

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年5月31日

【発行者名】 ブラックロック・グローバル・ファンズ
(BLACKROCK GLOBAL FUNDS)

【代表者の役職氏名】 取締役 ジェフ・ラドクリフ
(Geoff Radcliffe)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 2453、
ユージン・リュペール通り2 - 4番
(2-4, rue Eugène Ruppert, L-2453 Luxembourg,
Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 中野春芽
同 十枝美紀子
同 三宅章仁

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【事務連絡者氏名】 弁護士 中野春芽
同 十枝美紀子
同 三宅章仁

【連絡場所】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 03(6775)1000

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
ブラックロック・グローバル・ファンズ -
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド
(BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund)

【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号に掲げる投資証券に類するもの)
クラスA毎月分配型投資証券 1,000万口を上限とする。
(上限見込額^(注1): 5,190万アメリカ合衆国ドル(約69億円))
クラスA無分配投資証券 1,000万口を上限とする。
(上限見込額^(注1): 3億5,620万アメリカ合衆国ドル(約476億円))

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

- (注1) 上限見込額は、便宜上、ブラックロック・グローバル・ファンズのUSドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドのクラスA毎月分配型投資証券およびクラスA無分配投資証券の2023年3月末日現在の1口当たり純資産価格(5.19アメリカ合衆国ドルおよび35.62アメリカ合衆国ドル)に、それぞれ1,000万口を乗じて算出した金額である。
- (注2) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、スターリング・ボンド(以下「英ポンド」という。)、カナダ・ドル、スイス・フラン、ユーロ、オーストラリア・ドル(以下「豪ドル」という。)、香港ドル、人民元、シンガポール・ドル、ニュージーランド・ドルおよび南アフリカ・ランドの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、株式会社三菱UFJ銀行の2023年3月31日現在における対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=133.53円、1英ポンド=165.56円、1カナダ・ドル=98.75円、1スイス・フラン=146.16円、1ユーロ=145.72円、1豪ドル=89.69円、1香港ドル=17.01円、1人民元=19.42円、1シンガポール・ドル=100.60円、1ニュージーランド・ドル=83.71円および1南アフリカ・ランド=7.49円)による。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年2月28日に提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)の関係情報を新たな情報により訂正および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円貨換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書に係る訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容と同一内容に更新または追加されます。

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加または更新
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加または更新
5 運用状況	(1) 投資状況		(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加または更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「当中間会計期間末における純資産価額の概要」 「損益および純資産変動計算書」 財務書類に対する注記 「2. 重要な会計方針の要約」	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	更新
5 その他			(5) その他	追加または更新
第4 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況	(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	3 資産運用会社の概況	(1) 名称及び資本金の額	追加または更新
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員の状況		(3) 役員の状況	更新
	(5) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 1 財務諸表		4 外国投資法人の経理状況		追加
第6 販売及び買戻しの実績		5 販売及び買戻しの実績		追加

半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

ブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「ファンド」という。)のサブ・ファンドであるUSドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(以下「サブ・ファンド」ということがある。)の概況は、以下のとおりである。

[次へ](#)

(1) 主要な経営指標等の推移

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
(a) 営業収益 (注1)	84,997,799米ドル (11,349,756千円)	181,538,565米ドル (24,240,845千円)	85,553,171米ドル (11,423,915千円)	161,075,208米ドル (21,508,373千円)	67,527,827米ドル (9,016,991千円)
(b) 経常利益 (損失) 金額	68,322,694米ドル (9,123,129千円)	145,182,196米ドル (19,386,179千円)	66,751,910米ドル (8,913,383千円)	127,569,398米ドル (17,034,342千円)	55,723,573米ドル (7,440,769千円)
(c) 当期純利益 (損失) 金額	82,249,712米ドル (10,982,804千円)	140,878,869米ドル (18,811,555千円)	11,021,162米ドル (1,471,656千円)	- 83,260,514米ドル (- 11,117,776千円)	- 91,768,544米ドル (- 12,253,854千円)
(d) 出資総額 (注2)	3,727,544,815米ドル (497,739,059千円)	3,591,197,714米ドル (479,532,631千円)	3,053,668,434米ドル (407,756,346千円)	2,357,372,193米ドル (314,779,909千円)	2,031,004,182米ドル (271,199,988千円)
(e) 発行済投資証券総数			□	□	□
クラスA英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	102,753	93,693	102,535	104,359	107,327
クラスA毎日分配型投資証券	12,408,009	12,857,102	11,512,531	9,325,297	8,761,544
クラスA毎月分配型投資証券	19,369,718	24,737,631	22,158,627	17,098,452	14,499,790
クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,300,108	1,322,112	1,506,978	1,258,350	1,239,215
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	731,261	847,673	780,294	650,570	727,266
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	676,033	482,679	384,748	379,652	386,510
クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	870,489	820,748	709,105	617,092	532,584
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	315,200	323,306	314,900	308,379	308,186
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,615,678	1,519,955	1,320,276	1,271,914	1,262,834
クラスA豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	10,584,889	10,027,461	9,102,627	8,638,823	8,092,379
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	1,912,674	1,904,833	1,716,347	1,717,156	1,754,214
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	4,196	31,874	34,957	45,215	51,636
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	154,951,793	185,599,653	174,996,860	165,208,335	147,256,653
クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	14,582,201	15,559,141	15,740,095	15,535,128	6,660,793
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	671,033	1,030,229	1,466,610	1,449,696	1,416,434
クラスA無分配投資証券	12,366,116	13,589,691	11,471,641	8,990,579	7,924,368

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	274,643	215,097	197,332	184,729	180,238
クラスAスイス・フラン ・ヘッジ無分配投資証券	113,318	115,410	115,196	107,476	152,689
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	81,532	88,879	83,505	69,136	59,438
クラスAシンガポール・ ドル・ヘッジ無分配投資 証券	101,715	144,380	146,462	90,200	83,224
クラスC毎日分配型投資 証券	879,846	694,907	658,276	637,630	586,633
クラスC無分配投資証券	460,783	508,925	378,679	316,879	288,961
クラスD英ポンド・ヘッ ジ毎年分配英国報告型投 資証券	1,402,342	1,440,695	1,535,282	1,436,709	1,369,540
クラスD毎月分配型投資 証券	13,753,124	14,760,235	13,207,023	12,221,460	11,926,958
クラスDシンガポール・ ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	358,431	348,426	282,111	282,111	292,111
クラスD豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	136,339	104,313	107,352	107,352	116,801
クラスDスイス・フラン ・ヘッジ無分配投資証券	254,629	303,316	341,091	306,408	276,709
クラスDユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	252,216	278,671	241,887	246,794	115,278
クラスDシンガポール・ ドル・ヘッジ無分配投資 証券	557	16,662	16,662	16,662	16,662
クラスD無分配英国報告 型投資証券	8,176,492	8,731,300	8,357,571	6,195,563	5,199,535
クラスE無分配投資証券	511,984	501,284	504,890	455,300	381,533
クラスEユーロ・ヘッジ 無分配投資証券(注3)	-	413	413	953	13,247
クラスI英ポンド・ヘッ ジ毎年分配英国報告型投 資証券	7,241,503	2,621,471	32,540	872,712	1,000,369
クラスI毎月分配型投資 証券	22,156,425	22,145,496	24,249,689	15,705,324	6,164,513
クラスI無分配投資証券	37,119,978	27,217,160	23,603,337	22,593,825	24,023,867
クラスIユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	27,181,341	10,900,609	7,108,235	3,143,684	308,544
クラスIスイス・フラン ・ヘッジ無分配英国報 告型 投資証券(注4)	-	449	449	449	449
クラスI英ポンド・ヘッ ジ無分配英国報告型投資 証券(注5)	382	382	382	382	382

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
クラスS R 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券(注6)	-	364	364	364	364
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券(注6)	-	500	122,176	52,588	116,137
クラスS R 無分配英国報告型投資証券(注6)	-	500	323,642	291,662	176,143
クラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券(注6)	-	420	93,610	15,051	15,051
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	7,483,842	7,715,659	4,649,371	4,697,932	4,845,854
クラスX 無分配投資証券	545,626	468,549	476,857	393,926	426,368
(f) 純資産額	3,727,544,815米ドル (497,739,059千円)	3,591,197,714米ドル (479,532,631千円)	3,053,668,434米ドル (407,756,346千円)	2,357,372,193米ドル (314,779,909千円)	2,031,004,182米ドル (271,199,988千円)
(g) 総資産額	3,795,104,946米ドル (506,760,363千円)	3,620,336,960米ドル (483,423,594千円)	3,106,507,693米ドル (414,811,972千円)	2,404,600,980米ドル (321,086,369千円)	2,060,404,463米ドル (275,125,808千円)
(h) 1口当たり純資産価格					
クラスA 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	10.79英ポンド (1,786円)	10.71英ポンド (1,773円)	10.32英ポンド (1,709円)	9.09英ポンド (1,505円)	9.14英ポンド (1,513円)
クラスA 毎日分配型投資証券	5.97米ドル (797円)	6.03米ドル (805円)	5.72米ドル (764円)	5.18米ドル (692円)	5.13米ドル (685円)
クラスA 毎月分配型投資証券	6.02米ドル (804円)	6.09米ドル (813円)	5.77米ドル (770円)	5.22米ドル (697円)	5.18米ドル (692円)
クラスA 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	11.45豪ドル (1,027円)	11.57豪ドル (1,038円)	10.93豪ドル (980円)	9.83豪ドル (882円)	9.65豪ドル (866円)
クラスA カナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	10.23カナダ・ドル (1,010円)	10.34カナダ・ドル (1,021円)	9.79カナダ・ドル (967円)	8.84カナダ・ドル (873円)	8.73カナダ・ドル (862円)
クラスA ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.24ユーロ (1,346円)	9.31ユーロ (1,357円)	8.77ユーロ (1,278円)	7.84ユーロ (1,142円)	7.64ユーロ (1,113円)
クラスA 英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.75英ポンド (1,614円)	9.85英ポンド (1,631円)	9.33英ポンド (1,545円)	8.39英ポンド (1,389円)	8.23英ポンド (1,363円)
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	11.22ニュージーランド・ドル (939円)	11.34ニュージーランド・ドル (949円)	10.74ニュージーランド・ドル (899円)	9.70ニュージーランド・ドル (812円)	9.55ニュージーランド・ドル (799円)
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.96シンガポール・ドル (1,002円)	10.07シンガポール・ドル (1,013円)	9.54シンガポール・ドル (960円)	8.62シンガポール・ドル (867円)	8.50シンガポール・ドル (855円)
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	9.13豪ドル (819円)	9.17豪ドル (822円)	8.59豪ドル (770円)	7.67豪ドル (688円)	7.51豪ドル (674円)
クラスA 南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	90.09南アフリカ・ランド (675円)	90.97南アフリカ・ランド (681円)	86.00南アフリカ・ランド (644円)	77.05南アフリカ・ランド (577円)	75.58南アフリカ・ランド (566円)
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	105.08人民元 (2,041円)	105.70人民元 (2,053円)	99.41人民元 (1,931円)	88.78人民元 (1,724円)	85.89人民元 (1,668円)
クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券	5.05米ドル (674円)	5.05米ドル (674円)	4.74米ドル (633円)	4.25米ドル (568円)	4.17米ドル (557円)

