	8,048,250	0.07
USD 4,639,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5% 15/4/2022	4,697,451	0.04
USD 415,863	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series '2001-R1A A' '144A' FRN 19/2/2030	412,727	0.00
USD 416,327	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series '2006-S5 A1' '144A' FRN 25/10/2036	376,004	0.00
USD 2,850,665	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series '2007-2 A4' FRN 25/4/2047	2,358,687	0.02
USD 559,281	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series (Step-up coupon) '2006-AF1 1A4' 6.634% 25/5/2036	239,235	0.00
USD 1,392,000	Northwell Healthcare Inc 4.26% 1/11/2047	1,352,341	0.01
USD 71,662	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	75,156	0.00
USD 7,448,000	Northwestern University 3.662% 1/12/2057	7,026,439	0.06
USD 350,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd '2014-10A CR' '144A' FRN 20/7/2026	351,541	0.00
USD 250,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd '2014-10A DR' '144A' FRN 20/7/2026	251,825	0.00
USD 430,000	Oak Hill Credit Partners XII Ltd '2015-12A D1' '144A' FRN 23/1/2027	431,655	0.00
USD 1,870,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd '2015-1A A1R' '144A' FRN 20/10/2027	1,875,037	0.02
USD 2,000,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd '2015-1A DR' '144A' FRN 20/10/2027	1,985,959	0.02
USD 805,545	Oakwood Mortgage Investors Inc '2001-D A2' FRN 15/1/2019	637,508	0.01
USD 669,875	Oakwood Mortgage Investors Inc '2001-D A4' FRN 15/9/2031	599,232	0.01
USD 6,860,000	Oasis Petroleum Inc 6.875% 15/3/2022*	7,022,925	0.06
USD 383,000	Oasis Petroleum Inc 7.25% 1/2/2019*	383,958	0.00
USD 1,580,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,946,657	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2012-2 Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 22/11/2025	448,764	0.00
USD 1,020,000	OCP CLO 2014-5 Ltd '2014-5A A1R' '144A' FRN 26/4/2031	1,020,000	0.01
USD 1,540,000	OCP CLO 2014-7 Ltd '2014-7A A1AR' '144A' FRN 20/10/2026	1,541,084	0.01
USD 2,100,000	OCP CLO 2015-10 Ltd '2015-10A A1R' '144A' FRN 26/10/2027	2,100,629	0.02
USD 1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd '2015-10A BR' '144A' FRN 26/10/2027	1,756,327	0.02
USD 2,184,000	OCP CLO 2015-8 Ltd '2015-8A A1R' '144A' FRN 17/4/2027	2,185,533	0.02
USD 440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd '2016-12A C' '144A' FRN 18/10/2028	448,401	0.00
USD 5,210,000	OCP CLO 2017-13 Ltd '2017-13A A1A' '144A' FRN 15/7/2030	5,271,750	0.04
USD 920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd '2017-13A D' '144A' FRN 15/7/2030	940,386	0.01
USD 750,000	OCP CLO 2017-14 Ltd '2017-14A B' '144A' FRN 20/11/2030	753,676	0.01
USD 7,960,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd '2015-1A A1R' '144A' ' FRN 21/5/2027	7,962,796	0.07
USD 2,220,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd '2015-1A A2AR' ' 144A' FRN 21/5/2027	2,225,753	0.02
USD 940,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 21/5/2027	952,494	0.01
USD 430,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A C' '144A' FRN 15/4/2027	431,948	0.00
USD 600,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 15/4/2027	605,645	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 1,500,000	Octagon Investment Partners 26 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2027	1,518,355	0.01
USD 1,500,000	Octagon Investment Partners 27 Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 15/7/2027	1,530,417	0.01
USD 1,000,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC '2017-1A E' '144A' FRN 20/7/2030	1,032,228	0.01
USD 448,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC '2017-1A F' '144A' FRN 20/7/2030	451,377	0.00
USD 1,625,000	Octagon Investment Partners 33 Ltd '2017-1A A1' '144A' FRN 20/1/2031	1,629,751	0.01
USD 1,209,580	Octagon Investment Partners XVII Ltd '2013-1A A1R' '144A' FRN 25/10/2025	1,209,929	0.01
USD 4,335,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd '2013-1A A1R2' '144A' FRN 25/1/2031	4,335,000	0.04
USD 450,000	Octagon Investment Partners XVIII Ltd '2013-1A CR' '144A' FRN 16/12/2024	453,063	0.00
USD 1,775,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 14/11/2026	1,779,711	0.02
USD 3,100,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 14/11/2026	3,117,884	0.03
USD 460,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd '2014-1A DRR' '144A' FRN 22/1/2030	463,694	0.00
USD 5,169,000	OFSI Fund VI Ltd '2014-6A A2' '144A' FRN 20/3/2025	5,170,168	0.04
USD 610,525	OHA Credit Partners IX Ltd '2013-9A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	611,096	0.01
USD 3,650,946	OHA Credit Partners VIII Ltd '2013-8A A' '144A' FRN 20/4/2025	3,658,042	0.03
USD 280,000	OHA Credit Partners XI Ltd '2015-11A E' '144A' FRN 20/10/2028	286,326	0.00
USD 260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd '2016-13A E' '144A' FRN 21/1/2030	268,704	0.00
USD 1,280,589	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd '2013-2A A' '144A' FRN 23/8/2024	1,282,564	0.01
USD 7,920,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 20/1/2028	8,090,517	0.07
USD 4,570,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust '2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	4,231,109	0.04
USD 29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust '2017-OT XA' '144A' FRN 10/5/2039	969,813	0.01
USD 43,880,000	One Market Plaza Trust '2017-1MKT XCP' '144A' FRN 10/2/2032	240,024	0.00
USD 2,914,210	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A A' '144A' '2.57%' 18/7/2025	2,915,683	0.02
USD 2,499,261	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A B' '144A' '3.02%' 18/9/2024	2,504,195	0.02
USD 16,601,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A B' '144A' '3.1%' 18/7/2025	16,603,754	0.14
USD 4,774,486	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A A' '144A' '3.19%' 18/3/2026	4,797,602	0.04
USD 1,985,000	OneMain Financial Issuance Trust '2016-1A A' '144A' '3.66%' 20/2/2029	2,006,732	0.02
USD 1,588,000	OneMain Financial Issuance Trust '2016-2A A' '144A' '4.1%' 20/3/2028	1,603,328	0.01
USD 8,170,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-2A C' '144A' '4.32%' 18/7/2025	8,164,913	0.07
USD 2,815,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A C' '144A' '4.33%' 18/9/2024	2,830,089	0.02
USD 810,000	OneMain Financial Issuance Trust '2016-1A B' '144A' '4.57%' 20/2/2029	827,624	0.01
USD 2,733,000	OneMain Financial Issuance Trust '2015-1A C' '144A' '5.12%' 18/3/2026	2,754,036	0.02
USD 11,050,000	OneMain Financial Issuance Trust '2014-2A D' '144A' '5.31%' 18/9/2024	11,118,965	0.09
USD 1,470,263	Option One Mortgage Loan Trust '2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	1,084,544	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 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust '2007-CP1 2A3' FRN 25/3/2037	1,379,325	0.01
USD 11,657,438	Option One Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) '2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	11,509,642	0.10
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,387,398	0.04
USD 3,695,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	3,951,359	0.03
USD 4,255,000	Oregon School Boards Association 5.48% 30/6/2022	4,687,159	0.04
USD 5,965,000	Oregon School Boards Association 5.49% 30/6/2023	6,648,589	0.06
USD 701,333	Origen Manufactured Housing Contract Trust '2001-A M1' FRN 15/3/2032	692,653	0.01
USD 2,461,275	Origen Manufactured Housing Contract Trust '2007-B A1' '144A' FRN 15/10/2037	2,441,780	0.02
USD 1,998,000	Orlando Health Obligated Group 4.089% 1/10/2048	1,967,732	0.02
USD 1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series (Step-up coupon) '2006-2 A2C' 6% 25/1/2037	1,484,292	0.01
USD 6,944,000	OZLM Funding II Ltd '2012-2A A1R' '144A' FRN 30/10/2027	6,964,712	0.06
USD 940,000	OZLM Funding II Ltd '2012-2A DR' '144A' FRN 30/10/2027	949,487	0.01
USD 2,060,000	OZLM Funding III Ltd '2013-3A BR' '144A' FRN 22/1/2029	2,103,676	0.02
USD 2,850,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,876,258	0.02
USD 290,000	OZLM Funding IV Ltd '2013-4A A2R' '144A' FRN 22/10/2030	293,283	0.00
USD 3,610,000	OZLM Funding Ltd '2012-1X SUB' FRN 22/7/2029	1,872,471	0.02
USD 720,000	OZLM IX Ltd '2014-9A BR' '144A' FRN 20/1/2027	723,291	0.01
USD 2,380,000	OZLM IX Ltd '2014-9A CR' '144A' FRN 20/1/2027	2,400,273	0.02
USD 1,400,000	OZLM VI Ltd '2014-6A BR' '144A' FRN 17/4/2026	1,405,029	0.01
USD 3,200,000	OZLM VI Ltd '2014-6A SUB' '144A' FRN 17/4/2026	1,640,205	0.01
USD 390,000	OZLM VII Ltd '2014-7A B1R' '144A' FRN 17/7/2026	391,508	0.00
USD 560,000	OZLM VII Ltd '2014-7A CR' '144A' FRN 17/7/2026	564,349	0.00
USD 5,345,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A A1AR' '144A' FRN 17/10/2026	5,356,896	0.05
USD 1,250,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A BR' '144A' FRN 17/10/2026	1,254,850	0.01
USD 1,315,000	OZLM VIII Ltd '2014-8A CR' '144A' FRN 17/10/2026	1,321,339	0.01
USD 531,000	OZLM XI Ltd '2015-11A BR' '144A' FRN 30/10/2030	538,635	0.00
USD 874,000	OZLM XI Ltd '2015-11A CR' '144A' FRN 30/10/2030	895,217	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A1' '144A' FRN 30/4/2027	621,742	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd '2015-12A A2' '144A' FRN 30/4/2027	622,342	0.01
USD 290,000	OZLM XII Ltd '2015-12A B' '144A' FRN 30/4/2027	293,381	0.00
USD 875,000	OZLM XII Ltd '2015-12A C' '144A' FRN 30/4/2027	881,745	0.01
USD 470,000	OZLM XII Ltd '2015-12A D' '144A' FRN 30/4/2027	471,522	0.00
USD 335,000	OZLM XIII Ltd '2015-13A C' '144A' FRN 30/7/2027	340,265	0.00
USD 2,000,000	OZLM XIV Ltd '2015-14A B1' '144A' FRN 15/1/2029	2,005,845	0.02
USD 470,000	OZLM XIV Ltd '2015-14A C' '144A' FRN 15/1/2029	472,778	0.00
USD 660,000	OZLM XIV Ltd '2015-14A D' '144A' FRN 15/1/2029	662,048	0.01
USD 2,250,000	OZLM XIX Ltd '2017-19A A1' '144A' FRN 22/11/2030	2,266,552	0.02
USD 2,000,000	OZLM XIX Ltd '2017-19A D' '144A' FRN 22/11/2030	2,067,427	0.02
USD 2,120,000	OZLM XV Ltd '2016-15A A1' '144A' FRN 20/1/2029	2,137,922	0.02
USD 830,000	OZLM XV Ltd '2016-15A A2A' '144A' FRN 20/1/2029	841,973	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd '2016-15A C' '144A' FRN 20/1/2029	450,221	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 440,000	OZLM XV Ltd '2016-15A D' '144A' FRN 20/1/2029	456,748	0.00
USD 570,000	OZLM XXI '2017-21A B' '144A' FRN 20/1/2031	572,401	0.00
USD 6,750,000	OZLM XXI '2017-21A C' '144A' FRN 20/1/2031	6,801,330	0.06
USD 1,170,000	OZLM XXI '2017-21A D' '144A' FRN 20/1/2031	1,172,401	0.01
USD 250,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1AR' '144A' ' FRN 17/10/2027	251,087	0.00
USD 640,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd '2013-2A CR' '144A' ' FRN 17/10/2027	647,707	0.01
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A A1R2' '144A' ' FRN 17/1/2031	583,951	0.01
USD 530,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A CR2' '144A' ' FRN 17/1/2031	529,768	0.00
USD 440,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd '2014-1A DR2' '144A' ' FRN 17/1/2031	443,296	0.00
USD 250,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd '2015-2A CR' '144A' ' FRN 20/7/2030	254,982	0.00
USD 630,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd '2015-2A DR' '144A' ' FRN 20/7/2030	645,579	0.01
USD 2,090,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd '2018-1A A1' '144A' ' FRN 18/4/2031	2,090,000	0.02
USD 1,280,000	Palmer Square Loan Funding 2017-1 Ltd '2017-1A A2' ' '144A' FRN 15/10/2025	1,283,374	0.01
USD 107,188	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	102,963	0.00
USD 670,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd '2016-1A D' '144A' FRN 23/8/2028	682,892	0.01
USD 7,125,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd '2017-1A A1' '144A' FRN 14/11/2029	7,152,724	0.06
USD 1,500,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd '2017-1A A2' '144A' FRN 14/11/2029	1,506,449	0.01
USD 2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd '2017-1A D' '144A' FRN 14/11/2029	2,892,260	0.02
USD 5,597,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.375% 15/1/2025	5,597,000	0.05
USD 2,150,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 6.25% 1/6/2024	2,244,063	0.02
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,110,230	0.01
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	435,772	0.00
USD 3,325,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' ' 2.7% 14/3/2023	3,203,948	0.03
USD 3,750,000	Pepperdine University 3.948% 1/12/2057	3,627,465	0.03
USD 3,450,000	Permanent University Fund - University of Texas System 3.376% 1/7/2047	3,176,846	0.03
USD 1,126,000	Pinnacle Entertainment Inc 5.625% 1/5/2024	1,194,134	0.01
USD 360,000	Pinnacle Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 15/4/2026	362,701	0.00
USD 2,139,000	Pioneer Energy Services Corp 6.125% 15/3/2022	1,943,816	0.02
USD 3,694,000	Ply Gem Industries Inc 6.5% 1/2/2022	3,841,760	0.03
USD 2,875,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	3,089,576	0.03
USD 1,425,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.81% 15/10/2065	1,620,111	0.01
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	302,527	0.00
USD 710,000	Port Authority of New York & New Jersey 5% 15/11/2047	798,207	0.01
USD 5,548,000	Post Holdings Inc '144A' 5.5% 1/3/2025	5,582,952	0.05
USD 8,772,921	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL2 LLC (Step-up coupon) '2017-NPL2 A1' '144A' 3.25% 28/3/2057	8,757,033	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 7,651,813	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL3 LLC (Step-up coupon) '2017-NPL3 A1' '144A' 3.25% 29/6/2032	7,645,187	0.07
USD 354,944	Prime Mortgage Trust '2006-DR1 2A1' '144A' 5.5% 25/5/2035	309,075	0.00
USD 2,488,552	Progress Residential 2015-SFR2 Trust '2015-SFR2 A' '144A' 2.74% 12/6/2032	2,476,452	0.02
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust '2015-SFR3 F' '144A' 6.643% 12/11/2032	620,760	0.01
USD 1,287,646	Progress Residential 2016-SFR1 Trust '2016-SFR1 A' '144A' FRN 17/9/2033	1,298,318	0.01
USD 2,450,000	Progress Residential 2016-SFR1 Trust '2016-SFR1 E' '144A' FRN 17/9/2033	2,500,792	0.02
USD 1,350,000	Progress Residential 2016-SFR2 Trust '2016-SFR2 E' '144A' FRN 17/1/2034	1,384,836	0.01
USD 2,085,083	Progress Residential 2017-SFR1 Trust '2017-SFR1 A' '144A' 2.768% 17/8/2034	2,032,695	0.02
USD 250,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust '2017-SFR1 D' '144A' 3.565% 17/8/2034	246,814	0.00
USD 380,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust '2017-SFR1 E' '144A' 4.261% 17/8/2034	378,991	0.00
USD 750,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust '2018-SFR1 E' '144A' 4.38% 17/3/2035	749,966	0.01
USD 350,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust '2018-SFR1 F' '144A' 4.778% 17/3/2035	350,625	0.00
USD 2,653,000	Providence St Joseph Health Obligated Group 3.93% 1/10/2048	2,566,212	0.02
USD 409,256	PRPM 2017-1 LLC (Step-up coupon) '2017-1A A1' ' 144A' 4.25% 25/1/2022	409,880	0.00
EUR 638,000	PSPC Escrow Corp 6% 1/2/2023	815,917	0.01
USD 880,000	Public Power Generation Agency 5% 1/1/2035	988,178	0.01
USD 2,765,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	2,830,392	0.02
USD 3,255,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	3,930,413	0.03
EUR 1,116,000	PVH Corp 3.125% 15/12/2027	1,361,094	0.01
USD 11,390,000	Quicken Loans Inc '144A' 5.75% 1/5/2025	11,534,653	0.10
EUR 1,500,000	Quintiles IMS Inc 3.25% 15/3/2025	1,848,501	0.02
USD 630,000	Race Point IX CLO Ltd '2015-9A A1AR' '144A' FRN 15/10/2030	633,457	0.01
USD 2,809,480	RAIT 2017-FL7 Trust '2017-FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	2,801,321	0.02
USD 430,000	RAIT 2017-FL7 Trust '2017-FL7 C' '144A' FRN 15/6/2037	430,397	0.00
USD 1,234,288	RALI Series 2007-QH1 Trust '2007-QH1 A1' FRN 25/2/2037	1,133,712	0.01
USD 2,046,010	RALI Series 2007-QH6 Trust '2007-QH6 A1' FRN 25/7/2037	1,938,690	0.02
USD 1,367,424	RALI Series 2007-QH9 Trust '2007-QH9 A1' FRN 25/11/2037	1,201,596	0.01
USD 5,583,678	RAMP Series 2006-RS6 Trust '2006-RS6 A4' FRN 25/11/2036	4,721,193	0.04
USD 1,981,762	RAMP Series 2007-RS1 Trust '2007-RS1 A3' FRN 25/2/2037	1,106,884	0.01
USD 939,644	RBSSP Resecuritization Trust '2013-2 1A2' '144A' FRN 26/12/2036	905,657	0.01
USD 156,251	RCO Mortgage LLC '2015-NQM1 A' '144A' FRN 25/11/2045	156,937	0.00
USD 310,000	Regatta IV Funding Ltd '2014-1A DR' '144A' FRN 25/7/2026	313,655	0.00
USD 585,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A BR' '144A' FRN 25/10/2026	587,776	0.01
USD 1,025,000	Regatta V Funding Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 25/10/2026	1,030,544	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 3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,553,183	0.04
USD 194,127	Reperforming Loan REMIC Trust '2005-R3 AF' '144A' FRN 25/9/2035	171,486	0.00
USD 1,805,642	Residential Asset Securitization Trust '2005-A5 A5' FRN 25/5/2035	1,552,460	0.01
USD 11,822,000	Resolute Energy Corp 8.5% 1/5/2020	11,836,778	0.10
USD 3,518,261	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd '2017-CRE5 A' '144A' FRN 15/7/2034	3,526,416	0.03
USD 1,109,532	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd '2017-CRE5 B' '144A' FRN 15/7/2034	1,111,138	0.01
USD 14,810,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	15,275,708	0.13
USD 5,910,588	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC/Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	5,999,247	0.05
USD 630,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd '2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	636,643	0.01
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd '2017-2A C' '144A' FRN 15/10/2029	1,267,859	0.01
USD 4,390,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd '2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	4,490,828	0.04
USD 2,860,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd '2017-2A E' '144A' FRN 15/10/2029	2,909,545	0.02
USD 8,690,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd '2017-3A A' '144A' FRN 20/10/2030	8,734,125	0.07
USD 1,935,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd '2017-3A E' '144A' FRN 20/10/2030	1,952,141	0.02
USD 1,320,000	Rockford Tower CLO Ltd '2017-1A B' '144A' FRN 15/4/2029	1,329,366	0.01
USD 2,140,000	Rockford Tower CLO Ltd '2017-1A D' '144A' FRN 15/4/2029	2,173,417	0.02
USD 1,930,000	Rockford Tower CLO Ltd '2017-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	1,930,180	0.02
USD 500,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 5.625% 15/4/2020	521,875	0.00
USD 1,340,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6% 15/1/2019	1,375,175	0.01
USD 2,201,000	Rosslyn Portfolio Trust '2017-ROSS E' '144A' FRN 15/6/2033	2,203,508	0.02
USD 960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,040,750	0.01
USD 410,000	RR 2 Ltd '2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	419,328	0.00
USD 6,645,000	RR 3 Ltd '2018-3A A1R2' '144A' FRN 15/1/2030	6,670,152	0.06
USD 5,412,000	RSP Permian Inc 6.625% 1/10/2022	5,655,540	0.05
USD 713,000	RWJ Barnabas Health Inc 3.949% 1/7/2046	682,830	0.01
USD 5,840,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	6,309,092	0.05
USD 7,115,000	Sable Permian Resources Land LLC/AEPB Finance Corp '144A' 13% 30/11/2020	8,200,037	0.07
USD 1,975,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	1,999,273	0.02
USD 2,500,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.375% 15/4/2023	2,512,950	0.02
USD 647,967	SACO I Trust '2006-9 A1' FRN 25/8/2036	624,922	0.01
USD 900,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	1,017,374	0.01
USD 2,405,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	2,665,774	0.02
USD 1,020,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2036	1,161,255	0.01
USD 1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority Sewer Revenue 5% 15/5/2039	1,149,965	0.01
USD 1,390,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2041	1,541,093	0.01
USD 1,660,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2047	1,849,605	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,425,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 2.958% 1/8/2024	3,376,708	0.03
USD 1,506,535	Saxon Asset Securities Trust '2007-1 M1' FRN 25/1/2047	917,945	0.01
EUR 200,000	Scientific Games International Inc 3.375% 15/2/2026	239,814	0.00
USD 2,396,000	Scientific Games International Inc '144A' 7% 1/1/2022*	2,526,582	0.02
USD 3,166,000	Scientific Games International Inc 10% 1/12/2022	3,453,948	0.03
USD 5,248,000	SEACOR Holdings Inc 3% 15/11/2028	4,961,276	0.04
EUR 218,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023	299,323	0.00
USD 3,885,214	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series '2017-3 B' '144A' 25/7/2056 (Zero Coupon)	632,857	0.01
USD 5,256,193	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series '2017-3 B10' '144A' FRN 25/7/2056	1,204,894	0.01
USD 2,550,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series '2017-3 M2' '144A' FRN 25/7/2056	2,479,494	0.02
USD 5,701,765	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust ' 2006- WM4 A1' '144A' FRN 25/11/2036	3,597,471	0.03
USD 1,387,532	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust ' 2006- WM4 A2A' FRN 25/11/2036	600,313	0.01
USD 4,155,227	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust ' 2006- WM4 A2C' FRN 25/11/2036	1,816,970	0.02
USD 942,473	Security National Mortgage Loan Trust '2007-1A 2A' '144A' FRN 25/4/2037	913,456	0.01
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A CR' '144A' FRN 17/7/2026	1,752,728	0.02
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,590,448	0.01
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd '2014-1A SUB' '144A' FRN 17/7/2026	102,421	0.00
USD 1,439,237	SG Mortgage Securities Trust '2006- FRE2 A2C' FRN 25/7/2036	517,973	0.00
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust '2006- OPT2 A3D' FRN 25/10/2036	1,034,784	0.01
USD 3,120,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd '2013-3A AR' '144A' FRN 15/7/2030	3,137,466	0.03
USD 1,000,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd '2013-3A DR' '144A' FRN 15/7/2030	1,008,811	0.01
USD 440,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd '2013-3A ER' '144A' FRN 15/7/2030	441,306	0.00
USD 4,030,000	Shackleton 2014-V CLO Ltd '2014-5A AR' '144A' FRN 7/5/2026	4,038,187	0.03
EUR 540,000	Silgan Holdings Inc 3.25% 15/3/2025	675,471	0.01
USD 3,750,000	Silver Creek CLO Ltd '2014-1A AR' '144A' FRN 20/7/2030	3,770,916	0.03
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd '2014-1A DR' '144A' FRN 20/7/2030	509,876	0.00
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd '2014-1A E1R' '144A' FRN 20/7/2030	500,278	0.00
USD 3,900,000	SLC Private Student Loan Trust '2006-A C' FRN 15/7/2036	3,736,647	0.03
USD 7,469,715	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-B A3' FRN 15/3/2024	7,456,495	0.06
USD 3,883,695	SLM Private Credit Student Loan Trust '2004-A A3' FRN 15/6/2033	3,818,486	0.03
USD 2,380,817	SLM Private Credit Student Loan Trust '2005-B B' FRN 15/6/2039	2,343,742	0.02
USD 5,594,748	SLM Private Credit Student Loan Trust '2006-B A5' FRN 15/12/2039	5,507,922	0.05
USD 3,673,459	SLM Private Education Loan Trust '2013-A A2B' ' 144A' FRN 17/5/2027	3,685,207	0.03
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-C B' '144A' ' FRN 15/6/2044	2,485,613	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 591,198	SLM Private Education Loan Trust '2012-E A2B' '144A' FRN 15/6/2045	594,085	0.01
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-A B' '144A' 2.5% 15/3/2047	4,193,819	0.04
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust '2013-B B' '144A' 3% 16/5/2044	2,672,084	0.02
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust '2014-A B' '144A' 3.5% 15/11/2044	4,729,478	0.04
USD 420,764	SLM Private Education Loan Trust '2011-C' 4.54% 17/10/2044	429,275	0.00
USD 1,398,462	SMB Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/5/2026	1,417,123	0.01
USD 6,100,000	SMB Private Education Loan Trust '2017-B A2B' '144A' FRN 15/10/2035	6,139,224	0.05
USD 10,170,000	SMB Private Education Loan Trust '2017-B A2A' '144A' 2.82% 15/10/2035	9,970,201	0.08
USD 2,960,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-B B' '144A' 3.5% 17/12/2040	2,933,076	0.03
USD 3,880,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-C B' '144A' 3.5% 15/9/2043	3,737,062	0.03
USD 7,090,000	SMB Private Education Loan Trust '2015-C C' '144A' 4.5% 17/9/2046	7,123,252	0.06
USD 3,275,000	SolarCity LMC Series IV LLC '2015-1 B' '144A' 5.58% 21/8/2045	3,262,883	0.03
USD 500,000	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A1R' '144A' FRN 26/1/2031	500,094	0.00
USD 1,500,000	Sound Point CLO II Ltd '2013-1A A3R' '144A' FRN 26/1/2031	1,501,054	0.01
USD 250,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A C1R' '144A' FRN 15/7/2025	250,659	0.00
USD 1,190,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A DR' '144A' FRN 15/7/2025	1,193,554	0.01
USD 1,340,000	Sound Point CLO III Ltd '2013-2A E' '144A' FRN 15/7/2025	1,344,031	0.01
USD 680,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A CR' '144A' FRN 21/1/2026	682,770	0.01
USD 1,085,000	Sound Point CLO IV Ltd '2013-3A DR' '144A' FRN 21/1/2026	1,088,515	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2027	702,819	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd '2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2027	705,661	0.01
USD 449,000	Sound Point CLO V Ltd '2014-1A E' '144A' FRN 18/4/2026	450,285	0.00
USD 2,025,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A AR' '144A' FRN 23/1/2027	2,038,526	0.02
USD 590,000	Sound Point CLO VII Ltd '2014-3A D' '144A' FRN 23/1/2027	592,809	0.01
USD 1,380,000	Sound Point CLO X Ltd '2015-3A E' '144A' FRN 20/1/2028	1,385,455	0.01
USD 1,000,000	Sound Point CLO XI Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	1,027,808	0.01
USD 1,300,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	1,311,126	0.01
USD 650,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/10/2028	665,852	0.01
USD 440,000	Sound Point Clo XIV Ltd '2016-3A C' '144A' FRN 23/1/2029	448,426	0.00
USD 1,440,000	Sound Point Clo XIV Ltd '2016-3A E' '144A' FRN 23/1/2029	1,477,598	0.01
USD 2,230,000	Sound Point CLO XVIII Ltd '2017-4A A1' '144A' FRN 21/1/2031	2,242,401	0.02
USD 340,000	Sound Point CLO XVIII Ltd '2017-4A B' '144A' FRN 21/1/2031	341,499	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 81,060	Soundview Home Loan Trust '2004- WMC1 M2' FRN 25/1/2035	78,429	0.00
USD 2,225,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,088,530	0.02
USD 2,090,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,105,518	0.02
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2049	1,531,980	0.01
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2050	1,547,189	0.01
USD 3,567,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	4,682,847	0.04
USD 1,500,000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4.857% 15/7/2045	1,650,293	0.01
USD 2,700,000	Spectrum Brands Inc 5.75% 15/7/2025	2,801,250	0.02
USD 11,806,596	SpringCastle America Funding LLC '2016-AA A' '144A' ' 3.05% 25/4/2029	11,820,881	0.10
USD 5,363,000	Springleaf Funding Trust '2016-AA A' '144A' 2.9% 15/11/2029	5,364,165	0.05
USD 12,856,958	Springleaf Funding Trust '2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	12,875,085	0.11
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust '2015-AA B' '144A' 3.62% 15/11/2024	11,177,303	0.10
USD 480,000	Springleaf Funding Trust '2016-AA B' '144A' 3.8% 15/11/2029	482,062	0.00
USD 2,178,000	Sprint Communications Inc '144A' 7% 1/3/2020	2,305,958	0.02
USD 863,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	897,520	0.01
USD 3,165,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,291,600	0.03
USD 17,781,563	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	17,829,302	0.15
USD 2,219,000	SSM Health Care Corp 3.823% 1/6/2027	2,227,513	0.02
USD 9,838,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,403,685	0.09
USD 1,409,018	Stanwich Mortgage Loan Co 2016- NPL2 LLC (Step-up coupon) '2016-NPL2 NOTE' '144A' 3.721% 16/8/2046	1,410,102	0.01
USD 12,545,290	Stanwich Mortgage Loan Co 2017- NPL-B-1 LLC (Step-up coupon) '2017-NPB1 A1' '144A' 3.598% 17/5/2022	12,545,290	0.11
USD 3,845,000	State Board of Administration Finance Corp 2.638% 1/7/2021	3,827,371	0.03
USD 2,955,000	State Board of Administration Finance Corp 2.995% 1/7/2020	2,982,614	0.03
USD 6,925,000	State of California 2.25% 1/10/2023	6,662,612	0.06
USD 755,000	State of California 7.3% 1/10/2039	1,087,747	0.01
USD 1,210,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,755,631	0.02
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	3,683,512	0.03
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,044,230	0.02
USD 7,775,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	7,436,787	0.06
USD 740,000	State of Kansas Department of Transportation 5% 1/9/2035	847,829	0.01
USD 980,000	State of Ohio 5% 1/5/2030	1,130,773	0.01
USD 1,960,000	State of Ohio 5% 15/3/2032	2,222,473	0.02
USD 1,310,000	State of Ohio 5% 1/5/2032	1,503,245	0.01
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2034	1,027,733	0.01
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2035	1,025,226	0.01
USD 2,150,000	State of Ohio 5% 1/5/2036	2,444,658	0.02
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,850,009	0.02
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	5,714,574	0.05
USD 3,950,000	State of Washington 5% 1/7/2030	4,508,017	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,400,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,708,484	0.02
USD 930,000	State of Washington 5% 1/8/2040	1,065,966	0.01
USD 1,670,000	State of Washington 5% 1/2/2041	1,898,773	0.02
USD 980,000	State of Washington 5% 1/8/2041	1,120,704	0.01
USD 1,030,000	State of Washington 5% 1/8/2042	1,175,189	0.01
USD 3,780,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	3,697,861	0.03
USD 920,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2032	1,060,245	0.01
USD 830,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2033	954,189	0.01
USD 1,210,000	State of Wisconsin 5% 1/11/2033	1,412,143	0.01
USD 1,080,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2034	1,237,804	0.01
USD 1,340,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2036	1,531,111	0.01
USD 1,350,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2038	1,537,839	0.01
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,891,533	0.02
USD 1,006,000	Steel Dynamics Inc 5.125% 1/10/2021	1,028,635	0.01
USD 4,323,000	Steel Dynamics Inc 5.5% 1/10/2024	4,495,920	0.04
USD 3,690,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd '2017-1A A' '144A' FRN 15/1/2030	3,689,802	0.03
USD 3,125,000	Stewart Park CLO Ltd '2015-1A CR' '144A' FRN 15/1/2030	3,140,009	0.03
USD 327,460	STRIPs 2012-1 Ltd '2012-1A B' '144A' 0.5% 25/12/2044	324,595	0.00
USD 2,009,105	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust ' 2006-3 4A' FRN 25/4/2036	1,773,686	0.02
USD 2,262,860	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	2,161,802	0.02
USD 6,344,314	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR4 3A1' FRN 25/6/2036	5,993,480	0.05
USD 611,561	Structured Asset Mortgage Investments II Trust ' 2006-AR5 2A1' FRN 25/5/2046	520,107	0.00
USD 1,289,353	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series '2006- RF4 2A1' '144A' 6% 25/10/2036	1,116,308	0.01
USD 1,359,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/7/2023	1,403,168	0.01
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	817,550	0.01
USD 5,429,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.875% 15/1/2023	5,429,000	0.05
USD 2,855,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 5.875% 15/3/2028	2,872,844	0.02
USD 250,000	Symphony CLO VIII LP '2012-8A CR' '144A' FRN 9/1/2023	250,580	0.00
USD 1,370,000	Symphony CLO VIII LP '2012-8A ER' '144A' FRN 9/1/2023	1,373,198	0.01
USD 4,466,894	Symphony CLO XII Ltd '2013-12A AR' '144A' FRN 15/10/2025	4,475,035	0.04
USD 1,275,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A DR' '144A' FRN 17/10/2026	1,281,154	0.01
USD 425,000	Symphony CLO XV Ltd '2014-15A E' '144A' FRN 17/10/2026	426,527	0.00
USD 330,000	Symphony CLO XVI Ltd '2015-16A E' '144A' FRN 15/7/2028	331,451	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVII Ltd '2016-17A E' '144A' FRN 15/4/2028	252,555	0.00
USD 250,000	Symphony CLO XVIII Ltd '2016-18A D' '144A' FRN 23/1/2028	257,548	0.00
USD 6,595,000	Synchrony Financial 3.95% 1/12/2027	6,340,918	0.05
USD 5,620,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	4,362,525	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,470,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 9.5% 15/7/2022	2,485,438	0.02
USD 7,065,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10.5% 15/1/2026	6,623,438	0.06
USD 1,810,000	TCI-Flatiron Clo 2017-1 Ltd '2017-1A A' '144A' FRN 17/11/2030	1,815,831	0.02
USD 579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd '2017-1A E' '144A' FRN 15/7/2030	590,533	0.01
USD 1,720,000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 1/2/2025*	1,593,150	0.01
USD 10,121,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	10,551,143	0.09
USD 4,000,000	Texas A&M University 2.756% 15/5/2026	3,856,640	0.03
USD 1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,714,523	0.01
USD 720,000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	844,139	0.01
USD 570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	617,948	0.01
USD 1,410,000	Thacher Park CLO Ltd '2014-1A D1R' '144A' FRN 20/10/2026	1,417,065	0.01
USD 260,000	Thayer Park CLO Ltd '2017-1A D' '144A' FRN 20/4/2029	266,947	0.00
USD 2,500,000	THL Credit Wind River 2012-1 CLO Ltd '2012-1A DR' '144A' FRN 15/1/2026	2,550,264	0.02
USD 250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd '2014-3A DR' '144A' FRN 22/1/2027	251,326	0.00
USD 250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd '2014-3A E' '144A' FRN 22/1/2027	251,477	0.00
USD 670,000	THL Credit Wind River 2015-1 CLO Ltd '2015-1A E1' '144A' FRN 20/7/2027	673,597	0.01
USD 1,156,649	Thornburg Mortgage Securities Trust '2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	1,044,988	0.01
USD 250,000	TIAA CLO II Ltd '2017-1A E' '144A' FRN 20/4/2029	253,562	0.00
USD 8,500,000	Tiaa Clo III Ltd '2017-2A A' '144A' FRN 16/1/2031	8,529,319	0.07
USD 750,000	Tiaa Clo III Ltd '2017-2A B' '144A' FRN 16/1/2031	750,822	0.01
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/7/2027	290,098	0.00
USD 290,000	TICP CLO I Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/7/2027	290,088	0.00
USD 1,416,000	TICP CLO III Ltd '2014-3A AR' '144A' FRN 20/1/2027	1,422,461	0.01
USD 2,300,000	TICP CLO VII Ltd '2017-7A E' '144A' FRN 15/7/2029	2,346,607	0.02
USD 2,173,000	T-Mobile USA Inc 6% 15/4/2024	2,262,636	0.02
USD 195,000	T-Mobile USA Inc 6.836% 28/4/2023	203,385	0.00
USD 6,140,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	5,953,498	0.05
USD 3,070,000	Tobacco Settlement Financing Corp/ NJ 5% 1/6/2041	3,055,172	0.03
USD 2,945,000	Tobacco Settlement Financing Corp/ VA 6.706% 1/6/2046	2,641,194	0.02
USD 1,298,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,301,245	0.01
USD 2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,837,486	0.02
USD 1,091,000	TransDigm Inc 5.5% 15/10/2020	1,101,910	0.01
USD 3,690,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	3,777,638	0.03
USD 2,150,000	TransDigm Inc 6.5% 15/7/2024	2,219,875	0.02
USD 790,000	Treman Park CLO Ltd '2015-1A AR' '144A' FRN 20/4/2027	791,174	0.01
USD 1,750,000	Treman Park CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	1,762,791	0.02
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd '2006-1A A2' '144A' FRN 3/3/2039	1,144,058	0.01
USD 3,013,000	Trinity Health Corp 4.125% 1/12/2045	2,993,321	0.03
USD 1,400,000	TSASC Inc/NY 5% 1/6/2041	1,543,703	0.01
USD 169,043	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	180,174	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 5,527,841	UBS Commercial Mortgage Trust '2017-C1 XA' FRN 15/6/2050	594,168	0.01
USD 2,610,972	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	2,718,674	0.02
USD 2,150,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	2,219,875	0.02
USD 945,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	981,335	0.01
USD 350,000,000	United States Treasury Bill 8/3/2018 (Zero Coupon)	349,904,625	2.98
USD 531,667,100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2020* †	558,215,204	4.75
USD 75,676,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2021*	78,016,520	0.66
USD 66,231,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2022*	66,089,980	0.56
USD 23,105,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/7/2026*	22,673,273	0.19
USD 10,040,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.375% 15/1/2027* †	9,904,596	0.08
USD 10,000,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/1/2028	9,748,151	0.08
USD 62,438,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 31/1/2023	61,613,624	0.52
USD 118,860,000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 28/2/2023	118,651,067	1.01
USD 161,945,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/2/2028* †	160,059,860	1.36
USD 6,900,000	United States Treasury Note/Bond 3% 15/2/2048 †	6,710,250	0.06
USD 6,820,000	United Technologies Corp 2.8% 4/5/2024	6,527,531	0.06
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,464,164	0.01
USD 1,665,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,783,049	0.02
USD 790,000	University of Houston 5% 15/2/2033	899,277	0.01
USD 720,000	University of Houston 5% 15/2/2034	816,876	0.01
USD 1,630,000	University of Houston 5% 15/2/2035	1,844,402	0.02
USD 2,110,000	University of Houston 5% 15/2/2036	2,382,781	0.02
USD 4,275,000	University of Notre Dame du Lac 3.394% 15/2/2048	3,978,123	0.03
USD 6,002,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	5,378,827	0.05
USD 2,075,000	University of Vermont & State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,349,979	0.02
USD 2,522,050	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,555,088	0.02
USD 766,616	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	798,507	0.01
USD 9,280,000	US Bancorp FRN 15/4/2027 (Perpetual)	9,709,200	0.08
USD 4,780,000	US Bancorp 2.375% 22/7/2026	4,335,981	0.04
USD 2,957,000	Valvoline Inc 5.5% 15/7/2024	3,064,191	0.03
GBP 700,000	Vantiv LLC / Vanity Issuer Corp 3.875% 15/11/2025*	962,603	0.01
USD 1,402,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2014-1 M1' '144A' FRN 25/9/2044	1,414,634	0.01
USD 1,028,634	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2015-1 AFL' '144A' FRN 25/6/2045	1,051,315	0.01
USD 954,634	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-2 AFL' FRN 25/10/2046	975,336	0.01
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-2 M1' FRN 25/10/2046	298,185	0.00
USD 170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-2 M2' FRN 25/10/2046	167,808	0.00
USD 290,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-2 M3' FRN 25/10/2046	289,222	0.00
USD 310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2016-2 M4' FRN 25/10/2046	325,054	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,979,005	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-1 AFL' '144A' FRN 25/5/2047	2,999,049	0.03
USD 332,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-1 M1' '144A' FRN 25/5/2047	325,459	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-1 M2' '144A' FRN 25/5/2047	329,485	0.00
USD 330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-1 M3' '144A' FRN 25/5/2047	335,843	0.00
USD 2,506,510	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-2 M3' '144A' FRN 25/11/2047	2,472,354	0.02
USD 415,772	Velocity Commercial Capital Loan Trust '2017-2 M4' '144A' FRN 25/11/2047	408,052	0.00
USD 1,200,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A AR' '144A' FRN 15/1/2027	1,202,022	0.01
USD 650,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A BR' '144A' FRN 15/1/2027	655,457	0.01
USD 1,280,000	Venture XVII CLO Ltd '2014-17A B2R' '144A' FRN 15/7/2026	1,284,940	0.01
USD 804,000	Venture XXIV CLO Ltd '2016-24A E' '144A' FRN 20/10/2028	822,257	0.01
USD 750,000	Venture XXVI CLO Ltd '2017-26A D' '144A' FRN 20/1/2029	775,973	0.01
USD 2,450,000	Venture XXVI CLO Ltd '2017-26A E' '144A' FRN 20/1/2029	2,519,912	0.02
USD 13,355,000	VeriSign Inc 4.625% 1/5/2023	13,521,938	0.12
EUR 200,000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd 7.5% 1/2/2023	258,315	0.00
EUR 615,000	Verizon Communications Inc 1.375% 27/10/2026*	743,315	0.01
EUR 355,000	Verizon Communications Inc 2.875% 15/1/2038	436,549	0.00
USD 6,915,000	Verizon Communications Inc 5.012% 15/4/2049	7,000,303	0.06
USD 5,228,000	Viacom Inc FRN 28/2/2057*	5,284,928	0.05
USD 645,000	Vibrant Clo III Ltd '2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2026	647,116	0.01
USD 250,000	Vibrant Clo III Ltd '2015-3A A2R' '144A' FRN 20/4/2026	251,732	0.00
USD 440,000	Vibrant Clo III Ltd '2015-3A BR' '144A' FRN 20/4/2026	442,124	0.00
USD 1,310,000	Vibrant Clo IV Ltd '2016-4A C' '144A' FRN 20/7/2028	1,339,739	0.01
USD 470,000	Vibrant Clo IV Ltd '2016-4A D' '144A' FRN 20/7/2028	482,009	0.00
USD 830,000	Vibrant Clo V Ltd '2016-5A A' '144A' FRN 20/1/2029	838,055	0.01
USD 450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust '2013-PENN D' '144A' ' FRN 13/12/2029	449,210	0.00
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust '2013-PENN E' '144A' ' FRN 13/12/2029	868,584	0.01
USD 3,310,000	VNDO Trust '2016-350P E' '144A' FRN 10/1/2035	3,101,950	0.03
USD 1,602,498	Voya CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1' '144A' FRN 25/4/2025	1,606,813	0.01
USD 1,210,000	Voya CLO 2013-2 Ltd '2013-2A C' '144A' FRN 25/4/2025	1,218,345	0.01
USD 2,640,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A1R' '144A' FRN 18/1/2026	2,645,666	0.02
USD 1,275,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A A2R' '144A' FRN 18/1/2026	1,276,081	0.01
USD 685,000	Voya CLO 2013-3 Ltd '2013-3A BR' '144A' FRN 18/1/2026	686,069	0.01
USD 440,000	Voya CLO 2014-1 Ltd '2014-1A C' '144A' FRN 18/4/2026	443,551	0.00
USD 5,010,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A A1R' '144A' FRN 14/10/2026	5,014,274	0.04
USD 865,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A BR' '144A' FRN 14/10/2026	868,616	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 2,965,000	Voya CLO 2014-4 Ltd '2014-4A CR' '144A' FRN 14/10/2026	2,998,307	0.03
USD 275,000	Voya CLO 2016-2 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 19/7/2028	280,592	0.00
USD 330,000	Voya CLO 2016-3 Ltd '2016-3A D' '144A' FRN 18/10/2027	338,924	0.00
USD 250,000	Voya CLO 2016-4 Ltd '2016-4A E2' '144A' FRN 20/7/2029	258,387	0.00
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd '2017-4A A1' '144A' FRN 15/10/2030	3,507,776	0.03
USD 2,640,168	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007- HE2 Trust '2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	2,440,471	0.02
USD 2,117,935	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series ' 2006-C28 AJ' FRN 15/10/2048	2,150,382	0.02
USD 2,690,000	Wachovia Corp 6.55% 15/10/2035	3,228,137	0.03
USD 9,041,453	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust '2007-HE2 2A3' FRN 25/4/2037	5,059,771	0.04
USD 968,727	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust '2007-HE2 2A4' FRN 25/4/2037	547,263	0.00
USD 587,210	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005- AR2 Trust '2005-AR2 B1' FRN 25/1/2045	389,976	0.00
USD 612,538	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006- AR15 Trust '2006-AR15 2A' FRN 25/11/2046	582,783	0.01
USD 823,635	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007- OA5 Trust '2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	812,519	0.01
USD 4,000,000	Washington Mill CLO Ltd '2014-1A A1R' '144A' FRN 20/4/2026	4,008,961	0.03
USD 6,705,637	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust '2006-4 1A1' 6% 25/4/2036	6,166,745	0.05
USD 473,339	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) '2006-4 3A5' 6.35% 25/5/2036	416,887	0.00
USD 2,070,738	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) '2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,823,553	0.02
USD 3,603,463	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-8 Trust (Step-up coupon) '2006-8 A4' 4.499% 25/10/2036	2,320,846	0.02
USD 1,988,636	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-0A1 Trust '2007-0A1 2A' FRN 25/12/2046	1,589,584	0.01
USD 5,036,087	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust '2006-HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,569,674	0.02
USD 4,362,466	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 1A' FRN 25/10/2036	3,645,852	0.03
USD 3,724,095	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust '2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	2,077,016	0.02
USD 4,819,902	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2007-HE2 Trust '2007-HE2 2A2' FRN 25/2/2037	2,133,043	0.02
USD 2,240,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A C' '144A' FRN 20/1/2027	2,247,388	0.02
USD 1,250,000	Webster Park CLO Ltd '2015-1A D' '144A' FRN 20/1/2027	1,255,125	0.01
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp '144A' 6.625% 15/8/2025	1,829,559	0.02
USD 1,240,000	Weld County School District No RE-4 5.25% 1/12/2041	1,443,918	0.01
USD 5,500,000	Wellfleet CLO 2015-1 Ltd '2015-1A DR' '144A' FRN 20/10/2027	5,520,775	0.05
USD 1,625,000	Wellfleet CLO 2015-1 Ltd '2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2027	1,630,795	0.01
USD 5,480,000	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd '2017-3A A1' '144A' FRN 17/1/2031	5,509,155	0.05
USD 510,000	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd '2017-3A B' '144A' FRN 17/1/2031	511,737	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 24,865,000	Wells Fargo & Co FRN 15/6/2024 (Perpetual)	26,005,806	0.22
USD 5,415,000	Wells Fargo & Co FRN 22/5/2028	5,294,292	0.05
USD 9,605,000	Wells Fargo & Co 2.625% 22/7/2022	9,334,931	0.08
USD 1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-HSDB A' '144A' FRN 13/12/2031	1,358,543	0.01
USD 810,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2018-BXI E' '144A' FRN 15/12/2036	809,890	0.01
USD 16,129,264	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 XA' FRN 15/2/2048	802,278	0.01
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	108,727	0.00
USD 1,030,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-NXS4 D' FRN 15/12/2048	921,979	0.01
USD 1,340,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-C34 C' FRN 15/6/2049	1,365,961	0.01
USD 5,483,598	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XB' FRN 15/8/2049	513,566	0.00
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-BNK1 XD' '144A' FRN 15/8/2049	227,383	0.00
USD 1,730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C39 D' '144A' FRN 15/9/2050	1,580,009	0.01
USD 29,401,557	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C41 XA' FRN 15/11/2050	2,646,287	0.02
USD 800,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-NXS5 C' FRN 15/1/2059	825,969	0.01
USD 15,337,230	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-C33 XA' FRN 15/3/2059	1,494,272	0.01
USD 40,072,570	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2016-LC25 XA' FRN 15/12/2059	2,398,143	0.02
USD 9,940,530	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-RC1 XA' FRN 15/1/2060	971,314	0.01
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-P2 D' '144A' 3.241% 15/12/2048	370,046	0.00
USD 2,500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C31 A4' 3.695% 15/11/2048	2,528,388	0.02
USD 2,200,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 D' '144A' 3.768% 15/2/2048	1,686,448	0.01
USD 1,329,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-C27 C' 3.894% 15/2/2048	1,242,846	0.01
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2017-C39 C' 4.118% 15/9/2050	1,864,084	0.02
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	439,138	0.00
USD 2,380,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	2,357,570	0.02
USD 7,616,000	West CLO 2013-1 Ltd '2013-1A A1AR' '144A' FRN 7/11/2025	7,637,206	0.07
USD 2,199,000	West Corp '144A' 4.75% 15/7/2021	2,226,488	0.02
USD 830,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2019	865,296	0.01
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	955,878	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	970,643	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,082,840	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	911,355	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	979,970	0.01
USD 4,330,000	Westcott Park CLO Ltd '2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	4,496,255	0.04
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2012-C8 C' FRN 15/8/2045	366,118	0.00
USD 4,798,798	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C20 XA' FRN 15/5/2047	209,661	0.00
USD 14,583,650	WFRBS Commercial Mortgage Trust '2014-C23 XA' FRN 15/10/2057	453,519	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 937,000	Whiting Petroleum Corp 1.25% 1/4/2020	885,396	0.01
USD 7,197,000	Willis North America Inc 3.6% 15/5/2024	7,149,762	0.06
USD 650,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/12/2044	697,548	0.01
EUR 200,000	WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	257,290	0.00
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-D B' 3.34% 17/4/2023	671,927	0.01
USD 1,520,000	World Financial Network Credit Card Master Trust '2012-C C' 4.55% 15/8/2022	1,534,856	0.01
USD 2,930,000	Worldwide Plaza Trust '2017-WWP E' '144A' FRN 10/11/2036	2,612,426	0.02
USD 1,262,000	WPX Energy Inc 7.5% 1/8/2020	1,359,805	0.01
USD 674,565	WVUE (Step-up coupon) '2015-1A A' '144A' 7.5% 25/9/2020	677,165	0.01
USD 6,300,000	Xerox Corp 3.625% 15/3/2023	6,155,922	0.05
USD 1,315,000	Xilinx Inc 2.95% 1/6/2024	1,272,441	0.01
USD 2,220,831	Yale Mortgage Loan Trust '2007-1 A' '144A' FRN 25/6/2037	1,004,471	0.01
USD 340,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A CR' '144A' FRN 22/1/2027	341,635	0.00
USD 600,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A DR' '144A' FRN 22/1/2027	602,386	0.01
USD 1,120,000	York CLO 1 Ltd '2014-1A E' '144A' FRN 22/1/2027	1,122,760	0.01
USD 3,500,000	York CLO-2 Ltd '2015-1A AR' '144A' FRN 22/1/2031	3,529,163	0.03
USD 1,170,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A BR' '144A' FRN 20/10/2029	1,177,375	0.01
USD 2,990,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A DR' '144A' FRN 20/10/2029	3,063,582	0.03
USD 1,520,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	1,549,638	0.01
USD 730,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A FR' '144A' FRN 20/10/2029	719,438	0.01
USD 3,290,000	York Clo-3 Ltd '2016-1A SUB' '144A' FRN 20/10/2029	2,861,635	0.02
USD 610,000	York Clo-4 Ltd '2016-2A D' '144A' FRN 20/1/2030	629,896	0.01
USD 1,820,000	York Clo-4 Ltd '2016-2A E' '144A' FRN 20/1/2030	1,870,933	0.02
USD 3,115,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	3,251,281	0.03
USD 1,085,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6.375% 15/5/2025	1,138,024	0.01
EUR 2,700,000	ZF North America Capital Inc 2.75% 27/4/2023	3,538,116	0.03
USD 5,679,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	5,856,469	0.05
		6,453,226,140	54.89
債券合計		9,763,819,890	83.04
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合計		9,946,566,840	84.60