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	37.66香港ドル (641円)	37.69香港ドル (641円)	35.29香港ドル (600円)	31.53香港ドル (536円)	30.84香港ドル (525円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	9.23シンガポール・ドル (929円)	9.25シンガポール・ドル (931円)	8.67シンガポール・ドル (872円)	7.75シンガポール・ドル (780円)	7.59シンガポール・ドル (764円)
クラスA無分配投資証券	37.87米ドル (5,057円)	39.04米ドル (5,213円)	37.63米ドル (5,025円)	34.83米ドル (4,651円)	35.38米ドル (4,724円)
クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	18.56豪ドル (1,665円)	19.12豪ドル (1,715円)	18.40豪ドル (1,650円)	16.91豪ドル (1,517円)	17.00豪ドル (1,525円)
クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	11.47スイス・フラン (1,676円)	11.76スイス・フラン (1,719円)	11.28スイス・フラン (1,649円)	10.30スイス・フラン (1,505円)	10.24スイス・フラン (1,497円)
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	223.60ユーロ (32,583円)	229.57ユーロ (33,453円)	220.31ユーロ (32,104円)	201.30ユーロ (29,333円)	200.82ユーロ (29,263円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	16.14シンガポール・ドル (1,624円)	16.64シンガポール・ドル (1,674円)	16.04シンガポール・ドル (1,614円)	14.80シンガポール・ドル (1,489円)	14.96シンガポール・ドル (1,505円)
クラスC毎日分配型投資証券	5.98米ドル (799円)	6.04米ドル (807円)	5.73米ドル (765円)	5.19米ドル (693円)	5.14米ドル (686円)
クラスC無分配投資証券	28.92米ドル (3,862円)	29.63米ドル (3,956円)	28.39米ドル (3,791円)	26.11米ドル (3,486円)	26.36米ドル (3,520円)
クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	10.78英ポンド (1,785円)	10.66英ポンド (1,765円)	10.31英ポンド (1,707円)	9.04英ポンド (1,497円)	9.12英ポンド (1,510円)
クラスD毎月分配型投資証券	10.32米ドル (1,378円)	10.43米ドル (1,393円)	9.88米ドル (1,319円)	8.95米ドル (1,195円)	8.87米ドル (1,184円)
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.99シンガポール・ドル (1,005円)	10.10シンガポール・ドル (1,016円)	9.57シンガポール・ドル (963円)	8.64シンガポール・ドル (869円)	8.52シンガポール・ドル (857円)
クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	19.62豪ドル (1,760円)	20.28豪ドル (1,819円)	19.58豪ドル (1,756円)	18.05豪ドル (1,619円)	18.22豪ドル (1,634円)
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	11.96スイス・フラン (1,748円)	12.31スイス・フラン (1,799円)	11.84スイス・フラン (1,731円)	10.85スイス・フラン (1,586円)	10.84スイス・フラン (1,584円)
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	238.76ユーロ (34,792円)	246.02ユーロ (35,850円)	236.91ユーロ (34,523円)	217.23ユーロ (31,655円)	217.48ユーロ (31,691円)
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	17.00シンガポール・ドル (1,710円)	17.60シンガポール・ドル (1,771円)	17.02シンガポール・ドル (1,712円)	15.76シンガポール・ドル (1,585円)	15.99シンガポール・ドル (1,609円)
クラスD無分配英国報告型投資証券	29.01英ポンド (4,803円)	30.35英ポンド (5,025円)	30.17英ポンド (4,995円)	32.37英ポンド (5,359円)	31.56英ポンド (5,225円)
クラスE無分配投資証券	34.49米ドル (4,605円)	35.47米ドル (4,736円)	34.11米ドル (4,555円)	31.49米ドル (4,205円)	31.91米ドル (4,261円)
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券(注3)	-	10.17ユーロ (1,482円)	9.74ユーロ (1,419円)	8.87ユーロ (1,293円)	8.83ユーロ (1,287円)
クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	9.35英ポンド (1,548円)	9.24英ポンド (1,530円)	8.94英ポンド (1,480円)	7.84英ポンド (1,298円)	7.91英ポンド (1,310円)
クラスI毎月分配型投資証券	9.71米ドル (1,297円)	9.82米ドル (1,311円)	9.31米ドル (1,243円)	8.43米ドル (1,126円)	8.36米ドル (1,116円)
クラスI無分配投資証券	16.43米ドル (2,194円)	17.01米ドル (2,271円)	16.47米ドル (2,199円)	15.31米ドル (2,044円)	15.62米ドル (2,086円)
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	12.30ユーロ (1,792円)	12.69ユーロ (1,849円)	12.23ユーロ (1,782円)	11.22ユーロ (1,635円)	11.24ユーロ (1,638円)

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
クラスI スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券(注4)	-	10.13スイス・フラン (1,481円)	9.75スイス・フラン (1,425円)	8.94スイス・フラン (1,307円)	8.94スイス・フラン (1,307円)
クラスI 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券(注5)	10.51英債券 (1,740円)	10.88英債券 (1,801円)	10.53英債券 (1,743円)	9.72英債券 (1,609円)	9.82英債券 (1,626円)
クラスS R 英債券・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券(注6)	-	10.09英債券 (1,671円)	9.76英債券 (1,616円)	8.56英債券 (1,417円)	8.64英債券 (1,430円)
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券(注6)	-	7.33英債券 (1,214円)	7.13英債券 (1,180円)	7.46英債券 (1,235円)	7.08英債券 (1,172円)
クラスS R 無分配英国報告型投資証券(注6)	-	7.45英債券 (1,233円)	7.41英債券 (1,227円)	7.96英債券 (1,318円)	7.76英債券 (1,285円)
クラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券(注6)	-	10.24ユーロ (1,492円)	9.87ユーロ (1,438円)	9.05ユーロ (1,319円)	9.06ユーロ (1,320円)
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	11.02米ドル (1,472円)	11.12米ドル (1,485円)	10.49米ドル (1,401円)	9.49米ドル (1,267円)	9.41米ドル (1,257円)
クラスX 無分配投資証券	45.16米ドル (6,030円)	46.89米ドル (6,261円)	45.52米ドル (6,078円)	42.43米ドル (5,666円)	43.40米ドル (5,795円)
(i) 1口当たり当期純利益金額(注7)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	39,372,401米ドル (5,257,397千円)	88,628,460米ドル (11,834,558千円)	44,465,524米ドル (5,937,481千円)	85,316,226米ドル (11,392,276千円)	34,197,742米ドル (4,566,424千円)
(k) 1口当たり分配金額(注7)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	98.22%	99.20%	98.30%	98.04%	98.57%
(m) 自己資本利益率	2.21%	3.92%	0.36%	-3.53%	-4.52%

(注1) 営業収益には投資収益を記載している。

(注2) ファンドは、変動資本を有する会社型投資信託(以下「SICAV」という。)であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(注3) クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券は、2021年4月28日に運用を開始した。以下同じ。

(注4) クラスI スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券は、2021年6月9日に運用を開始した。以下同じ。

(注5) クラスI 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券は、2020年10月28日に運用を開始した。以下同じ。

(注6) クラスS R 英債券・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券、クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券 - 米ドル、クラスS R 無分配英国報告型投資証券 - 米ドルおよびクラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券は、それぞれ2021年4月14日に運用を開始した。以下同じ。

(注7) (i) および(k) は、ファンドの性格上、算定していない。

(注8) USドル・ハイ・イールド・債券・ファンドは、1993年10月29日より運用を開始した。

[次へ](#)

(2) 外国投資法人の出資総額

サブ・ファンドの2023年3月末日現在の発行済投資証券総口数、ならびに下記の各会計年度末現在および2023年3月末日現在の純資産総額ならびにクラスA毎月分配型投資証券およびクラスA無分配投資証券の発行済投資証券総口数は、以下のとおりである。

サブ・ファンドにつき、発行可能投資証券総口数の定めはない。

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
クラスA英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	107,327
クラスA毎日分配型投資証券	8,572,791
クラスA毎月分配型投資証券	14,588,511
クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,212,825
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	679,898
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	386,515
クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	533,405
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	308,186
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,262,186
クラスA豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	8,029,733
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	1,761,850
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	51,636
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	144,249,611
クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	6,298,411
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	1,368,747
クラスA無分配投資証券	7,817,181
クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	177,284
クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	93,284
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	58,592
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	79,058
クラスC毎日分配型投資証券	553,769
クラスC無分配投資証券	284,501
クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	376,670
クラスD毎月分配型投資証券	10,877,303
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	292,111
クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	116,801
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	266,709
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	113,058
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	16,662
クラスD無分配英国報告型投資証券	5,034,564
クラスE無分配投資証券	378,423
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	13,247
クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	1,000,369
クラスI毎月分配型投資証券	6,172,007

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
クラスI無分配投資証券	23,409,346
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	350,074
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	449
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	382
クラスSR英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	364
クラスSR毎月分配英国報告型投資証券	64,048
クラスSR無分配英国報告型投資証券	176,143
クラスSRユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	15,051
クラスX安定毎月総収益分配型投資証券	4,870,646
クラスX無分配投資証券	412,588

会計年度	純資産総額	クラスA毎月分配型投資証券 発行済投資証券総口数	クラスA無分配投資証券 発行済投資証券総口数
第56会計年度末 (2017年8月末日)	3,565,072,601米ドル (476,044,144千円)	27,749,128口	15,216,798口
第57会計年度末 (2018年8月末日)	2,489,192,280米ドル (332,381,845千円)	20,569,525口	10,985,138口
第58会計年度末 (2019年8月末日)	2,106,616,767米ドル (281,296,537千円)	17,247,134口	9,669,599口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	3,031,279,724米ドル (404,766,782千円)	16,062,099口	11,441,254口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	3,591,197,714米ドル (479,532,631千円)	24,737,631口	13,589,691口
第61会計年度末 (2022年8月末日)	2,357,372,193米ドル (314,779,909千円)	17,098,452口	8,990,579口
2023年3月末日	1,983,615,192米ドル (264,872,137千円)	14,588,511口	7,817,181口

(3) 主要な投資主の状況

サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は、これを開示すると欧州連合(以下「EU」という。)のデータ保護法に基づくファンドの義務に違反することとなるため、開示できない。

(4) 役員の状況

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有 投資 証券 口数
ポール・フリーマン (Paul Freeman)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズ の非常勤取締役	0
ベッティナ・マツゾッキ (Bettina Mazzocchi)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディ レクターならびにフランス、ベル ギー、ルクセンブルグおよびモナコに おけるiShares&ウェルス部門のヘッド	0
ジェフ・ラドクリフ (Geoff Radcliffe)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディ レクターならびにブラックロック・ル クセンブルグ・オフィスおよびイン ターナショナル・プロダクト・オー バーサイト・アンド・ガバナンスの ヘッド	0
デニス・ヴォス (Denise Voss)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファン ズの非常勤取締役	0
キース・サルダナ (Keith Saldanha)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディ レクターおよびEMEA・ウェルス・ プロダクト・グループのヘッド	0
ダヴィーナ・セイント (Davina Saint)	独立非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファン ズの独立非常勤取締役	0
ヴァシリキ・ パチャトゥリディ (Vasiliki Pachatouridi)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディ レクターおよびiSharesフィクスト・イ ンカム・プロダクト・ストラテジーE MEAのヘッド	0

(注) ファンドに従業員はいない。ファンドの独立監査人は、アーンスト・アンド・ヤング・ソシエテ・アノニムである。

(5) その他

a. 定款の変更

ファンドの定款は、法律に規定された定足数および要件に従って、ファンドの投資主総会の特別決議により変更することができる。

b. 事業譲渡または事業譲受

合併

ルクセンブルグ規制当局(ルクセンブルグ金融監督委員会(Commission de Surveillance du Sector Financier)) (以下「CSSF」という。)の事前承認を条件に、譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託(以下「UCITS」という。)同士の併合による合併が認められている。

併合による合併の結果、吸収されるUCITSは、その資産および債務を相手方のUCITSに抛出し、清算を行わずに解散される。

変動資本を有する会社型投資信託(以下「SICAV」という。)間で合併が行われる場合、ルクセンブルグの投資信託に関する2010年12月17日の法律(以下「2010年法」という。)の規定が適用され、1915年8月10日の法律(改正済)の規定は制限される。

SICAVは、2010年法に基づき契約型投資信託(以下「FCP」という。)および会社型投資信託との合併が可能である。

資産の譲渡

SICAVの投資主またはFCPの管理会社の決定に基づき、UCITSは、その資産のすべてを別のUCITSに譲渡することができ、その後、空のUCITSが清算を行わずに解散される。

UCITSは、特別な状況において、またCSSFおよび適用法により要求される手続に従い(例えば、サブ・ファンドの合併によるかまたは分離により)、その資産の一部を相手方のUCITSに譲渡することができる。

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他ファンドに重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

(資産別および地域別の投資状況)

(2023年3月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 ^(注1) (%)
社債	米国	1,494,982,976	74.32
	カナダ	101,620,603	5.05
	ルクセンブルグ	39,622,994	1.97
	オランダ	34,516,574	1.72
	フランス	34,247,280	1.70
	連合王国	28,255,757	1.40
	ドイツ	20,691,276	1.03
	ケイマン諸島	18,229,996	0.91
	パナマ	16,646,463	0.83
	イタリア	14,866,263	0.74
	リベリア	11,493,117	0.57
	バミューダ	9,037,885	0.45
	モーリシャス	4,528,913	0.23
	アイルランド	4,295,824	0.21
	スペイン	2,606,034	0.13
	ジャマイカ	1,883,188	0.09
	スウェーデン	1,595,681	0.08
	ポルトガル	1,416,660	0.07
	スイス	1,258,483	0.06
	フィンランド	1,206,310	0.06
	日本	1,084,028	0.05
	ポーランド	878,392	0.04
	ジャージー	874,444	0.04
オーストラリア	725,545	0.04	
オーストリア	347,513	0.02	
ルーマニア	205,977	0.01	
マーシャル諸島	178,162	0.01	
イギリス領ヴァージン諸島	169,813	0.01	
	小計	1,847,466,151	91.84
政府機関債	アイルランド	32,027,860	1.59
	ケイマン諸島	27,836,655	1.38
	ジャージー	3,401,918	0.17
	小計	63,266,433	3.15
株式	米国	9,685,537	0.48
	フランス	3,962,497	0.20
	小計	13,648,034	0.68
小計		1,924,380,618	95.66

現金・その他の資産(負債控除後)	87,267,308	4.34
資産総額	2,011,647,926	100.00
負債総額	28,032,734	1.39 (注2)
純資産総額	1,983,615,192 (約264,872百万円)	98.61 (注3)

(注1) 投資比率とは、サブ・ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。

(2) 運用実績

純資産等の推移

2023年3月末日および同日前1年以内における各月末のサブ・ファンドの総資産額および純資産総額、ならびにクラスA毎月分配型投資証券およびクラスA無分配投資証券の1口当たり純資産価格の推移は、以下のとおりである。

	総資産額		純資産総額	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
2022年4月末日	2,749,821	367,184	2,717,260	362,836
5月末日	2,703,423	360,988	2,688,249	358,962
6月末日	2,411,425	321,998	2,389,594	319,082
7月末日	2,462,064	328,759	2,441,324	325,990
8月末日	2,404,601	321,086	2,357,372	314,780
9月末日	2,193,893	292,951	2,151,846	287,336
10月末日	2,109,813	281,723	2,077,053	277,349
11月末日	2,108,235	281,513	2,083,431	278,201
12月末日	2,076,213	277,237	2,061,782	275,310
2023年1月末日	2,145,808	286,530	2,094,593	279,691
2月末日	2,060,404	275,126	2,031,004	271,200
3月末日	2,011,648	268,615	1,983,615	264,872

	1口当たり純資産価格			
	クラスA 毎月分配型投資証券		クラスA 無分配投資証券	
	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	5.50	734	36.15	4,827
5月末日	5.46	729	35.98	4,804
6月末日	5.07	677	33.57	4,483
7月末日	5.33	712	35.38	4,724
8月末日	5.22	697	34.83	4,651
9月末日	4.96	662	33.20	4,433
10月末日	5.10	681	34.29	4,579
11月末日	5.13	685	34.62	4,623
12月末日	5.10	681	34.58	4,617
2023年1月末日	5.27	704	35.89	4,792
2月末日	5.18	692	35.38	4,724
3月末日	5.19	693	35.62	4,756

クラスA 毎月分配型投資証券およびクラスA 無分配投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所が運営するユーロ多角的取引システム（MTF）に上場されている。同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

2023年3月末日前1年間におけるサブ・ファンドの分配金の額は、以下のとおりである。

総額63,793,909米ドル（約8,518,401千円）

（注）上記金額は、サブ・ファンドの分配金の総額である。クラスA 毎月分配型投資証券につき、2023年3月末日前1年間における各月の1口当たり分配金は、以下のとおりである。クラスA 無分配投資証券については、分配金は支払われていない。

分配落ち日	分配支払日	1口当たり分配金
2022年4月29日	2022年5月6日	0.017264米ドル（2.31円）
2022年5月31日	2022年6月8日	0.021287米ドル（2.84円）
2022年6月30日	2022年7月7日	0.019079米ドル（2.55円）
2022年7月29日	2022年8月5日	0.018518米ドル（2.47円）
2022年8月31日	2022年9月7日	0.020573米ドル（2.75円）
2022年9月30日	2022年10月7日	0.019642米ドル（2.62円）
2022年10月31日	2022年11月8日	0.021422米ドル（2.86円）
2022年11月30日	2022年12月7日	0.021160米ドル（2.83円）
2022年12月30日	2023年1月6日	0.020906米ドル（2.79円）
2023年1月31日	2023年2月7日	0.022802米ドル（3.04円）
2023年2月28日	2023年3月7日	0.020576米ドル（2.75円）
2023年3月31日	2023年4月11日	0.023487米ドル（3.14円）

自己資本利益率(収益率)の推移

下記の期間におけるサブ・ファンドの自己資本利益率は、以下のとおりである。

期間	自己資本利益率(収益率)
(2022年4月1日 ~ 2023年3月31日)	- 2.54%

(3) 投資リスク

第62会計年度中間期において、2023年2月28日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載されたリスク要因について、重要な変更はない。

ファンドが将来にわたって営業活動を継続するとの前提に重要な疑義を生じさせるような事象または状況その他ファンドの経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

名称

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー(BlackRock(Luxembourg)S.A.)(運用会社)

資本金(株主資本)の額

2023年4月30日現在、6,309,670ユーロ(約9億1,945万円)

(2) 大株主の状況

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、ブラックロック・インコーポレイテッド・グループ内の完全子会社である。運用会社の大株主に関するより詳細な情報は、これを開示するとEUのデータ保護法に基づく運用会社の義務に違反することとなるため、開示できない。

(3) 役員の状況

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式数
ジョナサン・グリフィン (Jonathan Griffin)	取締役会長 および 非常勤取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役会長および非常勤取締役	0
ジェフ・ラドクリフ (Geoff Radcliffe)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクターならびにブラックロック・ルクセンブルグ・オフィスおよびインターナショナル・プロダクト・オーバーサイト・アンド・ガバナンスのヘッド	0
ジョアン・フィッツジェラルド (Joanne Fitzgerald)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役およびEMEA・ファンド・ボード・ガバナンス	0
レオン・シュワブ (Leon Schwab)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役、ブラックロック・グローバル・ファンズ・アドミニストレーション・サービス・グループおよびレギュラトリー・アンド・タックス・サブスタンス・EMEA・オルタナティブのヘッド	0
スヴェトラナ・ブトビナ (Svetlana Butvina)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクターおよびEMEA・ファンズ・リスクのヘッド	0
リチャード・ガードナー (Richard Gardner)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクター、EMEA・クライアント・コア・ビジネスのCOOおよびブラックロック・ライフ・リミテッドのCOO	0
タレク・マフムード (Tarek Mahmoud)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役	0
マイケル・レンナー (Michael Renner)	非常勤取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの非常勤取締役	0

(4) 事業の内容及び営業の概況

ブラックロック(ルクセンブルグ) エス・エーは、2010年法第15章に基づき運用会社として行為することを認可されている。運用会社契約に基づきファンドの投資運用、管理およびサブ・ファンドのマーケティングに関するあらゆる運営機能を、直接または委託により遂行する責任とともに、ファンドの日々の運用を行っている。2023年3月末日現在、運用会社は、以下の3本の投資法人(合計純資産総額は、133,671,497,904.69米ドル、792,952,771.95英ポンド、663,872,896.39スイス・フラン、39,571,893,604.39ユーロ、30,231,154,373.33人民元および43,099,177,511.68円)を運用、助言および/または管理している。

名称(設立国)	基本的性格	設立年月日	純資産総額(通貨別)
ブラックロック・ グローバル・ファンズ (ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型 投資信託(アンブレラ型)	1962年6月14日	120,995,874,551.53米ドル 238,247,661.39英ポンド 663,872,896.39スイス・フラン 29,973,087,570.96ユーロ 30,231,154,373.33人民元 43,099,177,511.68円
ブラックロック・ ストラテジック・ファンズ (ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型 投資信託(アンブレラ型)	2007年5月2日	7,907,185,736.30米ドル 9,102,500,901.02ユーロ 554,705,110.56英ポンド
ブラックロック・ グローバル・ インデックス・ファンズ (ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型 投資信託(アンブレラ型)	2012年8月30日	4,768,437,616.86米ドル 496,305,132.41ユーロ

(注) 上記投資法人は、アンブレラ型であり、複数のサブ・ファンドおよび複数の投資証券クラスにより構成される。各サブ・ファンドの1単位当たり純資産価格については開示していない。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- (a) サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文(英文)の中間財務書類を翻訳したものである(ただし、円換算部分を除く。)。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」(平成5年大蔵省令第22号。その後の改正を含む。)に基づき、「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。その後の改正を含む。)第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- (b) ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号。その後の改正を含む。)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。
- (c) ファンドの原文の中間財務書類は、外国通貨で表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円への換算には、2023年3月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=133.53円、1英ポンド=165.56円、1カナダ・ドル=98.75円、1スイス・フラン=146.16円、1ユーロ=145.72円、1豪ドル=89.69円、1香港ドル=17.01円、1人民元=19.42円、1シンガポール・ドル=100.60円、1ニュージーランド・ドル=83.71円および1南アフリカ・ランド=7.49円)が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は四捨五入のため合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。
- (注) ファンドの原文の中間財務書類には、現在ファンドを構成するすべてのサブ・ファンドの情報が掲載されているが、日本語の中間財務書類には、USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの情報のみが掲載されている(ただし、「財務書類に対する注記」を除く。)。

(1) 資産及び負債の状況

純資産計算書 2023年2月28日現在(未監査)

	注記	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		2,180,502,528	291,162,503
未実現評価損		(224,198,451)	(29,937,219)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,956,304,077	261,225,283
銀行預金	2 (a)	63,710,469	8,507,259
ブローカーに対する債権	14	3,169,000	423,157
未収利息および未収配当金	2 (a)	32,831,515	4,383,992
販売投資証券未収金	2 (a)	3,336,836	445,568
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	657,254	87,763
スワップの時価	2 (c)	395,312	52,786
資産合計		2,060,404,463	275,125,808
負債			
ブローカーに対する債務	14	682,065	91,076
未払収益分配金	2 (a)	5,366,767	716,624
買戻し投資証券未払金	2 (a)	17,999,635	2,403,491
以下に係る未実現評価損：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	3,267,531	436,313
その他の負債	4 , 5 , 6 , 7 , 8	2,084,283	278,314
負債合計		29,400,281	3,925,820
純資産合計		2,031,004,182	271,199,988