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 (%)
普通株式			
	ルクセンブルグ		
44,485	Aroundtown SA**	338,892	0.00
普通株式合計		338,892	0.00
債券			
	米国		
USD 5,230,021	American Homes 4 Rent '2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052**	52	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Holdings Inc (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	160	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	2	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust '2017-1MKT XNCP' '144A' FRN 10/2/2032**	52,656	0.00
USD 7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) FRN 1/5/2009**	-	0.00
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 6/11/2009 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2010 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD 630,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2010 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2011 (Zero Coupon)**	-	0.00
債券合計		52,870	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		391,762	0.00
投資有価証券合計		9,946,958,602	84.60
その他の純資産		1,810,751,719	15.40
純資産合計(米ドル)		11,757,710,321	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2018年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 978,311,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 3/18 ' 2.5% TBA	952,553,950	8.10
USD (506,507,000)	Fannie Mae Pool ' 3 3/18 ' 3% TBA	(503,697,466)	(4.28)
USD (751,700,000)	Fannie Mae Pool ' 3 4/18 ' 3% TBA	(746,590,785)	(6.35)
USD 39,407,000	Fannie Mae Pool ' 3 3/18 ' 3% TBA	38,077,783	0.32
USD 532,071,000	Fannie Mae Pool ' 3.5 3/18 ' 3.5% TBA	540,592,436	4.60
USD (2,017,606,000)	Fannie Mae Pool ' 3.5 3/18 ' 3.5% TBA	(2,009,330,627)	(17.09)
USD 10,789,346	Fannie Mae Pool ' 4 M1630 ' 4% TBA	11,120,568	0.09
USD 508,741,000	Fannie Mae Pool ' 4 3/18 ' 4% TBA	520,051,737	4.42
USD 978,038,000	Fannie Mae Pool ' 4 4/18 ' 4% TBA	997,948,702	8.49
USD (3,600,000)	Fannie Mae Pool ' 4.5 4/18 ' 4.5% TBA	(3,758,927)	(0.03)
USD (14,525,000)	Fannie Mae Pool ' 4.5 3/18 ' 4.5% TBA	(15,185,842)	(0.13)
USD (71,514,000)	Freddie Mac Gold Pool ' 4 3/18 ' 4% TBA	(73,117,480)	(0.62)
USD (2,503,000)	Freddie Mac Gold Pool ' 4.5 3/18 ' 4.5% TBA	(2,617,279)	(0.02)
T B A 合計		(293,953,230)	(2.50)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	7,269,513	GBP	5,210,000	Citibank	1/3/2018	76,587
USD	7,268,158	GBP	5,210,000	BNP Paribas	1/3/2018	75,232
BRL	21,521,903	USD	6,615,000	BNP Paribas	2/3/2018	23,547
BRL	130,900,341	USD	41,596,600	Deutsche Bank	2/3/2018	(1,219,686)
EUR	3,285,809	USD	4,060,000	Goldman Sachs	2/3/2018	(48,515)
GBP	2,952,487	USD	4,100,000	Goldman Sachs	2/3/2018	(23,797)
HUF	510,443,500	USD	2,030,000	Bank of America	2/3/2018	(45,303)
HUF	510,380,367	USD	2,030,000	Morgan Stanley	2/3/2018	(45,549)
JPY	443,685,732	USD	4,060,000	Goldman Sachs	2/3/2018	83,304
MXN	37,909,000	USD	2,030,000	Goldman Sachs	2/3/2018	(15,467)
MXN	38,155,628	USD	2,030,000	Citibank	2/3/2018	(2,361)
RUB	115,696,875	USD	2,050,000	Deutsche Bank	2/3/2018	10,176
RUB	115,967,475	USD	2,050,000	BNP Paribas	2/3/2018	14,994
SEK	32,391,825	USD	4,060,000	Deutsche Bank	2/3/2018	(150,400)
TRY	7,677,097	USD	2,030,000	Goldman Sachs	2/3/2018	(11,335)
TRY	7,753,281	USD	2,030,000	Citibank	2/3/2018	8,697
USD	4,961,000	BRL	16,391,144	Barclays	2/3/2018	(94,937)
USD	6,615,000	BRL	21,521,903	Goldman Sachs	2/3/2018	(23,547)
USD	2,030,000	EUR	1,628,560	State Street	2/3/2018	41,770
USD	2,030,000	EUR	1,635,451	Barclays	2/3/2018	33,357
USD	2,050,000	GBP	1,440,907	Deutsche Bank	2/3/2018	60,684
USD	2,050,000	GBP	1,448,829	Goldman Sachs	2/3/2018	49,747
USD	2,030,000	HUF	504,913,577	Barclays	2/3/2018	66,805
USD	2,030,000	HUF	509,124,000	Deutsche Bank	2/3/2018	50,434
USD	4,060,000	JPY	442,756,315	Morgan Stanley	2/3/2018	(74,625)
USD	4,060,000	MXN	76,739,038	Toronto Dominion	2/3/2018	(18,011)
USD	4,100,000	RUB	236,168,200	BNP Paribas	2/3/2018	(105,369)
USD	2,030,000	SEK	15,952,704	Barclays	2/3/2018	104,555
USD	2,030,000	SEK	15,993,232	Goldman Sachs	2/3/2018	99,663
USD	4,060,000	TRY	15,474,487	Citibank	2/3/2018	(8,960)
USD	4,060,000	ZAR	49,194,050	HSBC Bank Plc	2/3/2018	(121,843)
ZAR	24,222,141	USD	2,030,000	Goldman Sachs	2/3/2018	29,053
ZAR	24,448,650	USD	2,030,000	Citibank	2/3/2018	48,308
BRL	6,469,610	USD	2,030,000	RBS Plc	5/3/2018	(35,047)
EUR	2,981,500	TRY	14,070,751	Barclays	5/3/2018	(55,522)
IDR	105,658,888,213	USD	7,846,928	Nomura	5/3/2018	(164,963)
IDR	105,828,006,715	USD	7,860,072	JP Morgan	5/3/2018	(165,811)
TRY	28,220,446	EUR	5,963,000	Barclays	5/3/2018	131,783
TRY	20,973,678	USD	5,544,000	Goldman Sachs	5/3/2018	(34,199)
TWD	34,822,000	USD	1,150,000	JP Morgan	5/3/2018	42,576
USD	2,030,000	BRL	6,449,716	BNP Paribas	5/3/2018	41,181
USD	20,449,936	DKK	121,837,404	Bank of America	5/3/2018	469,544
USD	4,438,593	EUR	3,557,000	Nomura	5/3/2018	94,944
USD	2,013,940	EUR	1,640,000	State Street	5/3/2018	11,245

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	731,565,397	EUR	587,521,000	HSBC Bank Plc	5/3/2018	14,111,068
USD	21,502,575	EUR	17,645,028	Goldman Sachs	5/3/2018	(44,743)
USD	8,462,831	EUR	7,021,972	UBS	5/3/2018	(112,086)
USD	298,926,752	GBP	210,641,000	Barclays	5/3/2018	8,070,815
USD	5,394,875	IDR	73,548,336,874	UBS	5/3/2018	47,519
USD	10,312,125	IDR	140,628,494,116	BNP Paribas	5/3/2018	87,682
USD	57,849,946	JPY	6,311,284,500	Barclays	5/3/2018	(1,100,719)
USD	58,142,531	JPY	6,311,284,500	Bank of America	5/3/2018	(808,135)
USD	490,000	KRW	554,925,000	JP Morgan	5/3/2018	(22,512)
USD	5,544,000	TRY	21,218,551	JP Morgan	5/3/2018	(30,129)
USD	1,150,000	TWD	33,528,250	HSBC Bank Plc	5/3/2018	1,732
USD	4,277,972	ZAR	53,125,996	Deutsche Bank	5/3/2018	(235,968)
USD	3,583,719	ZAR	44,539,813	Citibank	5/3/2018	(200,681)
INR	130,539,150	USD	2,030,000	Standard Chartered Bank	6/3/2018	(27,634)
INR	129,554,600	USD	2,030,000	BNP Paribas	6/3/2018	(42,737)
USD	4,060,000	INR	262,499,300	JP Morgan	6/3/2018	33,472
AUD	31,734,422	USD	24,775,000	ANZ	7/3/2018	(26,328)
CAD	31,587,357	USD	24,775,000	Morgan Stanley	7/3/2018	(91,807)
EUR	8,880,000	JPY	1,178,773,254	Goldman Sachs	7/3/2018	(166,380)
EUR	20,237,800	USD	24,775,000	Goldman Sachs	7/3/2018	(57,407)
GBP	17,863,761	USD	24,775,000	Morgan Stanley	7/3/2018	(105,935)
INR	873,789,539	USD	13,687,179	Deutsche Bank	7/3/2018	(286,328)
INR	128,458,205	USD	2,012,821	BNP Paribas	7/3/2018	(42,725)
INR	126,356,925	USD	1,945,000	JP Morgan	7/3/2018	(7,130)
JPY	635,534,002	AUD	7,605,000	Goldman Sachs	7/3/2018	6,226
RUB	1,090,407,863	USD	18,975,000	Deutsche Bank	7/3/2018	429,372
USD	24,775,000	AUD	31,538,413	Morgan Stanley	7/3/2018	179,189
USD	24,775,000	CAD	31,331,605	Morgan Stanley	7/3/2018	291,658
USD	24,775,000	EUR	20,077,669	Credit Suisse	7/3/2018	252,985
USD	24,775,000	GBP	17,643,237	Barclays	7/3/2018	410,469
USD	5,375,000	INR	343,220,625	Nomura	7/3/2018	111,206
USD	12,270,000	INR	794,930,700	Deutsche Bank	7/3/2018	78,565
USD	1,240,000	BRL	3,955,600	Morgan Stanley	8/3/2018	20,648
AUD	14,258,000	USD	11,252,984	HSBC Bank Plc	9/3/2018	(133,617)
EUR	11,203,000	USD	13,743,949	Bank of America	9/3/2018	(58,810)
EUR	3,601,000	USD	4,431,174	Goldman Sachs	9/3/2018	(32,336)
EUR	9,971,100	USD	12,397,318	Deutsche Bank	9/3/2018	(217,019)
GBP	10,210,695	USD	14,358,168	Goldman Sachs	9/3/2018	(256,195)
GBP	4,001,000	USD	5,570,752	UBS	9/3/2018	(44,979)
GBP	596,305	USD	838,524	Morgan Stanley	9/3/2018	(14,968)
GBP	1,001,000	USD	1,399,211	Bank of America	9/3/2018	(16,732)
GBP	2,001,000	USD	2,797,159	Barclays	9/3/2018	(33,581)
TRY	42,019,397	USD	11,147,000	Bank of America	9/3/2018	(122,241)
USD	11,468,009	AUD	14,258,000	UBS	9/3/2018	348,642

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,590,846	EUR	1,300,000	Bank of America	9/3/2018	2,818
USD	5,677,480	EUR	4,601,000	BNP Paribas	9/3/2018	57,081
USD	35,684,620	EUR	28,845,200	UBS	9/3/2018	448,473
USD	8,336,567	GBP	6,004,000	Goldman Sachs	9/3/2018	44,453
USD	834,559	GBP	600,000	Bank of America	9/3/2018	5,900
USD	5,858,988	GBP	4,203,000	Barclays	9/3/2018	54,233
USD	1,674,472	GBP	1,201,000	Morgan Stanley	9/3/2018	15,773
USD	7,582,460	GBP	5,404,000	RBS Plc	9/3/2018	119,006
USD	10,855,000	JPY	1,184,120,931	Deutsche Bank	9/3/2018	(208,686)
USD	15,707,000	ZAR	190,188,210	Citibank	9/3/2018	(442,418)
ZAR	47,747,913	USD	3,987,000	Barclays	9/3/2018	67,410
ZAR	140,392,614	USD	11,720,000	Morgan Stanley	9/3/2018	201,133
KRW	8,309,342,600	USD	7,748,000	HSBC Bank Plc	12/3/2018	(71,336)
USD	19,048,500	RUB	1,105,539,630	Bank of America	12/3/2018	(612,816)
COP	16,657,269,100	USD	5,710,000	Credit Suisse	13/3/2018	98,565
USD	5,710,000	COP	16,638,940,000	Credit Suisse	13/3/2018	(92,174)
USD	3,873,200	JPY	413,738,012	Morgan Stanley	13/3/2018	6,307
USD	9,575,000	TWD	281,026,250	JP Morgan	13/3/2018	(46,461)
JPY	552,382,500	USD	5,000,521	JP Morgan	14/3/2018	162,571
JPY	252,434,000	USD	2,253,753	HSBC Bank Plc	14/3/2018	105,735
JPY	40,000,000	USD	354,384	Morgan Stanley	14/3/2018	19,494
USD	6,738,994	CNH	44,922,131	HSBC Bank Plc	14/3/2018	(354,419)
USD	15,972,508	EUR	13,405,493	Morgan Stanley	14/3/2018	(409,898)
USD	14,182,808	HKD	110,800,000	Barclays	14/3/2018	21,376
USD	11,254,545	HKD	87,829,344	HSBC Bank Plc	14/3/2018	29,010
USD	867,892	JPY	97,839,000	BNY Mellon	14/3/2018	(46,604)
USD	2,242,577	JPY	252,840,000	Morgan Stanley	14/3/2018	(120,705)
USD	2,745,280	JPY	293,675,000	Bank of America	14/3/2018	315
USD	30,460,745	JPY	3,408,209,275	JP Morgan	14/3/2018	(1,395,616)
USD	30,374,327	JPY	3,402,129,619	UBS	14/3/2018	(1,425,208)
USD	480,838	JPY	54,265,000	Deutsche Bank	14/3/2018	(26,374)
USD	16,720,500	TRY	64,229,414	Bank of America	14/3/2018	(105,251)
CAD	5,752,722	USD	4,585,000	RBS Plc	15/3/2018	(88,935)
IDR	15,243,070,259	USD	1,113,446	Bank of America	15/3/2018	(6,686)
USD	14,157,246	IDR	192,113,826,633	HSBC Bank Plc	15/3/2018	208,362
USD	4,631,916	IDR	62,970,900,000	Morgan Stanley	15/3/2018	59,763
USD	2,214,253	IDR	30,191,335,874	Citibank	15/3/2018	22,138
USD	38,028,594	INR	2,444,198,881	Citibank	15/3/2018	596,404
USD	32,396,175	INR	2,088,643,888	Nomura	15/3/2018	409,205
USD	2,605,243	INR	169,445,000	Deutsche Bank	15/3/2018	10,242
USD	4,218,256	KRW	4,585,666,347	Bank of America	15/3/2018	(18,827)
USD	16,720,500	MXN	313,413,705	HSBC Bank Plc	15/3/2018	101,581
USD	2,624,850	THB	85,438,878	BNY Mellon	15/3/2018	(97,999)
USD	2,984,546	TWD	88,118,716	RBS Plc	15/3/2018	(32,123)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,525,095	TWD	45,455,452	Bank of America	15/3/2018	(31,034)
CAD	5,178,048	AUD	5,235,000	Bank of America	16/3/2018	(35,607)
EUR	3,067,996	USD	3,784,978	Nomura	16/3/2018	(35,060)
USD	3,768,462	EUR	3,067,996	Morgan Stanley	16/3/2018	18,544
USD	6,186,931	ZAR	72,763,440	Barclays	16/3/2018	15,246
USD	19,884,275	ZAR	248,851,696	HSBC Bank Plc	16/3/2018	(1,222,952)
ZAR	105,418,498	USD	8,958,216	Bank of America	16/3/2018	(16,778)
CAD	9,314,279	USD	7,250,000	Barclays	19/3/2018	30,212
EUR	7,458,780	USD	9,250,588	Citibank	19/3/2018	(131,682)
EUR	5,014,402	USD	6,195,691	Morgan Stanley	19/3/2018	(65,217)
EUR	11,738,697	USD	14,469,566	Nomura	19/3/2018	(118,147)
EUR	17,207,999	USD	21,212,819	Bank of America	19/3/2018	(174,776)
EUR	3,555,363	USD	4,431,074	Credit Suisse	19/3/2018	(84,382)
EUR	612,906	USD	768,839	RBS Plc	19/3/2018	(19,517)
HKD	246,622,208	USD	31,670,000	JP Morgan	19/3/2018	(144,171)
HUF	770,547,249	PLN	10,400,000	Deutsche Bank	19/3/2018	(41,205)
HUF	559,702,000	PLN	7,600,000	BNP Paribas	19/3/2018	(43,308)
JPY	589,634,070	USD	5,230,000	Barclays	19/3/2018	283,388
JPY	590,397,807	USD	5,230,000	Citibank	19/3/2018	290,529
JPY	579,934,991	USD	5,185,000	HSBC Bank Plc	19/3/2018	237,697
PLN	2,500,000	HUF	188,211,250	Goldman Sachs	19/3/2018	(1,709)
PLN	15,500,000	HUF	1,164,578,550	BNP Paribas	19/3/2018	(1,523)
TRY	7,298,936	USD	1,852,778	Standard Chartered Bank	19/3/2018	56,283
USD	5,236,111	CAD	6,560,076	HSBC Bank Plc	19/3/2018	108,635
USD	2,013,889	CAD	2,523,375	JP Morgan	19/3/2018	41,573
USD	1,437,804	CHF	1,343,333	Bank of America	19/3/2018	12,695
USD	4,934,651	EUR	4,017,529	Morgan Stanley	19/3/2018	22,926
USD	39,125,309	EUR	31,857,961	UBS	19/3/2018	176,613
USD	13,678,364	EUR	11,193,706	RBS Plc	19/3/2018	(6,763)
USD	31,670,000	HKD	246,622,208	JP Morgan	19/3/2018	144,171
USD	2,925,000	INR	193,050,000	HSBC Bank Plc	19/3/2018	(29,401)
USD	3,017,308	JPY	335,041,845	JP Morgan	19/3/2018	(115,509)
USD	12,627,692	JPY	1,415,665,201	Credit Suisse	19/3/2018	(609,521)
USD	1,852,778	TRY	7,135,233	UBS	19/3/2018	(13,466)
CAD	7,155,000	MXN	109,036,713	BNP Paribas	20/3/2018	(184,271)
CAD	3,245,000	MXN	49,353,302	Morgan Stanley	20/3/2018	(78,380)
MXN	157,265,722	CAD	10,400,000	Goldman Sachs	20/3/2018	203,085
USD	17,100,000	IDR	231,814,506,000	HSBC Bank Plc	20/3/2018	279,914
AUD	13,550,000	BRL	34,844,065	BNP Paribas	21/3/2018	(158,993)
AUD	5,210,000	BRL	13,375,633	Barclays	21/3/2018	(54,369)
AUD	18,847,000	CAD	18,635,631	Morgan Stanley	21/3/2018	131,659
AUD	1,675,000	CAD	1,668,702	RBS Plc	21/3/2018	1,940
AUD	13,550,000	CAD	13,496,763	Citibank	21/3/2018	17,486
AUD	8,650,000	CAD	8,594,925	Barclays	21/3/2018	27,647