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 2023年2月28日現在(未監査)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2023年2月28日現在現在			
純資産合計	米ドル	2,031,004,182	271,199,988 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.14	1,513 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.13	685 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.18	692 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	9.65	866 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	8.73	862 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	7.64	1,113 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	8.23	1,363 円
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ニュージー ランド・ドル	9.55	799 円
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	8.50	855 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	7.51	674 円
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	南アフリカ・ ランド	75.58	566 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	85.89	1,668 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.17	557 円
クラスA香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	30.84	525 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポール・ ドル	7.59	764 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	35.38	4,724 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	17.00	1,525 円
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	10.24	1,497 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	200.82	29,263 円
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	14.96	1,505 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2023年2月28日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き) :			
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	5.14	686 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	26.36	3,520 円
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	9.12	1,510 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	8.87	1,184 円
クラスD 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	8.52	857 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.22	1,634 円
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	10.84	1,584 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	217.48	31,691 円
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	15.99	1,609 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	31.56	5,225 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	31.91	4,261 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	8.83	1,287 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.91	1,310 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	8.36	1,116 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	15.62	2,086 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.24	1,638 円
クラスI スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	スイス・フラン	8.94	1,307 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.82	1,626 円
クラスS R 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	8.64	1,430 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.08	1,172 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.76	1,285 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	9.06	1,320 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	9.41	1,257 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	43.40	5,795 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2022年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	2,357,372,193	314,779,909 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.09	1,505 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.18	692 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.22	697 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	9.83	882 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	8.84	873 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	7.84	1,142 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	8.39	1,389 円
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ニュージー ランド・ドル	9.70	812 円
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	8.62	867 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	7.67	688 円
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	南アフリカ・ ランド	77.05	577 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	88.78	1,724 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.25	568 円
クラスA香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	31.53	536 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポール・ ドル	7.75	780 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	34.83	4,651 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	16.91	1,517 円
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	10.30	1,505 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	201.30	29,333 円
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	14.80	1,489 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2022年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き) :			
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	5.19	693 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	26.11	3,486 円
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	9.04	1,497 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	8.95	1,195 円
クラスD 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	8.64	869 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.05	1,619 円
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	10.85	1,586 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	217.23	31,655 円
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	15.76	1,585 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	32.37	5,359 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	31.49	4,205 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	8.87	1,293 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.84	1,298 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	8.43	1,126 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	15.31	2,044 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.22	1,635 円
クラスI スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	スイス・フラン	8.94	1,307 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.72	1,609 円
クラスS R 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	8.56	1,417 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.46	1,235 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.96	1,318 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	9.05	1,319 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	9.49	1,267 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	42.43	5,666 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	3,591,197,714	479,532,631 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.71	1,773 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	6.03	805 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	6.09	813 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	11.57	1,038 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	10.34	1,021 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	9.31	1,357 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	9.85	1,631 円
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ニュージー ランド・ドル	11.34	949 円
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	10.07	1,013 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	9.17	822 円
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	南アフリカ・ ランド	90.97	681 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	105.70	2,053 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	5.05	674 円
クラスA香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	37.69	641 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポール・ ドル	9.25	931 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	39.04	5,213 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	19.12	1,715 円
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	11.76	1,719 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	229.57	33,453 円
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	16.64	1,674 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き) :			
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	6.04	807 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	29.63	3,956 円
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	10.66	1,765 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	10.43	1,393 円
クラスD 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	10.10	1,016 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	20.28	1,819 円
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	12.31	1,799 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	246.02	35,850 円
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	17.60	1,771 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	30.35	5,025 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	35.47	4,736 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	10.17	1,482 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.24	1,530 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	9.82	1,311 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	17.01	2,271 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	12.69	1,849 円
クラスI スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	スイス・フラン	10.13	1,481 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.88	1,801 円
クラスS R 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.09	1,671 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.33	1,214 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.45	1,233 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	10.24	1,492 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	11.12	1,485 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	46.89	6,261 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	3,031,279,724	404,766,782 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.30	1,705 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.79	773 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.84	780 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	11.13	998 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.94	982 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	9.01	1,313 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	9.48	1,570 円
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ニュージー ランド・ドル	10.90	912 円
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	9.67	973 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	8.94	802 円
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	南アフリカ・ ランド	88.00	659 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	102.59	1,992 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.95	661 円
クラスA香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	36.96	629 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポール・ ドル	9.06	911 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	36.04	4,812 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	17.70	1,588 円
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	10.98	1,605 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	213.89	31,168 円
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	15.37	1,546 円

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 2023年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き) :			
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	5.80	774 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	27.70	3,699 円
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	10.25	1,697 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	10.01	1,337 円
クラスD 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	9.70	976 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.65	1,673 円
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	11.42	1,669 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	227.62	33,169 円
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	16.14	1,624 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	28.79	4,766 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	32.91	4,394 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	8.89	1,472 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	9.42	1,258 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	15.57	2,079 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.72	1,708 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	10.74	1,434 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	42.70	5,702 円

価格は、関連する投資証券クラスの取引通貨で提示されている。投資証券クラスに二つ以上の取引通貨がある場合は、関連する投資証券クラスの基準通貨が表示されている。追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

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 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間（未監査）

U S ドル・ハイ・イールド・
ボンド・ファンド

	注記	U S ドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
期首純資産		2,357,372,193	314,779,909
収益			
銀行利息	2 (b)	1,189,430	158,825
債券利息（源泉徴収税控除後）	2 (b)	65,329,555	8,723,455
スワップ利息	2 (c)	436,032	58,223
配当金（源泉徴収税控除後）	2 (b)	301,452	40,253
有価証券貸付収益	2 (b)	264,069	35,261
投資運用報酬リベート	4	3,286	439
その他の払戻し	10	4,003	535
収益合計	2 (b)	67,527,827	9,016,991
費用			
スワップ利息	2 (c)	14,627	1,953
年次サービス料	6	1,263,769	168,751
ローン・コミットメント・フィー	16	7,092	947
保管および預託報酬	2 (h), 7	118,678	15,847
販売報酬	5	99,354	13,267
税金	8	393,811	52,586
投資運用報酬	4	9,906,923	1,322,871
費用合計		11,804,254	1,576,222
純利益		55,723,573	7,440,769
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(78,818,076)	(10,524,578)
上場先物取引	2 (c)	(537,336)	(71,750)
オプション / スワップション契約	2 (c)	(140,843)	(18,807)
スワップ取引	2 (c)	(18,100,876)	(2,417,010)
先渡為替予約	2 (c)	5,587,274	746,069
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	241,313	32,223
当期実現純評価損		(91,768,544)	(12,253,854)
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)	64,798,392	8,652,529
上場先物取引	2 (c)	862,031	115,107
オプション / スワップション契約	2 (c)	34,240	4,572
スワップ取引	2 (c)	8,674,122	1,158,256
先渡為替予約	2 (c)	(4,834,595)	(645,563)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(71,178)	(9,504)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		69,463,012	9,275,396
運用成績による純資産増加		33,418,041	4,462,311
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		329,917,890	44,053,936
投資証券買戻しによる正味支払額		(655,506,200)	(87,529,743)
資本の変動による純資産の減少		(325,588,310)	(43,475,807)
配当金宣言額	15	(34,197,742)	(4,566,424)
期末純資産		2,031,004,182	271,199,988

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 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)

U S ドル・ハイ・イールド・
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英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	104,359	3,077	109	107,327
クラスA毎日分配型投資証券	9,325,297	339,088	902,841	8,761,544
クラスA毎月分配型投資証券	17,098,452	1,230,228	3,828,890	14,499,790
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	1,258,350	741,979	761,114	1,239,215
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	650,570	153,483	76,787	727,266
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	379,652	16,869	10,011	386,510
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	617,092	3,391	87,899	532,584
クラスAニュージーランド・ドル・ ヘッジ毎月分配型投資証券	308,379	20,581	20,774	308,186
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	1,271,914	8,547	17,627	1,262,834
クラスA豪ドル・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	8,638,823	119,618	666,062	8,092,379
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	1,717,156	122,071	85,013	1,754,214
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	45,215	6,421	-	51,636
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	165,208,335	7,776,876	25,728,558	147,256,653
クラスA香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	15,535,128	1,149,820	10,024,155	6,660,793
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	1,449,696	20,506	53,768	1,416,434
クラスA無分配投資証券	8,990,579	4,535,431	5,601,642	7,924,368
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	184,729	19,418	23,909	180,238
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	107,476	46,213	1,000	152,689
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	69,136	2,261	11,959	59,438
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	90,200	12,604	19,580	83,224

発行済投資証券口数変動表 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)(続き)

U S ドル・ハイ・イールド・
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C 毎日分配型投資証券	637,630	2,460	53,457	586,633
クラスC 無分配投資証券	316,879	14,166	42,084	288,961
クラスD 英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	1,436,709	82,415	149,584	1,369,540
クラスD 毎月分配型投資証券	12,221,460	937,183	1,231,685	11,926,958
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	282,111	10,000	-	292,111
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	107,352	9,449	-	116,801
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	306,408	-	29,699	276,709
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	246,794	20,802	152,318	115,278
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	16,662	-	-	16,662
クラスD 無分配英国報告型投資証券	6,195,563	1,009,040	2,005,068	5,199,535
クラスE 無分配投資証券	455,300	30,529	104,296	381,533
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	953	12,834	540	13,247
クラスI 英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	872,712	609,046	481,389	1,000,369
クラスI 毎月分配型投資証券	15,705,324	76,161	9,616,972	6,164,513
クラスI 無分配投資証券	22,593,825	2,811,996	1,381,954	24,023,867
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	3,143,684	1,007,804	3,842,944	308,544
クラスI スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	449	-	-	449
クラスI 英ボンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	382	-	-	382
クラスS R 英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	364	-	-	364
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	52,588	63,549	-	116,137
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	291,662	-	115,519	176,143
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	15,051	-	-	15,051
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	4,697,932	147,923	1	4,845,854
クラスX 無分配投資証券	393,926	58,311	25,869	426,368

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品			
普通株式			
300,630	ケイマン諸島 Diversey	1,770,711	0.09
260,348	フランス Constellium	4,056,222	0.20
7,658	米国 Block*	573,354	0.03
70,139	Element Solutions*	1,449,773	0.07
89,638	Informatica	1,552,530	0.08
3,677	Twilio*	251,286	0.01
28,994	Uber Technologies	977,968	0.05
		4,804,911	0.24
普通株式合計		10,631,844	0.53
債券			
USD 715,000	オーストラリア Macquarie Bank 6.798% 18/1/2033	718,851	0.04
EUR 400,000	オーストラリア ams-OSRAM 0% 5/3/2025	346,236	0.02
USD 1,051,000	バミューダ Nabors Industries 7.25% 15/1/2026	1,001,409	0.05
USD 2,471,000	Nabors Industries 7.5% 15/1/2028	2,287,196	0.11
USD 1,513,000	NCL 5.875% 15/3/2026	1,321,056	0.06
USD 388,000	NCL 7.75% 15/2/2029	341,440	0.02
USD 863,000	NCL 8.375% 1/2/2028	881,037	0.04
USD 1,328,000	NCL Finance 6.125% 15/3/2028	1,110,606	0.05
USD 1,750,000	OHA Credit Funding 11 8.233% 19/7/2033	1,684,546	0.08
USD 505,000	Viking Ocean Cruises Ship VII 5.625% 15/2/2029	430,250	0.02
USD 1,519,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	1,486,403	0.07
USD 2,965,000	Weatherford International 8.625% 30/4/2030*	2,964,822	0.14
USD 52,000	Weatherford International 11% 1/12/2024	53,499	0.00
		13,562,264	0.64
EUR 166,000	英領バージン諸島 Global Switch 2.25% 31/5/2027	162,882	0.01
USD 467,000	カナダ 1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	416,517	0.02
USD 1,071,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	887,366	0.04
USD 1,189,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	1,065,609	0.05
USD 635,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 5.75% 15/4/2025	630,184	0.03
USD 2,844,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	2,564,165	0.13

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 849,000	ATS Automation Tooling Systems 4.125% 15/12/2028	742,083	0.04
USD 5,483,000	Bombardier 6% 15/2/2028	5,125,005	0.25
USD 6,817,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	6,688,465	0.33
USD 856,000	Bombardier 7.45% 1/5/2034	870,219	0.04
USD 358,000	Bombardier 7.5% 15/3/2025	357,508	0.02
USD 2,555,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029	2,515,921	0.12
USD 2,664,000	Bombardier 7.875% 15/4/2027	2,652,192	0.13
USD 2,211,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 4.875% 15/2/2030	1,669,471	0.08
USD 1,580,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	1,233,917	0.06
USD 2,776,000	Clarios Global 6.75% 15/5/2025	2,764,653	0.14
EUR 234,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	235,063	0.01
USD 4,180,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	4,101,239	0.20
USD 16,896,000	Clarios Global / Clarios US Finance 8.5% 15/5/2027	16,784,652	0.83
USD 1,798,000	Enerflex 9% 15/10/2027	1,763,496	0.09
USD 1,681,000	ERO Copper 6.5% 15/2/2030	1,419,132	0.07
USD 953,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	845,215	0.04
USD 2,195,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	2,156,368	0.11
USD 117,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	102,262	0.01
USD 876,000	GFL Environmental 3.75% 1/8/2025	824,097	0.04
USD 3,681,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	3,205,635	0.16
USD 643,000	GFL Environmental 4.25% 1/6/2025	611,761	0.03
USD 1,232,000	GFL Environmental 4.375% 15/8/2029	1,063,068	0.05
USD 1,961,000	GFL Environmental 4.75% 15/6/2029	1,747,202	0.09
USD 1,575,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	1,509,079	0.07
USD 2,709,000	Husky III 13% 15/2/2025*	2,492,280	0.12
USD 1,694,000	Jones Deslauriers Insurance Management 10.5% 15/12/2030	1,726,578	0.08
USD 1,245,000	Masonite International 3.5% 15/2/2030	1,013,964	0.05
USD 1,343,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,117,121	0.06
USD 956,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	854,879	0.04
USD 4,829,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	4,159,007	0.21
USD 1,692,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	1,660,080	0.08
USD 5,746,000	Open Text 6.9% 1/12/2027	5,822,997	0.29
USD 1,407,000	Parkland 5.875% 15/7/2027	1,322,394	0.07
USD 403,000	Precision Drilling 6.875% 15/1/2029	366,798	0.01
USD 658,000	Tervita 11% 1/12/2025*	710,434	0.04
USD 7,488,000	Titan Acquisition / Titan Co- Borrower 7.75% 15/4/2026	6,782,518	0.33
USD 706,000	TransAlta 7.75% 15/11/2029	721,207	0.03

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,315,000	Vermilion Energy 6.875% 1/5/2030	1,164,070	0.06
USD 420,000	Videotron 3.625% 15/6/2029	352,117	0.02
		96,817,988	4.77
	ケイマン諸島		
USD 1,000,000	AGL CLO 17 11.003% 21/1/2035	922,565	0.05
USD 1,500,000	AGL CLO 5 11.258% 20/7/2034	1,398,984	0.07
USD 1,250,000	Aimco CLO 12 7.558% 17/1/2032	1,181,859	0.06
USD 1,000,000	Allegany Park CLO 7.739% 20/1/2035	931,061	0.05
USD 1,000,000	Allegany Park CLO 11.039% 20/1/2035	914,677	0.04
USD 1,500,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 10.315% 13/4/2031	1,300,200	0.06
USD 1,500,000	Bain Capital Credit CLO 2019- 2 7.942% 17/10/2032	1,461,213	0.07
USD 3,000,000	Beechwood Park CLO 11.158% 17/1/2035	2,790,883	0.14
USD 2,000,000	Canyon Capital CLO 2022- 1 7.832% 15/4/2035	1,903,935	0.09
USD 1,300,000	CIFC Funding 2013-III-R 7.716% 24/4/2031	1,229,689	0.06
USD 1,000,000	CIFC Funding 2018-II 7.658% 20/4/2031	951,093	0.05
USD 1,975,615	Global Aircraft Leasing 6.5% 15/9/2024*	1,771,910	0.09
USD 1,500,000	Goldentree Loan Management US Clo 8 7.908% 20/10/2034	1,400,241	0.07
USD 1,800,000	Golub Capital Partners CLO 50B-R 8.089% 20/4/2035	1,731,576	0.09
USD 1,912,174	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5.75% 20/1/2026	1,774,838	0.09
USD 1,000,000	Invesco CLO 7.692% 15/7/2034	952,596	0.05
USD 3,000,000	Invesco CLO 2022-1 7.689% 20/4/2035	2,861,919	0.14
USD 2,000,000	Invesco CLO 2022-1 10.939% 20/4/2035	1,835,776	0.09
USD 772,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	733,400	0.03
USD 1,000,000	Madison Park Funding XXVIII 7.492% 15/7/2030	945,717	0.05
USD 1,000,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 47 10.882% 14/4/2035	915,550	0.04
USD 1,090,000	Palmer Square CLO 2018- 2 7.63% 16/7/2031	1,037,829	0.05
USD 800,000	Sable International Finance 5.75% 7/9/2027	738,674	0.04
USD 355,069	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	356,311	0.02
USD 1,139,000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	1,144,980	0.05
USD 1,400,000	Symphony CLO XXIX 7.942% 15/1/2034	1,332,242	0.07
USD 1,000,000	TICP CLO XI 10.808% 20/10/2031	918,661	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,585,000	Transocean 7.5% 15/1/2026	1,456,480	0.07
USD 6,326,000	Transocean 8.75% 15/2/2030	6,430,189	0.32
USD 1,118,000	Transocean 11.5% 30/1/2027	1,147,359	0.06
USD 1,130,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	1,154,408	0.06
		45,626,815	2.26
	フィンランド		
USD 200,000	Ahlstrom-Munksjo 3 Oy 4.875% 4/2/2028	170,791	0.01
USD 1,044,000	Nokia 6.625% 15/5/2039	1,018,998	0.05
		1,189,789	0.06
	フランス		
EUR 3,301	Accor 0.7% 7/12/2027	160,666	0.01
EUR 200,000	Air France-KLM 8.125% 31/5/2028	214,497	0.01
USD 1,295,000	Altice France 5.125% 15/1/2029	995,460	0.05
USD 1,338,000	Altice France 5.125% 15/7/2029	1,028,882	0.05
USD 3,483,000	Altice France 5.5% 15/10/2029	2,721,681	0.13
EUR 500,000	Altice France 5.875% 1/2/2027	473,482	0.02
USD 3,332,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	3,093,429	0.15
EUR 200,000	Atos 0% 6/11/2024	188,023	0.01
EUR 100,000	Atos 1.75% 7/5/2025	96,898	0.01
EUR 100,000	Atos 2.5% 7/11/2028	82,255	0.00
EUR 200,000	BNP Paribas 7.375% 6/11/2030	214,017	0.01
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon 3.58% 7/2/2025	145,132	0.01
EUR 200,000	Casino Guichard Perrachon 3.992% 31/1/2172	45,939	0.00
EUR 100,000	Casino Guichard Perrachon 6.625% 15/1/2026	63,745	0.00
USD 5,598,000	Constellium 3.75% 15/4/2029	4,609,988	0.23
EUR 1,017,000	Constellium 4.25% 15/2/2026*	1,050,503	0.05
USD 1,639,000	Constellium 5.625% 15/6/2028	1,523,765	0.07
USD 2,476,000	Constellium 5.875% 15/2/2026	2,403,967	0.12
USD 2,075,000	Credit Agricole 4.75% 23/3/2171	1,696,105	0.08
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/12/2171	175,086	0.01
EUR 600,000	Electricite de France 3.375% 15/9/2171	491,431	0.02
EUR 200,000	Electricite de France 7.5% 9/6/2028	213,273	0.01
EUR 100,000	Elior 3.75% 15/7/2026	89,993	0.01
EUR 100,000	Eutelsat 2% 2/10/2025	97,286	0.01
EUR 300,000	Faurecia 2.75% 15/2/2027	280,968	0.02
EUR 210,000	Faurecia 7.25% 15/6/2026	229,661	0.01
EUR 272,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026*	270,900	0.01
EUR 100,000	iliad 1.875% 11/2/2028	87,624	0.00
EUR 100,000	iliad 2.375% 17/6/2026	96,016	0.01
EUR 200,000	iliad 5.375% 14/6/2027	208,029	0.01
EUR 100,000	iliad 5.625% 15/2/2030	102,898	0.01
USD 5,714,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	5,347,037	0.26
USD 4,158,000	Iliad 7% 15/10/2028	3,825,283	0.19
GBP 300,000	Korian 4.125% 15/6/2171	286,784	0.01
EUR 100,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	70,703	0.00

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 115,000	Loxam 3.75% 15/7/2026	112,763	0.01
EUR 201,000	Loxam 4.5% 15/2/2027	197,934	0.01
EUR 100,000	Loxam 5.75% 15/7/2027	94,683	0.01
EUR 100,000	Novafives 5% 15/6/2025	87,465	0.00
EUR 172,000	Paprec 3.5% 1/7/2028	156,753	0.01
EUR 168,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026	161,257	0.01
EUR 900,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	883,141	0.04
EUR 200,000	Renault 2.375% 25/5/2026	195,238	0.01
EUR 100,000	Societe Generale 7.875% 18/1/2029	108,125	0.01
EUR 150,000	Tereos Finance Groupe I 7.25% 15/4/2028	159,334	0.01
		34,838,099	1.72
	ドイツ		
EUR 400,000	Bayer 4.5% 25/3/2082	397,144	0.02
USD 1,314,000	Cheplapharm Arzneimittel 5.5% 15/1/2028	1,163,786	0.06
EUR 400,000	Commerzbank 6.125% 9/4/2171	402,400	0.02
GBP 100,000	Commerzbank 8.625% 28/2/2033	124,791	0.01
EUR 200,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024	158,396	0.01
EUR 300,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	287,663	0.01
EUR 200,000	Deutsche Bank 10% 12/1/2027	226,432	0.01
EUR 400,000	Deutsche Lufthansa 3.5% 14/7/2029	369,180	0.02
EUR 147,000	Gruenenthal 4.125% 15/5/2028	137,205	0.01
EUR 192,000	HT Troplast 9.25% 15/7/2025	198,354	0.01
EUR 152,000	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027	143,714	0.01
EUR 100,000	Nidda Healthcare 7.5% 21/8/2026	104,261	0.00
EUR 1,700,000	Novelis Sheet Ingot 3.375% 15/4/2029*	1,519,802	0.07
EUR 229,000	PCF 4.75% 15/4/2026	209,322	0.01
EUR 260,000	Renk 5.75% 15/7/2025	272,608	0.01
EUR 100,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2% 15/7/2025	98,358	0.00
EUR 175,840	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 6% 30/7/2026	180,497	0.01
EUR 366,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025*	316,335	0.02
USD 4,913,000	TK Elevator Holdco 7.625% 15/7/2028*	4,512,269	0.22
EUR 973,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	942,509	0.05
EUR 100,000	Vantage Towers 0% 31/3/2025	102,789	0.01
EUR 300,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	274,820	0.01
EUR 300,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	283,030	0.01
EUR 100,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	107,134	0.01
		12,532,799	0.62
	アイルランド		
EUR 328,000	AIB 5.25% 9/4/2171	324,211	0.02
EUR 183,000	Aqueduct European CLO 2-2017 6.688% 15/10/2030	175,544	0.01
EUR 5,880,000	Aurium CLO II 4.231% 22/6/2034	5,791,381	0.29
EUR 5,100,000	Aurium CLO II 5.181% 22/6/2034	4,905,455	0.24