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	42,222,804	GBP	23,769,000	Bank of America	21/3/2018	80,674
AUD	41,680,000	NOK	255,594,026	Goldman Sachs	21/3/2018	22,014
AUD	10,320,000	NOK	64,298,554	JP Morgan	21/3/2018	(123,325)
AUD	10,320,000	NOK	64,589,877	Morgan Stanley	21/3/2018	(160,349)
AUD	22,330,000	NZD	24,381,914	Bank of America	21/3/2018	(190,579)
AUD	5,210,000	NZD	5,686,663	Citibank	21/3/2018	(42,959)
AUD	3,720,000	NZD	4,074,579	Morgan Stanley	21/3/2018	(40,952)
AUD	8,340,000	NZD	9,090,308	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(59,584)
AUD	10,869,000	NZD	11,839,820	JP Morgan	21/3/2018	(72,592)
AUD	1,040,000	SEK	6,516,696	Morgan Stanley	21/3/2018	23,247
AUD	8,340,000	SEK	53,446,056	Goldman Sachs	21/3/2018	42,901
AUD	3,130,000	USD	2,526,974	JP Morgan	21/3/2018	(85,981)
AUD	11,275,000	USD	8,972,832	Bank of America	21/3/2018	(179,798)
AUD	5,235,000	USD	4,183,561	Citibank	21/3/2018	(100,942)
AUD	6,737,714	USD	5,157,077	HSBC Bank Plc	21/3/2018	97,464
AUD	70,000	USD	55,035	Standard Chartered Bank	21/3/2018	(444)
AUD	8,640,000	USD	6,825,702	Deutsche Bank	21/3/2018	(87,625)
BRL	48,561,005	AUD	18,760,000	BNP Paribas	21/3/2018	318,429
BRL	59,523,928	USD	18,485,000	BNP Paribas	21/3/2018	(161,437)
BRL	14,681,588	USD	4,607,000	Citibank	21/3/2018	(87,490)
BRL	60,537,178	USD	18,703,000	Barclays	21/3/2018	(67,522)
BRL	17,984,160	USD	5,430,000	Goldman Sachs	21/3/2018	106,158
BRL	25,152,190	USD	7,697,000	RBS Plc	21/3/2018	45,730
CAD	8,334,204	AUD	8,340,000	Deutsche Bank	21/3/2018	10,319
CAD	8,286,338	AUD	8,375,000	Bank of America	21/3/2018	(54,391)
CAD	5,176,460	AUD	5,237,000	UBS	21/3/2018	(37,996)
CAD	5,179,303	AUD	5,210,000	Citibank	21/3/2018	(14,718)
CAD	3,426,636	AUD	3,440,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(4,321)
CAD	5,189,832	AUD	5,210,000	Barclays	21/3/2018	(6,488)
CAD	14,188,006	EUR	9,380,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(379,579)
CAD	7,290,000	MXN	114,412,905	JP Morgan	21/3/2018	(362,449)
CAD	8,340,000	NOK	53,864,093	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(326,521)
CAD	36,423,433	NZD	39,676,000	Bank of America	21/3/2018	(177,847)
CAD	3,381,162	USD	2,709,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(66,113)
CAD	6,432,995	USD	5,210,000	Barclays	21/3/2018	(181,646)
CAD	7,771,305	USD	6,282,000	Toronto Dominion	21/3/2018	(207,555)
CAD	2,077,961	USD	1,670,000	JP Morgan	21/3/2018	(45,761)
CAD	15,263,324	USD	12,195,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(264,415)
CAD	4,549,555	USD	3,540,000	BNP Paribas	21/3/2018	16,162
CAD	29,434,142	USD	23,750,000	Citibank	21/3/2018	(742,789)
CHF	11,144,088	USD	11,900,000	Barclays	21/3/2018	(75,195)
CHF	5,849,265	USD	6,252,000	RBS Plc	21/3/2018	(45,443)
CHF	4,843,977	USD	5,235,000	Bank of America	21/3/2018	(95,137)
CHF	5,924,140	USD	6,282,000	Credit Suisse	21/3/2018	4,005

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CHF	163,232	USD	170,000	BNP Paribas	21/3/2018	3,203
CHF	5,092,879	USD	5,210,000	UBS	21/3/2018	193,969
CHF	14,344,362	USD	15,261,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(40,437)
CHF	1,604,729	USD	1,670,000	Morgan Stanley	21/3/2018	32,751
CHF	5,197,344	USD	5,475,000	JP Morgan	21/3/2018	39,815
CNH	46,768,719	USD	7,410,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(27,965)
COP	15,155,325,000	USD	5,235,000	BNP Paribas	21/3/2018	48,712
EUR	2,932,000	AUD	4,602,393	Deutsche Bank	21/3/2018	(4,088)
EUR	4,170,000	CAD	6,232,565	JP Morgan	21/3/2018	227,289
EUR	5,210,000	CAD	7,844,020	Deutsche Bank	21/3/2018	239,382
EUR	14,040,000	MXN	323,159,129	RBS Plc	21/3/2018	49,390
EUR	2,950,000	NZD	4,944,030	Morgan Stanley	21/3/2018	37,329
EUR	2,260,000	NZD	3,787,613	Deutsche Bank	21/3/2018	28,610
EUR	2,604,000	RUB	180,811,040	BNP Paribas	21/3/2018	(27,866)
EUR	3,560,000	SEK	35,751,745	Deutsche Bank	21/3/2018	30,974
EUR	2,506,000	SEK	24,579,936	JP Morgan	21/3/2018	92,753
EUR	1,426,250	SEK	14,206,021	BNP Paribas	21/3/2018	26,587
EUR	10,726,000	USD	13,375,249	Credit Suisse	21/3/2018	(259,751)
EUR	21,405,000	USD	26,671,467	Morgan Stanley	21/3/2018	(497,943)
EUR	53,291,000	USD	66,463,198	Bank of America	21/3/2018	(1,300,233)
EUR	8,775,000	USD	10,886,332	Citibank	21/3/2018	(156,472)
EUR	15,695,000	USD	19,016,313	HSBC Bank Plc	21/3/2018	175,158
EUR	5,000,000	USD	5,944,620	UBS	21/3/2018	169,261
EUR	1,040,000	USD	1,233,655	Deutsche Bank	21/3/2018	38,032
EUR	18,925,000	USD	23,077,705	Goldman Sachs	21/3/2018	63,334
EUR	9,244,000	USD	11,050,083	Nomura	21/3/2018	253,260
GBP	20,942,000	AUD	37,112,910	Deutsche Bank	21/3/2018	(2,401)
GBP	2,827,000	AUD	5,030,220	Barclays	21/3/2018	(16,138)
GBP	20,942,000	NZD	39,797,821	Bank of America	21/3/2018	204,640
GBP	3,246,000	NZD	6,235,420	Barclays	21/3/2018	(16,497)
GBP	4,580,000	SEK	50,567,780	Deutsche Bank	21/3/2018	216,087
GBP	6,250,000	SEK	70,229,063	JP Morgan	21/3/2018	147,050
GBP	4,188,000	USD	5,947,965	Bank of America	21/3/2018	(160,349)
GBP	8,358,000	USD	11,735,432	Barclays	21/3/2018	(185,075)
GBP	4,190,000	USD	5,877,145	RBS Plc	21/3/2018	(86,766)
GBP	10,420,000	USD	14,619,408	Goldman Sachs	21/3/2018	(219,466)
GBP	13,977,000	USD	19,402,611	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(87,066)
GBP	11,088,000	USD	15,411,551	Citibank	21/3/2018	(88,466)
GBP	5,000,000	USD	6,840,713	JP Morgan	21/3/2018	69,048
GBP	10,637,000	USD	14,635,837	Deutsche Bank	21/3/2018	63,989
KRW	8,661,600,300	USD	8,085,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(79,667)
KRW	11,256,757,680	USD	10,470,000	BNP Paribas	21/3/2018	(66,138)
KRW	1,142,295,000	USD	1,050,000	Nomura	21/3/2018	5,746
KRW	19,647,459,740	USD	18,372,000	JP Morgan	21/3/2018	(213,179)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
MXN	115,214,805	CAD	7,290,000	BNP Paribas	21/3/2018	404,927
MXN	333,601,800	EUR	14,040,000	RBS Plc	21/3/2018	503,779
MXN	305,703,412	USD	16,242,571	Barclays	21/3/2018	(48,848)
MXN	333,179,431	USD	17,486,082	Goldman Sachs	21/3/2018	163,100
MXN	188,611,490	USD	10,050,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(58,871)
MXN	63,120,700	USD	3,350,000	Toronto Dominion	21/3/2018	(6,370)
MXN	179,862,333	USD	9,532,857	Deutsche Bank	21/3/2018	(5,189)
MXN	295,125,575	USD	15,601,000	Citibank	21/3/2018	32,395
MXN	91,803,548	USD	4,653,061	UBS	21/3/2018	209,957
MXN	331,781,895	USD	17,484,000	JP Morgan	21/3/2018	91,153
NOK	96,311,263	AUD	15,630,000	Morgan Stanley	21/3/2018	50,651
NOK	129,041,468	AUD	20,840,000	Deutsche Bank	21/3/2018	147,149
NOK	64,741,488	AUD	10,320,000	UBS	21/3/2018	179,617
NOK	97,015,117	AUD	15,530,000	JP Morgan	21/3/2018	218,089
NOK	54,702,060	CAD	8,340,000	Bank of America	21/3/2018	433,017
NOK	179,269,716	NZD	31,331,000	Morgan Stanley	21/3/2018	160,357
NOK	180,532,564	NZD	31,260,000	Bank of America	21/3/2018	372,116
NOK	29,643,899	NZD	5,235,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(12,569)
NOK	35,857,000	NZD	6,250,000	BNP Paribas	21/3/2018	44,157
NOK	47,403,726	NZD	8,340,000	JP Morgan	21/3/2018	2,515
NOK	83,360,000	SEK	84,593,978	Bank of America	21/3/2018	367,308
NOK	83,360,000	SEK	85,002,767	BNP Paribas	21/3/2018	317,889
NOK	72,940,000	SEK	73,003,979	Deutsche Bank	21/3/2018	444,192
NOK	40,171,861	USD	5,210,000	Citibank	21/3/2018	(104,633)
NOK	12,965,154	USD	1,675,000	UBS	21/3/2018	(27,283)
NOK	48,417,714	USD	5,840,000	JP Morgan	21/3/2018	313,316
NOK	168,161,942	USD	21,500,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(128,614)
NZD	11,461,465	AUD	10,420,000	BNP Paribas	21/3/2018	149,560
NZD	11,439,295	AUD	10,420,000	Citibank	21/3/2018	133,551
NZD	9,136,430	AUD	8,340,000	Nomura	21/3/2018	92,887
NZD	23,344,703	AUD	21,289,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	253,501
NZD	14,621,000	CAD	13,528,987	Goldman Sachs	21/3/2018	(17,778)
NZD	16,715,000	CAD	15,478,182	Morgan Stanley	21/3/2018	(29,385)
NZD	8,340,000	CAD	7,545,198	JP Morgan	21/3/2018	124,228
NZD	8,747,877	EUR	5,210,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(54,219)
NZD	30,036,618	GBP	15,707,000	Citibank	21/3/2018	(18,242)
NZD	9,975,294	GBP	5,235,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(31,812)
NZD	6,266,273	GBP	3,246,000	Bank of America	21/3/2018	38,775
NZD	26,086,000	NOK	149,567,558	Morgan Stanley	21/3/2018	(172,742)
NZD	1,047,000	NOK	6,015,545	Citibank	21/3/2018	(8,513)
NZD	20,840,000	NOK	119,217,380	Barclays	21/3/2018	(103,493)
NZD	15,665,000	NOK	89,904,615	Bank of America	21/3/2018	(114,823)
NZD	6,250,000	NOK	35,768,750	Goldman Sachs	21/3/2018	(32,942)
NZD	8,340,000	NOK	47,621,400	JP Morgan	21/3/2018	(30,178)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
NZD	4,188,000	NOK	23,708,729	Credit Suisse	21/3/2018	10,867
NZD	16,721,000	SEK	96,638,420	Deutsche Bank	21/3/2018	390,639
NZD	5,630,000	SEK	32,747,458	BNP Paribas	21/3/2018	106,253
NZD	5,210,000	USD	3,820,701	UBS	21/3/2018	(58,797)
NZD	6,250,000	USD	4,581,194	RBS Plc	21/3/2018	(68,352)
NZD	8,335,000	USD	6,153,868	Goldman Sachs	21/3/2018	(135,542)
NZD	3,141,000	USD	2,303,264	Bank of America	21/3/2018	(35,290)
NZD	9,824,000	USD	7,139,608	Deutsche Bank	21/3/2018	(46,143)
NZD	23,960,000	USD	17,533,958	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(233,527)
NZD	5,418,000	USD	3,974,699	Citibank	21/3/2018	(62,607)
NZD	8,965,000	USD	6,585,131	Morgan Stanley	21/3/2018	(111,911)
RUB	91,553,840	EUR	1,304,000	Bank of America	21/3/2018	31,886
RUB	90,469,600	EUR	1,300,000	BNP Paribas	21/3/2018	17,517
RUB	971,124,323	USD	17,125,000	Bank of America	21/3/2018	126,308
RUB	650,219,763	USD	11,485,000	BNP Paribas	21/3/2018	65,676
RUB	443,880,450	USD	7,590,000	Deutsche Bank	21/3/2018	295,209
RUB	497,803,100	USD	8,468,000	JP Morgan	21/3/2018	375,106
RUB	488,116,916	USD	8,228,400	Barclays	21/3/2018	442,638
SEK	53,063,926	AUD	8,340,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(89,097)
SEK	6,523,400	AUD	1,040,000	Citibank	21/3/2018	(22,436)
SEK	73,218,356	CHF	8,376,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(36,101)
SEK	50,998,477	EUR	5,210,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(205,342)
SEK	12,307,155	EUR	1,256,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(47,967)
SEK	12,363,844	EUR	1,256,000	Goldman Sachs	21/3/2018	(41,114)
SEK	14,206,021	EUR	1,426,250	BNP Paribas	21/3/2018	(26,587)
SEK	12,306,181	EUR	1,250,000	JP Morgan	21/3/2018	(40,748)
SEK	49,198,588	GBP	4,425,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(167,410)
SEK	72,143,143	GBP	6,405,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(129,856)
SEK	56,563,044	NOK	55,300,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(189,939)
SEK	107,403,755	NOK	104,705,000	Barclays	21/3/2018	(322,479)
SEK	172,983,337	NOK	166,720,000	RBS Plc	21/3/2018	(275,785)
SEK	73,363,672	NOK	72,940,000	Citibank	21/3/2018	(400,707)
SEK	85,306,456	NOK	83,360,000	JP Morgan	21/3/2018	(281,175)
SEK	28,721,935	NOK	28,060,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(93,833)
SEK	60,645,508	NZD	10,471,000	Barclays	21/3/2018	(229,062)
SEK	124,068,481	NZD	20,840,000	Bank of America	21/3/2018	(48,700)
SEK	60,573,164	NZD	10,471,000	Citibank	21/3/2018	(237,807)
SEK	32,888,788	NZD	5,630,000	Morgan Stanley	21/3/2018	(89,168)
SEK	73,518,944	NZD	12,500,000	JP Morgan	21/3/2018	(137,811)
SEK	25,333,384	USD	3,141,000	Bank of America	21/3/2018	(78,390)
SEK	33,062,679	USD	4,170,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(172,978)
SEK	132,452,439	USD	16,528,000	Citibank	21/3/2018	(515,525)
TRY	37,922,549	USD	9,873,551	Citibank	21/3/2018	38,997
TRY	9,616,250	USD	2,500,000	Morgan Stanley	21/3/2018	13,585

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
TRY	17,137,386	USD	4,475,949	JP Morgan	21/3/2018	3,581
TRY	6,367,261	USD	1,675,000	Goldman Sachs	21/3/2018	(10,666)
TRY	13,590,865	USD	3,547,000	Deutsche Bank	21/3/2018	5,507
TRY	20,731,044	USD	5,432,000	RBS Plc	21/3/2018	(13,127)
TRY	39,515,566	USD	10,265,500	Bank of America	21/3/2018	63,446
TRY	8,826,576	USD	2,290,000	Barclays	21/3/2018	17,173
TRY	83,142,538	USD	21,764,000	BNP Paribas	21/3/2018	(31,429)
USD	2,958,488	AUD	3,750,000	Goldman Sachs	21/3/2018	33,975
USD	2,531,716	AUD	3,130,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	90,723
USD	3,268,181	AUD	4,188,000	Bank of America	21/3/2018	2,086
USD	9,688,238	AUD	12,369,714	Deutsche Bank	21/3/2018	41,470
USD	53,634	AUD	70,000	Barclays	21/3/2018	(957)
USD	1,431,378	AUD	1,870,000	Nomura	21/3/2018	(26,979)
USD	4,334,377	AUD	5,520,000	JP Morgan	21/3/2018	29,495
USD	11,687,000	BRL	37,202,932	Barclays	21/3/2018	234,627
USD	8,314,000	BRL	27,682,294	RBS Plc	21/3/2018	(207,586)
USD	22,411,000	BRL	73,394,838	BNP Paribas	21/3/2018	(182,517)
USD	5,125,000	BRL	16,428,624	JP Morgan	21/3/2018	67,691
USD	5,235,000	CAD	6,594,069	BNP Paribas	21/3/2018	80,743
USD	6,282,000	CAD	7,710,590	HSBC Bank Plc	21/3/2018	255,014
USD	14,658,000	CAD	18,527,991	Toronto Dominion	21/3/2018	175,587
USD	4,587,000	CAD	5,777,349	Deutsche Bank	21/3/2018	71,132
USD	15,290,000	CAD	19,104,555	Citibank	21/3/2018	356,915
USD	4,194,000	CAD	5,381,418	RBS Plc	21/3/2018	(12,388)
USD	9,372,000	CAD	11,681,901	Bank of America	21/3/2018	240,837
USD	14,590,000	CAD	18,303,950	Barclays	21/3/2018	282,709
USD	11,462,000	CHF	11,153,901	Goldman Sachs	21/3/2018	(373,218)
USD	5,210,000	CHF	4,968,696	Barclays	21/3/2018	(62,200)
USD	6,282,000	CHF	5,831,888	Citibank	21/3/2018	93,881
USD	5,210,000	CHF	5,089,406	Morgan Stanley	21/3/2018	(190,284)
USD	11,072,000	CHF	10,526,769	Deutsche Bank	21/3/2018	(97,778)
USD	10,420,000	CHF	10,038,070	UBS	21/3/2018	(231,229)
USD	7,410,000	CNH	46,853,430	HSBC Bank Plc	21/3/2018	14,594
USD	5,235,000	COP	14,815,050,000	BNP Paribas	21/3/2018	69,921
USD	5,291,922	EUR	4,250,000	Credit Suisse	21/3/2018	95,123
USD	36,256,880	EUR	29,128,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	639,855
USD	6,617,771	EUR	5,285,000	Morgan Stanley	21/3/2018	155,399
USD	10,879,198	EUR	8,775,000	Citibank	21/3/2018	149,338
USD	2,544,824	EUR	2,035,000	UBS	21/3/2018	56,475
USD	6,525,095	EUR	5,300,000	Barclays	21/3/2018	44,381
USD	3,781,980	EUR	3,120,000	JP Morgan	21/3/2018	(33,082)
USD	31,789,915	EUR	26,013,000	Deutsche Bank	21/3/2018	(18,162)
USD	6,277,321	EUR	5,210,000	Nomura	21/3/2018	(93,343)
USD	1,536,266	EUR	1,250,000	Goldman Sachs	21/3/2018	7,796

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	3,202,900	EUR	2,605,000	BNP Paribas	21/3/2018	17,568
USD	5,965,479	GBP	4,188,000	JP Morgan	21/3/2018	177,864
USD	5,952,698	GBP	4,188,000	UBS	21/3/2018	165,082
USD	4,058,826	GBP	2,932,000	Morgan Stanley	21/3/2018	6,942
USD	6,713,263	GBP	4,816,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	57,782
USD	5,873,236	GBP	4,190,000	Bank of America	21/3/2018	82,857
USD	2,913,165	GBP	2,080,000	RBS Plc	21/3/2018	38,704
USD	21,085,219	GBP	15,210,000	Deutsche Bank	21/3/2018	65,727
USD	27,429,629	GBP	19,844,000	Citibank	21/3/2018	6,171
USD	1,703,488	GBP	1,250,000	Nomura	21/3/2018	(23,953)
USD	11,978,251	GBP	8,568,000	Barclays	21/3/2018	137,685
USD	4,275,517	GBP	3,130,000	Credit Suisse	21/3/2018	(49,993)
USD	4,170,000	KRW	4,421,868,000	Citibank	21/3/2018	83,166
USD	1,050,000	KRW	1,116,150,000	BNP Paribas	21/3/2018	18,418
USD	20,662,000	KRW	22,090,936,220	JP Morgan	21/3/2018	244,839
USD	15,820,000	KRW	17,073,355,130	HSBC Bank Plc	21/3/2018	40,250
USD	6,260,000	MXN	120,274,632	JP Morgan	21/3/2018	(111,188)
USD	15,095,000	MXN	283,116,435	Goldman Sachs	21/3/2018	97,754
USD	3,560,000	MXN	67,457,016	Nomura	21/3/2018	(13,333)
USD	12,183,000	MXN	230,017,561	Morgan Stanley	21/3/2018	(1,492)
USD	5,749,000	MXN	107,963,321	Deutsche Bank	21/3/2018	29,966
USD	20,400,000	MXN	395,885,587	Barclays	21/3/2018	(570,854)
USD	21,790,000	MXN	420,852,015	Citibank	21/3/2018	(503,375)
USD	2,688,571	MXN	51,987,860	Bank of America	21/3/2018	(65,330)
USD	12,851,000	MXN	247,086,645	BNP Paribas	21/3/2018	(237,675)
USD	1,675,000	NOK	12,797,578	JP Morgan	21/3/2018	48,580
USD	1,460,000	NOK	11,522,378	Goldman Sachs	21/3/2018	(4,357)
USD	10,010,000	NOK	80,574,429	Citibank	21/3/2018	(230,053)
USD	15,655,000	NOK	123,770,747	Morgan Stanley	21/3/2018	(74,792)
USD	2,160,196	NZD	2,917,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	53,963
USD	23,086,979	NZD	31,260,000	Bank of America	21/3/2018	515,550
USD	15,510,230	NZD	21,691,000	Citibank	21/3/2018	(151,858)
USD	11,109,898	NZD	15,235,000	Deutsche Bank	21/3/2018	109,395
USD	22,285,400	RUB	1,289,832,763	Deutsche Bank	21/3/2018	(627,530)
USD	12,631,000	RUB	736,161,873	Bank of America	21/3/2018	(446,374)
USD	16,931,000	RUB	970,404,660	BNP Paribas	21/3/2018	(307,525)
USD	5,224,000	SEK	41,924,219	Morgan Stanley	21/3/2018	155,686
USD	7,969,000	SEK	63,779,393	JP Morgan	21/3/2018	258,564
USD	7,500,000	SEK	59,996,000	Deutsche Bank	21/3/2018	246,947
USD	6,282,000	TRY	23,937,142	RBS Plc	21/3/2018	25,087
USD	1,000,000	TRY	3,837,652	Goldman Sachs	21/3/2018	(3,121)
USD	2,860,000	TRY	10,966,670	BNP Paribas	21/3/2018	(6,570)
USD	29,280,000	TRY	116,212,232	Deutsche Bank	21/3/2018	(1,096,635)
USD	11,688,000	TRY	44,868,584	Barclays	21/3/2018	(40,168)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	8,376,000	JPY	697,463,656	Bank of America	22/3/2018	9,044
AUD	5,210,000	JPY	454,413,595	Deutsche Bank	22/3/2018	(186,858)
AUD	5,941,000	JPY	516,564,498	Goldman Sachs	22/3/2018	(198,049)
CHF	18,149,000	JPY	2,131,776,054	Citibank	22/3/2018	(678,310)
CHF	6,981,000	JPY	813,914,790	Deutsche Bank	22/3/2018	(204,128)
CHF	10,420,000	JPY	1,217,772,607	JP Morgan	22/3/2018	(331,854)
CHF	14,659,000	JPY	1,726,280,487	Barclays	22/3/2018	(589,388)
EUR	5,315,000	JPY	711,268,182	Barclays	22/3/2018	(152,663)
EUR	4,790,000	JPY	649,824,333	JP Morgan	22/3/2018	(220,009)
JPY	318,532,852	AUD	3,769,500	HSBC Bank Plc	22/3/2018	39,413
JPY	702,694,468	AUD	8,376,000	JP Morgan	22/3/2018	39,878
JPY	114,594,975	AUD	1,361,000	RBS Plc	22/3/2018	10,366
JPY	456,307,430	AUD	5,210,000	Bank of America	22/3/2018	204,570
JPY	405,665,256	AUD	4,580,000	Citibank	22/3/2018	222,249
JPY	1,734,013,110	CHF	14,659,000	Deutsche Bank	22/3/2018	661,708
JPY	1,224,756,221	CHF	10,471,000	Citibank	22/3/2018	343,049
JPY	1,217,769,770	CHF	10,420,000	Bank of America	22/3/2018	331,827
JPY	217,484,985	EUR	1,635,000	State Street	22/3/2018	34,661
JPY	490,443,904	EUR	3,680,000	Citibank	22/3/2018	86,771
JPY	653,236,250	EUR	4,790,000	RBS Plc	22/3/2018	251,920
JPY	456,990,768	SEK	33,340,000	Deutsche Bank	22/3/2018	243,193
JPY	1,196,042,917	USD	10,905,000	BNP Paribas	22/3/2018	281,196
JPY	800,257,814	USD	7,318,000	Bank of America	22/3/2018	166,548
JPY	578,156,406	USD	5,305,000	UBS	22/3/2018	102,307
JPY	446,243,434	USD	4,156,000	Nomura	22/3/2018	17,568
JPY	578,188,767	USD	5,305,000	Credit Suisse	22/3/2018	102,609
JPY	3,276,553,348	USD	29,823,000	Morgan Stanley	22/3/2018	821,525
JPY	1,296,202,811	USD	11,703,111	Deutsche Bank	22/3/2018	419,847
JPY	1,045,397,817	USD	9,485,000	Goldman Sachs	22/3/2018	292,261
JPY	998,664,649	USD	9,098,000	Barclays	22/3/2018	242,181
JPY	11,957,485,309	USD	109,534,000	Citibank	22/3/2018	2,300,422
JPY	1,459,530,940	USD	13,110,000	RBS Plc	22/3/2018	540,512
SEK	33,340,000	JPY	455,030,487	JP Morgan	22/3/2018	(224,859)
USD	22,574,000	JPY	2,487,158,172	RBS Plc	22/3/2018	(687,571)
USD	7,645,000	JPY	829,817,649	Deutsche Bank	22/3/2018	(116,012)
USD	7,275,385	JPY	782,641,506	BNP Paribas	22/3/2018	(44,403)
USD	26,780,000	JPY	2,927,041,903	Morgan Stanley	22/3/2018	(595,659)
USD	1,665,000	JPY	183,830,152	Bank of America	22/3/2018	(54,303)
USD	9,910,000	JPY	1,104,438,884	UBS	22/3/2018	(419,453)
USD	31,113,111	JPY	3,385,394,247	Goldman Sachs	22/3/2018	(549,366)
USD	40,946,726	JPY	4,438,728,163	Citibank	22/3/2018	(567,236)
USD	25,750,000	JPY	2,843,367,686	HSBC Bank Plc	22/3/2018	(843,082)
USD	12,280,535	MXN	236,310,645	RBS Plc	22/3/2018	(235,207)
USD	2,230,000	ZAR	28,008,800	Morgan Stanley	22/3/2018	(143,398)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	17,938,000	ZAR	221,191,144	Barclays	22/3/2018	(805,206)
USD	11,280,182	ZAR	38,144,038	JP Morgan	22/3/2018	(425,812)
USD	6,282,000	ZAR	72,866,639	Goldman Sachs	22/3/2018	107,456
USD	5,235,448	ZAR	62,767,892	Citibank	22/3/2018	(83,351)
USD	1,040,000	ZAR	14,010,982	Standard Chartered Bank	22/3/2018	(147,257)
USD	15,120,000	ZAR	201,298,566	RBS Plc	22/3/2018	(1,937,556)
USD	830,000	ZAR	10,645,027	Deutsche Bank	22/3/2018	(72,034)
USD	19,598,552	ZAR	236,965,193	BNP Paribas	22/3/2018	(481,308)
USD	3,273,500	ZAR	41,888,485	HSBC Bank Plc	22/3/2018	(276,030)
ZAR	74,307,963	USD	6,282,000	Bank of America	22/3/2018	14,678
ZAR	148,240,224	USD	12,532,000	Barclays	22/3/2018	29,521
ZAR	99,758,193	USD	8,586,000	Credit Suisse	22/3/2018	(132,731)
ZAR	17,147,182	USD	1,464,182	Toronto Dominion	22/3/2018	(11,171)
ZAR	20,753,090	USD	1,670,000	Morgan Stanley	22/3/2018	88,567
ZAR	106,720,625	USD	8,340,000	HSBC Bank Plc	22/3/2018	703,249
ZAR	73,178,434	USD	6,040,000	Goldman Sachs	22/3/2018	160,965
ZAR	93,355,674	USD	7,743,000	JP Morgan	22/3/2018	167,735
ZAR	452,065,007	USD	37,094,000	BNP Paribas	22/3/2018	1,212,900
IDR	287,347,694,812	USD	21,339,229	JP Morgan	26/3/2018	(506,734)
IDR	227,628,907,000	USD	16,652,931	UBS	26/3/2018	(150,003)
IDR	386,703,403,415	USD	28,379,818	BNP Paribas	26/3/2018	(344,106)
IDR	554,338,720,000	USD	41,480,000	Barclays	26/3/2018	(1,290,852)
IDR	462,674,340,018	USD	34,220,746	Deutsche Bank	26/3/2018	(677,198)
IDR	170,867,015,379	USD	12,716,158	RBS Plc	26/3/2018	(328,425)
USD	21,096,895	IDR	289,328,086,630	BNP Paribas	26/3/2018	120,822
USD	5,274,224	IDR	72,267,412,315	Goldman Sachs	26/3/2018	34,890
USD	2,554,658	IDR	35,003,925,697	Citibank	26/3/2018	16,899
USD	122,555,801	IDR	1,641,259,260,735	Barclays	26/3/2018	3,565,716
USD	4,456,847	IDR	59,570,216,419	HSBC Bank Plc	26/3/2018	138,050
USD	7,280,000	IDR	99,444,800,000	JP Morgan	26/3/2018	70,325
AUD	10,641,400	NZD	11,426,948	UBS	27/3/2018	48,503
COP	16,420,532,500	USD	5,710,000	Deutsche Bank	28/3/2018	13,766
COP	16,292,514,300	USD	5,710,000	RBS Plc	28/3/2018	(30,858)
USD	5,710,000	COP	16,187,850,000	Barclays	28/3/2018	67,341
USD	5,710,000	COP	16,267,790,000	RBS Plc	28/3/2018	39,476
AUD	4,256,560	USD	3,330,511	UBS	29/3/2018	(10,944)
AUD	1,619,084	USD	1,273,212	Credit Suisse	29/3/2018	(10,536)
AUD	4,765,756	USD	3,748,225	Morgan Stanley	29/3/2018	(31,551)
EUR	3,909,600	BRL	15,810,422	Deutsche Bank	29/3/2018	(79,133)
RUB	943,331,235	USD	16,786,000	Bank of America	29/3/2018	(45,282)
BRL	119,012,578	USD	36,635,600	UBS	3/4/2018	(49,895)
ARS	223,392,600	USD	11,070,000	Citibank	4/4/2018	(134,627)
IDR	125,417,270,700	USD	9,156,550	Deutsche Bank	4/4/2018	(73,483)
USD	15,574,000	ARS	302,182,322	Citibank	4/4/2018	781,763