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 440,000	Avoca CLO XV 6.418% 15/4/2031	393,810	0.02
EUR 300,000	Bilbao CLO I 7.072% 20/7/2031	276,560	0.01
EUR 4,410,000	Cairn CLO VI 5.549% 25/7/2029	4,574,068	0.23
EUR 2,700,000	Contego Clo V 4.088% 15/1/2031	2,730,129	0.13
EUR 1,920,000	Contego Clo V 4.938% 15/1/2031	1,879,612	0.09
USD 646,000	James Hardie International Finance 5% 15/1/2028*	606,704	0.03
USD 639,000	Jazz 4.375% 15/1/2029	566,128	0.03
USD 2,308,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	2,138,619	0.10
EUR 2,810,000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 4.504% 15/2/2031	2,831,649	0.14
EUR 6,000,000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 5.454% 15/2/2031	5,921,469	0.29
USD 717,000	Motion Bondco 6.625% 15/11/2027	661,819	0.03
EUR 200,000	Northwoods Capital 21 Euro 8.453% 22/7/2034	187,961	0.01
EUR 298,000	OCP Euro CLO 2017-2 7.288% 15/1/2032	287,808	0.01
EUR 200,000	OCP Euro CLO 2017-2 8.688% 15/1/2032	181,968	0.01
EUR 200,000	Providus Clo III 8.588% 18/7/2034	190,110	0.01
USD 2,094,000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV 5% 15/7/2028	1,821,086	0.09
		36,446,091	1.79
	イタリア		
EUR 293,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	302,121	0.01
EUR 112,000	Azzurra Aeroporti 2.625% 30/5/2027	104,234	0.00
EUR 150,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	140,010	0.00
EUR 125,000	Cedacri Mergeco 7.279% 15/5/2028	129,553	0.00
EUR 150,000	Centurion Bidco 5.875% 30/9/2026	144,053	0.01
EUR 100,000	Enel 6.375% 16/4/2028	106,504	0.00
USD 2,616,000	F-Brasile / F-Brasile US 7.375% 15/8/2026*	2,141,222	0.11
EUR 103,000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027	117,461	0.01
EUR 249,000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5.625% 1/8/2027	232,108	0.01
EUR 200,000	Gamma Bidco 5.125% 15/7/2025	212,912	0.01
EUR 271,000	Gamma Bidco 6.25% 15/7/2025	290,255	0.01
EUR 140,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	129,540	0.01
EUR 100,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	100,543	0.01
USD 1,585,000	Intesa Sanpaolo 4.198% 1/6/2032*	1,189,884	0.06
USD 1,160,000	Intesa Sanpaolo 4.95% 1/6/2042	775,022	0.04
GBP 150,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030	152,535	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 400,000	Intesa Sanpaolo 5.71% 15/1/2026	382,749	0.02
EUR 113,000	Lottomatica 9.75% 30/9/2027	129,042	0.01
EUR 200,000	Nexi 0% 24/2/2028	156,334	0.01
EUR 154,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026	141,809	0.01
EUR 146,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029	117,978	0.01
EUR 100,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	101,196	0.00
EUR 100,000	Telecom Italia 3.625% 25/5/2026	101,057	0.00
EUR 158,000	Telecom Italia 4% 11/4/2024	166,256	0.01
USD 785,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	764,943	0.04
EUR 125,000	Telecom Italia 6.875% 15/2/2028	134,686	0.01
EUR 200,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032	182,957	0.01
EUR 200,000	UniCredit 6.625% 3/12/2171	211,943	0.01
		8,858,907	0.44
	ジャマイカ		
USD 2,078,000	Digicel International Finance /Digicel international 8.75% 25/5/2024	1,813,325	0.09
	日本		
EUR 224,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	224,599	0.01
EUR 100,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025	101,819	0.00
EUR 535,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025*	544,882	0.03
USD 200,000	SoftBank 6% 19/1/2172	195,245	0.01
		1,066,545	0.05
	ジャージー		
EUR 200,000	Adient Global 3.5% 15/8/2024	208,289	0.01
USD 2,000,000	Boyce Park Clo 7.753% 21/4/2035	1,879,109	0.09
USD 1,750,000	Boyce Park Clo 10.903% 21/4/2035	1,601,382	0.08
GBP 181,000	CPUK Finance 4.5% 28/8/2027	189,749	0.01
GBP 200,000	CPUK Finance 4.875% 28/2/2047	233,467	0.01
GBP 205,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	228,319	0.01
		4,340,315	0.21
	リベリア		
USD 1,042,000	Royal Caribbean Cruises 5.375% 15/7/2027	918,523	0.05
USD 906,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	820,963	0.04
USD 786,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	685,416	0.03
USD 1,711,000	Royal Caribbean Cruises 7.25% 15/1/2030	1,713,207	0.08
USD 1,380,000	Royal Caribbean Cruises 8.25% 15/1/2029	1,429,786	0.07
USD 2,644,000	Royal Caribbean Cruises 9.25% 15/1/2029	2,806,870	0.14
USD 1,044,000	Royal Caribbean Cruises 11.5% 1/6/2025	1,108,918	0.05
USD 1,329,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	1,413,259	0.07
		10,896,942	0.53
	ルクセンブルグ		
EUR 400,000	ADLER 2.75% 13/11/2026	193,309	0.01
EUR 100,000	ADLER 3.25% 5/8/2025	50,373	0.00

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,721,000	Albion Financing 1 / Aggreko 6.125% 15/10/2026	1,533,470	0.07
EUR 150,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	129,963	0.01
USD 6,888,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	5,734,427	0.28
USD 5,722,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	4,705,914	0.23
EUR 461,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029	394,604	0.02
USD 1,780,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	1,481,227	0.07
USD 6,210,000	Altice Financing 5.75% 15/8/2029	5,114,152	0.25
USD 7,667,000	Altice France 10.5% 15/5/2027	6,300,776	0.31
EUR 2,780,000	Aramark International Finance 3.125% 1/4/2025*	2,849,993	0.14
USD 6,100,795	ARD Finance 6.5% 30/6/2027	4,995,575	0.25
EUR 100,000	Aroundtown 3.375% 23/12/2171	58,573	0.00
GBP 281,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2171	177,802	0.01
USD 2,823,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	2,591,485	0.13
GBP 190,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028*	198,258	0.01
EUR 129,000	Cirsa Finance International 4.75% 22/5/2025	134,386	0.01
EUR 24,133	Cirsa Finance International 6.25% 20/12/2023	25,630	0.00
EUR 180,675	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	172,246	0.01
EUR 88,355	Codere Finance 2 Luxembourg 12.75% 30/11/2027	47,152	0.00
EUR 184,000	Cullinan Holdco 4.625% 15/10/2026	173,965	0.01
EUR 100,000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	84,770	0.00
EUR 300,000	European TopSoho 4% 18/10/2021****	294,401	0.01
USD 5,487,000	EverArc Escrow 5% 30/10/2029*	4,380,931	0.22
EUR 387,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025	335,813	0.02
USD 3,326,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	2,730,749	0.13
EUR 158,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	114,721	0.01
USD 2,192,000	ION Trading Technologies 5.75% 15/5/2028*	1,780,989	0.09
EUR 286,000	Kleopatra Finco 4.25% 1/3/2026	257,467	0.01
EUR 49,616	Lincoln Financing 3.625% 1/4/2024	52,750	0.00
EUR 196,000	Monitchem HoldCo 3 5.25% 15/3/2025	206,016	0.01
EUR 302,000	Rossini 6.75% 30/10/2025	323,246	0.02
EUR 278,000	SES 2.875% 27/8/2171	250,880	0.01
EUR 100,000	SES 5.625% 29/1/2172	105,514	0.01
EUR 100,000	Stena International 7.25% 15/2/2028	107,405	0.00
EUR 400,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026	377,875	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

**** 当該有価証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 2,413,000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	2,004,943	0.10
USD 637,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	551,461	0.03
USD 775,000	Telecom Italia Capital 7.2% 18/7/2036*	678,239	0.03
USD 2,203,000	Telecom Italia Capital 7.721% 4/6/2038	1,989,649	0.10
EUR 183,000	Telecom Italia Finance 7.75% 24/1/2033	207,585	0.01
USD 1,000,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028*	942,250	0.05
		54,840,934	2.70
	マーシャル諸島		
USD 183,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	178,994	0.01
	モーリシャス		
USD 5,103,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	4,732,777	0.23
	オランダ		
EUR 200,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/2/2172	191,520	0.01
EUR 332,000	Axalta Coating Systems Dutch B 3.75% 15/1/2025	347,976	0.02
USD 3,698,000	Clear Channel International 6.625% 1/8/2025	3,623,689	0.18
EUR 236,000	Darling Global Finance 3.625% 15/5/2026	240,535	0.01
USD 4,723,000	Diamond BC 4.625% 1/10/2029	3,874,065	0.19
USD 3,887,000	Elastic 4.125% 15/7/2029	3,191,472	0.16
USD 200,000	ING Groep 5.75% 16/11/2026	185,191	0.01
EUR 400,000	Naturgy Finance 2.374% 23/2/2172	371,127	0.02
EUR 100,000	Promontoria 264 6.375% 1/3/2027	102,890	0.00
EUR 342,000	Repsol International Finance 4.247% 11/12/2171	326,135	0.02
EUR 200,000	Saipem Finance International 3.375% 15/7/2026*	200,272	0.01
USD 858,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	754,075	0.04
USD 723,000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	704,117	0.03
USD 973,000	Sensata Technologies 5.625% 1/11/2024	963,679	0.05
USD 1,791,000	Sensata Technologies 5.875% 1/9/2030	1,703,902	0.08
EUR 278,954	Summer BidCo 9% 15/11/2025	231,234	0.01
EUR 500,000	Telefonica Europe 6.135% 2/3/2030	511,411	0.03
EUR 100,000	Telefonica Europe 7.125% 23/8/2028	109,365	0.01
EUR 100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.625% 15/10/2028	81,292	0.00
EUR 176,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	167,305	0.01
EUR 156,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.5% 1/3/2025	164,280	0.01
EUR 300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 6% 31/1/2025	324,512	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 650,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	569,702	0.03
USD 1,089,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4.75% 9/5/2027	988,279	0.05
USD 200,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 6.75% 1/3/2028	194,058	0.01
USD 432,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7.125% 31/1/2025	437,616	0.02
EUR 100,000	Trivium Packaging Finance 3.75% 15/8/2026	97,258	0.00
USD 2,576,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	2,430,443	0.12
EUR 102,000	Trivium Packaging Finance 6.404% 15/8/2026	106,923	0.01
USD 7,258,000	Trivium Packaging Finance 8.5% 15/8/2027*	6,906,296	0.34
EUR 100,000	United 4.875% 1/7/2024	103,025	0.00
USD 2,780,000	UPC Broadband Finco 4.875% 15/7/2031	2,330,752	0.11
EUR 170,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032	141,679	0.01
EUR 100,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027	92,904	0.00
USD 1,007,000	Ziggo 4.875% 15/1/2030	854,691	0.04
USD 732,000	Ziggo Bond 5.125% 28/2/2030	585,794	0.03
USD 680,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	629,663	0.03
		34,839,127	1.72
	パナマ		
USD 2,686,000	Carnival 4% 1/8/2028	2,284,362	0.11
USD 5,737,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	4,702,562	0.23
USD 3,625,000	Carnival 6% 1/5/2029	2,808,287	0.13
USD 778,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	701,913	0.03
EUR 129,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	122,169	0.01
USD 2,057,000	Carnival 9.875% 1/8/2027	2,096,248	0.10
EUR 302,000	Carnival 10.125% 1/2/2026*	336,366	0.02
USD 3,287,000	Carnival 10.5% 1/2/2026*	3,405,200	0.17
		16,457,107	0.80
	ポーランド		
USD 983,000	Canpack / Canpack US 3.125% 1/11/2025	870,667	0.04
	ポルトガル		
EUR 3,100,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017***	478,135	0.03
EUR 4,400,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018***	678,644	0.03
EUR 100,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	96,212	0.00
EUR 200,000	EDP - Energias de Portugal 1.875% 2/8/2081	183,914	0.01
EUR 100,000	EDP - Energias de Portugal 5.943% 23/4/2083	104,988	0.01
		1,541,893	0.08
	ルーマニア		
EUR 200,000	RCS & RDS 2.5% 5/2/2025	199,956	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

*** 当該有価証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	スペイン		
EUR 400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/10/2171	410,641	0.02
EUR 400,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031	379,138	0.02
EUR 100,000	Banco de Sabadell 5.25% 7/2/2029	103,759	0.00
EUR 200,000	CaixaBank 6.75% 13/9/2171	210,525	0.01
EUR 100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	88,918	0.01
EUR 300,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	258,496	0.01
EUR 100,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030	82,859	0.00
EUR 292,000	Grupo Antolin-Irausa 3.5% 30/4/2028	230,165	0.01
EUR 400,000	International Consolidated Airlines 1.125% 18/5/2028	349,878	0.02
EUR 100,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029	86,985	0.00
EUR 338,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	325,481	0.02
		2,526,845	0.12
	スウェーデン		
EUR 100,000	Dometic 3% 8/5/2026	94,218	0.00
EUR 100,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	82,916	0.00
EUR 850,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/5/2171	581,277	0.03
EUR 200,000	Intrum 4.875% 15/8/2025	199,995	0.01
EUR 100,000	Intrum 9.25% 15/3/2028	108,029	0.01
EUR 542,000	Verisure 3.25% 15/2/2027	498,722	0.02
EUR 100,000	Verisure 9.25% 15/10/2027	112,653	0.01
		1,677,810	0.08
	スイス		
USD 1,774,000	Credit Suisse 5.25% 11/2/2172*	1,226,852	0.06
USD 1,820,000	UBS 4.375% 10/8/2171	1,435,483	0.07
		2,662,335	0.13
	英国		
USD 1,024,688	Ardonagh Midco 2 11.5% 15/1/2027*	962,552	0.05
USD 4,605,000	Barclays 4.375% 15/12/2171*	3,609,374	0.18
USD 1,400,000	Barclays 5.2% 12/5/2026	1,362,764	0.07
USD 1,345,000	Barclays 8% 15/12/2171*	1,314,334	0.06
GBP 300,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	313,497	0.02
GBP 200,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	201,551	0.01
GBP 350,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	364,368	0.02
USD 200,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	176,628	0.01
GBP 200,000	BUPA Finance 4% 24/3/2171	170,626	0.01
EUR 107,710	Codere New Topco 7.5% 30/11/2027	56,547	0.00
GBP 314,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027	275,820	0.01
EUR 190,000	EC Finance 3% 15/10/2026	184,793	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 144,000	eG Global Finance 3.625% 7/2/2024	144,027	0.01
USD 3,066,000	eG Global Finance 6.75% 7/2/2025	2,740,084	0.13
USD 1,768,000	eG Global Finance 8.5% 30/10/2025	1,568,544	0.08
USD 252,000	EnQuest 11.625% 1/11/2027*	246,257	0.01
GBP 159,000	Gatwick Airport Finance 4.375% 7/4/2026	177,544	0.01
GBP 100,000	Greene King Finance 5.512% 15/12/2034	92,788	0.00
GBP 100,000	Greene King Finance 5.792% 15/3/2036	93,865	0.00
USD 773,000	Harbour Energy 5.5% 15/10/2026	715,922	0.04
GBP 286,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	294,341	0.02
USD 965,000	HSBC 4.6% 17/6/2171*	780,041	0.04
USD 1,810,000	HSBC 7.39% 3/11/2028	1,912,831	0.09
USD 380,000	HSBC Bank 5.401% 19/12/2171	299,098	0.01
EUR 127,000	INEOS Finance 6.625% 15/5/2028	133,471	0.01
EUR 175,000	INEOS Quattro Finance 1 3.75% 15/7/2026*	161,191	0.01
GBP 120,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025	138,119	0.01
USD 1,783,000	Merlin Entertainments 5.75% 15/6/2026	1,693,713	0.08
GBP 250,000	National Express 4.25% 26/2/2172	272,126	0.01
GBP 200,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/12/2171	219,921	0.01
USD 600,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	584,136	0.03
GBP 299,000	Ocado 3.875% 8/10/2026	282,656	0.01
USD 434,000	Odeon Finco 12.75% 1/11/2027*	403,927	0.02
GBP 100,000	Pinewood Finance 3.625% 15/11/2027	108,553	0.01
GBP 190,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	207,004	0.01
GBP 354,000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	404,002	0.02
GBP 192,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025	222,390	0.01
EUR 107,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025	105,780	0.00
GBP 200,000	Thames Water Kemble Finance 4.625% 19/5/2026	216,975	0.01
GBP 142,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	172,774	0.01
GBP 123,000	Very Funding 6.5% 1/8/2026*	119,640	0.01
USD 469,000	Virgin Media Secured Finance 4.5% 15/8/2030	387,184	0.02
GBP 136,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	154,061	0.01
GBP 200,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029	210,228	0.01
GBP 200,000	Vmed 02 UK Financing I 4% 31/1/2029	199,393	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 441,000	Vmed O2 UK Financing I 4.25% 31/1/2031*	354,342	0.02
GBP 469,000	Vmed O2 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	447,715	0.02
USD 1,271,000	Vmed O2 UK Financing I 4.75% 15/7/2031	1,053,786	0.05
EUR 300,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	285,653	0.01
EUR 300,000	Vodafone 3% 27/8/2080	257,028	0.01
EUR 200,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078	194,658	0.01
GBP 189,000	Vodafone 4.875% 3/10/2078	220,261	0.01
		27,268,883	1.34
	米国		
USD 498,000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	451,640	0.02
USD 778,000	Acadia Healthcare 5.5% 1/7/2028	728,409	0.04
USD 2,614,000	ACI Worldwide 5.75% 15/8/2026*	2,525,634	0.12
USD 1,699,000	Acrisure / Acrisure Finance 6% 1/8/2029	1,387,709	0.07
USD 4,238,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	3,382,729	0.17
USD 267,000	AdaptHealth 5.125% 1/3/2030	232,937	0.01
USD 546,000	AdaptHealth 6.125% 1/8/2028	512,035	0.03
USD 66,000	ADT Security 4.125% 15/6/2023	65,654	0.00
USD 98,000	ADT Security 4.875% 15/7/2032	83,886	0.00
USD 1,989,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	1,848,393	0.09
USD 2,875,000	Advanced Drainage Systems 6.375% 15/6/2030	2,750,881	0.14
USD 5,906,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	5,662,568	0.28
USD 1,467,000	Ahead DB 6.625% 1/5/2028	1,238,419	0.06
USD 3,436,000	AHP Health Partners 5.75% 15/7/2029	2,877,378	0.14
USD 676,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.25% 15/3/2026	620,845	0.03
USD 796,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	672,914	0.03
USD 1,833,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	1,724,880	0.09
USD 1,358,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	1,219,372	0.06
USD 1,179,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	1,142,398	0.06
USD 976,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028	969,735	0.05
USD 849,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	832,899	0.04
USD 9,959,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 4.25% 15/10/2027	8,799,614	0.43
USD 8,203,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 5.875% 1/11/2029	6,866,533	0.34
USD 13,960,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 6.75% 15/10/2027	12,691,462	0.62

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 3,881,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6.75% 15/4/2028	3,797,539	0.19
USD 5,234,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029	3,908,523	0.19
USD 6,301,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	5,977,160	0.29
USD 6,215,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9.75% 15/7/2027	5,709,472	0.28
USD 292,000	Ally Financial 5.75% 20/11/2025	285,242	0.01
USD 789,000	AMC Networks 4.25% 15/2/2029	584,617	0.03
USD 292,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	274,348	0.01
USD 10,004,000	American Airlines 11.75% 15/7/2025	10,953,520	0.54
USD 1,012,460	American Airlines Aadvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	986,677	0.05
USD 6,354,933	American Airlines Aadvantage Loyalty IP 5.75% 20/4/2029	6,043,489	0.30
USD 602,000	American Builders & Contractors Supply 3.875% 15/11/2029	498,155	0.02
USD 1,792,000	American Tower 4.05% 15/3/2032	1,589,113	0.08
USD 740,000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	625,966	0.03
USD 973,000	Amsted Industries 5.625% 1/7/2027	932,874	0.05
USD 2,743,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	2,333,991	0.11
USD 2,081,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	1,565,884	0.08
USD 1,789,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.375% 15/6/2029	1,611,907	0.08
USD 1,007,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.75% 1/3/2027	952,798	0.05
USD 573,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	578,800	0.03
USD 1,271,000	Apache 4.25% 15/1/2030	1,125,867	0.05
USD 2,142,000	Apache 5.1% 1/9/2040	1,772,104	0.09
USD 918,000	Apache 5.35% 1/7/2049*	730,209	0.04
USD 1,348,000	API DE 4.125% 15/7/2029	1,160,432	0.06
USD 997,000	API DE 4.75% 15/10/2029	891,192	0.04
USD 3,014,000	APX 5.75% 15/7/2029	2,529,876	0.12
USD 1,096,000	APX 6.75% 15/2/2027	1,053,578	0.05
USD 507,000	Aramark Services 5% 1/4/2025	492,303	0.02
USD 1,876,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	1,731,510	0.09
USD 1,731,000	Aramark Services 6.375% 1/5/2025	1,723,470	0.08
USD 256,000	Arches Buyer 4.25% 1/6/2028	209,675	0.01
USD 8,115,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	7,657,436	0.38
USD 2,557,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	2,479,558	0.12
USD 1,459,000	Arconic 6% 15/5/2025	1,433,654	0.07
USD 1,757,000	Arconic 6.125% 15/2/2028	1,656,270	0.08
USD 3,649,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	3,191,240	0.16

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 568,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	455,697	0.02
USD 716,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	602,158	0.03
USD 9,106,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	7,331,377	0.36
USD 3,901,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	3,761,461	0.19
EUR 100,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	92,042	0.00
EUR 100,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	92,063	0.00
GBP 100,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	95,007	0.01
USD 1,190,000	Aretec Escrow Issuer 7.5% 1/4/2029	1,047,124	0.05
USD 1,798,000	Arko 5.125% 15/11/2029	1,413,399	0.07
USD 31,000	Asbury Automotive 4.75% 1/3/2030	26,707	0.00
USD 1,034,000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	880,794	0.04
USD 2,260,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	1,957,239	0.10
USD 7,871,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	9,615,507	0.47
USD 1,161,000	Ashland 3.375% 1/9/2031	927,042	0.05
USD 839,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	686,680	0.03
USD 1,342,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,081,339	0.05
USD 1,064,000	AthenaHealth 6.5% 15/2/2030	842,941	0.04
USD 1,010,000	ATI 4.875% 1/10/2029	905,731	0.05
USD 2,749,000	ATI 5.125% 1/10/2031	2,424,912	0.12
USD 462,000	ATI 5.875% 1/12/2027	440,515	0.02
EUR 165,000	Avantor Funding 3.875% 15/7/2028*	161,163	0.01
USD 1,941,000	Avantor Funding 3.875% 1/11/2029	1,679,654	0.08
USD 2,409,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	2,218,809	0.11
USD 1,586,000	Avient 7.125% 1/8/2030	1,590,068	0.08
USD 2,003,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	1,665,677	0.08
USD 937,000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4.75% 15/6/2027	865,275	0.04
USD 993,000	Ball 3.125% 15/9/2031	796,391	0.04
USD 1,997,000	Bank of America 6.204% 10/11/2028	2,050,371	0.10
USD 1,749,000	BCPE Empire 7.625% 1/5/2027	1,603,121	0.08
USD 1,089,000	Beacon Roofing Supply 4.125% 15/5/2029	932,767	0.05
USD 10,388,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	10,132,258	0.49
USD 2,565,000	Black Knight InfoServ 3.625% 1/9/2028	2,241,169	0.11