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	7,018,220	BRL	23,497,000	Goldman Sachs	4/4/2018	(204,236)
USD	9,149,871	IDR	125,417,270,700	HSBC Bank Plc	4/4/2018	66,803
USD	58,515,284	JPY	6,266,314,000	HSBC Bank Plc	4/4/2018	(147,798)
USD	7,459,207	KRW	8,000,000,000	HSBC Bank Plc	4/4/2018	61,192
ARS	47,531,288	USD	2,369,403	BNP Paribas	5/4/2018	(43,954)
ARS	42,691,943	USD	2,134,597	JP Morgan	5/4/2018	(45,911)
CLP	3,433,994,000	USD	5,710,000	UBS	5/4/2018	67,785
RUB	500,822,480	EUR	7,036,000	Bank of America	9/4/2018	260,435
TRY	229,257,893	USD	59,811,998	BNP Paribas	9/4/2018	(229,553)
TRY	71,342,951	USD	18,605,299	JP Morgan	9/4/2018	(63,789)
USD	5,710,000	COP	16,334,028,959	Credit Suisse	9/4/2018	19,076
USD	80,257,086	TRY	307,111,986	BNP Paribas	9/4/2018	440,931
USD	3,330,000	BRL	10,750,905	Deutsche Bank	11/4/2018	27,868
USD	40,940,537	RUB	2,364,561,632	Deutsche Bank	12/4/2018	(954,943)
ARS	234,300,222	USD	11,509,000	Citibank	20/4/2018	(140,101)
ARS	39,072,000	USD	1,920,000	BNP Paribas	20/4/2018	(24,118)
USD	27,284,000	MXN	513,160,200	HSBC Bank Plc	23/4/2018	246,223
USD	10,494,000	ARS	214,418,655	Deutsche Bank	2/5/2018	159,256
EUR	250,000	USD	307,572	JP Morgan	11/5/2018	(713)
EUR	320,000	USD	397,699	Bank of America	11/5/2018	(4,919)
EUR	1,263,000	USD	1,564,099	Citibank	11/5/2018	(13,849)
EUR	330,000	USD	410,042	Goldman Sachs	11/5/2018	(4,988)
GBP	3,410,000	EUR	3,827,697	Citibank	11/5/2018	24,729
GBP	528,000	USD	736,731	Morgan Stanley	11/5/2018	(5,431)
GBP	470,000	USD	657,453	Goldman Sachs	11/5/2018	(6,485)
GBP	350,000	USD	487,751	Citibank	11/5/2018	(2,988)
GBP	420,000	USD	586,377	Barclays	11/5/2018	(4,661)
USD	7,700,715	GBP	5,500,000	Citibank	11/5/2018	83,004
CHF	27,160,000	EUR	23,661,628	Bank of America	14/5/2018	(96,620)
EUR	4,422,071	SEK	44,400,000	Deutsche Bank	14/5/2018	39,344
EUR	1,059,294	SEK	10,500,000	JP Morgan	14/5/2018	25,921
EUR	46,895,000	USD	57,666,735	Barclays	14/5/2018	(92,475)
GBP	41,240,000	EUR	46,420,166	Barclays	14/5/2018	135,029
GBP	39,720,000	USD	55,473,548	HSBC Bank Plc	14/5/2018	(452,755)
IDR	39,300,000,000	USD	2,882,077	Morgan Stanley	14/5/2018	(45,044)
JPY	2,042,715,000	USD	18,917,181	Bank of America	14/5/2018	257,271
JPY	3,614,000,000	USD	33,922,487	Deutsche Bank	14/5/2018	1,222
JPY	3,186,000,000	USD	29,461,610	Morgan Stanley	14/5/2018	444,571
JPY	2,042,715,000	USD	18,905,100	Citibank	14/5/2018	269,352
PLN	88,000,000	EUR	20,893,749	HSBC Bank Plc	14/5/2018	108,732
RUB	357,010,000	USD	6,057,691	Morgan Stanley	14/5/2018	247,021
RUB	48,200,000	USD	825,060	JP Morgan	14/5/2018	26,140
RUB	493,950,000	USD	8,535,658	Bank of America	14/5/2018	187,381
SEK	223,092,973	EUR	22,401,761	Bank of America	14/5/2018	(421,810)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
TRY	29,285,000	USD	7,448,243	Citibank	14/5/2018	86,794
USD	5,763,797	CNY	36,920,000	HSBC Bank Plc	14/5/2018	(38,940)
USD	55,373,346	EUR	45,030,000	Barclays	14/5/2018	88,798
USD	90,067,291	GBP	65,070,000	Barclays	14/5/2018	(68,736)
USD	25,450,538	GBP	18,250,000	Deutsche Bank	14/5/2018	170,339
USD	2,105,782	IDR	28,965,030,614	Bank of America	14/5/2018	14,821
USD	4,090,559	INR	265,600,000	Goldman Sachs	14/5/2018	56,577
USD	2,294,993	JPY	243,416,857	Citibank	14/5/2018	10,100
USD	11,394,633	JPY	1,208,583,143	Deutsche Bank	14/5/2018	49,967
USD	739,714	RUB	42,700,000	HSBC Bank Plc	14/5/2018	(14,358)
USD	23,265,260	RUB	1,347,130,000	Bank of America	14/5/2018	(524,735)
USD	3,158,196	TRY	12,130,000	Bank of America	14/5/2018	37,145
USD	4,194,008	TRY	16,490,000	Citibank	14/5/2018	(48,873)
USD	10,070,843	ZAR	118,985,000	Barclays	14/5/2018	63,981
USD	19,452,961	ZAR	230,965,000	BNP Paribas	14/5/2018	28,370
ARS	139,623,074	USD	6,697,000	BNP Paribas	16/5/2018	(23,852)
USD	4,525,612	MYR	17,552,587	Citibank	16/5/2018	61,568
USD	11,247,222	MYR	43,639,124	UBS	16/5/2018	148,745
USD	9,054,346	MYR	35,092,388	Morgan Stanley	16/5/2018	129,510
USD	4,452,084	MYR	17,271,861	Goldman Sachs	16/5/2018	59,435
CNH	12,127,530	USD	1,765,000	HSBC Bank Plc	17/5/2018	142,802
USD	1,765,000	CNH	12,260,749	HSBC Bank Plc	17/5/2018	(163,759)
ARS	138,835,449	USD	6,714,000	Citibank	21/5/2018	(98,588)
CNH	83,101,928	USD	11,785,000	HSBC Bank Plc	21/5/2018	1,284,587
USD	11,785,000	CNH	83,113,713	JP Morgan	21/5/2018	(1,286,441)
USD	3,045,556	EUR	2,469,561	Nomura	21/5/2018	11,929
TRY	315,626,000	USD	81,641,826	BNP Paribas	25/6/2018	(1,422,156)
USD	21,154,762	TRY	84,137,776	Citibank	25/6/2018	(229,739)
USD	59,691,146	TRY	231,488,224	BNP Paribas	25/6/2018	855,978
CNH	128,090,808	USD	20,002,000	JP Morgan	20/8/2018	43,472
TRY	192,662,000	USD	49,557,445	BNP Paribas	20/8/2018	(1,407,182)
USD	20,002,000	CNH	127,412,740	Deutsche Bank	20/8/2018	62,642
USD	27,585,141	TRY	111,175,372	Citibank	20/8/2018	(199,910)
USD	20,064,644	TRY	81,486,628	BNP Paribas	20/8/2018	(300,569)
MXN	531,249,492	USD	27,284,000	HSBC Bank Plc	26/11/2018	(239,413)
MXN	85,946,400	USD	4,320,000	Barclays	14/6/2019	(68,756)
USD	4,320,000	MXN	85,060,800	Barclays	14/6/2019	112,562
未実現純評価益						9,412,898
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	144,015,082	USD	112,131,097	BNY Mellon	14/3/2018	181,825
USD	1,105,794	AUD	1,415,724	BNY Mellon	14/3/2018	1,713
未実現純評価益						183,538

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	600,895,716	USD	476,779,938	BNY Mellon	14/3/2018	(7,155,115)
USD	2,672,856	CAD	3,370,282	BNY Mellon	14/3/2018	38,842
未実現純評価損						(7,116,273)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	249,834,480	USD	266,754,302	BNY Mellon	14/3/2018	(1,838,891)
USD	1,553,874	CHF	1,450,356	BNY Mellon	14/3/2018	15,964
未実現純評価損						(1,822,927)
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,069,971	USD	642,609	BNY Mellon	14/3/2018	59
USD	4,116	CNY	26,085	BNY Mellon	14/3/2018	(3)
未実現純評価益						56
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	2,924,766,741	USD	3,588,308,167	BNY Mellon	14/3/2018	(14,034,221)
USD	166,845,161	EUR	135,270,171	BNY Mellon	14/3/2018	1,534,464
未実現純評価損						(12,499,757)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,527,527,997	USD	2,114,670,348	BNY Mellon	14/3/2018	(4,459,138)
USD	41,267,418	GBP	29,751,844	BNY Mellon	14/3/2018	166,536
未実現純評価損						(4,292,602)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	6,071,924	USD	777,118	BNY Mellon	14/3/2018	(1,060)
USD	5,150	HKD	40,239	BNY Mellon	14/3/2018	7
未実現純評価損						(1,053)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	56,491,860,326	USD	518,854,198	BNY Mellon	14/3/2018	9,163,982
USD	3,570,030	JPY	386,936,355	BNY Mellon	14/3/2018	(46,602)
未実現純評価益						9,117,380
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	301,009,096	USD	87,932,766	BNY Mellon	14/3/2018	66,873
USD	3,137,528	PLN	10,597,547	BNY Mellon	14/3/2018	39,337
未実現純評価益						106,210
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,216,431,161	USD	149,860,423	BNY Mellon	14/3/2018	(2,887,868)
USD	4,040,609	SEK	32,680,223	BNY Mellon	14/3/2018	92,080
未実現純評価損						(2,795,788)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	86,697,030	USD	65,151,729	BNY Mellon	14/3/2018	355,374
USD	1,226,416	SGD	1,619,004	BNY Mellon	14/3/2018	3,117
未実現純評価益						358,491
未実現純評価損合計						(9,349,827)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2018年2月28日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(15)	HKD	Hang Seng Index	2018年2月	(26,422)
113	AUD	Australian 10 Year Bond	2018年3月	73,520
2	AUD	Australian 3 Year Bond	2018年3月	744
1,508	EUR	EURO STOXX 600 Bank Index	2018年3月	63,661
376	EUR	VSTOXX Mini Index	2018年3月	124,453
290	EUR	3 Month EURIBOR	2018年3月	6,562
16	EUR	DAX Index	2018年3月	(309,364)
14	EUR	Euro Schatz	2018年3月	1,236
(137)	EUR	Euro Bund	2018年3月	(181,295)
(253)	EUR	30 Year Euro-BUXL	2018年3月	(444,640)
(560)	EUR	Euro BOBL	2018年3月	(367,102)
(591)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2018年3月	1,277,145
(1,099)	EUR	Euro-OAT	2018年3月	1,792,770
(1,445)	EUR	Euro-BTP	2018年3月	239,930
(8)	JPY	Nikkei 225 (OSE)	2018年3月	(38,194)
(167)	JPY	TOPIX Index	2018年3月	1,336,228
(292)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2018年3月	(642,480)
292	KRW	Korean 10 Year Bond	2018年3月	(711,866)
1,026	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年3月	(224,399)
850	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2018年3月	(270,610)
742	USD	90 Day Euro \$	2018年3月	(56,632)
556	USD	Russell 2000 Mini Index	2018年3月	430,764
552	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2018年3月	17,683
43	USD	CBOE Volatility Index	2018年3月	(30,100)
(494)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2018年3月	(414,371)
376	EUR	VSTOXX Mini Index	2018年4月	(156,629)
235	USD	CBOE Volatility Index	2018年4月	108,750
55	USD	CBOE Volatility Index	2018年5月	(16,550)
(147)	CAD	Canadian 10 Year Bond	2018年6月	(59,054)
193	EUR	3 Month EURIBOR	2018年6月	(4,364)
(6)	EUR	Euro BOBL	2018年6月	(293)
(7)	EUR	Euro Bund	2018年6月	(1,282)
1,009	GBP	90 Day Sterling	2018年6月	(119,301)
(1,013)	GBP	Long Gilt	2018年6月	(451,726)
109	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2018年6月	(94,598)
19,775	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年6月	(3,244,884)
722	USD	US Ultra Bond (CBT)	2018年6月	578,593
706	USD	US Ultra 10 Year Note	2018年6月	(76,047)
353	USD	90 Day Euro \$	2018年6月	(89,738)
55	USD	CBOE Volatility Index	2018年6月	(17,650)
(2,797)	USD	US Long Bond (CBT)	2018年6月	(2,840,778)
(6,110)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2018年6月	1,826,660
(10,528)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2018年6月	3,581,720
700	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	(259,436)
(290)	EUR	3 Month EURIBOR	2019年3月	(42,608)

未決済上場先物取引 2018年2月28日現在(続き)

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
2,171	USD	90 Day Euro \$	2019年3月	(809,334)
(193)	EUR	3 Month EURIBOR	2019年6月	(15,718)
(169)	GBP	90 Day Sterling	2019年6月	43,748
(353)	USD	90 Day Euro \$	2019年6月	76,913
(1,442)	USD	90 Day Euro \$	2019年12月	683,533
(1,585)	USD	90 Day Euro \$	2020年3月	1,704,379
(586)	USD	90 Day Euro \$	2020年6月	92,990
合計				2,044,517

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2018年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	376,084	166,103
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(298,157)	(171,450)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(46,431)	(63,442)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(28,381)	(39,652)
CDS	USD 360,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2022	(4,627)	(1,106)
CDS	EUR 35,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(60)	639
CDS	USD 3,063,437	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(55,110)	60,913
CDS	EUR 606,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(1,031)	11,068
CDS	EUR (1,210,000)	ファンドはWPP 2005 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	Bank of America	20/12/2022	1,017	25,680
CDS	EUR (3,130,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2022	2,033	(47,233)
CDS	USD 1,500,000	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(26,559)	29,826
CDS	EUR 330,000	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	Bank of America	20/12/2022	(9,790)	(13,837)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	78,163	53,672
CDS	JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(19,170)	(31,684)
CDS	JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(18,377)	(16,363)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	JPY 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	(16,815)	(23,791)
CDS	USD 2,050,895	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(46,239)	(48,095)
CDS	EUR 300,000	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	15,073	11,229
CDS	USD 42,000,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(12,460)	(864,855)
CDS	USD 4,556,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	15,143	7,250
CDS	USD 7,852,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(21,636)	12,496
CDS	EUR 330,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	2,805	11,977
CDS	EUR 230,000	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	20/12/2022	1,834	(48,858)
CDS	EUR 860,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(1,929)	15,707
CDS	EUR (250,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2022	(1,796)	47,089
CDS	USD 9,111,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	30,282	14,499
CDS	USD 4,556,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	16,161	7,250
CDS	USD (63,971,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(134,859)	4,587,444
CDS	EUR (620,000)	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	20/12/2022	2,585	3,084
CDS	USD 5,512,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	17,088	8,772
CDS	EUR (20,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2022	(144)	3,767
CDS	EUR 330,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	8,323	(12,988)
CDS	EUR (1,190,000)	ファンドはWPP 2005 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	Barclays	20/12/2022	(626)	25,256

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 5,173,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	59,640	(545,291)
CDS	EUR 1,870,000	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	20/12/2022	1,792	(38,161)
CDS	EUR (6,230,000)	ファンドはImperial Brands Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2022	2,684	135,794
CDS	EUR 660,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(10,393)	23,953
CDS	EUR 660,000	ファンドはAssicurazioni Generali SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(9,927)	13,087
CDS	EUR 102,000	ファンドはBanco Comercial Portugues SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(13,888)	(14,858)
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(57,125)	(36,475)
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(99,837)	(64,553)
CDS	USD 1,949,105	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2021	(42,175)	(45,708)
CDS	EUR 330,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(320)	11,977
CDS	EUR 720,000	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	20/12/2022	30,460	26,950
CDS	EUR 920,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(25,848)	3,474
CDS	EUR (200,000)	ファンドはAltice Finco 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	BNP Paribas	20/12/2022	(4,597)	5,173
CDS	USD 9,700,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(45,399)	(695,600)
CDS	EUR (2,900,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2018	(220,710)	52,887
CDS	EUR 4,100,000	ファンドはITRAXX.FINSR.19.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2018	(6,232)	(14,236)
CDS	EUR (2,300,000)	ファンドはITRAXX.FINSUB.20.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2018	(150,578)	110,202

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,900,000	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	(12,800)	(25,619)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(59,708)	(65,058)
CDS	USD 1,119,712	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2021	(24,935)	(26,258)
CDS	EUR 600,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2021	4,324	(79,379)
CDS	USD 2,305,677	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2022	(46,122)	(21,518)
CDS	EUR 640,000	ファンドはArcelormittalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	(14,609)	(144,441)
CDS	USD 1,402,763	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	3,261	(8,970)
CDS	USD 1,402,763	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	3,740	(8,970)
CDS	USD 1,402,763	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	2,327	(8,970)
CDS	EUR (20,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	101	(302)
CDS	USD 1,402,763	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	2,327	(8,970)
CDS	EUR (2,750,000)	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	38,617	(50,225)
CDS	EUR (1,190,000)	ファンドはWPP 2005 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	20/12/2022	1,483	25,256
CDS	EUR 330,000	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	Citibank	20/12/2022	2,370	(70,100)
CDS	EUR (330,000)	ファンドはAltice Finco 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	Citibank	20/12/2022	(11,970)	8,536
CDS	EUR 320,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2022	1,359	(69,133)
CDS	EUR (150,000)	ファンドはFiat Chrysler Automobiles 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	Citibank	20/12/2022	(1,233)	30,446
CDS	EUR (290,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	70,350	62,197

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (600,000)	ファンドはConstellium 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	Citibank	20/12/2024	(8,403)	68,132
CDS	USD 17,900,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(154,821)	(1,283,632)
CDS	EUR (150,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	(1,722)	26,943
CDS	EUR (200,000)	ファンドはSaipem Finance International BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	20,002	34,339
CDS	EUR 100,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	2,031	(3,936)
CDS	EUR (360,000)	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	Credit Suisse	20/12/2022	(1,448)	71,684
CDS	EUR 360,000	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	Credit Suisse	20/12/2022	17,586	13,475
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	2,489	(37,338)
CDS	EUR (250,000)	ファンドはIntrum Justitia ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(13,748)	28,443
CDS	EUR (360,000)	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	1,278	9,312
CDS	EUR 30,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(566)	(5,110)
CDS	EUR 160,451,000	ファンドはITRAXX.X0.28.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	20/12/2022	608,436	(20,323,078)
CDS	EUR 300,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(8,056)	(75,222)
CDS	EUR 280,000	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	Credit Suisse	20/12/2022	11,678	10,481
CDS	EUR 640,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(834)	2,417
CDS	EUR 524,000	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	Credit Suisse	20/12/2022	21,886	19,614
CDS	USD 225,040,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(4,919)	(4,633,976)
CDS	EUR 640,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	3,574	(138,265)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUnitymedia GmbHに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(1,931)	(43,971)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはIntrum Justitia ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(19,541)	29,581
CDS	EUR 160,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(2,700)	(27,254)
CDS	EUR 330,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(6,087)	(56,211)
CDS	EUR 200,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(818)	(34,067)
CDS	EUR 640,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(1,129)	2,417
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	54,328	(166)
CDS	USD (343,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(3,850)	(40,436)
CDS	USD (420,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	6,698	(15,302)
CDS	USD (335,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(1,908)	(39,493)
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(49,845)	(6,671)
CDS	USD (1,450,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	(5,388)	(52,827)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(45,740)	(102,684)
CDS	USD 14,510,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	142,574	(1,040,531)
CDS	USD 16,440,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	170,140	(1,178,934)
CDS	USD (714,000)	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	53,353	(26,013)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(40,544)	(5,359)
CDS	USD 4,721,159	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(31,260)	(32,934)
CDS	USD 3,358,147	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(24,082)	(23,426)
CDS	USD 5,412,542	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(39,507)	(37,757)
CDS	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	59,346	21,405

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	79,585	53,672
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(12,682)	(19,531)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(59,369)	(47,758)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,397)	(18,914)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	270,421	103,096
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(15,633)	(18,914)
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(32,767)	(38,148)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(15,434)	(18,914)
CDS	EUR 330,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・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	(2,056)	(40,662)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(17,151)	(19,074)
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(16,706)	(20,654)
CDS	EUR 220,000	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	Goldman Sachs	20/6/2021	2,921	(8,565)
CDS	EUR 440,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2021	6,436	(58,211)
CDS	USD 3,420,087	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(69,352)	(31,919)
CDS	USD 30,000	ファンドはFrench Republic Government Bond OATに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.25%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(386)	(92)
CDS	EUR 640,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(17,954)	4,294
CDS	USD (17,900,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	214,206	1,283,632
CDS	EUR (300,000)	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	20/12/2022	(584)	59,582
CDS	USD 1,670,000	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(1,826)	(33,443)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 16,737,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(422,433)	(1,764,263)
CDS	EUR 330,000	ファンドはAssicurazioni Generali SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	911	7,700
CDS	EUR (600,000)	ファンドはCommerzbank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2022	11,789	(10,524)
CDS	EUR (780,000)	ファンドはTelecom Italia SpA/Milanoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2022	4,749	(11,770)
CDS	USD 15,480,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(169,112)	(1,110,091)
CDS	USD 2,500,000	ファンドはKorea International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(21,319)	(56,020)
CDS	EUR (440,000)	ファンドはConstellium 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	20/12/2024	(22,641)	49,964
CDS	EUR (330,000)	ファンドはConstellium 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	20/12/2024	(2,047)	37,473
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(43,228)	166
CDS	USD (1,400,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	19,177	(61,324)
CDS	USD (430,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	26,435	(18,835)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(15,573)	(133,099)
CDS	USD (1,058,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(6,458)	(124,728)
CDS	USD (2,280,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	7,494	(268,791)
CDS	USD 8,113,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2022	28,449	189,147
CDS	EUR 330,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2022	(10,526)	2,214
CDS	USD 2,180,000	ファンドはBahrain Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2022	(44,920)	137,993
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(252,380)	(166,103)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	403,048	171,450
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(44,743)	(51,626)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(59,309)	(63,860)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(68,748)	(78,213)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(64,312)	(64,919)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(62,889)	(65,187)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(20,012)	(16,611)
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(66,343)	(73,439)
CDS	USD 1,440,144	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(32,976)	(33,773)
CDS	USD 1,440,144	ファンドはThailand Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(33,428)	(33,773)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(27,736)	(39,651)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(12,587)	(19,826)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(13,868)	(19,826)
CDS	USD 3,074,236	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(65,079)	(28,691)
CDS	EUR 400,000	ファンドはMelia Hotels International S.A.に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(24,195)	(94,387)
CDS	EUR 333,078	ファンドはStmicroelectronics NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(8,068)	(9,673)
CDS	USD 6,777,010	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(54,794)	(485,988)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 790,000	ファンドはBahrain Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(16,218)	50,007
CDS	EUR (100,000)	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(12,438)	(11,279)
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	78,277	112,795
CDS	USD 194,000,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.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	20/12/2022	(69,607)	(3,994,807)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはVue International Bidco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(525)	39,291
CDS	EUR (230,000)	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(23,087)	(25,943)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(4,252)	7,760
CDS	EUR (250,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	540	(10,074)
CDS	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	JP Morgan	20/12/2022	1,061	6,273
CDS	EUR (1,210,000)	ファンドはWPP 2005 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	20/12/2022	111	25,680
CDS	USD 35,517,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	362,442	(2,546,970)
CDS	USD 32,890,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	335,634	(2,358,585)
CDS	USD 32,890,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	335,634	(2,358,585)
CDS	EUR (400,000)	ファンドはVue International Bidco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(1,324)	52,388
CDS	EUR 330,000	ファンドはLloyds Banking 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	JP Morgan	20/12/2022	(8,119)	(4,800)
CDS	EUR 894,000	ファンドはLanxessに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(2,060)	(22,324)
CDS	USD 35,517,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	374,678	(2,546,970)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはAltice Finco SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(3,889)	5,173
CDS	USD 166,989,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.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	20/12/2022	(252,044)	(3,438,602)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 80,080,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.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	20/12/2022	14,893	(1,648,991)
CDS	EUR 310,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(10,546)	2,080
CDS	USD 30,073,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(54,083)	(495,065)
CDS	EUR 1,830,000	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(50,194)	6,910
CDS	EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(1,879)	(43,964)
CDS	USD (590,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(2,324)	(21,495)
CDS	USD (1,080,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(8,751)	(39,347)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(9,015)	(132,037)
CDS	USD 590,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/9/2058	(58,533)	21,495
CDS	USD (522,175)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	46,900	(19,024)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(9,336)	(133,216)
CDS	USD (1,130,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(5,839)	(41,169)
CDS	USD (835,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(4,262)	(30,421)
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	11,587	(135,574)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	(357)	(3,520)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	36,330	102,684
CDS	EUR (11,220,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/12/2022	(49,172)	308,055
CDS	EUR 258,920,000	ファンドはITRAXX.EUR.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/12/2022	(1,019,726)	(7,227,516)
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(29,804)	(18,893)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (710,000)	ファンドはIntrum Justitia ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(54,372)	80,779
CDS	USD (64,790,000)	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(138,003)	1,334,142
CDS	EUR 180,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2022	4,110	(7,085)
CDS	USD 5,356,047	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2022	(96,353)	106,499
CDS	EUR (20,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(86)	3,767
CDS	USD (33,834,000)	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(72,513)	696,703
CDS	USD (99,566,000)	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(216,987)	2,050,242
CDS	USD (99,570,000)	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(176,545)	2,050,325
CDS	EUR 200,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2022	3,804	(7,872)
CDS	USD (166,275,000)	ファンドはCDX.NA.IG.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(303,021)	3,423,900
CDS	USD (270,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/10/2057	12,065	(11,827)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(28,003)	(3,748)
CDS	USD 1,700,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(150,341)	61,936
CDS	USD (557,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(767)	(20,293)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	237	(40,805)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(15,096)	(132,037)
CDS	USD (850,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(13,031)	(30,968)
CDS	USD (840,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(12,135)	(30,604)
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(50,826)	(6,802)
CDS	USD (1,320,000)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	24,681	(48,091)
CDS	USD 4,020,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(61,561)	(7,533)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (2,540,000)	ファンドはCMBX.NA.6.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	Morgan Stanley	11/5/2063	(12,697)	(7,833)
CS	KRW (45,000,000,000)	ファンドはKRW 1.46%の固定金利を支払い、USD 2.44%の固定金利を受け取る	JP Morgan	4/4/2018	(1,949,989)	(1,949,989)
IFS	GBP 4,490,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.365%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/1/2023	24,691	24,691
IFS	EUR 9,000,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.581%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/2/2028	15,593	15,593
IFS	EUR 5,725,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.578%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/2/2028	7,714	7,714
IFS	GBP 7,220,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.32%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/12/2022	13,244	13,244
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	41,850	41,850
IRS	MXN 48,534,715	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.85%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2018	54,327	54,327
IRS	MXN 37,929,872	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.7%の固定金利を支払う	Bank of America	6/12/2018	50,515	50,515
IRS	BRL 275,522,973	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.02%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(335,166)	(335,166)
IRS	BRL 148,342,954	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.75%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(508,363)	(508,363)
IRS	BRL 103,599,072	ファンドは7.7%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	2/1/2020	101,984	101,984
IRS	BRL 79,587,158	ファンドは7.81%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	2/1/2020	126,679	126,679
IRS	BRL 184,741,707	ファンドは8.21%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	2/1/2020	839,883	839,883
IRS	BRL 65,856,884	ファンドは9.135%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	572,886	572,886
IRS	CNY 102,160,000	ファンドは3.915%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	26/4/2022	62,805	62,805
IRS	CNY 16,338,168	ファンドは3.72%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Bank of America	30/6/2022	(11,154)	(11,154)
IRS	KRW 5,068,500,000	ファンドは2.1125%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	21/3/2023	(37,828)	(37,828)
IRS	KRW 2,512,660,000	ファンドは2.1575%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	21/3/2023	(13,820)	(13,820)
IRS	KRW 2,195,435,900	ファンドは2.226%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	21/3/2023	(5,515)	(5,515)
IRS	CNY 82,160,000	ファンドは3.98%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	21/3/2023	46,798	46,798

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CNY 19,657,440	ファンドは4.01%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	21/3/2023	15,416	15,416
IRS	CNY 20,154,658	ファンドは4.03%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	21/3/2023	18,690	18,690
IRS	CNY 28,792,368	ファンドは4.03%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	21/3/2023	26,700	26,700
IRS	CNY 11,639,315	ファンドは4.045%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	21/3/2023	12,043	12,043
IRS	CNY 14,225,829	ファンドは4.05%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	21/3/2023	15,228	15,228
IRS	CNY 21,162,390	ファンドは4.06%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	21/3/2023	24,167	24,167
IRS	HUF 2,476,325,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.05%の固定金利を支払う	Bank of America	21/3/2023	71,658	71,658
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	422,321	422,321
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	422,321	422,321
IRS	MXN 10,285,479	ファンドは6.27%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	(51,303)	(51,303)
IRS	JPY 249,750,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.89%の固定金利を支払う	Bank of America	15/12/2046	169	2,501
IRS	MXN 80,656,062	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.55%の固定金利を支払う	Barclays	21/3/2018	8,154	8,154
IRS	USD 134,480,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.831%の固定金利を支払う	Barclays	7/2/2022	80,868	80,868
IRS	PLN 16,480,000	ファンドは2.5075%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	20/6/2023	(30,147)	(30,147)
IRS	USD 12,470,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.387%の固定金利を支払う	Barclays	6/12/2027	516,830	516,830
IRS	JPY 610,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3185%の固定金利を支払う	Barclays	22/3/2028	10,414	10,414
IRS	JPY 1,540,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.379%の固定金利を支払う	Barclays	22/3/2028	(60,420)	(60,420)
IRS	SEK 51,220,000	ファンドは1.42%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Barclays	20/6/2028	9,512	9,512
IRS	USD 11,120,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.4375%の固定金利を支払う	Barclays	11/12/2028	486,730	486,730
IRS	EUR 27,200,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.37%の固定金利を支払う	Barclays	20/2/2029	(183,809)	(183,809)
IRS	EUR 24,270,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.38%の固定金利を支払う	Barclays	22/2/2029	(188,854)	(188,854)
IRS	USD 13,380,000	ファンドは2.607%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	9/12/2032	(465,147)	(465,147)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 5,790,000	ファンドは1.61661%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Barclays	4/7/2042	19,867	19,867
IRS	EUR 11,820,000	ファンドは1.6436%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Barclays	4/7/2042	122,230	122,230
IRS	MXN 1,091,400,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.8350004%の固定金利を支払う	BNP Paribas	7/6/2018	(16,486)	(16,486)
IRS	KRW 67,342,275,000	ファンドは2.255%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/3/2020	8,564	8,564
IRS	JPY 480,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.913%の固定金利を支払う	BNP Paribas	12/7/2047	(15,277)	(15,277)
IRS	MXN 393,052,250	ファンドは7.07%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	21/11/2018	(142,890)	(142,890)
IRS	MXN 670,800,000	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	28/11/2018	(273,166)	(273,166)
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.77%の固定金利を支払う	Citibank	5/12/2018	49,298	49,298
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.76%の固定金利を支払う	Citibank	6/12/2018	49,603	49,603
IRS	BRL 133,962,282	ファンドは9.25%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2019	1,179,974	1,179,974
IRS	BRL 145,696,578	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2019	(633,054)	(633,054)
IRS	BRL 155,639,032	ファンドは7.78%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	222,473	222,473
IRS	BRL 75,232,939	ファンドは7.82%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	123,819	123,819
IRS	BRL 130,170,295	ファンドは9.48%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	1,738,546	1,738,546
IRS	BRL 15,447,336	ファンドは9.23%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	37,408	37,408
IRS	BRL 58,486	ファンドは9.24%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	150	150
IRS	BRL 34,154,876	ファンドは9.85%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	493,353	493,353
IRS	COP 29,751,319,835	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.36%の固定金利を支払う	Citibank	12/2/2023	13,470	13,470
IRS	COP 29,751,319,834	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.418%の固定金利を支払う	Citibank	13/2/2023	(13,110)	(13,110)
IRS	COP 59,687,430,476	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.4%の固定金利を支払う	Citibank	23/2/2023	1,511	1,511
IRS	KRW 2,195,435,900	ファンドは2.2275%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	21/3/2023	(5,372)	(5,372)
IRS	KRW 4,325,336,400	ファンドは2.2425%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Citibank	21/3/2023	(7,753)	(7,753)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CNY 17,000,000	ファンドは3.88%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	21/3/2023	(2,480)	(2,480)
IRS	CNY 32,986,800	ファンドは4%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	21/3/2023	23,509	23,509
IRS	CNY 16,993,200	ファンドは4.025%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	21/3/2023	15,150	15,150
IRS	HUF 4,321,115,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.035%の固定金利を支払う	Citibank	21/3/2023	137,341	137,341
IRS	MXN 86,921,000	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(396,626)	(396,626)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,643,933)	(1,643,933)
IRS	MXN 1,235,687,404	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3614%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2019	380,681	380,681
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/11/2021	(3,371,793)	(3,371,793)
IRS	USD 27,465,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.904%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/2/2022	(21,743)	(21,743)
IRS	USD 27,465,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.91%の固定金利を支払う	Credit Suisse	18/2/2022	(24,802)	(24,802)
IRS	USD 33,530,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9445%の固定金利を支払う	Credit Suisse	24/2/2022	(52,418)	(52,418)
IRS	MXN 277,700,000	ファンドは6.92%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/7/2022	(429,718)	(429,718)
IRS	MXN 99,000,000	ファンドは6.9%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/8/2022	(159,459)	(159,459)
IRS	USD 252,830,000	ファンドは2.41%の固定金利を受け取り、1日USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	31/8/2022	(250,119)	(250,119)
IRS	USD 47,580,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.79842%の固定金利を支払う	Credit Suisse	31/8/2022	(42,762)	(42,762)
IRS	USD 47,160,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.82927%の固定金利を支払う	Credit Suisse	31/8/2022	(99,365)	(99,365)
IRS	USD 47,290,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.83125%の固定金利を支払う	Credit Suisse	31/8/2022	(103,306)	(103,306)
IRS	USD 220,844,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6365%の固定金利を支払う	Credit Suisse	5/3/2023	1,183,127	1,183,127
IRS	MXN 159,500,000	ファンドは1日MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.29%の固定金利を支払う	Credit Suisse	25/6/2027	372,335	372,335
IRS	MXN 56,400,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.18%の固定金利を支払う	Credit Suisse	27/7/2027	155,320	155,320
IRS	USD 55,245,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Credit Suisse	5/3/2028	316,815	316,815
IRS	USD 16,801,000	ファンドは3.0326%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	15/11/2043	202,374	202,374

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 51,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8795%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2048	614,866	614,866
IRS	MXN 1,091,400,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.8125004%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	12/6/2018	(11,270)	(11,270)
IRS	MXN 1,109,740,000	ファンドは7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Deutsche Bank	29/4/2020	(778,563)	(778,563)
IRS	USD 173,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6502%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	31/1/2021	662,846	662,846
IRS	USD 88,400,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8006%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/2/2021	105,922	105,922
IRS	CNY 32,240,000	ファンドは3.92%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/5/2022	15,131	15,131
IRS	CNY 32,240,000	ファンドは3.94%の固定金利を受け取り、3ヶ月CNY CNRRの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/5/2022	19,121	19,121
IRS	MXN 191,475,491	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1300016%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	7/10/2022	226,461	226,461
IRS	MXN 76,770,834	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1399988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/10/2022	89,261	89,261
IRS	MXN 253,592,767	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1049996%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	313,759	313,759
IRS	MXN 193,289,233	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	237,134	237,134
IRS	KRW 4,390,871,800	ファンドは2.2425%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	21/3/2023	(7,870)	(7,870)
IRS	INR 851,200,000	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、6.82%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	21/3/2023	45,543	45,543
IRS	INR 870,912,000	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、6.84%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	21/3/2023	35,447	35,447
IRS	USD 75,540,000	ファンドは2.7297%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/1/2024	(470,804)	(470,804)
IRS	MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	1,570,510	1,570,510
IRS	USD 223,460,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.626%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	14/7/2019	2,318,724	2,318,724
IRS	MXN 1,000,000,000	ファンドは7.345%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/2/2020	(485,988)	(485,988)
IRS	MXN 876,300,000	ファンドは7.45%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	28/5/2020	(346,592)	(346,592)
IRS	USD 305,570,000	ファンドは2.765%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2021	(564,081)	(564,081)
IRS	USD 518,760,000	ファンドは2.7725%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2021	(883,859)	(883,859)
IRS	MXN 188,850,992	ファンドは7.47%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	(83,440)	(83,440)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 188,832,063	ファンドは7.48%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	(79,935)	(79,935)
IRS	EUR 13,930,000	ファンドは0.214%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	27/9/2022	(131,770)	(131,770)
IRS	SEK 132,880,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、0.454%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	27/9/2022	1,216	1,216
IRS	EUR 17,550,000	ファンドは0.21%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	20/10/2022	(183,423)	(183,423)
IRS	SEK 169,660,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、0.41%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/10/2022	58,810	58,810
IRS	JPY 2,528,000,000	ファンドは0.135%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2023	5,674	5,674
IRS	HUF 3,368,920,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.02%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	21/3/2023	116,666	116,666
IRS	HUF 5,526,430,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.039%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	21/3/2023	171,456	171,456
IRS	HUF 6,393,520,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.149%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	21/3/2023	64,903	64,903
IRS	JPY 11,817,000,000	ファンドは0.105%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	22/3/2023	(170,723)	(170,723)
IRS	ZAR 69,780,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.505%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(56,696)	(56,696)
IRS	ZAR 106,200,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.605%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(123,223)	(123,223)
IRS	MXN 261,414,000	ファンドは6.321%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	6/8/2025	(1,205,998)	(1,205,998)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(665,166)	(665,166)
IRS	USD 14,610,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.347%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	25/10/2027	640,361	640,361
IRS	USD 9,680,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.437%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	27/10/2027	350,005	350,005
IRS	USD 59,084,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.248%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	8/12/2027	3,159,605	3,159,605
IRS	USD 202,880,000	ファンドは2.398%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	3/1/2028	(8,258,384)	(8,258,384)
IRS	JPY 1,269,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2028	(31,282)	(31,282)
IRS	USD 111,770,000	ファンドは2.8903%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	2/3/2028	173,275	173,275
IRS	JPY 5,933,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3079%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/3/2028	159,823	159,823
IRS	JPY 384,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.367%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/3/2028	(10,777)	(10,777)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 115,280,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2029	(452,012)	(452,012)
IRS	USD 67,625,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2029	(285,518)	(285,518)
IRS	JPY 480,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.92%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	12/7/2047	(23,915)	(23,915)
IRS	JPY 101,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.951%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/2/2048	(11,692)	(11,692)
IRS	USD 3,430,000	ファンドは3.0335%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/2/2053	43,783	43,783
IRS	USD 611,500,000	ファンドは2.645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	26/1/2021	(1,759,016)	(1,759,016)
IRS	USD 625,900,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.68625%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	26/1/2022	524,450	524,450
IRS	HUF 7,386,270,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、1.005%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	21/3/2023	276,811	276,811
IRS	INR 854,945,280	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、1.137%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	21/3/2023	122,361	122,361
IRS	MXN 471,662,700	ファンドは7.06%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	21/11/2018	(173,261)	(173,261)
IRS	MXN 380,532,808	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	28/11/2018	(154,962)	(154,962)
IRS	BRL 127,171,224	ファンドは9.275%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	1,134,059	1,134,059
IRS	BRL 33,737,878	ファンドは12.17%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2021	1,504,950	1,504,950
IRS	USD 1,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.1805%の固定金利を支払う	JP Morgan	8/11/2021	16,880	16,880
IRS	USD 71,400,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6015%の固定金利を支払う	JP Morgan	22/1/2022	352,402	352,402
IRS	BRL 16,995,037	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,124,752	1,124,752
IRS	BRL 58,456,690	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	326,700	326,700
IRS	BRL 12,389,222	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	69,240	69,240
IRS	USD 83,210,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.2055%の固定金利を支払う	JP Morgan	22/1/2023	2,026,411	2,026,411
IRS	COP 30,305,692,255	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.4%の固定金利を支払う	JP Morgan	14/2/2023	(4,304)	(4,304)
IRS	COP 30,305,692,254	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.41%の固定金利を支払う	JP Morgan	15/2/2023	(8,456)	(8,456)
IRS	HUF 12,615,110,000	ファンドは6ヶ月HUF BUBORの変動金利を受け取り、0.7875%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/3/2023	993,424	993,424

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	INR 951,471,360	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、6.745%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/3/2023	96,587	96,587
IRS	INR 951,471,360	ファンドは6ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、6.77%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/3/2023	81,360	81,360
IRS	PLN 25,300,000	ファンドは2.619%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	20/6/2023	(8,111)	(8,111)
IRS	USD 33,750,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.2265%の固定金利を支払う	JP Morgan	18/8/2027	1,788,602	1,788,602
IRS	KRW 32,605,970,000	ファンドは3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を受け取り、1.837%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/9/2027	1,487,686	1,487,686
IRS	JPY 795,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.8075%の固定金利を支払う	JP Morgan	31/5/2047	186,270	186,270
IRS	MXN 1,627,791,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、7.8249996%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/2/2021	(222,860)	(222,860)
IRS	USD 34,500,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.944%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/2/2022	(53,614)	(53,614)
IRS	USD 40,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9975%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	25/2/2022	(101,997)	(101,997)
IRS	USD 31,885,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.948%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	2/3/2022	(54,834)	(54,834)
IRS	USD 63,770,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9495%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	2/3/2022	(111,441)	(111,441)
IRS	USD 137,950,000	ファンドは2.797%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	31/8/2022	116,310	116,310
IRS	EUR 10,517,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.484%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	31/1/2023	(26,897)	(26,897)
IRS	USD 57,420,000	ファンドは2.641%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/2/2023	(257,717)	(257,717)
IRS	USD 53,010,000	ファンドは2.821%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	5/2/2024	(113,535)	(113,535)
IRS	USD 16,300,000	ファンドは2.9545%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	26/2/2024	62,436	62,436
IRS	USD 7,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/1/2027	359,107	359,235
IRS	USD 102,500,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/11/2027	(291,435)	(291,435)
IRS	USD 8,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.462%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	8/1/2028	282,665	282,665
IRS	USD 826,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.663%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/1/2028	14,588	14,588
IRS	USD 20,260,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.705%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/1/2028	283,038	283,038
IRS	USD 11,880,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.67%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	25/1/2028	202,431	202,431

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 9,620,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.765%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	5/2/2028	85,086	85,086
IRS	USD 6,780,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8055%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	5/2/2028	35,853	35,853
IRS	USD 68,200,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.825%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	6/2/2028	244,086	244,086
IRS	USD 3,390,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.858%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	6/2/2028	2,309	2,309
IRS	USD 13,580,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8695%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	6/2/2028	(4,466)	(4,466)
IRS	EUR 9,715,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.137%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/2/2028	(66,279)	(66,279)
IRS	EUR 5,725,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.149%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/2/2028	(47,177)	(47,177)
IRS	USD 3,464,800	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9665%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/2/2028	(29,902)	(29,902)
IRS	USD 8,700,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.951%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	26/2/2028	(62,780)	(62,780)
IRS	USD 13,800,000	ファンドは2.876%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	7,797	7,797
IRS	USD 4,295,000	ファンドは2.8805%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	4,133	4,133
IRS	USD 4,295,000	ファンドは2.887%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	6,597	6,597
IRS	USD 8,590,000	ファンドは2.8895%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	15,090	15,090
IRS	USD 8,590,000	ファンドは2.8995%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	22,672	22,672
IRS	USD 8,590,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.888%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	27/2/2028	(13,952)	(13,952)
IRS	USD 11,790,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.1235%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	21/2/2033	(61,036)	(61,036)
IRS	USD 16,801,000	ファンドは3.02642%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/11/2043	183,245	183,245
IRS	USD 33,050,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.06%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/11/2043	(564,938)	(564,938)
IRS	GBP 10,510,000	ファンドは0.814%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	27/9/2019	(31,934)	(31,934)
IRS	GBP 25,120,000	ファンドは0.8%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2019	(112,142)	(112,142)
IRS	USD 324,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.19%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	3/12/2020	3,857,716	3,857,716
IRS	USD 583,560,000	ファンドは2.305%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	17/12/2020	(3,544,477)	(3,544,477)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 56,830,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.299%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/12/2020	581,003	581,003
IRS	USD 209,290,000	ファンドは2.815%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	20/2/2021	(193,247)	(193,247)
IRS	USD 583,560,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.343%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/12/2021	2,423,421	2,423,421
IRS	JPY 5,564,000,000	ファンドは0.1055%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	6/10/2022	(33,410)	(33,410)
IRS	MXN 174,450,000	ファンドは6.32%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(798,653)	(798,653)
IRS	JPY 2,780,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.286%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	6/10/2027	70,202	70,202
IRS	PLN 82,960,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.8085%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/3/2028	456,728	456,728
IRS	USD 45,845,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り3.04625%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/2/2029	(361,504)	(361,504)
IRS	USD 4,310,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9629%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	15/11/2043	3,430	3,430
IRS	KRW 55,098,225,000	ファンドは2.273%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Nomura	20/3/2020	15,888	15,888
IRS	KRW 55,009,500,000	ファンドは2.277%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Nomura	20/3/2020	17,832	17,832
IRS	KRW 95,550,000,000	ファンドは2.285%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KORIBORの変動金利を支払う	Nomura	20/3/2020	37,819	37,819
IRS	MXN 566,665,605	ファンドは6.92%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	UBS	28/11/2018	(244,014)	(244,014)
IRS	MXN 1,065,934,395	ファンドは6.94%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	UBS	29/11/2018	(452,158)	(452,158)
IRS	USD 46,820,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、2.4113%の固定金利を支払う	UBS	31/8/2022	43,806	43,806
IRS	GBP 12,020,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.108%の固定金利を支払う	UBS	3/10/2022	163,714	163,714
IRS	MXN 144,525,723	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	137,548	137,548
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	UBS	19/11/2026	200,219	200,219
IRS	USD 7,490,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.82786%の固定金利を支払う	UBS	15/11/2043	180,644	180,644
IRS	EUR 5,040,000	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	UBS	20/1/2048	(25,203)	(25,203)
TRS	USD 16,630,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Bank of America	20/3/2018	(45,869)	(46,437)
TRS	USD (61,905)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを受け取り、Superior Energy Services Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	7/2/2019	27,164	27,164

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD (17,984)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを受け取り、Herc Holdings Inc + Obpsを支払う	BNP Paribas	8/2/2019	(80,131)	(80,131)
TRS	EUR 3,300,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	Deutsche Bank	20/3/2018	(11,992)	(13,149)
TRS	USD 4,500,000	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	46,166	49,567
TRS	EUR 6,420,000	ファンドはMarkit IBOXX Euro Corporate Index + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	(35,738)	(35,416)
TRS	EUR 4,320,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	32,796	32,579
TRS	EUR 7,200,000	ファンドはMarkit IBOXX Euro Corporate + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	(72,613)	(71,213)
TRS	EUR 2,400,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	2,477	2,016
TRS	USD 85,780,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2018	(620,328)	(628,616)
TRS	USD 84,840,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2018	(15,923)	(227,484)
TRS	EUR 3,300,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	JP Morgan	20/3/2018	25,934	25,716
TRS	EUR 3,300,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	JP Morgan	20/3/2018	30,491	30,274
TRS	EUR 2,400,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	JP Morgan	20/3/2018	3,246	2,779
TRS	USD 51,500,000	ファンドはIBOXX US\$ Liquid High Yield + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/12/2018	(189,045)	(256,531)
TRS	EUR 3,600,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、IBOXX EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	Merrill Lynch	20/3/2018	3,716	3,025
TRS	USD (3,567)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、O'Reilly Automotive Inc + Obpsを支払う	Merrill Lynch	31/8/2018	(25,219)	(25,219)
TRS	EUR 7,200,000	ファンドはMarkit IBOXX Euro Corporate + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2018	(70,299)	(68,916)
合計					4,078,999	(40,793,642)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

CS: 通貨スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2018年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
28,130,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.3	6/3/2018	(172,373)	11,879
20,840,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.36	6/3/2018	(19,798)	-
20,590,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.275	6/3/2018	84,742	127,014
20,840,000	プット	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.73	15/3/2018	(84,174)	59
35,000,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 119	23/3/2018	(92,610)	-
31,260,000	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.18	26/3/2018	(39,687)	13
6,683,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 56.6	30/3/2018	(1,206)	95,497
9,170,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.25	6/4/2018	131,344	228,757
41,680,000	コール	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 65	10/4/2018	(72,432)	2,134
20,840,000	コール	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 60	10/4/2018	(127,675)	46,651
18,847,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 57	11/4/2018	236,005	382,107
10,471,000	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 11.3	12/4/2018	(27,797)	35,867
15,630,000	コール	OTC USD/TRY	Bank of America	USD 3.9	16/4/2018	(213,281)	165,278
20,840,000	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 1.03	19/4/2018	(61,920)	183
10,420,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.36	4/5/2018	(19,619)	7,577
30,650,000	プット	OTC EUR/NOK	Bank of America	EUR 9.5	4/6/2018	5,782	273,820
14,704,000	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 0.995	13/6/2018	(116,205)	22,469
18,760,000	プット	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 82	14/6/2018	50,339	235,358
206,750,000	コール	OTC GBP/USD	Bank of America	GBP 1.5	17/7/2018	(1,404,346)	809,194
133,220,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.25	27/7/2018	980,534	2,173,738
10,420,000	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 21.169	5/9/2018	(201,376)	159,052
20,840,000	プット	OTC USD/TRY	Barclays	USD 3.6	27/4/2018	(30,595)	14,431
41,882,000	プット	OTC CHF/JPY	Barclays	CHF 115	1/5/2018	588,355	851,063
25,680,000	プット	OTC CAD/MXN	Barclays	CAD 14.5	4/6/2018	(1,539)	191,376
1,047,000	プット	OTC AUD/JPY	Barclays	AUD 84.25	7/6/2018	333,771	689,858
10,641,400	プット	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.777	6/3/2018	(22,554)	28,884
75,000,000	コール	OTC EUR/PLN	BNP Paribas	EUR 4.35	9/3/2018	(1,192,221)	11
14,659,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.25	12/3/2018	(63,012)	10,690
41,680,000	プット	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.7	15/3/2018	(69,759)	-
36,470,000	プット	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.77	15/3/2018	(329,142)	76,043
36,705,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.28	22/3/2018	(172,148)	5,274
25,129,000	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 56	11/4/2018	2,226	251,003
52,100,000	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 103	13/4/2018	(64,110)	140,643
628,000	プット	OTC AUD/JPY	BNP Paribas	AUD 80	16/4/2018	55,529	109,297
36,647,000	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 110	25/4/2018	2,311	107,487
20,840,000	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 106	25/4/2018	(5,030)	213,790
30,910,000	コール	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,130	29/5/2018	9,284	197,372
26,467,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.2945	13/6/2018	(116,747)	271,736
20,840,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.75	20/7/2018	(14,365)	93,586
18,760,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.4	20/7/2018	(13,574)	312,850
20,840,000	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 112	26/7/2018	(101,046)	88,598
41,882,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 112	1/3/2018	(49,002)	-
10,594,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18	2/3/2018	(36,761)	-
52,587,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.226	6/3/2018	83,407	466,106
20,590,000	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.285	6/3/2018	5,429	48,935
31,260,000	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.3	8/3/2018	(13,044)	20,717

買建オプション 2018年2月28日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
31,412,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 101	9/3/2018	(22,208)	94
18,847,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	9/3/2018	(19,411)	96,603
14,524,500	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 101	9/3/2018	(10,559)	44
9,683,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	9/3/2018	(11,226)	49,631
31,260,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.45	12/3/2018	(186,712)	47,580
10,641,400	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.797	27/3/2018	133,235	205,136
20,840,000	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 2.9	9/4/2018	(37,191)	217
36,647,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 110	12/4/2018	(94,423)	81,300
9,975,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.23	18/4/2018	76,531	165,061
25,129,000	プット	OTC CHF/SEK	Citibank	CHF 8.4	24/4/2018	(21,725)	30,111
11,148,000	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.65	30/4/2018	(34,432)	17,629
41,882,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 17.4	24/5/2018	(26,104)	59,922
18,847,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.1	24/5/2018	(47,339)	94,767
21,105,000	プット	OTC EUR/NOK	Citibank	EUR 9.25	4/6/2018	(22,122)	55,935
36,470,000	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.75	7/6/2018	14,384	163,379
20,840,000	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.7	7/6/2018	(2,452)	9,233
14,000,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.18	14/6/2018	(178,469)	62,755
10,420,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.25	20/6/2018	(60,623)	126,453
110,860,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.3	16/7/2018	(608,845)	532,535
15,630,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20.5	5/9/2018	(73,364)	332,349
9,790,000	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 4.1897	3/1/2019	(34,239)	513,360
25,620,000	プット	OTC CAD/MXN	Credit Suisse	CAD 14.5	4/6/2018	6,153	190,929
31,412,000	コール	OTC CHF/JPY	Deutsche Bank	CHF 118.25	1/3/2018	(12,749)	-
31,000,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 116	1/3/2018	(140,740)	-
31,000,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 115	1/3/2018	(178,250)	-
36,470,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.85	1/3/2018	190,070	446,454
7,432,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.7	1/3/2018	(34,559)	-
8,880,000	プット	OTC EUR/JPY	Deutsche Bank	EUR 134.75	5/3/2018	261,239	333,290
5,300,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.215	7/3/2018	11,206	21,706
20,840,000	プット	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.9675	8/3/2018	375,206	524,629
36,400,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 106	8/3/2018	(93,562)	70,602
94,050,000	コール	OTC EUR/PLN	Deutsche Bank	EUR 4.35	9/3/2018	(1,448,837)	14
53,160,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 110.5	12/3/2018	(196,978)	7,689
5,235,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.2	12/3/2018	758	13,793
7,432,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.75	21/3/2018	(13,476)	19,597
35,000,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 114	23/3/2018	(511,369)	331
630,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18	26/3/2018	(114,100)	26,869
37,000,000	プット	OTC EUR/GBP	Deutsche Bank	EUR 0.84	30/3/2018	(299,794)	5,659
18,500,000	プット	OTC EUR/GBP	Deutsche Bank	EUR 0.81	30/3/2018	(12,840)	15
51,000,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.215	5/4/2018	(39,543)	433,658
41,680,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 2.9	9/4/2018	(110,852)	434
31,000,000	プット	OTC EUR/JPY	Deutsche Bank	EUR 128	12/4/2018	(53,590)	210,435
9,536,000	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.47	12/4/2018	(44,169)	19,913
9,536,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 3.275	12/4/2018	(490)	171,921
10,594,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.5	13/4/2018	(11,304)	63,277

買建オプション 2018年2月28日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
41,882,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.65	24/4/2018	(44,079)	30,890
18,847,000	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 4	24/4/2018	(25,639)	123,629
31,412,000	プット	OTC EUR/SEK	Deutsche Bank	EUR 9.75	25/4/2018	(21,073)	33,019
15,630,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.2	26/4/2018	34,001	86,888
41,680,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.61	1/5/2018	(143,660)	38,481
31,260,000	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.6	1/5/2018	(20,812)	24,828
7,276,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20	16/5/2018	(154,075)	50,817
20,941,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.31	17/5/2018	(20,231)	21,320
18,847,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.265	17/5/2018	(71,254)	96,449
31,412,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 17.25	17/5/2018	(32,001)	26,425
19,800,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.75	25/5/2018	(168,849)	82,809
1,087,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 22.5	25/5/2018	(59,692)	31,834
20,840,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 109	6/6/2018	478,242	655,174
59,010,000	プット	OTC EUR/TRY	Deutsche Bank	EUR 4	12/6/2018	(444,339)	357
40,435,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 113.65	13/6/2018	(454,458)	68,771
20,941,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.25	15/6/2018	(3,452)	194,440
18,760,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	15/6/2018	3,314	338,180
79,127,000	コール	OTC EUR/CHF	Deutsche Bank	EUR 1.2	25/6/2018	(502,298)	205,835
5,235,000	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 4.22	25/6/2018	(8,391)	42,388
140,000,000	コール	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.5	17/7/2018	(463,226)	342,944
26,800,000	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 62.5	24/7/2018	(69,488)	36,372
26,800,000	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 62.5	26/7/2018	(68,628)	36,964
20,200,000	コール	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 6.4	27/7/2018	(4,785)	264,481
47,117,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 115	16/8/2018	13,964	114,324
47,117,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 115	16/8/2018	13,964	114,324
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 127	24/8/2018	(70,632)	2,127
20,840,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 103	9/10/2018	223,591	364,469
92,653,000	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.7795	6/3/2018	(140,386)	353,718
10,420,000	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.35	6/3/2018	(263,517)	2,193
29,820,000	プット	OTC EUR/SEK	Goldman Sachs	EUR 9.865	12/3/2018	(192,528)	3,840
18,760,000	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 14.5	16/3/2018	(142,914)	-
18,760,000	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 14.5	16/3/2018	(202,645)	-
31,412,000	コール	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.6	12/4/2018	35,008	58,599
20,941,000	コール	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.25	12/4/2018	162,314	257,344
41,680,000	コール	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 115	16/4/2018	(65,468)	4,137
26,176,250	プット	OTC CHF/JPY	Goldman Sachs	CHF 113	1/5/2018	24,550	263,268
52,100,000	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4	2/5/2018	(180,719)	1,006
31,005,000	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.63	2/5/2018	(319,130)	38,854
20,941,000	コール	OTC AUD/JPY	Goldman Sachs	AUD 88	7/6/2018	(49,314)	49,007
31,412,000	コール	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 4.6	2/7/2018	(28,632)	94,032
18,847,000	コール	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 4.2	2/7/2018	(65,942)	179,634
26,800,000	プット	OTC USD/INR	Goldman Sachs	USD 64.5	26/7/2018	(157,979)	137,330
20,941,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 102	14/8/2018	(70,472)	221,654
20,670,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19.25	5/9/2018	(45,927)	858,158
20,941,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 94	15/2/2019	(39,245)	191,440
1,870,000	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30.49	2/3/2018	(51,913)	26

買建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
20,840,000	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,085	8/3/2018	(121,268)	147,673
35,150,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank Plc	USD 7.75	15/3/2018	118,403	330,182
20,941,000	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,060	28/3/2018	(53,805)	58,543
18,500,000	プット	OTC EUR/GBP	HSBC Bank Plc	EUR 0.84	30/3/2018	(156,757)	2,829
20,670,000	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.45	3/4/2018	311,679	404,178
20,840,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,100	9/4/2018	(25,319)	127,709
20,941,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.55	18/5/2018	(21,151)	61,909
67,680,000	プット	OTC EUR/TRY	HSBC Bank Plc	EUR 4	12/6/2018	(329,555)	409
38,720,000	プット	OTC AUD/USD	HSBC Bank Plc	AUD 0.756	13/6/2018	(308,750)	231,587
173,750,000	プット	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.1705	13/6/2018	(1,613,884)	574,157
12,988,000	コール	OTC USD/SEK	HSBC Bank Plc	USD 8.496	13/6/2018	(106,852)	90,241
16,670,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,140	9/7/2018	(954)	132,139
26,800,000	プット	OTC USD/INR	HSBC Bank Plc	USD 62.5	26/7/2018	(19,317)	36,964
116,810,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 102.5	10/8/2018	16,233	1,325,673
62,824,000	プット	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.3	31/8/2018	97,173	592,008
20,840,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,143	10/9/2018	(160,052)	233,069
15,706,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.14	1/3/2018	(115,177)	-
2,610,000	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 30.225	1/3/2018	(73,575)	27
75,124,000	コール	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1.2655	6/3/2018	525,809	899,551
36,400,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 108	8/3/2018	252,487	383,927
20,840,000	プット	OTC USD/NOK	JP Morgan	USD 8.2	9/3/2018	673,070	871,049
20,840,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 12	14/3/2018	372,157	475,107
15,630,000	コール	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 3.88	16/3/2018	(229,116)	57,851
9,711,000	プット	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,050	27/3/2018	(88,415)	12,871
28,130,000	プット	OTC USD/RUB	JP Morgan	USD 56	11/4/2018	94,671	280,979
18,847,000	コール	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1.28	12/4/2018	66,257	184,134
9,683,000	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 13,400	12/4/2018	(82,351)	9,397
41,680,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 11.4	12/4/2018	158,957	205,638
31,260,000	プット	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17	27/4/2018	(28,010)	5,439
26,060,000	プット	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 18.25	27/4/2018	(57,472)	115,827
15,706,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.09	3/5/2018	(100,487)	41,915
17,850,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.9	17/5/2018	1,378,977	1,528,256
20,380,000	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,100	29/5/2018	51,130	232,512
7,276,000	コール	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 20	19/7/2018	(216,612)	130,998
26,800,000	プット	OTC USD/INR	JP Morgan	USD 65	24/7/2018	(146,813)	192,019
24,494,000	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 4.195	2/1/2019	(83,270)	1,306,324
10,240,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.35	6/3/2018	(32,609)	2,155
32,410,000	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.2455	7/3/2018	(122,687)	15,715
32,410,000	プット	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.2205	7/3/2018	65,279	203,562
20,840,000	コール	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 1.005	8/3/2018	(119,309)	-
20,840,000	プット	OTC USD/CHF	Morgan Stanley	USD 0.98	8/3/2018	564,165	799,053
31,260,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.23	12/3/2018	(63,571)	168,816
20,840,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.55	12/3/2018	(192,749)	21
15,630,000	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.315	14/3/2018	(75,713)	5,876
15,630,000	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.215	14/3/2018	(13,031)	36

買建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
10,420,000	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.215	14/3/2018	(13,814)	24
10,420,000	コール	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.315	14/3/2018	(34,209)	3,917
55,400,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13.75	19/3/2018	(817,791)	24
6,675,200	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.3	20/3/2018	(22,398)	31,351
6,675,200	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.19	20/3/2018	(59,800)	21,944
10,420,000	プット	OTC EUR/TRY	Morgan Stanley	EUR 4.1	3/4/2018	(64,228)	-
20,941,000	プット	OTC USD/NOK	Morgan Stanley	USD 7.5	12/4/2018	(17,421)	24,000
18,847,000	プット	OTC USD/NOK	Morgan Stanley	USD 7.8	12/4/2018	(17,601)	171,020
20,941,000	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.225	13/4/2018	(66,388)	14,736
15,630,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.09	24/4/2018	(97,598)	33,491
18,847,000	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 11.4	24/4/2018	(40,631)	116,888
20,840,000	プット	OTC USD/TRY	Morgan Stanley	USD 3.65	27/4/2018	(7,845)	17,163
31,260,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18.45	12/6/2018	(93,319)	322,095
232,523,000	コール	OTC EUR/CHF	Morgan Stanley	EUR 1.2	25/6/2018	(1,442,538)	604,869
213,030,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 107	20/7/2018	2,684,542	5,375,111
41,340,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 116	24/8/2018	(348,717)	83,492
20,590,000	コール	OTC USD/JPY	RBS Plc	USD 110	12/3/2018	(19,604)	5,927
9,250,000	プット	OTC EUR/GBP	RBS Plc	EUR 0.81	30/3/2018	(13,088)	7
41,680,000	コール	OTC GBP/USD	RBS Plc	GBP 1.47	20/4/2018	(131,975)	40,995
28,609,000	プット	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.383	7/3/2018	130,667	226,877
28,609,000	コール	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.411	7/3/2018	(27,721)	12,036
38,970,000	プット	OTC EUR/SEK	UBS	EUR 9.65	12/3/2018	(227,409)	12
25,790,000	プット	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 9.45	26/6/2018	(68,494)	214,639
71,680,000	コール	OTC GBP/USD	UBS	GBP 1.5	17/7/2018	(510,116)	280,547
83,764,000	コール	OTC USD/CHF	UBS	USD 1	16/8/2018	89,840	223,863
667	プット	Nifty 50 Index	Citibank	USD 10,044.52	28/3/2018	(62,473)	46,656
3,047,359	コール	TOPIX Index	Citibank	JPY 1,850	13/4/2018	(556,152)	189,647
667	プット	Nifty 50 Index	Citibank	USD 9,875.957	28/6/2018	(45,447)	150,091
9,600,000,000	プット	JGB Index	Deutsche Bank	JPY 100.089	15/3/2018	(78,392)	50,289
2,721,863	コール	TOPIX Index	Deutsche Bank	JPY 1,850	13/4/2018	(694,071)	169,390
149,916,000	コール	DXY Index	Deutsche Bank	USD 95.27	15/6/2018	(891,057)	173,346
910,750	コール	TOPIX Index	JP Morgan	JPY 1,800	13/4/2018	(110,337)	155,383
2,372,000	コール	TOPIX Index	Morgan Stanley	JPY 1,850	13/4/2018	(554,565)	147,617
167	プット	KOSPI 200 Index	UBS	KRW 295.3792	12/4/2018	(80,787)	66,815
664	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	17/9/2018	57,098	83,000
4,080	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.375	17/12/2018	656,839	867,000
875	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	16/12/2019	(116,165)	136,719
886	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	14/12/2020	15,275	282,412
81	プット	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 930	20/4/2018	(37,613)	17,415
61	コール	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 1,120	20/4/2018	113,441	256,810
71	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 1,500	20/4/2018	295,734	559,480
35	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 1,700	20/4/2018	11,013	38,937
3,542	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 25	21/3/2018	(199,060)	265,650

買建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
1,789	コール	DR Horton Inc	Exchange Traded	USD 50	18/5/2018	(251,712)	63,509
227	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,700	16/3/2018	(122,958)	1,801
71	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,675	16/3/2018	(50,322)	694
46	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,650	16/3/2018	(24,460)	702
42	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,425	16/3/2018	(9,124)	33,304
1,881	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,625	15/6/2018	(790,645)	401,874
1,881	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,725	15/6/2018	(631,993)	157,305
35	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,525	15/6/2018	1,699	17,391
117	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 142.5	16/3/2018	(19,785)	3,035
192	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 145	20/4/2018	(35,471)	9,083
532	プット	General Electric Co	Exchange Traded	USD 15	16/3/2018	22,051	40,964
3,514	コール	General Electric Co	Exchange Traded	USD 20	15/6/2018	(193,973)	21,084
1,422	コール	Lincoln National Corp	Exchange Traded	USD 90	16/3/2018	(193,676)	9,954
486	コール	NASDAQ 100 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 7,180	16/3/2018	(2,608,459)	789,750
424	コール	S&P 500 E Mini Index	Exchange Traded	USD 2,800	16/3/2018	(18,206)	254,400
15	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,730	16/3/2018	(31,893)	29,625
351	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 275	1/3/2018	(8,670)	12,811
1,758	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	2/3/2018	(48,697)	34,281
1,727	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	2/3/2018	28,592	106,211
1,620	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 266	2/3/2018	(172,864)	12,150
1,606	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 282	7/3/2018	(68,031)	40,150
1,242	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 275	9/3/2018	74,893	236,601
1,004	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 285	14/3/2018	(31,840)	24,096
9,753	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	16/3/2018	(303,541)	82,900
5,561	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 276	16/3/2018	501,315	1,748,935
1,644	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 277	16/3/2018	54,924	421,686
1,644	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	16/3/2018	(59,476)	338,664
1,242	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 283	16/3/2018	(40,687)	65,826
1,065	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	16/3/2018	51,965	132,592
7,046	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 285	29/3/2018	(137,615)	457,990
4,952	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	20/4/2018	165,329	2,114,504
1,623	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	18/5/2018	362,416	797,705
811	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 294	18/5/2018	16,058	62,853

買建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
2,624	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	15/6/2018	4,023	165,312
3,415	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	20/7/2018	986,062	2,568,080
2,793	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	20/12/2019	348,918	491,568
166	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 120.5	9/3/2018	(6,722)	27,234
19,448	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119.5	23/3/2018	(1,316,877)	7,444,928
533	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 120	23/3/2018	7,566	324,797
530	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119.5	20/4/2018	53,070	318,828
1,547	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119	25/5/2018	246,781	954,790
655	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 118	25/5/2018	8,056	220,039
501	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 121	25/5/2018	484,627	829,781
1,619	コール	Valero Energy Corp	Exchange Traded	USD 95	16/3/2018	(56,179)	204,803
合計						(17,340,889)	66,349,085

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション 2018年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(8,376,000)	コール	OTC NZD/JPY	Bank of America	NZD 78.83	6/3/2018	42,469	(3,505)
(8,376,000)	プット	OTC NZD/JPY	Bank of America	NZD 78.83	6/3/2018	(72,294)	(123,993)
(46,890,000)	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.33	6/3/2018	98,446	(22)
(2,094,000)	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 11.55	14/3/2018	(8,683)	(48,699)
(7,329,000)	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 11.7	14/3/2018	(15,792)	(107,111)
(10,471,000)	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 11.55	14/3/2018	42,668	(34,084)
(5,210,000)	プット	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.77	15/3/2018	81,357	(10,863)
(5,210,000)	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.77	15/3/2018	(7,529)	(59,818)
(6,683,000)	コール	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 58	30/3/2018	23,475	(28,452)
(41,680,000)	コール	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 62.5	10/4/2018	132,941	(18,566)
(28,130,000)	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 56	11/4/2018	(189,529)	(280,979)
(15,630,000)	コール	OTC USD/TRY	Bank of America	USD 3.79	16/4/2018	245,504	(365,316)
(30,650,000)	プット	OTC EUR/NOK	Bank of America	EUR 9.25	4/6/2018	13,022	(81,233)
(14,704,000)	コール	OTC USD/CHF	Bank of America	USD 1.0445	13/6/2018	27,512	(1,528)
(18,760,000)	プット	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 79	14/6/2018	(10,384)	(92,263)
(133,220,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.35	27/7/2018	(42,656)	(237,254)
(10,420,000)	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 22	5/9/2018	153,141	(111,736)
(31,412,000)	コール	OTC CHF/JPY	Barclays	CHF 118.25	1/3/2018	192,310	-
(10,420,000)	プット	OTC USD/TRY	Barclays	USD 3.85	1/3/2018	79,695	(127,558)
(15,630,000)	コール	OTC USD/TRY	Barclays	USD 3.75	1/3/2018	174,489	(222,670)
(104,705,000)	プット	OTC NOK/SEK	Barclays	NOK 1.035	7/3/2018	73,684	(3,142)
(104,705,000)	コール	OTC NOK/SEK	Barclays	NOK 1.035	7/3/2018	(170,284)	(212,031)
(25,680,000)	プット	OTC CAD/MXN	Barclays	CAD 14.2	4/6/2018	(6,480)	(100,407)
(10,471,000)	プット	OTC GBP/USD	BNP Paribas	GBP 1.39	6/3/2018	(78,782)	(126,510)
(10,471,000)	コール	OTC GBP/USD	BNP Paribas	GBP 1.4	6/3/2018	23,869	(10,762)
(75,000,000)	コール	OTC EUR/PLN	BNP Paribas	EUR 4.5	9/3/2018	521,201	-
(20,840,000)	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 106.75	12/3/2018	16,093	(102,695)
(20,840,000)	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 106.75	12/3/2018	566	(160,215)
(83,360,000)	プット	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.74	15/3/2018	391,939	(42)
(36,705,000)	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.3	22/3/2018	81,334	(553)
(9,774,000)	コール	OTC EUR/BRL	BNP Paribas	EUR 3.95	27/3/2018	38,719	(180,594)
(18,847,000)	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 57	11/4/2018	(25,144)	(382,106)
(41,882,000)	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 55	11/4/2018	(15,554)	(174,706)
(30,910,000)	コール	OTC USD/KRW	BNP Paribas	USD 1,130	16/4/2018	(8,629)	(96,259)
(26,467,000)	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.3585	13/6/2018	57,823	(55,932)
(50,020,000)	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.6	20/7/2018	48,071	(372,097)
(20,590,000)	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.275	6/3/2018	(30,796)	(127,014)
(5,235,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.66	6/3/2018	(2,868)	(60,187)
(5,235,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.66	6/3/2018	21,907	(11,287)
(5,235,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.5	7/3/2018	(45,442)	(99,205)
(10,471,000)	プット	OTC CHF/SEK	Citibank	CHF 8.6	8/3/2018	6,708	(9,076)
(19,366,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	9/3/2018	32,191	(6,832)
(41,882,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	9/3/2018	63,336	(14,774)
(5,210,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19.2	12/3/2018	117,396	(13,728)
(31,260,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.45	12/3/2018	113,097	(47,580)
(41,680,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18	12/3/2018	132,459	(4,625)

売建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(10,641,400)	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.825	27/3/2018	41,313	(805)
(41,882,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 111.5	12/4/2018	55,736	(39,964)
(9,975,000)	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.3	18/4/2018	21,796	(5,058)
(41,882,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 17.65	24/5/2018	35,708	(98,398)
(5,275,000)	プット	OTC EUR/NOK	Citibank	EUR 9.5	4/6/2018	9,979	(47,125)
(21,280,000)	プット	OTC EUR/NOK	Citibank	EUR 9.25	4/6/2018	26,205	(56,399)
(62,520,000)	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.725	7/6/2018	(7,766)	(103,982)
(14,000,000)	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.12	14/6/2018	42,508	(6,132)
(31,260,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 21.5	5/9/2018	155,801	(411,403)
(9,790,000)	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.7588	3/1/2019	19,721	(106,418)
(25,620,000)	プット	OTC CAD/MXN	Credit Suisse	CAD 14.2	4/6/2018	(4,102)	(100,173)
(31,412,000)	コール	OTC CHF/JPY	Deutsche Bank	CHF 116.25	1/3/2018	83,874	-
(62,520,000)	プット	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 3.77	1/3/2018	214,716	(6,605)
(15,706,000)	プット	OTC EUR/AUD	Deutsche Bank	EUR 1.565	7/3/2018	(3,887)	(80,800)
(15,706,000)	コール	OTC EUR/AUD	Deutsche Bank	EUR 1.565	7/3/2018	22,006	(97,423)
(15,706,000)	コール	OTC EUR/NZD	Deutsche Bank	EUR 1.685	7/3/2018	(15,421)	(139,370)
(15,706,000)	プット	OTC EUR/NZD	Deutsche Bank	EUR 1.685	7/3/2018	292	(55,032)
(51,000,000)	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.215	7/3/2018	112,685	(208,865)
(15,010,000)	プット	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.3785	7/3/2018	(4,113)	(85,539)
(15,010,000)	コール	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.406	7/3/2018	71,608	(10,865)
(6,683,000)	プット	OTC USD/RUB	Deutsche Bank	USD 57	7/3/2018	(57,325)	(106,311)
(20,840,000)	プット	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.98	8/3/2018	(526,465)	(799,052)
(20,840,000)	プット	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.9675	8/3/2018	477,358	(524,629)
(31,260,000)	コール	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.93	8/3/2018	(333,806)	(486,355)
(31,260,000)	プット	OTC USD/CHF	Deutsche Bank	USD 0.95	8/3/2018	(175,378)	(265,407)
(36,400,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 108	8/3/2018	(27,572)	(383,927)
(94,050,000)	コール	OTC EUR/PLN	Deutsche Bank	EUR 4.5	9/3/2018	619,024	-
(15,630,000)	コール	OTC USD/NOK	Deutsche Bank	USD 7.85	9/3/2018	84,086	(127,857)
(15,630,000)	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.24	12/3/2018	45,578	(30,195)
(15,630,000)	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.225	12/3/2018	(82,630)	(158,017)
(12,267,692)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 111.5	12/3/2018	23,558	(364)
(5,235,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.5	12/3/2018	(43,832)	(108,170)
(20,941,000)	コール	OTC EUR/SEK	Deutsche Bank	EUR 10.1	23/3/2018	(50,979)	(181,312)
(31,412,000)	プット	OTC EUR/SEK	Deutsche Bank	EUR 9.9	23/3/2018	43,114	(30,296)
(35,000,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 119	23/3/2018	183,750	-
(26,050,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18	26/3/2018	116,082	(20,941)
(9,250,000)	プット	OTC EUR/GBP	Deutsche Bank	EUR 0.81	30/3/2018	28,121	(7)
(35,500,000)	プット	OTC EUR/JPY	Deutsche Bank	EUR 125	12/4/2018	53,275	(102,494)
(10,594,000)	プット	OTC USD/CAD	Deutsche Bank	USD 1.21	13/4/2018	32,776	(2,608)
(15,706,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 109	18/4/2018	(7,154)	(66,366)
(15,706,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 109	18/4/2018	(7,154)	(66,366)
(41,882,000)	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 4.15	24/4/2018	24,710	(105,961)
(41,882,000)	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.285	17/5/2018	53,891	(110,249)
(33,340,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 21.65	25/5/2018	191,272	(57,111)
(52,100,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 106	6/6/2018	(601,281)	(804,471)

売建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(40,435,000)	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 119.25	13/6/2018	97,452	(6,466)
(41,882,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20	15/6/2018	(49,569)	(480,116)
(26,800,000)	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 65	24/7/2018	305,121	(192,019)
(26,800,000)	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 64.5	26/7/2018	240,282	(137,330)
(25,017,000)	コール	OTC AUD/JPY	Goldman Sachs	AUD 85.15	5/3/2018	61,576	(4,808)
(25,017,000)	プット	OTC AUD/JPY	Goldman Sachs	AUD 83.5	5/3/2018	(27,809)	(94,838)
(92,653,000)	プット	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.756	6/3/2018	95,005	(5,216)
(12,920,000)	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.4	6/3/2018	265,443	(251)
(20,840,000)	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 12	14/3/2018	166,140	(475,107)
(26,050,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 15.25	16/3/2018	88,440	-
(26,050,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 15.25	16/3/2018	139,550	-
(31,412,000)	コール	OTC USD/SEK	Goldman Sachs	USD 8.4	12/4/2018	(113,683)	(179,743)
(5,235,250)	コール	OTC CHF/JPY	Goldman Sachs	CHF 112	1/5/2018	22,673	(112,724)
(41,882,000)	プット	OTC CHF/JPY	Goldman Sachs	CHF 115	1/5/2018	(124,925)	(851,063)
(41,882,000)	プット	OTC CHF/JPY	Goldman Sachs	CHF 112	1/5/2018	(21,614)	(285,565)
(62,010,000)	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 3.78	2/5/2018	414,346	(18,463)
(41,882,000)	コール	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 4.4	2/7/2018	66,113	(226,056)
(26,800,000)	プット	OTC USD/INR	Goldman Sachs	USD 62.5	26/7/2018	80,125	(36,964)
(62,823,000)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 98	14/8/2018	114,565	(334,536)
(36,172,500)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20.5	5/9/2018	230,633	(769,154)
(2,600,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,242	2/3/2018	50,765	-
(10,420,000)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,085	8/3/2018	75,889	(73,836)
(41,680,000)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,065	8/3/2018	212,204	(32,375)
(31,411,000)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,050	28/3/2018	38,593	(44,237)
(18,500,000)	プット	OTC EUR/GBP	HSBC Bank Plc	EUR 0.81	30/3/2018	59,876	(15)
(31,260,000)	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.4	3/4/2018	(332,622)	(411,303)
(10,420,000)	プット	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,038.25	9/4/2018	28,522	(12,376)
(41,680,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,140	9/4/2018	53,564	(81,270)
(17,850,000)	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.9	17/5/2018	(1,299,330)	(1,528,257)
(31,412,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.7	18/5/2018	13,049	(39,648)
(62,824,000)	プット	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.35	30/5/2018	3,467	(528,909)
(38,720,000)	プット	OTC AUD/USD	HSBC Bank Plc	AUD 0.7177	13/6/2018	106,907	(52,144)
(173,750,000)	プット	OTC EUR/USD	HSBC Bank Plc	EUR 1.1115	13/6/2018	383,864	(48,190)
(12,988,000)	コール	OTC USD/SEK	HSBC Bank Plc	USD 8.9165	13/6/2018	42,902	(20,415)
(41,680,000)	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,225	10/9/2018	180,351	(210,895)
(5,235,000)	コール	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.2	1/3/2018	(19,469)	(69,725)
(41,882,000)	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.1	1/3/2018	138,210	-
(10,471,000)	コール	OTC GBP/AUD	JP Morgan	GBP 1.7975	7/3/2018	49,298	(11,726)
(10,471,000)	プット	OTC GBP/AUD	JP Morgan	GBP 1.7975	7/3/2018	(112,458)	(226,645)
(10,471,000)	コール	OTC GBP/NZD	JP Morgan	GBP 1.925	7/3/2018	32,763	(34,867)
(10,471,000)	プット	OTC GBP/NZD	JP Morgan	GBP 1.925	7/3/2018	(14,354)	(124,934)
(36,400,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 106	8/3/2018	(12,726)	(70,602)
(20,840,000)	プット	OTC USD/NOK	JP Morgan	USD 8.2	9/3/2018	12,567	(871,049)
(31,260,000)	プット	OTC USD/NOK	JP Morgan	USD 8	9/3/2018	(444,111)	(559,148)
(31,260,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 11.8	14/3/2018	(290,850)	(358,059)
(35,150,000)	コール	OTC USD/HKD	JP Morgan	USD 7.75	15/3/2018	(98,895)	(330,181)

売建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(15,630,000)	コール	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 3.79	16/3/2018	277,364	(191,953)
(5,826,000)	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,070	27/3/2018	(47,686)	(91,383)
(20,941,000)	コール	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1.31	12/4/2018	(17,039)	(62,607)
(9,683,000)	コール	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 13,550	12/4/2018	(140,131)	(210,508)
(26,176,000)	プット	OTC AUD/JPY	JP Morgan	AUD 84.25	16/4/2018	(111,091)	(406,464)
(20,380,000)	コール	OTC USD/KRW	JP Morgan	USD 1,100	16/4/2018	(46,415)	(143,220)
(41,680,000)	プット	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 17.5	27/4/2018	56,797	(34,066)
(7,276,000)	コール	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 22.5	19/7/2018	92,225	(30,740)
(24,494,000)	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 3.765	2/1/2019	47,094	(272,896)
(20,660,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.35	6/3/2018	382,820	(4,348)
(6,282,000)	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 11.55	6/3/2018	34,777	(7,181)
(6,282,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 11.55	6/3/2018	(46,117)	(125,811)
(28,609,000)	コール	OTC GBP/USD	Morgan Stanley	GBP 1.411	7/3/2018	139,213	(12,036)
(28,609,000)	プット	OTC GBP/USD	Morgan Stanley	GBP 1.383	7/3/2018	(71,879)	(226,877)
(10,420,000)	コール	OTC USD/NOK	Morgan Stanley	USD 7.8	9/3/2018	(8,346)	(127,082)
(41,680,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.75	12/3/2018	140,628	-
(62,520,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.14	12/3/2018	141,309	(26,432)
(8,376,000)	コール	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 83.75	13/3/2018	11,345	(36,311)
(8,376,000)	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 83.75	13/3/2018	(19,189)	(61,169)
(10,420,000)	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.255	14/3/2018	65,463	(7,821)
(15,630,000)	プット	OTC USD/CAD	Morgan Stanley	USD 1.255	14/3/2018	64,762	(11,732)
(6,675,200)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.3	20/3/2018	49,473	(31,350)
(9,536,000)	コール	OTC EUR/BRL	Morgan Stanley	EUR 4.13	12/4/2018	125,288	(55,052)
(41,882,000)	プット	OTC USD/NOK	Morgan Stanley	USD 7.65	12/4/2018	46,916	(146,160)
(10,641,400)	コール	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.79	23/4/2018	20,460	(62,395)
(10,641,400)	プット	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.775	23/4/2018	(2,782)	(88,265)
(41,882,000)	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 11.1	24/4/2018	22,577	(95,991)
(41,680,000)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18	12/6/2018	96,477	(226,168)
(265,660,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 104	20/7/2018	(1,728,719)	(3,562,570)
(93,000,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 121	24/8/2018	390,385	(43,181)
(6,282,000)	コール	OTC USD/ZAR	RBS Plc	USD 11.82	6/3/2018	23,710	(33,645)
(6,282,000)	プット	OTC USD/ZAR	RBS Plc	USD 11.82	6/3/2018	28,150	(59,044)
(10,471,000)	プット	OTC GBP/AUD	RBS Plc	GBP 1.773	7/3/2018	6,385	(82,836)
(10,471,000)	コール	OTC GBP/AUD	RBS Plc	GBP 1.773	7/3/2018	47,846	(59,481)
(10,471,000)	コール	OTC GBP/NZD	RBS Plc	GBP 1.8925	7/3/2018	(60,810)	(174,270)
(10,471,000)	プット	OTC GBP/NZD	RBS Plc	GBP 1.8925	7/3/2018	65,199	(18,764)
(20,941,000)	プット	OTC AUD/CAD	RBS Plc	AUD 0.99	15/3/2018	4,204	(42,497)
(20,941,000)	コール	OTC AUD/CAD	RBS Plc	AUD 1	15/3/2018	(8,911)	(70,360)
(32,410,000)	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.2205	7/3/2018	(42,063)	(203,562)
(32,410,000)	コール	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.2455	7/3/2018	13,323	(15,715)
(20,941,000)	コール	OTC USD/CHF	UBS	USD 0.96	17/5/2018	31,662	(23,203)
(31,110,000)	プット	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 9.2	26/6/2018	20,617	(86,779)
(667)	プット	Nifty 50 Index	Citibank	USD 9,526.76	28/3/2018	15,558	(10,688)
(667)	プット	Nifty 50 Index	Citibank	USD 8,836.383	28/6/2018	13,153	(31,230)
(9,600,000,000)	コール	JGB Index	Deutsche Bank	JPY 100.089	15/3/2018	(896,101)	(904,755)

売建オプション 2018年2月28日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(167)	プット	KOSPI 200 Index	UBS	KRW 270.5052	12/4/2018	40,251	(9,507)
(4,080)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.25	17/12/2018	(388,661)	(433,500)
(106)	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 1,600	20/4/2018	(168,292)	(347,415)
(5,433)	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 31	20/4/2018	(797,014)	(1,181,677)
(360)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 18	21/3/2018	18,897	(67,500)
(402)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	21/3/2018	(2,838)	(76,380)
(709)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 15	21/3/2018	14,747	(56,720)
(709)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	21/3/2018	15,456	(99,260)
(2,017)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 17	21/3/2018	(110,169)	(438,698)
(3,542)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 19	21/3/2018	328,698	(566,720)
(3,542)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 19	21/3/2018	(202,602)	(1,168,860)
(888)	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 80	16/3/2018	129,467	(22,200)
(1,199)	コール	JP Morgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 115	16/3/2018	(388,119)	(506,577)
(424)	コール	S&P 500 E Mini Index	Exchange Traded	USD 2,850	16/3/2018	28,432	(57,770)
(351)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 273	1/3/2018	15,637	(3,335)
(759)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 273	9/3/2018	(35,826)	(103,224)
(759)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 282	9/3/2018	31,725	(28,842)
(1,242)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 270	9/3/2018	(35,647)	(104,949)
(1,517)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 269	9/3/2018	92,467	(110,741)
(1,517)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	9/3/2018	(92,998)	(230,584)
(1,951)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 260	16/3/2018	235,088	(118,035)
(2,688)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 252	16/3/2018	583,918	(83,328)
(2,841)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 258	16/3/2018	232,738	(144,891)
(2,434)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 287	18/5/2018	(229,289)	(508,706)
(208)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 121.5	9/3/2018	4,578	(8,125)
(1,595)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119	23/3/2018	303,063	(348,906)
(21,277)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 118	23/3/2018	(2,110,771)	(4,654,344)
(163)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 118.5	20/4/2018	4,861	(45,844)
(604)	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 122	25/5/2018	36,933	(193,468)
(1,002)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 120	25/5/2018	(651,168)	(1,056,797)
(1,743)	プット	US Treasury 2 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 106	25/5/2018	(84,192)	(381,278)
(1,619)	コール	Valero Energy Corp	Exchange Traded	USD 100	16/3/2018	29,626	(41,284)
合計						242,991	(41,896,119)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2018年2月28日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価 益/(損) (米ドル)
	ベルギー		
3,363	KBC Group NV	Merrill Lynch	19,625
	フランス		
13,534	BNP Paribas SA	Merrill Lynch	26,725
16,423	Credit Agricole SA	Merrill Lynch	13,333
38,902	Europcar Groupe SA	Merrill Lynch	35,620
			75,678
	ギリシャ		
27,426	Hellenic Telecommunications Organization SA	Merrill Lynch	(15,402)
849,354	National Bank of Greece SA	Merrill Lynch	(10,577)
			(25,979)
	アイルランド		
(32,283)	Bank of Ireland Group Plc	Merrill Lynch	(2,562)
7,447	Smurfit Kappa Group Plc	Merrill Lynch	3,819
			1,257
	マン島		
(1,714)	GVC Holdings Plc	Merrill Lynch	185
	イタリア		
14,964	Unicredit S.p.A	Merrill Lynch	(118)
14,964	UniCredit SpA	Merrill Lynch	548
			430
	ルクセンブルグ		
44,485	Aroundtown SA	Merrill Lynch	12,220
	オランダ		
17,501	Altice NV	Merrill Lynch	(4,005)
	スペイン		
27,642	Abertis Infraestructuras SA	Merrill Lynch	3,375
(33,882)	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	Merrill Lynch	3,805
59,305	CaixaBank SA	Merrill Lynch	1,593
			8,773
	英国		
(158,689)	Anglo American Plc	Merrill Lynch	(160,651)
(68,488)	CYBG PLC	Merrill Lynch	(1,460)
258,592	Ladbrokes Coral Group Plc	Merrill Lynch	(5,732)
(93,070)	Tullow Oil Plc	Merrill Lynch	(16,319)
119,557	Vodafone Group Plc	Merrill Lynch	2,970
			(181,192)
合計			(93,008)

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 2018年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 105,050,000	ファンドは、ブット・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10/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3%の固定金利を10/4/2019より半年毎に支払う。	Bank of America	5/10/2018	59,590	681,051
USD 50,400,000	ファンドは、ブット・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30/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を31/7/2020より半年毎に支払う。	Bank of America	29/1/2020	20,834	411,434
EUR 3,300,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/12/2017よりITRAXX.X0.28.V1の変動金利を四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/3/2018	10,547	29,123
USD 108,885,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.35%の固定金利を29/10/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2019より四半期毎に支払う。	Barclays	25/4/2019	(47,772)	171,668
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(65,804)	278,654
JPY 1,354,500,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(91,696)	252,761
USD 853,264,000	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2.55%の固定金利を5/9/2018より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/6/2018より四半期毎に支払う。	Citibank	1/3/2018	(1,087,911)	-
USD 177,220,000	ファンドは、ブット・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27/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.96%の固定金利を27/10/2018より半年毎に支払う。	Citibank	25/4/2018	953,032	3,519,417
USD 148,240,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.45%の固定金利を12/4/2019より半年毎に支払う。	Citibank	10/10/2018	2,010,489	3,122,525
USD 21,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.5%の固定金利を24/8/2027より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2027より四半期毎に支払う。	Citibank	22/2/2027	(313,705)	779,682
USD 233,290,000	ファンドは、ブット・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30/4/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.05%の固定金利を31/7/2019より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	29/1/2019	472,612	1,967,871

買建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 303,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/5/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.95%の固定金利を15/8/2019より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	13/2/2019	(53,872)	3,193,897
USD 19,620,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.09%の固定金利を19/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/5/2020より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	28,563	742,248
USD 19,620,000	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19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.09%の固定金利を19/8/2020より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	(145,180)	576,579
USD 39,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.35%の固定金利を20/8/2020より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	18/2/2020	(270,520)	828,529
USD 423,070,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.8%の固定金利を29/9/2018より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/6/2018より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/3/2018	135,522	1,552,807
USD 212,095,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.93%の固定金利を18/1/2019より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	16/7/2018	1,862,591	2,935,834
USD 212,095,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/10/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.08%の固定金利を18/1/2019より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	16/7/2018	1,228,579	1,847,742
USD 18,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を5/8/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/2/2020	(83,877)	277,638
USD 34,930,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(56,890)	1,792,929
USD 10,840,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/5/2023より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.4%の固定金利を16/8/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	14/2/2023	(141,541)	744,944
USD 423,070,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.87%の固定金利を29/9/2018より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/6/2018より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/3/2018	1,054,667	2,620,026

買建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 425,855,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.7%の固定金利を25/10/2018より半年毎に支払う。	JP Morgan	23/4/2018	1,885,798	2,882,395
USD 145,815,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/8/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.17%の固定金利を18/11/2018より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/5/2018	(1,077,705)	1,309,538
USD 213,960,000	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19/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.48%の固定金利を19/4/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	17/10/2018	2,720,891	4,312,188
USD 42,670,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.2%の固定金利を11/6/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/3/2019より四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	(1,175,427)	109,469
USD 162,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3%の固定金利を18/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2022	575,926	7,924,698
USD 9,689,180	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/12/2017よりCDX.NA.HY.29.V1の変動金利を四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	21/3/2018	(111,929)	28,565
USD 100,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/4/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を31/7/2019より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	29/1/2019	90,916	322,756
USD 201,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/4/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を31/7/2019より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	29/1/2019	161,751	645,831
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(95,994)	245,096
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(62,436)	278,654
USD 90,100,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を1/9/2019より半年毎に支払う。	UBS	27/2/2019	(256,319)	1,288,604

買建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 25,190,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/7/2028より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(116,835)	1,553,900
合計				8,016,895	49,229,053

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 2018年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (40,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/9/2018より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、15/3/2019より0.1%の固定金利を毎年支払う。	Barclays	13/3/2018	108,822	-
EUR (3,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、20/12/2017よりITRAXX.XO.IG.28.V1の変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	21/3/2018	(1,593)	(10,727)
USD (39,500,000)	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20/2/2019より2.965%の固定金利を半年毎に受け取り、20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	16/8/2018	119,290	(564,060)
USD (39,500,000)	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20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、20/2/2019より2.965%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	16/8/2018	(37,608)	(720,958)
USD (23,100,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/3/2019より2.45%の固定金利を半年毎に受け取り、10/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	6/9/2018	(673,033)	(1,014,335)
EUR (90,290,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/2/2020より1.65%の固定金利を毎年受け取り、20/8/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	18/2/2019	242,767	(852,414)
EUR (90,290,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/2/2020より1.7%の固定金利を毎年受け取り、22/8/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	20/2/2019	226,303	(754,639)
USD (217,770,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/10/2019より1.85%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	25/4/2019	42,225	(94,586)
USD (105,490,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	(504,750)	(873,965)
USD (105,490,000)	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6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、6/5/2020より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	231,869	(97,787)
USD (366,760,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	3/2/2020	(75,894)	(1,718,978)

売建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (157,795,000)	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3.01%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	726,323	(178,790)
USD (496,720,000)	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27/10/2018より3%の固定金利を半年毎に受け取り、27/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	25/4/2018	(1,188,518)	(2,723,824)
USD (148,240,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは12/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、12/4/2019より1.95%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	10/10/2018	1,006,677	(60,651)
USD (588,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/7/2019より2.95%の固定金利を半年毎に受け取り、30/4/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	29/1/2019	(1,018,465)	(2,127,686)
USD (265,420,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/8/2019より3.05%の固定金利を半年毎に受け取り、20/5/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	15/2/2019	(102,356)	(834,974)
USD (111,070,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/8/2020より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	(12,160)	(303,719)
USD (111,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/8/2020より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	(59,919)	(484,762)
USD (112,110,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	58,264	(396,149)
USD (112,110,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	(17,491)	(388,589)
EUR (6,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、20/12/2017よりITRAXX.XO.IG.28.V1の変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2018	(16,333)	(42,213)
USD (423,070,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/6/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/9/2018より2.65%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/3/2018	62,534	(360,536)

売建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (212,095,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/10/2018より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、18/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	16/4/2018	(1,635,890)	(2,215,421)
USD (214,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/9/2019より1.6%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2019	580,153	(32,027)
USD (214,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/9/2019より2.6%の固定金利を半年毎に受け取り、25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2019	(419,524)	(1,708,324)
USD (87,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/11/2022より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	63,823	(1,762,814)
USD (423,070,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/6/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/9/2018より2.72%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	27/3/2018	(240,342)	(758,603)
USD (51,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/10/2018より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、10/7/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	6/4/2018	(309,183)	(461,752)
USD (140,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/2/2019より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2018	(1,926,337)	(3,823,422)
USD (227,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/2/2019より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、20/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2018	(3,403,552)	(6,181,743)
USD (19,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/2/2019より2.985%の固定金利を半年毎に受け取り、23/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2018	47,078	(271,884)
USD (19,750,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/11/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/2/2019より2.985%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2018	(64,653)	(383,615)
USD (42,670,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/6/2019より3.4%の固定金利を半年毎に受け取り、11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	441,481	(339,256)

売建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (64,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/6/2019より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	954,541	(28,511)
USD (141,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/10/2019より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	(242,972)	(892,246)
USD (141,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、1/10/2019より1.75%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	571,488	(36,102)
USD (26,930,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/10/2019より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、10/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	8/4/2019	(144,804)	(314,463)
EUR (10,775,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	(3,170)	(45,002)
USD (348,000,000)	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8/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、8/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	6/11/2019	(1,757,602)	(2,879,902)
USD (74,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/6/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	(398,391)	(632,034)
USD (74,400,000)	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18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、18/6/2020より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	70,137	(80,336)
USD (186,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/7/2020より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/1/2020	(541,713)	(1,321,603)
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	880,928	(119)
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	857,727	(95,735)

売建スワップション 2018年2月28日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (18,890,000)	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22/1/2020より1.65%の固定金利を毎年受け取り、22/7/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	UBS	18/1/2019	(54,716)	(151,447)
EUR (18,890,000)	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22/7/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、22/1/2020より0.65%の固定金利を毎年支払う。	UBS	18/1/2019	13,739	(20,516)
USD (350,600,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/9/2019より3%の固定金利を半年毎に受け取り、1/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	27/2/2019	(4,982)	(1,255,330)
USD (113,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	UBS	21/2/2020	(61,565)	(395,800)
USD (113,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/8/2020より3.55%の固定金利を半年毎に受け取り、25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	21/2/2020	40,360	(401,510)
合計				(7,570,987)	(41,093,859)

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 2018年2月28日現在(未監査)

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
アルゼンチン			
USD 386,476	Argentina Bonar Bonds 8% 8/10/2020	428,215	0.02
USD 902,690	Argentina Bonar Bonds 8.75% 7/5/2024	1,036,518	0.05
USD 513,812	Argentine Republic Government International Bond (Step-up coupon) 2.5% 31/12/2038	342,970	0.02
EUR 100,000	Argentine Republic Government International Bond 5.25% 15/1/2028	119,033	0.00
USD 485,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	494,215	0.02
USD 1,519,000	Argentine Republic Government International Bond 5.875% 11/1/2028	1,428,619	0.07
USD 597,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019	614,462	0.03
USD 780,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021	826,020	0.04
USD 404,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 11/1/2048	370,468	0.02
USD 321,000	Argentine Republic Government International Bond 7.125% 28/6/2117	299,172	0.01
ARS 4,483,000	Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	227,221	0.01
USD 33,000	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios SA '144A' 9.5% 20/7/2023	34,327	0.00
USD 150,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	163,500	0.01
USD 263,000	Genneia SA '144A' 8.75% 20/1/2022	285,769	0.01
USD 300,000	Provincia de Rio Negro '144A' 7.75% 7/12/2025	290,250	0.01
USD 215,000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	173,736	0.01
USD 131,000	Tecpetrol SA '144A' 4.875% 12/12/2022	128,052	0.01
USD 131,000	YPF SA '144A' 8.5% 23/3/2021	143,576	0.01
USD 306,000	YPF SA 8.75% 4/4/2024*	341,573	0.01
USD 145,000	YPF SA '144A' 8.75% 4/4/2024	161,856	0.01
		7,909,552	0.37
オーストラリア			
AUD 205,518	Apollo Series 2009-1 Trust '2009-1 A3' FRN 3/10/2040	160,822	0.01
USD 9,000,000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.4% 7/12/2021	8,835,979	0.41
AUD 243,301	National Rmbs Trust '2012-2 A1' FRN 20/6/2044	190,337	0.01
AUD 1,504,266	TORRENS Series 2013-1 Trust '2013-1 A' FRN 12/4/2044	1,175,342	0.05
USD 1,492,856	Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust '144A' 5% 23/10/2023	1,542,121	0.07
USD 1,277,762	Virgin Australia 2013-1B Pass Through Trust '144A' 6% 23/10/2020	1,303,317	0.06
USD 2,750,000	Westpac Banking Corp 1.6% 19/8/2019	2,706,619	0.12
		15,914,537	0.73
バーレーン			
USD 200,000	Bahrain Government International Bond '144A' 6.75% 20/9/2029	191,125	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 (%)
ブラジル			
BRL 51,680	Brazil Letras do Tesouro Nacional 1/1/2019 (Zero Coupon)	1,511,060	0.07
カナダ			
USD 1,731,746	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,805,345	0.08
USD 10,000,000	Bank of Montreal '144A' 1.75% 15/6/2021*	9,654,450	0.45
USD 7,955,000	Bank of Nova Scotia/The 1.875% 26/4/2021	7,724,603	0.36
USD 5,000,000	Canadian Imperial Bank of Commerce '144A' 2.35% 27/7/2022	4,860,643	0.23
USD 6,000,000	CPPIB Capital Inc '144A' 1.25% 20/9/2019	5,881,806	0.27
USD 1,990,000	Enbridge Inc 2.9% 15/7/2022	1,929,639	0.09
USD 17,520,000	Province of Alberta Canada 1.9% 6/12/2019	17,324,398	0.80
USD 4,500,000	Province of Ontario Canada 2.4% 8/2/2022	4,414,550	0.20
USD 10,000,000	Royal Bank of Canada 1.875% 5/2/2020*	9,862,745	0.46
USD 5,595,000	Royal Bank of Canada 2.1% 14/10/2020	5,506,965	0.25
USD 154,000	Stoneway Capital Corp '144A' 10% 1/3/2027	169,400	0.01
USD 4,000,000	Toronto-Dominion Bank/The '144A' 2.25% 15/3/2021	3,934,332	0.18
USD 1,125,000	TransCanada PipeLines Ltd 6.5% 15/8/2018	1,146,171	0.05
		74,215,047	3.43
ケイマン諸島			
USD 4,745	Ambac LSNI LLC '144A' FRN 12/2/2023	4,795	0.00
USD 2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,707,025	0.12
USD 135,000	Gol Finance Inc '144A' 7% 31/1/2025	133,312	0.01
USD 114,240	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd '144A' 6.35% 1/12/2021	112,059	0.01
USD 2,005,000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.25% 15/8/2022	2,027,556	0.09
USD 2,939,787	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd FRN 15/7/2034	2,946,601	0.14
USD 2,810,000	Vale Overseas Ltd 4.375% 11/1/2022	2,875,684	0.13
		10,807,032	0.50
コロンビア			
USD 730,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	757,375	0.03
キプロス			
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,653,721	0.12
EUR 3,230,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	4,177,664	0.20
		6,831,385	0.32
エクアドル			
USD 312,000	Ecuador Government International Bond '144A' 7.875% 23/1/2028	310,637	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
エジプト			
USD 744,000	Egypt Government International Bond '144A' 5.577% 21/2/2023	756,555	0.04
USD 468,000	Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	482,332	0.02
USD 237,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	265,440	0.01
EGP 25,000,000	Egypt Treasury Bills 4/9/2018 (Zero Coupon)	1,299,447	0.06
EGP 3,700,000	Egypt Treasury Bills 16/10/2018 (Zero Coupon)	188,870	0.01
EGP 2,575,000	Egypt Treasury Bills 13/11/2018 (Zero Coupon)	130,463	0.01
EGP 1,200,000	Egypt Treasury Bills 27/11/2018 (Zero Coupon)	60,453	0.00
		3,183,560	0.15
フランス			
USD 3,575,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 2.7% 20/7/2022	3,473,568	0.16
USD 5,970,000	BNP Paribas SA '144A' 2.95% 23/5/2022*	5,866,256	0.27
USD 2,810,000	BPCE SA '144A' 2.75% 11/1/2023	2,723,558	0.13
USD 2,605,000	BPCE SA '144A' 3% 22/5/2022	2,561,095	0.12
		14,624,477	0.68
ドイツ			
EUR 1,698,172	Compartment VCL 24 FRN 21/8/2022	2,078,012	0.10
USD 3,540,000	Deutsche Bank AG/New York NY 3.15% 22/1/2021	3,509,428	0.16
USD 4,800,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/6/2020*	4,735,704	0.22
USD 5,830,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/11/2020*	5,725,897	0.26
		16,049,041	0.74
ガーンジー			
USD 3,000,000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 3.125% 10/12/2020	2,988,675	0.14
インドネシア			
IDR 10,789,000,000	Indonesia Treasury Bond 5.625% 15/5/2023	769,830	0.04
IDR 14,481,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2024	1,153,867	0.05
		1,923,697	0.09
国際機関			
USD 7,080,000	European Investment Bank 2.5% 15/3/2023	6,958,550	0.32
USD 12,120,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.875% 15/8/2019*	11,873,376	0.55
		18,831,926	0.87
アイルランド			
USD 1,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	997,391	0.04
USD 1,010,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,031,721	0.05
USD 1,189,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	1,225,328	0.06
USD 1,775,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 30/10/2020	1,834,798	0.08
USD 1,500,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 5% 1/10/2021	1,575,225	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 (%)
アイルランド(続き)			
USD 5,500,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	5,383,956	0.25
USD 14,650,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/9/2019	14,424,610	0.67
USD 4,015,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.4% 23/9/2021	3,884,699	0.18
USD 754,000	Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	806,943	0.04
		31,164,671	1.44
イタリア			
EUR 173,039	Asset-Backed European Securitisation Transaction Ten Srl FRN 10/12/2028	211,842	0.01
USD 1,530,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.375% 12/1/2023	1,498,767	0.07
USD 2,867,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26/6/2024	2,861,875	0.13
		4,572,484	0.21
日本			
USD 1,740,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	1,734,863	0.08
USD 2,840,000	Mizuho Financial Group Inc 2.953% 28/2/2022	2,789,488	0.13
USD 5,395,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	5,305,991	0.24
		9,830,342	0.45
レバノン			
USD 426,000	Lebanon Government International Bond 6.1% 4/10/2022	412,421	0.02
USD 230,000	Lebanon Government International Bond 6.25% 4/11/2024	218,213	0.01
USD 130,000	Lebanon Government International Bond 6.65% 22/4/2024	125,937	0.00
USD 603,000	Lebanon Government International Bond 6.85% 23/3/2027	570,966	0.03
		1,327,537	0.06
ルクセンブルグ			
USD 395,000	Allergan Funding SCS 2.45% 15/6/2019	393,106	0.02
USD 11,185,000	Allergan Funding SCS 3% 12/3/2020	11,189,659	0.51
USD 3,475,000	Allergan Funding SCS 3.45% 15/3/2022	3,469,659	0.16
USD 200,000	Puma International Financing SA '144A' 5% 24/1/2026	196,834	0.01
USD 200,000	Rede D'or Finance Sarl '144A' 4.95% 17/1/2028	193,480	0.01
USD 200,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025	197,875	0.01
		15,640,613	0.72
メキシコ			
USD 755,000	Petroleos Mexicanos '144A' 5.35% 12/2/2028	741,976	0.03
オランダ			
USD 2,950,000	Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 2.82% 19/1/2022	2,897,559	0.13
USD 2,080,000	Enel Finance International NV '144A' 2.875% 25/5/2022	2,038,983	0.10
USD 1,340,000	ING Groep NV 3.15% 29/3/2022	1,326,731	0.06
USD 2,210,000	Mylan NV 2.5% 7/6/2019	2,197,139	0.10
USD 1,583,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.75% 1/6/2018	1,586,958	0.07
USD 703,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	706,304	0.03
USD 2,947,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	3,000,046	0.14

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
USD 304,000	Petrobras Global Finance BV 5.375% 27/1/2021	313,497	0.02
USD 1,971,000	Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022	2,076,449	0.10
USD 152,000	Petrobras Global Finance BV 6.85% 5/6/2115	143,830	0.01
USD 269,000	Petrobras Global Finance BV 8.375% 23/5/2021	301,953	0.01
		16,589,449	0.77
ノルウェー			
USD 3,000,000	DNB Boligkreditt AS '144A' 2% 28/5/2020	2,956,176	0.14
パナマ			
USD 1,380,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,417,928	0.07
ロシア連邦			
RUB 101,599,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.4% 27/5/2020	1,813,301	0.08
RUB 23,881,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	429,708	0.02
RUB 9,777,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.4% 7/12/2022	180,537	0.01
RUB 55,169,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.5% 18/8/2021	1,014,303	0.05
RUB 20,775,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.75% 16/9/2026	391,760	0.02
RUB 57,050,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 3/2/2027	1,105,775	0.05
		4,935,384	0.23
南アフリカ			
ZAR 9,614,500	Republic of South Africa Government Bond 6.25% 31/3/2036	622,595	0.03
ZAR 5,703,906	Republic of South Africa Government Bond 6.5% 28/2/2041	366,474	0.02
ZAR 2,205,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 28/2/2048	181,377	0.01
USD 363,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.875% 14/4/2026	364,815	0.01
USD 1,000,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.5% 9/3/2020	1,038,750	0.05
USD 276,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	298,080	0.01
		2,872,091	0.13
スイス			
USD 3,340,000	Credit Suisse AG/New York NY 2.3% 28/5/2019	3,322,707	0.15
USD 5,745,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	5,743,041	0.27
USD 675,000	UBS AG/Stamford CT 2.375% 14/8/2019	671,195	0.03
USD 2,215,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 15/8/2023	2,154,786	0.10
USD 2,395,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2.65% 1/2/2022	2,332,184	0.11
USD 2,890,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 3.491% 23/5/2023	2,892,881	0.13
		17,116,794	0.79
チュニジア			
EUR 130,000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 4.5% 22/6/2020	166,051	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
トルコ			
USD 200,000	Petkim Petrokimya Holding AS '144A' 5.875% 26/1/2023	201,000	0.01
TRY 1,383,000	Turkey Government Bond 11% 2/3/2022	350,483	0.02
USD 762,000	Turkey Government International Bond 4.875% 9/10/2026	729,139	0.03
USD 333,000	Turkey Government International Bond 5.625% 30/3/2021	346,528	0.02
USD 2,133,000	Turkey Government International Bond 6.25% 26/9/2022*	2,275,645	0.11
USD 888,000	Turkey Government International Bond 7% 5/6/2020	946,275	0.04
USD 675,000	Turkey Government International Bond 7.375% 5/2/2025	758,531	0.03
		5,607,601	0.26
英国			
USD 677,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.125% 15/4/2021	691,227	0.03
USD 1,665,000	Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,649,967	0.08
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,214,979	0.15
USD 2,200,000	Barclays Plc 2.875% 8/6/2020	2,183,738	0.10
USD 2,975,000	Barclays Plc 3.684% 10/1/2023	2,954,400	0.14
USD 3,845,000	Barclays Plc 4.375% 11/9/2024	3,778,089	0.17
USD 1,590,000	BAT International Finance Plc '144A' 2.75% 15/6/2020	1,579,036	0.07
USD 709,000	BP Capital Markets Plc 2.521% 15/1/2020	706,637	0.03
GBP 3,592,695	Compartment Driver UK Four 'A' FRN 25/3/2025	4,953,274	0.23
GBP 178,804	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	245,273	0.01
USD 6,540,000	HSBC Holdings Plc FRN 13/3/2023	6,502,971	0.30
USD 7,530,000	HSBC Holdings Plc 2.95% 25/5/2021	7,467,667	0.35
USD 3,310,000	Lloyds Banking Group Plc 3% 11/1/2022	3,262,674	0.15
USD 3,640,000	Lloyds Banking Group Plc 4.5% 4/11/2024	3,696,566	0.17
USD 274,000	MARB BondCo Plc '144A' 6.875% 19/1/2025	262,697	0.01
GBP 5,892,760	Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	8,109,698	0.38
USD 2,235,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,198,667	0.10
USD 3,800,000	Santander UK Group Holdings Plc 2.875% 5/8/2021	3,732,812	0.17
USD 475,000	Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	471,555	0.02
USD 6,490,000	Sky Plc '144A' 2.625% 16/9/2019	6,476,215	0.30
EUR 4,569,838	Turbo Finance 7 Plc FRN 20/6/2023	5,589,527	0.26
GBP 492,400	Unique Pub Finance Co Plc/ The 6.542% 30/3/2021	723,603	0.03
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/ The 7.395% 28/3/2024	1,676,506	0.08
		72,127,778	3.33
米国			
USD 2,390,000	Abbott Laboratories 2.35% 22/11/2019	2,377,528	0.11
USD 4,665,000	Abbott Laboratories 2.9% 30/11/2021	4,631,783	0.21
USD 1,500,000	Abbott Laboratories 3.25% 15/4/2023	1,492,408	0.07
USD 8,970,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	8,909,143	0.41
USD 4,655,000	Adams Mill CLO Ltd '2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	4,669,537	0.22
USD 950,000	AIG Global Funding '144A' 1.95% 18/10/2019	937,302	0.04
USD 3,090,000	Air Lease Corp 2.5% 1/3/2021	3,035,465	0.14
USD 680,000	Air Lease Corp 2.625% 4/9/2018	680,421	0.03
USD 855,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	826,206	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 565,000	Air Lease Corp 3.375% 15/1/2019	568,406	0.03
USD 4,500,000	ALM V Ltd '2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	4,504,957	0.21
USD 2,525,000	ALM XII Ltd '2015-12A A1R' '144A' FRN 16/4/2027	2,527,731	0.12
USD 1,338	Ambac Assurance Corp '144A' 5.1% 7/6/2020	1,776	0.00
USD 1,272,322	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	1,311,636	0.06
USD 3,315,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	3,206,694	0.15
USD 8,380,000	American Express Credit Account Master Trust '2017-4 A' 1.64% 15/12/2021	8,304,679	0.38
USD 3,459,000	American International Group Inc 2.3% 16/7/2019	3,437,393	0.16
USD 4,215,000	American Tower Corp 3.4% 15/2/2019	4,242,164	0.20
USD 3,755,104	Americold 2010 LLC '2010-ARTA A1' '144A' 3.847% 14/1/2029	3,808,716	0.18
USD 4,550,000	Americredit Automobile Receivables Trust '2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	4,553,172	0.21
USD 7,200,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2016-3 A3' 1.46% 10/5/2021	7,161,323	0.33
USD 1,030,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2017-1 A3' 1.87% 18/8/2021	1,018,531	0.05
USD 1,740,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust '2017-2 A3' 1.98% 20/12/2021	1,721,075	0.08
USD 2,965,000	Amgen Inc 2.2% 11/5/2020	2,925,828	0.14
USD 2,275,000	Amgen Inc 2.65% 11/5/2022	2,221,724	0.10
USD 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd '2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,426,921	0.16
USD 1,855,000	Amphenol Corp 2.2% 1/4/2020	1,831,520	0.08
USD 1,150,000	Analog Devices Inc 2.5% 5/12/2021	1,124,652	0.05
USD 1,000,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd '2014-3RA C' '144A' FRN 28/1/2031	1,004,096	0.05
USD 1,995,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 3.5% 1/12/2022	1,969,595	0.09
USD 1,435,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	1,504,956	0.07
USD 6,590,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.65% 1/2/2021	6,537,810	0.30
USD 3,520,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.3% 1/2/2023	3,514,826	0.16
USD 1,760,000	Anthem Inc 2.5% 21/11/2020	1,737,602	0.08
USD 2,200,000	Apache Corp 3.25% 15/4/2022	2,177,793	0.10
USD 804,202	Apidos CLO XV '2013-15A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	805,377	0.04
USD 750,000	Apidos CLO XVI '2013-16A A1R' '144A' FRN 19/1/2025	751,022	0.03
USD 2,580,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd '2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	2,588,875	0.12
USD 7,690,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/4/2027	7,695,386	0.36
USD 6,040,000	ARI Fleet Lease Trust '2017-A A2' '144A' 1.91% 15/4/2026	6,009,877	0.28
USD 5,245,000	ARI Fleet Lease Trust '2017-A A3' '144A' 2.28% 15/4/2026	5,179,963	0.24
USD 3,790,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd '2013-2A A1LR' '144A' FRN 17/2/2026	3,788,421	0.18
USD 1,820,963	Atrium X '144A' FRN 16/7/2025	1,823,414	0.08
USD 15,000,000	Aventura Mall Trust '2013-AVM A' '144A' FRN 5/12/2032	15,265,541	0.71
USD 3,405,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 2.875% 20/1/2022	3,340,080	0.15

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 560,000	Avon International Operations Inc '144A' 7.875% 15/8/2022	581,700	0.03
USD 3,042,138	B2R Mortgage Trust '2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	3,007,895	0.14
USD 5,624,252	B2R Mortgage Trust '2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	5,619,112	0.26
USD 2,685,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 2.773% 15/12/2022	2,622,092	0.12
USD 195,216	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2007-5 AM' FRN 10/2/2051	195,157	0.01
USD 7,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust '2016-UB10 A2' ' 2.723% 15/7/2049	7,367,890	0.34
USD 43,024	Banc of America Mortgage 2003-J Trust '2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	43,346	0.00
USD 3,570,000	Bank of America Corp FRN 20/1/2023	3,548,294	0.16
USD 9,445,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	9,277,970	0.43
USD 2,265,000	Bank of America Corp 2.25% 21/4/2020	2,241,595	0.10
USD 9,135,000	BAT Capital Corp '144A' 2.297% 14/8/2020	8,974,571	0.41
USD 3,485,000	BB&T Corp 2.45% 15/1/2020	3,467,549	0.16
USD 15,353	Bear Stearns ALT-A Trust '2004-13 A1' FRN 25/11/2034	15,396	0.00
USD 2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020	2,010,456	0.09
USD 940,000	Berkshire Hathaway Energy Co '144A' 2.375% 15/1/2021	928,518	0.04
USD 5,461,562	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd '2013-3A AR' '144A' FRN 29/10/2025	5,463,652	0.25
USD 10,000,000	BlueMountain CLO 2013-4 Ltd '2013-4A AR' '144A' FRN 15/4/2025	10,015,066	0.46
USD 2,610,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	2,579,245	0.12
USD 7,779,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	7,618,924	0.35
USD 3,130,000	BSPRT 2017-FL2 Issuer Ltd '2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	3,146,548	0.15
USD 1,060,000	CA Inc 3.6% 15/8/2022	1,071,517	0.05
USD 3,659,000	Caesars Palace Las Vegas Trust '2017-VICI A' '144A' 3.531% 15/10/2034	3,684,741	0.17
USD 955,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	941,662	0.04
USD 5,500,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust '2015-A2 A2' 2.08% 15/3/2023	5,428,985	0.25
USD 8,695,000	Capital One NA 2.35% 17/8/2018	8,689,400	0.40
USD 1,500,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3 Ltd '2014- 3A A2R' '144A' FRN 27/7/2026	1,508,567	0.07
USD 4,836,121	CarMax Auto Owner Trust '2016-2 A3' 1.52% 16/2/2021	4,798,971	0.22
USD 4,211,195	CarMax Auto Owner Trust '2015-4 A3' 1.56% 16/11/2020	4,190,822	0.19
USD 3,250,000	CarMax Auto Owner Trust '2014-4 B' 2.2% 15/9/2020	3,241,788	0.15
USD 1,306,760	Catamaran CLO 2012-1 Ltd '2012-1A AR' '144A' FRN 20/12/2023	1,308,483	0.06
USD 1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust '2016-HEAT A' '144A' ' 3.357% 10/4/2029	1,080,267	0.05
USD 1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,759,382	0.08
USD 4,680,000	CGDB Commercial Mortgage Trust '2017-BIO A' '144A' FRN 15/5/2030	4,688,760	0.22
USD 3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust '2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	3,159,742	0.15

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 8,105,281	CGGS Commercial Mortgage Trust '2016-RNDA AFX' '144A' ' 2.757% 10/2/2033	8,050,024	0.37
USD 752,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.579% 23/7/2020	757,680	0.04
USD 3,425,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.464% 23/7/2022	3,510,353	0.16
USD 8,230,000	Chesapeake Funding II LLC '2017-2A A2' '144A' FRN 15/5/2029	8,231,029	0.38
USD 6,775,663	Chesapeake Funding II LLC '2016-2A A1' '144A' 1.88% 15/6/2028	6,744,608	0.31
USD 2,910,000	Chicago Skyscraper Trust '2017-SKY A' '144A' FRN 15/2/2030	2,918,250	0.13
USD 296,214	CHL Mortgage Pass-Through Trust '2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	264,397	0.01
USD 1,000,000	CIFC Funding 2014-II Ltd '2014-2A A1LR' '144A' FRN 24/5/2026	1,002,854	0.05
USD 1,000,000	CIFC Funding 2014-V Ltd '2014-5A CR' '144A' FRN 17/1/2027	1,007,179	0.05
USD 7,350,000	CIFC Funding 2015-II Ltd '2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	7,346,974	0.34
USD 9,305,000	Citibank Credit Card Issuance Trust '2017-A3 A3' 1.92% 7/4/2022	9,158,435	0.42
USD 5,790,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2015-SSHP A' ' 144A' FRN 15/9/2027	5,793,661	0.27
USD 3,750,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust '2013-375P A' ' 144A' 3.251% 10/5/2035	3,733,670	0.17
USD 3,365,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2023	3,287,215	0.15
USD 775,000	Citigroup Inc 2.45% 10/1/2020	769,984	0.04
USD 2,000,000	Citigroup Inc 2.65% 26/10/2020	1,982,421	0.09
USD 640,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	626,545	0.03
USD 1,615,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 2/3/2020	1,593,037	0.07
USD 2,005,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.3% 3/12/2018	2,001,273	0.09
USD 6,510,000	CLNS Trust '2017-IKPR A' '144A' FRN 11/6/2032	6,526,679	0.30
USD 5,130,000	CNH Equipment Trust '2016-B A3' 1.63% 15/8/2021	5,085,042	0.24
USD 6,140,000	CNH Equipment Trust '2017-B A3' 1.86% 15/9/2022	6,044,306	0.28
USD 5,390,000	CNH Equipment Trust '2017-C A3' 2.08% 15/2/2023	5,313,902	0.25
USD 2,832,855	Colony American Homes '2015-1A A' '144A' FRN 17/7/2032	2,839,741	0.13
USD 1,180,578	COMM '2013-GAM A1' '144A' 1.705% 10/2/2028	1,157,853	0.05
USD 3,013,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust '2005-C6 F' '144A' FRN 10/6/2044	3,070,328	0.14
USD 6,144,917	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust '2013-CR7 ASB' 2.739% 10/3/2046	6,128,334	0.28
USD 1,608,780	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust '2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	1,596,086	0.07
USD 926,400	COMM 2013-SFS Mortgage Trust '2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	894,333	0.04
USD 5,238,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust '2014-TWC A' '144A' FRN 13/2/2032	5,245,068	0.24
USD 5,500,000	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust '2015-CR22 A2' 2.856% 10/3/2048	5,517,475	0.25
USD 10,862,152	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust '2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	492,527	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 2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust '2015-CR24 ASB' 3.445% 10/8/2048	2,681,090	0.12
USD 10,700,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust '2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	10,732,401	0.50
USD 258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	282	0.00
USD 205,833	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	209,692	0.01
USD 2,250,000	Continental Airlines 2012-3 Class C Pass Through Trust 6.125% 29/4/2018	2,264,288	0.10
USD 42,580,000	Core Industrial Trust '2015-CALW XA' '144A' FRN 10/2/2034	1,209,911	0.06
USD 3,000,000	Core Industrial Trust '2015-CALW A' '144A' 3.04% 10/2/2034	2,993,459	0.14
USD 6,450,000	Core Industrial Trust '2015-TEXW A' '144A' 3.077% 10/2/2034	6,442,381	0.30
USD 3,585,000	Cox Communications Inc '144A' 3.15% 15/8/2024	3,466,374	0.16
USD 8,500,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-3A A' '144A' 2.15% 15/4/2024	8,431,805	0.39
USD 10,820,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2016-2A A' '144A' 2.42% 15/11/2023	10,813,588	0.50
USD 5,150,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2017-1A A' '144A' 2.56% 15/10/2025	5,126,405	0.24
USD 8,160,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust '2018-1A A' '144A' 3.01% 16/2/2027	8,127,580	0.38
USD 305,518	Credit Suisse Commercial Mortgage Trust Series '2006-C1 G' '144A' FRN 15/2/2039	302,598	0.01
USD 3,315,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	3,193,701	0.15
USD 1,870,000	Crown Castle International Corp 4.875% 15/4/2022	1,968,446	0.09
USD 4,170,785	CSMC Trust 2015-DEAL '2015-DEAL A' '144A' FRN 15/4/2029	4,175,003	0.19
USD 846,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 4.42% 15/6/2021	864,609	0.04
USD 626,390	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' ' 6.875% 7/5/2019	656,175	0.03
USD 1,575,000	Delta Air Lines Inc 2.6% 4/12/2020	1,555,371	0.07
USD 2,115,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,112,165	0.10
USD 3,720,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	3,728,820	0.17
USD 2,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	1,984,680	0.09
USD 11,560,000	Discover Card Execution Note Trust '2016-A4 A4' 1.39% 15/3/2022	11,360,266	0.53
USD 5,000,000	Discover Card Execution Note Trust '2014-A4 A4' 2.12% 15/12/2021	4,974,631	0.23
USD 1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,307,711	0.06
USD 1,500,000	DISH DBS Corp 4.25% 1/4/2018	1,505,625	0.07
USD 830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	819,452	0.04
USD 1,315,000	Dow Chemical Co/The 4.25% 15/11/2020	1,355,175	0.06
USD 508,890	Drive Auto Receivables Trust '2017-AA A3' '144A' 1.77% 15/1/2020	508,794	0.02
USD 2,350,000	Drive Auto Receivables Trust '2017-2 B' 2.25% 15/6/2021	2,345,029	0.11
USD 1,500,000	Dryden 41 Senior Loan Fund '2015-41A A' '144A' FRN 15/1/2028	1,500,510	0.07
USD 2,410,000	Duke Energy Corp 1.8% 1/9/2021	2,306,682	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 2,460,000	Duke Energy Corp 2.4% 15/8/2022	2,379,918	0.11
USD 1,190,000	E*TRADE Financial Corp 2.95% 24/8/2022	1,159,722	0.05
USD 1,435,000	Emera US Finance LP 2.15% 15/6/2019	1,421,119	0.07
USD 2,005,000	Enbridge Energy Partners LP 5.2% 15/3/2020	2,085,001	0.10
USD 1,250,000	Energy Transfer LP 3.6% 1/2/2023	1,233,840	0.06
USD 2,960,000	Energy Transfer LP 4.15% 1/10/2020	3,024,112	0.14
USD 8,855,573	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A2' '144A' 1.74% 22/2/2022	8,818,685	0.41
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC '2016-2 A3' '144A' 2.04% 22/2/2022	3,798,467	0.18
USD 1,729,937	Enterprise Fleet Financing LLC '2017-1 A2' '144A' 2.13% 20/7/2022	1,723,810	0.08
USD 2,090,000	EOG Resources Inc 2.45% 1/4/2020	2,070,548	0.10
USD 385,000	Eversource Energy 2.75% 15/3/2022	379,965	0.02
USD 2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,085,994	0.10
USD 307,086	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2014-C02 1M1' ' FRN 25/5/2024	308,155	0.01
USD 3,697,637	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C02 2M1' ' FRN 25/9/2029	3,724,593	0.17
USD 4,723,674	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C04 2M1' ' FRN 25/11/2029	4,744,170	0.22
USD 2,455,067	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C07 1M1' ' FRN 25/5/2030	2,460,759	0.11
USD 2,448,244	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities '2017-C07 2M1' ' FRN 25/5/2030	2,450,667	0.11
USD 7,817	Fannie Mae Pool '255316' 5% 1/7/2019	7,915	0.00
USD 22,942	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	23,233	0.00
USD 93,767	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	95,042	0.00
USD 2,268,464	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	2,312,804	0.11
USD 5,403,362	Fannie Mae Pool 'AQ8719' 2.5% 1/12/2027	5,307,180	0.25
USD 4,427,157	Fannie Mae Pool 'AS7495' 2.5% 1/7/2031	4,321,739	0.20
USD 571,073	Fannie Mae Pool 'AS8678' 2.5% 1/1/2032	556,753	0.03
USD 3,888,874	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	3,906,025	0.18
USD 162,185	Fannie Mae Pool 'BA3822' 2.5% 1/9/2031	158,118	0.01
USD 3,338,840	Fannie Mae Pool 'BD4371' 2.5% 1/9/2031	3,255,109	0.15
USD 141,965	Fannie Mae Pool 'BD6462' 2.5% 1/8/2031	138,405	0.01
USD 74,957	Fannie Mae Pool 'BD7100' 2.5% 1/3/2032	73,077	0.00
USD 3,828,478	Fannie Mae Pool 'BD8284' 2.5% 1/10/2031	3,732,468	0.17
USD 211,037	Fannie Mae Pool 'BD8309' 2.5% 1/11/2031	205,745	0.01
USD 389,851	Fannie Mae Pool 'BD9575' 2.5% 1/12/2031	380,075	0.02
USD 376,097	Fannie Mae Pool 'BE0070' 2.5% 1/11/2031	366,665	0.02
USD 1,066,342	Fannie Mae Pool 'BH9183' 2.5% 1/8/2032	1,039,601	0.05
USD 3,168,529	Fannie Mae Pool 'BM1422' 2.5% 1/3/2032	3,089,070	0.14
USD 792,040	Fannie Mae Pool 'BM1890' 2.5% 1/1/2032	772,649	0.04
USD 417,834	Fannie Mae Pool 'BM1895' 2.5% 1/2/2032	408,604	0.02
USD 5,849,755	Fannie Mae REMICS '2013-133 NA' 3% 25/5/2036	5,865,707	0.27
USD 3,280,080	Fannie Mae REMICS '2015-10 KA' 3% 25/7/2040	3,256,756	0.15
USD 946,160	Fannie Mae REMICS '2017-96 PA' 3% 25/12/2054	936,061	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,773,180	Fannie Mae-Aces '2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	220,533	0.01
USD 247,966,792	Fannie Mae-Aces '2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	1,935,207	0.09
USD 663,000	Fifth Third Bancorp 2.875% 27/7/2020	662,212	0.03
USD 4,000,000	Fifth Third Bank/Cincinnati OH 2.875% 1/10/2021	3,972,006	0.18
USD 1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,292,057	0.06
USD 3,555,000	Ford Credit Auto Owner Trust '2017-C A3' 2.01% 15/3/2022	3,516,785	0.16
USD 4,500,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A '2016-1 A2' FRN 15/2/2021	4,534,941	0.21
USD 8,500,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A '2016-3 A2' FRN 15/7/2021	8,556,437	0.40
USD 3,000,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A '2016-5 A1' 1.95% 15/11/2021	2,967,605	0.14
USD 1,015,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,000,666	0.05
USD 3,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	3,492,962	0.16
USD 9,203,364	Freddie Mac Gold Pool 'G15602' 2.5% 1/11/2027	9,035,789	0.42
USD 109,435,912	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'K040 X1' FRN 25/9/2024	4,333,235	0.20
USD 3,346,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KJ05 A2' 2.158% 25/10/2021	3,266,099	0.15
USD 2,890,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KJ18 A2' 3.065% 25/8/2022	2,898,338	0.13
USD 3,681,303	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KPO3 A2' 1.78% 25/7/2019	3,649,760	0.17
USD 13,756,578	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'KW01 X1' FRN 25/1/2026	803,296	0.04
USD 8,560,071	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	8,564,965	0.40
USD 7,244,702	Freddie Mac REMICS '4223 DG' 3% 15/12/2038	7,245,584	0.33
USD 2,366,235	Freddie Mac REMICS '4482 DH' 3% 15/6/2042	2,364,083	0.11
USD 4,159,558	Freddie Mac REMICS '4459 BN' 3% 15/8/2043	4,103,514	0.19
USD 4,815,847	Freddie Mac REMICS '4748 HC' 3% 15/1/2044	4,786,054	0.22
USD 6,794,710	Freddie Mac REMICS '4735 BA' 3% 15/4/2047	6,694,060	0.31
USD 11,077,985	Freddie Mac REMICS '4705 D' 3.5% 15/10/2041	11,270,721	0.52
USD 2,939,018	Freddie Mac REMICS '4390 CA' 3.5% 15/6/2050	2,975,067	0.14
USD 5,063,852	Freddie Mac REMICS '4446 MA' 3.5% 15/12/2050	5,110,651	0.24
USD 3,987,203	Freddie Mac REMICS '4286 MP' 4% 15/12/2043	4,082,916	0.19
USD 6,476,336	Freddie Mac REMICS '4593 MP' 4% 15/4/2054	6,676,068	0.31
USD 210,787	Freddie Mac REMICS '3817 MA' 4.5% 15/10/2037	216,215	0.01
USD 358,109	Freddie Mac REMICS '3986 M' 4.5% 15/9/2041	374,410	0.02
USD 297,614	Freddie Mac REMICS '3959 MA' 4.5% 15/11/2041	311,200	0.01
USD 172,743	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2016-HQA2 M1' FRN 25/11/2028	173,253	0.01
USD 6,771,093	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	6,861,549	0.32
USD 7,457,385	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes '2017-HQA3 M1' FRN 25/4/2030	7,462,255	0.34
USD 635,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 9/5/2019	632,892	0.03
USD 1,495,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 15/1/2020	1,498,779	0.07
USD 8,823,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 13/7/2020	8,836,636	0.41

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,470,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	3,451,434	0.16
USD 375,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 15/5/2018	375,902	0.02
USD 5,062,299	GoldenTree Loan Opportunities VII Ltd '2013-7A A' '144A' FRN 25/4/2025	5,070,786	0.23
USD 345,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 31/10/2022	346,744	0.02
USD 2,810,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.6% 23/4/2020	2,790,631	0.13
USD 9,725,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3% 26/4/2022	9,586,399	0.44
USD 9,215,870	Government National Mortgage Association '2012-120 IO' FRN 16/2/2053	403,772	0.02
USD 12,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust '2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	12,462,562	0.58
USD 2,130,000	Great Wolf Trust '2017-WOLF A' '144A' FRN 15/9/2034	2,138,946	0.10
USD 4,530,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd '2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	4,540,428	0.21
USD 5,843,567	GS Mortgage Securities Trust '2012-GCJ7 A4' 3.377% 10/5/2045	5,890,611	0.27
USD 3,360,000	GS Mortgage Securities Trust '2013-GC16 AAB' 3.813% 10/11/2046	3,439,268	0.16
USD 1,940,000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 2.15% 26/2/2020	1,910,810	0.09
USD 4,513,000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5.125% 15/4/2022	4,818,724	0.22
USD 2,725,000	Hewlett Packard Enterprise Co '144A' 2.1% 4/10/2019	2,691,153	0.12
USD 5,612,000	Hewlett Packard Enterprise Co 2.85% 5/10/2018	5,624,863	0.26
USD 3,350,000	Hewlett Packard Enterprise Co 3.6% 15/10/2020	3,392,378	0.16
USD 6,107,507	Honda Auto Receivables 2016-2 Owner Trust '2016-2 A3' 1.39% 15/4/2020	6,075,774	0.28
USD 2,475,000	Huntington National Bank/The 2.375% 10/3/2020	2,457,038	0.11
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,261,415	0.15
USD 1,710,000	Hyundai Capital America '144A' 1.75% 27/9/2019	1,682,024	0.08
USD 880,000	Hyundai Capital America '144A' 2.4% 30/10/2018	881,646	0.04
USD 220,000	Hyundai Capital America '144A' 2.5% 18/3/2019	218,922	0.01
USD 1,575,000	Hyundai Capital America '144A' 2.55% 3/4/2020	1,552,698	0.07
USD 1,170,000	Hyundai Floorplan Master Owner Trust Series '2016-1A A2' '144A' 1.81% 15/3/2021	1,160,781	0.05
USD 3,151,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	3,260,371	0.15
USD 1,030,000	International Lease Finance Corp '144A' 7.125% 1/9/2018	1,052,350	0.05
USD 1,405,000	IPALCO Enterprises Inc 3.7% 1/9/2024	1,374,146	0.06
USD 900,000	ITC Holdings Corp '144A' 2.7% 15/11/2022	876,222	0.04
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2018-BCON A' '144A' 3.735% 5/1/2031	3,862,536	0.18
USD 8,000,000	Jamestown CLO III Ltd '2013-3A A1AR' '144A' FRN 15/1/2026	8,017,609	0.37
USD 1,725,000	John Deere Capital Corp 2.35% 8/1/2021	1,704,211	0.08
USD 6,610,000	John Deere Owner Trust '2017-B A3' 1.82% 15/10/2021	6,516,560	0.30
USD 12,893,274	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	556,925	0.03
USD 7,340,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-LC11 ASB' 2.554% 15/4/2046	7,279,293	0.34

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C20 A2' 2.872% 15/7/2047	6,015,402	0.28
USD 5,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2012-CBX A4' 3.483% 15/6/2045	5,054,184	0.23
USD 4,305,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust '2013-C16 ASB' 3.674% 15/12/2046	4,392,370	0.20
USD 5,734,210	JP Morgan Mortgage Trust '2016-2 A1' '144A' FRN 25/6/2046	5,708,166	0.26
USD 8,665,585	JP Morgan Mortgage Trust '2017-1 A4' '144A' FRN 25/1/2047	8,838,893	0.41
USD 15,257,368	JP Morgan Mortgage Trust '2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	15,174,611	0.70
USD 7,263,728	JP Morgan Mortgage Trust '2018-1 A5' '144A' FRN 25/6/2048	7,284,161	0.34
USD 1,055,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C26 ASB' 3.288% 15/1/2048	1,061,433	0.05
USD 3,830,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2014-C23 ASB' 3.657% 15/9/2047	3,907,380	0.18
USD 8,467,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust '2013-C17 ASB' 3.705% 15/1/2047	8,656,894	0.40
USD 6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	5,990,581	0.28
USD 7,565,000	JPMorgan Chase & Co 2.2% 22/10/2019	7,508,716	0.35
USD 6,850,000	JPMorgan Chase & Co 2.295% 15/8/2021	6,676,640	0.31
USD 3,000,000	KeyBank NA/Cleveland OH 2.25% 16/3/2020	2,969,274	0.14
USD 1,340,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3.5% 1/3/2021	1,345,921	0.06
USD 5,628,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.05% 1/12/2019	5,636,481	0.26
USD 1,500,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.15% 15/1/2023	1,468,801	0.07
USD 2,715,000	Kinder Morgan Inc/DE '144A' 5% 15/2/2021	2,834,138	0.13
USD 2,105,000	Kraft Heinz Foods Co 2.8% 2/7/2020	2,093,826	0.10
USD 971,000	Lam Research Corp 2.75% 15/3/2020	969,670	0.04
USD 8,425,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	8,359,508	0.39
USD 3,315,554	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	3,303,287	0.15
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust '2013-650M A' '144A' 3.843% 12/10/2032	1,412,370	0.07
USD 965,000	Marriott International Inc/MD 2.875% 1/3/2021	960,211	0.04
USD 2,705,000	Marriott International Inc/MD 3.125% 15/10/2021	2,702,326	0.12
USD 2,745,000	Marsh & McLennan Cos Inc 2.35% 6/3/2020	2,721,430	0.13
USD 3,750,000	Maxim Integrated Products Inc 2.5% 15/11/2018	3,745,517	0.17
USD 7,042,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	7,089,227	0.33
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust '2017-BA A' '144A' FRN 16/5/2022	9,861,725	0.46
USD 6,312,067	Mill City Mortgage Loan Trust '2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	6,247,898	0.29
USD 325,000	Moody's Corp 2.75% 15/12/2021	320,421	0.01
USD 2,130,000	Morgan Stanley FRN 22/7/2022	2,154,524	0.10
USD 7,000,000	Morgan Stanley 2.5% 21/4/2021	6,881,021	0.32
USD 3,000,000	Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021	2,939,816	0.14
USD 4,580,000	Morgan Stanley 2.75% 19/5/2022	4,480,662	0.21
USD 2,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C10 ASB' FRN 15/7/2046	2,045,334	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 5,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2013-C9 AAB' 2.657% 15/5/2046	4,968,395	0.23
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust '2014-C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,631,092	0.31
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust '2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	4,973,809	0.23
USD 5,270,000	MP CLO VII Ltd '2015-1A A1R' '144A' FRN 18/4/2027	5,267,916	0.24
USD 1,208,000	MPLX LP 3.375% 15/3/2023	1,198,779	0.06
USD 870,000	National Retail Properties Inc 5.5% 15/7/2021	928,123	0.04
USD 233,320	Navient Private Education Loan Trust '2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	233,970	0.01
USD 1,471,744	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	1,497,396	0.07
USD 2,376,867	Navient Private Education Loan Trust '2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	2,358,128	0.11
USD 5,800,000	NBCUniversal Media LLC 5.15% 30/4/2020	6,089,258	0.28
USD 2,795,000	NetApp Inc 2% 27/9/2019	2,764,276	0.13
USD 3,400,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 '2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	3,407,056	0.16
USD 1,146,081	New Residential Mortgage Loan Trust '2016-3A A1B' '144A' FRN 25/9/2056	1,142,923	0.05
USD 4,975,118	New Residential Mortgage Trust '2018-1A A1A' '144A' FRN 25/12/2057	5,105,689	0.24
USD 4,000,000	Nissan Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A3' 1.32% 15/1/2021	3,964,119	0.18
USD 8,200,000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2017-B A' FRN 18/4/2022	8,234,512	0.38
USD 7,610,000	Nissan Master Owner Trust Receivables '2016-A A2' 1.54% 15/6/2021	7,514,382	0.35
USD 2,500,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' 1.9% 14/9/2021	2,399,233	0.11
USD 1,300,000	Northrop Grumman Corp 2.08% 15/10/2020	1,273,868	0.06
USD 118,929	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	124,727	0.01
USD 679,440	Octagon Investment Partners XVI Ltd '2013-1A A' '144A' FRN 17/7/2025	680,844	0.03
USD 1,000,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd '2013-2A A1AR' '144A' FRN 17/10/2027	1,004,346	0.05
USD 7,643,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.875% 17/7/2018	7,652,921	0.35
USD 2,284,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.05% 9/1/2020	2,293,169	0.11
USD 850,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.3% 1/4/2021	853,039	0.04
USD 9,405,000	PFS Financing Corp '2017-C A' '144A' FRN 15/10/2021	9,425,949	0.44
USD 1,490,000	PFS Financing Corp '2016-BA A' '144A' 1.87% 15/10/2021	1,468,923	0.07
USD 3,630,000	PFS Financing Corp '2018-B A' '144A' 2.89% 15/2/2023	3,613,858	0.17
USD 2,399,000	Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/1/2021	2,424,540	0.11
USD 2,000,000	PNC Bank NA 2.3% 1/6/2020	1,975,667	0.09
USD 1,505,000	PNC Bank NA 2.45% 5/11/2020	1,488,286	0.07
USD 2,500,000	PNC Bank NA 2.625% 17/2/2022	2,452,294	0.11
USD 1,915,000	Prestige Auto Receivables Trust '2014-1A C' '144A' 2.39% 15/5/2020	1,915,627	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 1,445,000	Pricoa Global Funding I '144A' 2.45% 21/9/2022	1,399,641	0.06
USD 825,000	QUALCOMM Inc 2.25% 20/5/2020	811,428	0.04
USD 1,185,000	QUALCOMM Inc 3% 20/5/2022	1,161,625	0.05
USD 2,159,601	RAIT 2017-FL7 Trust '2017-FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	2,153,329	0.10
USD 7,060,000	Realty Income Corp 3.25% 15/10/2022	7,015,285	0.32
USD 3,085,000	Reynolds American Inc 3.25% 12/6/2020	3,095,346	0.14
USD 2,675,000	Reynolds American Inc 6.875% 1/5/2020	2,888,370	0.13
USD 885,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	883,324	0.04
USD 841,192	Santander Drive Auto Receivables Trust '2016-2 A3' 1.56% 15/5/2020	840,704	0.04
USD 970,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-1 A3' 1.77% 15/9/2020	967,287	0.04
USD 6,460,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2017-2 A3' 1.87% 15/12/2020	6,434,787	0.30
USD 286,734	Santander Drive Auto Receivables Trust '2014-3 C' 2.13% 17/8/2020	286,743	0.01
USD 2,810,000	Santander Drive Auto Receivables Trust '2018-1 A3' 2.32% 16/8/2021	2,801,927	0.13
USD 550,000	Santander Holdings USA Inc '144A' 3.4% 18/1/2023	537,968	0.02
USD 1,535,000	Santander Holdings USA Inc '144A' 3.7% 28/3/2022	1,537,944	0.07
USD 2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	2,760,083	0.13
USD 4,309,004	Sequoia Mortgage Trust '2017-CH1 A2' '144A' FRN 25/8/2047	4,323,164	0.20
USD 2,725,688	Sequoia Mortgage Trust '2017-CH2 A10' '144A' FRN 25/12/2047	2,771,719	0.13
USD 4,134	SLM Private Credit Student Loan Trust '2003-B A2' FRN 15/3/2022	4,135	0.00
USD 1,526,983	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	1,536,520	0.07
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust '2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,661,052	0.08
USD 1,096,990	SLM Private Education Loan Trust '2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	1,097,024	0.05
USD 283,355	SLM Private Education Loan Trust '2012-B A2' '144A' 3.48% 15/10/2030	284,175	0.01
USD 954,149	SLM Private Education Loan Trust '2012-A A2' '144A' 3.83% 17/1/2045	962,906	0.04
USD 934,487	SLM Private Education Loan Trust '2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	952,840	0.04
USD 1,696,336	SLM Student Loan Trust '2013-4 A' FRN 25/6/2043	1,706,920	0.08
USD 4,831,759	SMB Private Education Loan Trust '2017-A A1' '144A' FRN 17/6/2024	4,838,482	0.22
USD 2,762,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	2,700,595	0.12
USD 2,430,000	SMB Private Education Loan Trust '2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	2,390,601	0.11
USD 3,487,661	SMB Private Education Loan Trust '2015-C A2A' '144A' 2.75% 15/7/2027	3,468,114	0.16
USD 904,571	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC '2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	896,146	0.04
USD 1,508,300	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC '2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	1,526,262	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 4,996,292	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC '2015-D A2' '144A' 2.72% 27/10/2036	4,960,333	0.23
USD 1,994,050	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC '2016-A A2' '144A' 2.76% 26/12/2036	1,980,949	0.09
USD 1,130,000	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC '2016-C A2B' '144A' 2.36% 27/12/2032	1,096,560	0.05
USD 1,068,624	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC '2016-D A2A' '144A' 1.53% 25/4/2033	1,063,240	0.05
USD 1,010,000	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC '2016-D A2B' '144A' 2.34% 25/4/2033	978,535	0.05
USD 6,390,000	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC '2016-E A2B' '144A' 2.49% 25/1/2036	6,232,575	0.29
USD 3,353,875	Sofi Professional Loan Program 2017-C LLC '2017-C A2A' '144A' 1.75% 25/7/2040	3,331,205	0.15
USD 21,000,000	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC '2017-D A2FX' '144A' 2.65% 25/9/2040	20,553,882	0.95
USD 670,000	Sound Point Clo XII Ltd '2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	675,734	0.03
USD 1,500,000	Sound Point Clo XIV Ltd '2016-3A C' '144A' FRN 23/1/2029	1,528,726	0.07
USD 114,365	Soundview Home Loan Trust '2003-2 A2' FRN 25/11/2033	116,779	0.01
USD 2,687,394	Springleaf Funding Trust '2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	2,691,183	0.12
USD 1,367,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	1,421,680	0.07
USD 867,188	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	869,516	0.04
USD 1,375,000	Stryker Corp 2% 8/3/2019	1,367,149	0.06
USD 960,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.5% 15/2/2020	999,869	0.05
USD 390,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.875% 15/1/2023	390,000	0.02
USD 250,000	Synchrony Bank 3% 15/6/2022	244,275	0.01
USD 2,120,000	Synchrony Financial 2.6% 15/1/2019	2,117,466	0.10
USD 2,515,000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 2.8% 15/10/2022	2,430,336	0.11
USD 2,430,000	Thermo Fisher Scientific Inc 3.3% 15/2/2022	2,434,304	0.11
USD 1,220,000	Time Warner Inc 4.7% 15/1/2021	1,271,436	0.06
USD 3,837,481	Towd Point Mortgage Trust '2016-3 A1' '144A' FRN 25/4/2056	3,787,550	0.18
USD 4,892,797	Towd Point Mortgage Trust '2016-4 A1' '144A' FRN 25/7/2056	4,823,778	0.22
USD 3,810,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust '2016-B A4' 1.52% 16/8/2021	3,752,360	0.17
USD 14,555,000	Toyota Auto Receivables 2017-D Owner Trust '2017-D A3' 1.93% 18/1/2022	14,351,546	0.66
USD 10,250,000	Toyota Auto Receivables 2018-A Owner Trust '2018-A A3' 2.35% 16/5/2022	10,191,700	0.47
USD 5,080,000	United States Steel Corp '144A' 8.375% 1/7/2021	5,461,000	0.25
USD 15,500,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 30/9/2018*	15,395,557	0.71
USD 50,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 31/10/2018*	49,607,422	2.29
USD 40,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 30/11/2018*	39,819,531	1.84
USD 80,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 28/2/2019* †	79,439,062	3.67
USD 30,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 31/3/2019*	29,843,555	1.38

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 (%)
米国(続き)			
USD 124,900,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/10/2020* †	122,494,676	5.66
USD 39,200,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/2/2021 †	39,002,469	1.80
USD 3,206,584	US Airways 2011-1 Class B Pass Through Trust 9.75% 22/10/2018	3,361,911	0.16
USD 1,403,533	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,494,762	0.07
USD 1,000,000	Venture XIX CLO Ltd '2014-19A BR' '144A' FRN 15/1/2027	1,008,395	0.05
USD 4,760,000	Verizon Communications Inc 2.946% 15/3/2022	4,705,327	0.22
USD 143,000	Viacom Inc 2.75% 15/12/2019	142,427	0.01
USD 1,455,000	Viacom Inc 3.875% 15/12/2021	1,481,705	0.07
USD 3,284,000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 1.65% 22/5/2018	3,279,928	0.15
USD 5,745,000	Voya CLO 2014-3 Ltd '2014-3A A1R' '144A' FRN 25/7/2026	5,749,416	0.27
USD 580,681	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series '2007- C33 AM' FRN 15/2/2051	596,214	0.03
USD 1,030,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust '2016-BOCA A' '144A' ' FRN 15/6/2029	1,033,068	0.05
USD 4,040,000	Walgreen Co 3.1% 15/9/2022	3,971,306	0.18
USD 1,541,000	Walgreens Boots Alliance Inc 2.7% 18/11/2019	1,537,433	0.07
USD 5,985,000	Wells Fargo & Co 2.625% 22/7/2022	5,816,717	0.27
USD 1,195,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	1,178,114	0.05
USD 4,065,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2014-LC16 ASB' 3.477% 15/8/2050	4,111,370	0.19
USD 500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust '2015-LC22 ASB' 3.571% 15/9/2058	507,760	0.02
USD 3,330,000	Welltower Inc 2.25% 15/3/2018	3,330,033	0.15
USD 890,000	WestRock Co '144A' 3% 15/9/2024	856,883	0.04
USD 671,688	Wheels SPV 2 LLC '2016-1A A2' '144A' 1.59% 20/5/2025	668,828	0.03
USD 1,160,000	Wheels SPV 2 LLC '2017-1A A2' '144A' 1.88% 20/4/2026	1,152,153	0.05
USD 1,765,000	Williams Partners LP 4% 15/11/2021	1,800,492	0.08
USD 1,670,000	Willis North America Inc 3.6% 15/5/2024	1,659,039	0.08
USD 5,515,000	Wm Wrigley Jr Co '144A' 3.375% 21/10/2020	5,583,932	0.26
USD 3,490,000	Xerox Corp 3.5% 20/8/2020	3,494,636	0.16
USD 1,911,000	Xerox Corp 3.625% 15/3/2023	1,867,296	0.09
USD 719,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	741,469	0.03
		1,737,023,339	80.27
債券合計		2,100,139,340	97.05
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合計		2,100,139,340	97.05

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
	米国		
USD 260,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 4.896% 25/1/2037**	-	0.00
USD 350,000	Structured Asset Receivables Trust Series '2003-2' 0.649% 31/12/2049**	-	0.00
		-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		-	0.00
投資有価証券合計		2,100,139,340	97.05
その他の純資産		63,791,971	2.95
純資産合計(米ドル)		2,163,931,311	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2018年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 5,250,000	Fannie Mae Pool ' 2 3/18 ' 2% TBA	4,980,528	0.23
USD 7,437,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 3/18 ' 2.5% TBA	7,241,198	0.33
USD 43,000,000	Fannie Mae Pool ' 3 3/18 ' 3% TBA	42,761,484	1.98
USD 5,855,000	Fannie Mae Pool ' 4 3/18 ' 4% TBA	5,987,652	0.28
USD 5,000,000	Fannie Mae Pool ' 4.5 3/18 ' 4.5% TBA	5,029,688	0.23
USD 13,130,000	Freddie Mac Gold Pool ' 3.5 3/18 ' 3.5% TBA	13,354,627	0.62
T B A 合計		79,355,177	3.67

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
BRL	214,731	USD	66,000	BNP Paribas	2/3/2018	235
BRL	5,429,284	USD	1,725,280	Deutsche Bank	2/3/2018	(50,588)
USD	50,000	BRL	165,200	Barclays	2/3/2018	(957)
USD	66,000	BRL	214,731	Goldman Sachs	2/3/2018	(235)
IDR	4,130,295,842	USD	306,743	Nomura	5/3/2018	(6,449)
IDR	4,136,906,902	USD	307,257	JP Morgan	5/3/2018	(6,482)
TRY	820,939	USD	217,000	Goldman Sachs	5/3/2018	(1,339)
USD	739,064	AUD	913,000	BNP Paribas	5/3/2018	27,044
USD	12,011,079	EUR	9,646,000	HSBC Bank Plc	5/3/2018	231,816
USD	125,374	EUR	102,000	State Street	5/3/2018	816
USD	287,219	EUR	238,437	Goldman Sachs	5/3/2018	(3,949)
USD	330,902	EUR	274,563	UBS	5/3/2018	(4,383)
USD	14,905,855	GBP	10,503,524	Barclays	5/3/2018	402,448
USD	210,890	IDR	2,875,067,051	UBS	5/3/2018	1,858
USD	403,110	IDR	5,497,287,582	BNP Paribas	5/3/2018	3,427
USD	217,000	TRY	830,524	JP Morgan	5/3/2018	(1,179)
USD	276,337	ZAR	3,431,688	Deutsche Bank	5/3/2018	(15,242)
USD	231,491	ZAR	2,877,061	Citibank	5/3/2018	(12,963)
EUR	330,000	JPY	43,805,762	Goldman Sachs	7/3/2018	(6,183)
RUB	67,866,756	USD	1,181,000	Deutsche Bank	7/3/2018	26,724
AUD	940,000	USD	741,886	HSBC Bank Plc	9/3/2018	(8,809)
EUR	657,900	USD	817,984	Deutsche Bank	9/3/2018	(14,319)
TRY	1,639,763	USD	435,000	Bank of America	9/3/2018	(4,770)
USD	756,062	AUD	940,000	UBS	9/3/2018	22,985
USD	1,635,286	EUR	1,315,800	UBS	9/3/2018	27,958
USD	716,000	JPY	78,105,074	Deutsche Bank	9/3/2018	(13,765)
USD	614,000	ZAR	7,434,619	Citibank	9/3/2018	(17,294)
ZAR	1,844,289	USD	154,000	Barclays	9/3/2018	2,604
ZAR	5,510,290	USD	460,000	Morgan Stanley	9/3/2018	7,894
USD	614,000	RUB	35,565,950	Bank of America	12/3/2018	(18,518)
USD	652,500	TRY	2,506,486	Bank of America	14/3/2018	(4,108)
CAD	224,588	USD	179,000	RBS Plc	15/3/2018	(3,472)
USD	652,500	MXN	12,230,642	HSBC Bank Plc	15/3/2018	3,965
USD	180,238	ZAR	2,119,744	Barclays	16/3/2018	444
USD	391,915	ZAR	4,904,813	HSBC Bank Plc	16/3/2018	(24,104)
EUR	167,791	USD	207,319	Morgan Stanley	19/3/2018	(2,182)
EUR	783,038	USD	965,202	Nomura	19/3/2018	(7,881)
EUR	349,188	USD	433,073	Citibank	19/3/2018	(6,165)
EUR	587,137	USD	724,176	Bank of America	19/3/2018	(6,358)
EUR	101,005	USD	125,884	Credit Suisse	19/3/2018	(2,397)
USD	382,346	EUR	311,286	Morgan Stanley	19/3/2018	1,776
USD	1,252,770	EUR	1,020,073	UBS	19/3/2018	5,657
USD	922,366	EUR	754,819	RBS Plc	19/3/2018	(456)
USD	1,064,500	IDR	14,430,775,700	HSBC Bank Plc	20/3/2018	17,426

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
AUD	3,380,000	NZD	3,679,225	Goldman Sachs	21/3/2018	(20,641)
AUD	6,860,000	NZD	7,466,470	Citibank	21/3/2018	(41,291)
CAD	3,231,853	AUD	3,290,000	Citibank	21/3/2018	(39,593)
CAD	3,367,805	AUD	3,460,000	JP Morgan	21/3/2018	(65,904)
CAD	6,766,203	NZD	7,590,000	BNP Paribas	21/3/2018	(191,589)
CAD	10,147,919	USD	8,160,000	Citibank	21/3/2018	(227,874)
CHF	5,245,844	EUR	4,510,000	Citibank	21/3/2018	51,556
EUR	2,150,000	CHF	2,525,997	Citibank	21/3/2018	(51,325)
EUR	6,770,000	CHF	7,932,892	BNP Paribas	21/3/2018	(139,264)
EUR	2,200,000	GBP	1,952,892	Bank of America	21/3/2018	(8,695)
NOK	20,678,620	GBP	1,900,000	Citibank	21/3/2018	2,298
NOK	85,400,000	SEK	86,462,441	Citibank	21/3/2018	400,686
NOK	42,333,043	USD	5,430,000	Bank of America	21/3/2018	(49,973)
NZD	11,220,677	AUD	10,240,000	Citibank	21/3/2018	116,074
NZD	3,693,614	EUR	2,200,000	HSBC Bank Plc	21/3/2018	(23,116)
NZD	3,790,000	USD	2,723,221	Goldman Sachs	21/3/2018	13,366
SEK	20,962,257	EUR	2,120,000	Bank of America	21/3/2018	(58,111)
SEK	22,038,768	EUR	2,250,000	State Street	21/3/2018	(86,930)
SEK	65,294,739	NOK	64,115,000	Bank of America	21/3/2018	(254,626)
SEK	44,403,297	USD	5,460,000	Citibank	21/3/2018	(91,985)
TRY	616,611	USD	161,156	Citibank	21/3/2018	20
TRY	623,493	USD	162,844	JP Morgan	21/3/2018	130
TRY	1,240,693	USD	324,000	Bank of America	21/3/2018	304
USD	8,160,000	CAD	10,245,370	Morgan Stanley	21/3/2018	151,702
USD	2,721,380	GBP	2,005,000	Bank of America	21/3/2018	(49,434)
USD	2,700,000	NOK	20,700,163	Citibank	21/3/2018	69,255
USD	2,730,000	NOK	21,058,974	Bank of America	21/3/2018	53,654
USD	2,770,650	NZD	3,790,000	Citibank	21/3/2018	34,062
USD	2,730,000	SEK	21,936,642	Bank of America	21/3/2018	78,030
USD	2,730,000	SEK	22,022,203	Citibank	21/3/2018	67,686
NZD	3,820,000	JPY	308,664,824	BNP Paribas	22/3/2018	(128,617)
CHF	2,547,932	EUR	2,220,000	Citibank	23/3/2018	(10,915)
IDR	10,898,529,788	USD	809,355	JP Morgan	26/3/2018	(19,219)
IDR	8,632,314,000	USD	631,525	UBS	26/3/2018	(5,688)
IDR	14,665,918,006	USD	1,076,319	BNP Paribas	26/3/2018	(13,050)
IDR	32,127,056,000	USD	2,404,000	Barclays	26/3/2018	(74,812)
IDR	17,547,082,548	USD	1,297,835	Deutsche Bank	26/3/2018	(25,685)
IDR	6,480,647,977	USD	482,299	RBS Plc	26/3/2018	(12,457)
USD	1,313,313	IDR	18,011,096,364	BNP Paribas	26/3/2018	7,520
USD	328,328	IDR	4,498,752,037	Goldman Sachs	26/3/2018	2,172
USD	159,031	IDR	2,179,045,502	Citibank	26/3/2018	1,052
USD	4,907,266	IDR	65,758,128,904	Barclays	26/3/2018	139,850
USD	60,065	IDR	802,831,506	HSBC Bank Plc	26/3/2018	1,860
USD	275,000	IDR	3,756,500,000	JP Morgan	26/3/2018	2,657
RUB	13,880,783	USD	247,000	Bank of America	29/3/2018	(666)

未決済先渡為替予約 2018年2月28日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/ (損) (米ドル)
BRL	5,442,231	USD	1,675,280	UBS	3/4/2018	(2,282)
TRY	8,938,478	USD	2,331,995	BNP Paribas	9/4/2018	(8,949)
TRY	2,782,107	USD	725,537	JP Morgan	9/4/2018	(2,488)
USD	3,129,258	TRY	11,974,427	BNP Paribas	9/4/2018	17,192
USD	2,848,202	RUB	164,500,734	Deutsche Bank	12/4/2018	(66,435)
USD	991,000	MXN	18,638,827	HSBC Bank Plc	23/4/2018	8,943
USD	204,690	EUR	166,000	State Street	21/5/2018	774
TRY	37,864,000	USD	9,915,073	BNP Paribas	25/6/2018	(291,540)
USD	5,112,790	TRY	20,334,845	Citibank	25/6/2018	(55,525)
USD	4,512,590	TRY	17,529,155	BNP Paribas	25/6/2018	57,371
TRY	7,192,000	USD	1,850,316	BNP Paribas	20/8/2018	(52,884)
USD	1,031,628	TRY	4,157,731	Citibank	20/8/2018	(7,476)
USD	746,897	TRY	3,034,269	BNP Paribas	20/8/2018	(11,430)
MXN	19,295,860	USD	991,000	HSBC Bank Plc	26/11/2018	(8,696)
未実現純評価損						(380,421)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	136,025,700	USD	166,871,440	BNY Mellon	14/3/2018	(638,330)
USD	5,967,356	EUR	4,847,055	BNY Mellon	14/3/2018	43,887
未実現純評価損						(594,443)
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	439,042	USD	330,033	BNY Mellon	14/3/2018	1,701
未実現純評価益						1,701
未実現純評価損合計						(973,163)

未決済上場先物取引 2018年2月28日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
(17)	EUR	Euro Bund	2018年3月	62,862
3,284	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年6月	(506,909)
(3)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2018年6月	(721)
(24)	USD	US Long Bond (CBT)	2018年6月	(24,926)
(255)	USD	US Ultra 10 Year Note	2018年6月	30,291
(549)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2018年6月	201,086
(3,123)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2018年6月	935,092
1,717	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	(1,456,887)
(1,719)	USD	90 Day Euro \$	2019年12月	1,889,600
合計				1,129,488

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2018年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	13,050	5,764
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(10,347)	(5,949)
CDS	USD 131,055	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(2,358)	2,606
CDS	USD 295,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	(813)	470
CDS	USD (10,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	116,058	717,113
CDS	USD 355,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	1,180	565
CDS	USD 178,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	631	283
CDS	USD 178,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	591	283
CDS	USD 215,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2022	667	342
CDS	USD (10,150,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(9,246)	727,870
CDS	USD (14,500,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(27,708)	1,039,814
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	20/12/2022	(64,898)	645,402
CDS	USD (10,245,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.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	Deutsche Bank	20/12/2022	125,674	734,682
CDS	USD 905,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(22,842)	(95,397)
CDS	USD 305,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2022	1,070	7,111
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(8,758)	(5,764)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	13,985	5,949
CDS	USD 85,000	ファンドはBahrain Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(1,745)	5,380

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 12,283,000	ファンドはCDX.NA.IG.29.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	20/12/2022	(18,539)	(252,929)
CDS	USD 2,537,804	ファンドは Philippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(4,564)	(41,778)
CDS	USD 231,629	ファンドは Republic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2022	(4,167)	4,606
IRS	BRL 10,669,445	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.02%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(12,979)	(12,979)
IRS	BRL 5,428,388	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、7.75%の固定金利を支払う	Bank of America	2/1/2019	(18,603)	(18,603)
IRS	BRL 3,840,037	ファンドは7.7%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	2/1/2020	3,780	3,780
IRS	BRL 2,950,269	ファンドは7.81%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	2/1/2020	4,696	4,696
IRS	BRL 7,154,666	ファンドは8.21%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	2/1/2020	32,527	32,527
IRS	BRL 2,409,593	ファンドは9.135%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2021	20,961	20,961
IRS	MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	13,861	13,861
IRS	MXN 2,978,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.31%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	13,861	13,861
IRS	USD 37,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	1,328,699	1,328,699
IRS	MXN 29,180,086	ファンドは7.07%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	21/11/2018	(10,608)	(10,608)
IRS	MXN 49,800,000	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	28/11/2018	(20,280)	(20,280)
IRS	BRL 9,289,957	ファンドは9.25%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2019	81,829	81,829
IRS	BRL 5,401,377	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、8%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2019	(23,469)	(23,469)
IRS	BRL 5,768,775	ファンドは7.78%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	8,246	8,246
IRS	BRL 2,788,859	ファンドは7.82%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	4,590	4,590
IRS	BRL 1,266,165	ファンドは9.85%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2023	18,289	18,289
IRS COP	1,102,870,981	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.36%の固定金利を支払う	Citibank	12/2/2023	499	499
IRS COP	1,102,870,981	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.418%の固定金利を支払う	Citibank	13/2/2023	(486)	(486)
IRS COP	2,212,592,092	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.4%の固定金利を支払う	Citibank	23/2/2023	56	56
IRS	MXN 3,077,500	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(14,043)	(14,043)
IRS	MXN 9,181,000	ファンドは6.33%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	6/8/2025	(42,105)	(42,105)
IRS	MXN 91,737,079	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3614%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2019	28,262	28,262
IRS	USD 115,290,000	ファンドは2.3924%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	31/12/2019	(308,143)	(308,143)

スワップ 2018年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 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	366,901	366,901
IRS	EUR 31,100,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.44988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	(344,393)	(344,393)
IRS	MXN 76,960,000	ファンドは7.16%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Deutsche Bank	29/4/2020	(53,993)	(53,993)
IRS	MXN 6,767,809	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1300016%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	7/10/2022	8,004	8,004
IRS	MXN 2,713,508	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1399988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	10/10/2022	3,155	3,155
IRS	MXN 9,099,404	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1049996%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	11,258	11,258
IRS	MXN 6,935,596	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	8,509	8,509
IRS	MXN 11,053,204	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	51,540	51,540
IRS	USD 4,195,000	ファンドは2.645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	20/1/2027	(58,014)	(58,014)
IRS	MXN 13,509,627	ファンドは7.47%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	(5,969)	(5,969)
IRS	MXN 13,508,273	ファンドは7.48%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	7/3/2022	(5,718)	(5,718)
IRS	USD 440,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.231%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	21,085	21,085
IRS	USD 190,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.238%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	9,001	9,001
IRS	USD 540,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	25,286	25,286
IRS	USD 60,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.251%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	13/1/2027	2,781	2,781
IRS	MXN 35,016,104	ファンドは7.06%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	21/11/2018	(12,863)	(12,863)
IRS	MXN 28,250,647	ファンドは6.98%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	JP Morgan	28/11/2018	(11,504)	(11,504)
IRS	BRL 8,819,014	ファンドは9.275%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2019	78,644	78,644
IRS COP	1,123,421,371	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.4%の固定金利を支払う	JP Morgan	14/2/2023	(160)	(160)
IRS COP	1,123,421,371	ファンドは1日COP COOISの変動金利を受け取り、5.41%の固定金利を支払う	JP Morgan	15/2/2023	(313)	(313)
IRS	MXN 59,106,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.8249996%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/2/2021	(8,092)	(8,092)
IRS	MXN 6,176,000	ファンドは6.32%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(28,275)	(28,275)
合計					1,263,231	4,662,733

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2018年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評益/ (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
358,000	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.25	6/4/2018	5,128	8,931
330,000	プット	OTC EUR/JPY	Deutsche Bank	EUR 134.75	5/3/2018	9,708	12,386
27,000	プット	OTC EUR/TRY	Morgan Stanley	EUR 4.35	7/6/2018	(2,972)	960
合計						11,864	22,277

買建スワップション 2018年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
7,480,000,000	JPY ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/7/2019より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、25/7/2019より1.38%の固定金利を半年毎に支払う	Credit Suisse	23/1/2019	(212,185)	10,366
USD 12,585,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/4/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、20/7/2022より3.35%の固定金利を半年毎に支払う	Deutsche Bank	18/1/2022	(62,171)	220,991
合計				(274,356)	231,357

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2018年12月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,700,813,861円
負債総額	75,570,069円
純資産総額(-)	1,625,243,792円
発行済数量	1,719,855,212口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9450円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行

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

6 受益権の譲渡

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

前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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なわれた受益権に係る投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

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

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する証券投資信託は2018年12月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)。

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	78本	1,460,120百万円
	単位型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		70本	5,777,547百万円
合計		148本	7,237,667百万円

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

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

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

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

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

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

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

(単位：百万円)

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

第31期（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

(単位：百万円)

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

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

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

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

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

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

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

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

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

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

(3) 賞与引当金の計上方法

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

(4) 役員賞与引当金の計上方法

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

(5) 早期退職慰労引当金の計上方法

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

5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

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

6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

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

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

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

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

配当支払額

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

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年12月31日）

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

当事業年度(平成29年12月31日)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

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

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

(5) 長期差入保証金

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成28年12月31日)

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

当事業年度(平成29年12月31日)

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

(有価証券関係)

前事業年度(平成28年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(平成29年12月31日)

その他有価証券

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

(退職給付関係)

前事業年度(自 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

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

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

(単位:百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:百万円)

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

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

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、68百万円 でありました。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

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

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

(単位:百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:百万円)

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

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

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円 でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(単位：百万円)

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

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

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

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（平成29年12月31日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

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

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成28年1月1日 至 平成28年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

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

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

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

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

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

当事業年度（自平成29年1月1日至平成29年12月31日）

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

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自平成29年1月1日至平成29年12月31日）

該当事項はありません。

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

前事業年度（自平成28年1月1日至平成28年12月31日）

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

当事業年度 (自 平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

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

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

【中間財務諸表】

1. 中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、中間会計期間(自平成30年1月1日 至平成30年6月30日)の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

	中間会計期間末 (平成30年6月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	20,117
立替金		0
前払費用		185
未収入金		14
未収委託者報酬		1,595
未収運用受託報酬		1,817
未収収益		1,400
為替予約		2
繰延税金資産		620
その他流動資産		11
流動資産計		25,766
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,142
器具備品	1	413
有形固定資産計		1,556
無形固定資産		
ソフトウェア		11
のれん		14
無形固定資産計		25
投資その他の資産		
投資有価証券		14
長期差入保証金		1,116
前払年金費用		637
長期前払費用		20
投資その他の資産計		1,788
固定資産計		3,369
資産合計		29,135

(単位:百万円)

中間会計期間末
(平成30年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	95
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	74
未払手数料	564
その他未払金	707
未払費用	1,401
未払消費税等	135
未払法人税等	321
賞与引当金	966
役員賞与引当金	74
流動負債計	4,345
固定負債	
退職給付引当金	59
資産除去債務	339
繰延税金負債	90
固定負債計	490
負債合計	4,835
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	13,996
利益剰余金合計	14,333
株主資本合計	24,300
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	24,300
負債・純資産合計	29,135

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	2,830
運用受託報酬	4,526
その他営業収益	6,435
営業収益計	13,791
営業費用	
支払手数料	964
広告宣伝費	51
調査費	
調査費	187
委託調査費	2,300
調査費計	2,488
委託計算費	41
営業雑経費	
通信費	30
印刷費	23
諸会費	13
営業雑経費計	66
営業費用計	3,613
一般管理費	
給料	
役員報酬	290
給料・手当	2,047
賞与	1,354
給料計	3,692
退職給付費用	140
福利厚生費	459
事務委託費	1,292
交際費	29
寄付金	1
旅費交通費	127
租税公課	134
不動産賃借料	384
水道光熱費	31
固定資産減価償却費	1 145
のれん償却額	1 28
資産除去債務利息費用	2
諸経費	227
一般管理費計	6,696
営業利益	3,481

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日)
営業外収益	
受取利息	0
雑益	0
営業外収益計	0
営業外費用	
為替差損	1
営業外費用計	1
経常利益	3,480
特別損失	
特別退職金	41
特別損失計	41
税引前中間純利益	3,439
法人税、住民税及び事業税	925
法人税等調整額	257
中間純利益	2,256

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間（自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日）

(単位：百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価 証券評価 差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
平成30年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
中間事業年度中の変動額											
中間純利益						2,256	2,256	2,256			2,256
株主資本以外の項目の中間事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
中間事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	2,256	2,256	2,256	0	0	2,255
平成30年6月30日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	13,996	14,333	24,300	0	0	24,300

注 記 事 項

(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

項目	<p style="text-align: center;">中間会計期間</p> <p style="text-align: center;">自 平成30年1月 1日</p> <p style="text-align: center;">至 平成30年6月30日</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金の計上方法 債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金の計上方法 旧退職金制度 適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職制度に基づく給付額を保証しているため、中間会計期間末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。 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。</p> <p>(3) 賞与引当金の計上方法 従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(4) 役員賞与引当金の計上方法 役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

中間会計期間末 平成30年6月30日	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	1,428百万円
器具備品	880百万円
2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。	
当座貸越極度額	1,000百万円
借入実行残高	-
差引額	1,000百万円

(中間損益計算書関係)

中間会計期間 自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	143百万円
無形固定資産	30百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間				
自 平成30年1月 1日				
至 平成30年6月30日				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数
発行済株式				
普通株式	15,000	-	-	15,000
合計	15,000	-	-	15,000
2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項				
該当事項はありません。				
3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項				
該当事項はありません。				
4. 配当に関する事項				
(1) 配当金支払額				
該当事項はありません。				
(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの				
該当事項はありません。				

(金融商品関係)

中間会計期間	
自 平成30年1月 1日	
至 平成30年6月30日	
1. 金融商品の状況に関する事項	
(1) 金融商品に対する取組方針	
<p>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。</p> <p>投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。</p> <p>デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。</p>	
(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	
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	

中間会計期間

自 平成30年1月 1日

至 平成30年6月30日

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額 (*)	時価(*)	差額
現金・預金	20,117	20,117	-
未収委託者報酬	1,595	1,595	-
未収運用受託報酬	1,817	1,817	-
未収収益	1,400	1,400	-
投資有価証券			
その他有価証券	14	14	-
長期差入保証金	1,116	1,102	13
資産計	26,061	26,048	13
未払手数料	564	564	-
未払費用	1,401	1,401	-
負債計	1,965	1,965	-
デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	2	2	-
デリバティブ計	2	2	-

(注)

金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未収収益

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

投資有価証券

投資有価証券は、投資信託であり、決算日の基準価格によっております。

長期差入保証金

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

但し、上記レートがマイナスとなる場合は、割引率はゼロを使用しております。

未払手数料、未払費用

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

デリバティブ取引

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

(有価証券関係)

中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日				
その他有価証券				
(単位：百万円)				
	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの	その他 投資信託	5	5	0
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの	その他 投資信託	9	10	0
合計		14	15	0

(資産除去債務関係)

中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日	
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの	
1. 当該資産除去債務の概要	当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. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	262 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	75 百万円
時の経過による調整額	2 百万円
中間会計期間末残高	<u>339 百万円</u>

(セグメント情報等)

中間会計期間
自 平成30年1月 1日
至 平成30年6月30日

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

製品及びサービスに関する情報

(単位：百万円)

	委託者 報酬	運用受託 報酬	その他	合計
外部顧客 営業収益	2,830	4,526	6,435	13,791

地域に関する情報

(1) 売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
6,833	5,379	1,578	13,791

(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。

(2) 有形固定資産

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

主要な顧客に関する情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位：百万円)

相手先	営業収益	関連する セグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	2,721	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	1,575	投資運用業

(デリバティブ取引関係)

中間会計期間					
自 平成30年1月 1日					
至 平成30年6月30日					
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引					
通貨関連			(単位：百万円)		
区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	236	-	2	2
合計		236	-	2	2
(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。					

(1株当たり情報)

中間会計期間	
自 平成30年1月 1日	
至 平成30年6月30日	
1株当たり純資産額	1,620,018円36銭
1株当たり中間純利益	150,423円25銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の中間純利益	2,256百万円
1株当たり中間純利益の算定に	2,256百万円
用いられた普通株式に係る中間純利益	
期中平均株式数	15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

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

<参考:再信託受託会社の概要>

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

(2) 販売会社

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

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

2 【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3 【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【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。

2018年7月6日	臨時報告書
2018年9月14日	有価証券報告書、有価証券届出書
2018年10月5日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成30年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2019年2月6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2018年6月21日から2018年12月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2018年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月31日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の平成30年1月1日から平成30年12月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成30年1月1日から平成30年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。