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,252,000	Blackstone Finance 5.9% 3/11/2027	1,269,881	0.06
USD 2,137,000	Blackstone Finance 6.2% 22/4/2033	2,183,262	0.10
USD 504,000	Blackstone Private Credit Fund 3.25% 15/3/2027	434,177	0.02
USD 516,000	Blackstone Private Credit Fund 7.05% 29/9/2025	517,800	0.03
USD 6,908,000	Block 3.5% 1/6/2031	5,589,850	0.28
USD 625,000	Block Communications 4.875% 1/3/2028	547,581	0.03
USD 2,171,000	Booz Allen Hamilton 3.875% 1/9/2028	1,927,219	0.10
USD 1,912,000	Booz Allen Hamilton 4% 1/7/2029	1,675,443	0.08
EUR 2,843,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	3,022,601	0.15
USD 2,437,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	2,414,964	0.12
USD 5,949,000	Boxer Parent 9.125% 1/3/2026	5,781,816	0.28
USD 1,786,000	Boyd Gaming 4.75% 1/12/2027	1,676,090	0.08
USD 1,857,000	Boyd Gaming 4.75% 15/6/2031	1,635,311	0.08
USD 2,196,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	1,955,970	0.10
USD 604,000	Brink ' s 5.5% 15/7/2025	588,102	0.03
USD 567,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	446,709	0.02
USD 1,530,000	Broadcom 3.137% 15/11/2035	1,121,071	0.06
USD 779,000	Broadcom 3.187% 15/11/2036	559,281	0.03
USD 2,792,000	Broadcom 3.419% 15/4/2033	2,245,926	0.11
USD 62,000	Broadcom 3.469% 15/4/2034	48,860	0.00
USD 579,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	520,106	0.03
USD 2,426,000	Broadcom 4.3% 15/11/2032	2,141,046	0.10
USD 1,606,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGS1 Sellco 4.5% 1/4/2027	1,370,938	0.07
USD 1,334,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	1,251,941	0.06
USD 663,000	Buckeye Partners 5.6% 15/10/2044	494,416	0.02
USD 867,000	Buckeye Partners 5.85% 15/11/2043	646,687	0.03
USD 569,000	Cable One 0% 15/3/2026	450,925	0.02
USD 2,259,000	Cable One 1.125% 15/3/2028	1,681,881	0.08
USD 2,637,000	Cable One 4% 15/11/2030	2,061,842	0.10
USD 800,000	Cablevision Lightpath 3.875% 15/9/2027	652,688	0.03
USD 1,109,000	Cablevision Lightpath 5.625% 15/9/2028	827,569	0.04
USD 4,696,000	Caesars Entertainment 4.625% 15/10/2029	4,020,668	0.20
USD 6,213,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	6,171,363	0.30
USD 7,660,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	7,733,727	0.38
USD 7,268,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027*	7,329,947	0.36
USD 1,829,000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5.75% 1/7/2025	1,827,903	0.09
USD 976,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	928,767	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 5,305,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	4,874,181	0.24
USD 6,385,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	6,231,281	0.31
USD 236,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	199,488	0.01
USD 495,000	Calpine 5% 1/2/2031	408,922	0.02
USD 2,198,000	Calpine 5.125% 15/3/2028	1,953,206	0.10
USD 1,565,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	1,488,479	0.07
USD 778,000	Cano Health 6.25% 1/10/2028	472,433	0.02
USD 108,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	88,527	0.00
USD 10,286,000	Carnival Bermuda 10.375% 1/5/2028	10,999,639	0.54
USD 632,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028*	606,194	0.03
USD 1,247,000	Carpenter Technology 7.625% 15/3/2030	1,245,058	0.06
USD 1,384,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	1,198,433	0.06
USD 2,065,000	Catalent Pharma Solutions 3.5% 1/4/2030	1,788,696	0.09
USD 702,000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	676,219	0.03
USD 1,567,000	CCM Merger 6.375% 1/5/2026	1,503,344	0.07
USD 4,443,000	CCO / CCO Capital 4.25% 1/2/2031	3,581,547	0.18
USD 6,158,000	CCO / CCO Capital 4.25% 15/1/2034	4,608,542	0.23
USD 1,064,000	CCO / CCO Capital 4.5% 15/8/2030	876,671	0.04
USD 839,000	CCO / CCO Capital 4.5% 1/5/2032	665,936	0.03
USD 769,000	CCO / CCO Capital 4.5% 1/6/2033	596,966	0.03
USD 2,262,000	CCO / CCO Capital 4.75% 1/3/2030	1,908,359	0.09
USD 4,993,000	CCO / CCO Capital 4.75% 1/2/2032	4,055,065	0.20
USD 1,227,000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	1,110,067	0.05
USD 1,214,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	1,125,499	0.05
USD 912,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	813,953	0.04
USD 4,466,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	4,172,919	0.21
USD 1,922,000	CCO / CCO Capital 7.375% 1/3/2031	1,870,223	0.09
USD 2,081,000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/7/2025	1,820,875	0.09
USD 3,767,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	3,493,535	0.17
USD 1,860,000	CDW / CDW Finance 3.25% 15/2/2029	1,566,050	0.08
USD 911,000	CDW / CDW Finance 3.276% 1/12/2028	785,791	0.04
USD 538,000	Cedar Fair 5.25% 15/7/2029	492,157	0.02
USD 2,392,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	2,365,023	0.12

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 476,000	Cedar Fair / Canada 's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6.5% 1/10/2028	462,291	0.02
USD 1,600,000	Celanese US 6.165% 15/7/2027	1,586,713	0.08
USD 3,410,000	Centene 2.45% 15/7/2028	2,860,717	0.14
USD 7,221,000	Centene 2.5% 1/3/2031	5,621,899	0.28
USD 1,520,000	Centene 2.625% 1/8/2031	1,187,287	0.06
USD 6,784,000	Centene 3% 15/10/2030	5,531,436	0.27
USD 670,000	Centennial Resource Production 5.375% 15/1/2026	632,411	0.03
USD 1,325,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	1,278,387	0.06
USD 2,129,000	Central Garden & Pet 4.125% 15/10/2030	1,785,401	0.09
USD 1,592,000	Central Garden & Pet 4.125% 30/4/2031	1,305,980	0.06
USD 3,716,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	3,631,401	0.18
USD 730,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	659,270	0.03
USD 3,901,000	Chart Industries 7.5% 1/1/2030	3,956,112	0.19
USD 600,000	Chart Industries 9.5% 1/1/2031	624,906	0.03
USD 1,003,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.4% 1/4/2033	852,751	0.04
USD 1,613,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5.25% 1/4/2053	1,250,640	0.06
USD 3,408,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5.5% 1/4/2063	2,630,624	0.13
USD 917,000	Chemours 5.75% 15/11/2028	808,028	0.04
USD 5,736,000	Cheniere Energy Partners 3.25% 31/1/2032	4,591,869	0.23
USD 4,817,000	Cheniere Energy Partners 4% 1/3/2031	4,150,036	0.20
USD 4,167,000	Cheniere Energy Partners 4.5% 1/10/2029	3,764,299	0.18
USD 4,275,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	4,141,427	0.20
USD 4,871,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	4,254,330	0.21
USD 8,622,000	Chobani / Chobani Finance 7.5% 15/4/2025	8,412,399	0.41
USD 1,366,000	CHS/Community Health Systems 4.75% 15/2/2031	1,060,170	0.06
USD 3,378,000	CHS/Community Health Systems 5.25% 15/5/2030	2,712,196	0.13
USD 910,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	800,800	0.04
USD 6,031,000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	5,233,740	0.26
USD 1,385,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	1,261,921	0.06
USD 1,052,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	1,000,415	0.05

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 444,000	Ciena 4% 31/1/2030	378,388	0.02
USD 2,657,000	CITGO Petroleum 6.375% 15/6/2026	2,568,508	0.13
USD 2,022,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	1,993,894	0.10
USD 879,000	Civitas Resources 5% 15/10/2026	813,325	0.04
USD 5,739,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	4,954,433	0.24
USD 5,686,000	Clarivate Science 4.875% 1/7/2029	4,890,300	0.24
USD 467,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	440,612	0.02
USD 1,950,000	Clean Harbors 5.125% 15/7/2029	1,829,880	0.09
USD 708,000	Clean Harbors 6.375% 1/2/2031	703,637	0.03
USD 7,264,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	6,456,348	0.32
USD 5,441,000	Clear Channel Outdoor 7.5% 1/6/2029*	4,398,722	0.22
USD 7,237,000	Clear Channel Outdoor 7.75% 15/4/2028*	6,045,428	0.30
USD 1,417,000	Clearway Energy Operating 3.75% 15/1/2032	1,127,635	0.05
USD 1,066,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	979,055	0.05
USD 18,488,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	16,086,457	0.79
USD 4,580,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	4,375,610	0.22
USD 3,062,000	Clydesdale Acquisition 8.75% 15/4/2030	2,732,790	0.13
USD 4,095,000	CMG Media 8.875% 15/12/2027	2,746,219	0.13
USD 1,765,000	CNX Midstream Partners 4.75% 15/4/2030	1,449,286	0.07
USD 501,000	CNX Resources 6% 15/1/2029	457,443	0.02
USD 1,383,000	CNX Resources 7.375% 15/1/2031	1,320,765	0.06
USD 3,598,000	Colgate Energy Partners III 5.875% 1/7/2029	3,230,356	0.16
USD 3,052,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	3,024,791	0.15
USD 427,000	Commercial Metals 4.125% 15/1/2030	372,663	0.02
USD 504,000	Commercial Metals 4.375% 15/3/2032	435,433	0.02
USD 3,413,000	CommScope 4.75% 1/9/2029	2,802,450	0.14
USD 2,446,000	CommScope 6% 1/3/2026	2,359,925	0.12
USD 1,250,000	CommScope 7.125% 1/7/2028	971,632	0.05
USD 841,000	CommScope 8.25% 1/3/2027*	715,771	0.03
USD 3,965,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	3,810,306	0.19
USD 1,594,000	Compass Diversified 5.25% 15/4/2029	1,394,134	0.07
USD 6,975,000	Condor Merger Sub 7.375% 15/2/2030	5,547,721	0.27
USD 10,348,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	9,638,127	0.47
USD 717,000	Consensus Cloud Solutions 6% 15/10/2026	667,066	0.03

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 644,000	Consensus Cloud Solutions 6.5% 15/10/2028	561,275	0.03
USD 3,280,000	Consolidated Communications 6.5% 1/10/2028	2,566,600	0.13
USD 5,632,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	4,279,757	0.21
EUR 279,000	Coty 3.875% 15/4/2026	281,889	0.01
USD 127,000	Coty /HFC Prestige Products /HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	114,559	0.01
USD 1,490,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	1,260,301	0.06
USD 497,000	Covanta 5% 1/9/2030	416,262	0.02
USD 8,365,000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5.5% 15/6/2031	7,333,527	0.36
USD 6,572,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	6,137,394	0.30
USD 1,146,000	Crescent Energy Finance 9.25% 15/2/2028	1,113,815	0.05
USD 469,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 5.625% 1/5/2027	434,355	0.02
USD 2,227,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	2,034,732	0.10
USD 627,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 7.375% 1/2/2031	605,849	0.03
USD 516,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 8% 1/4/2029	516,170	0.02
USD 1,398,000	Crocs 4.125% 15/8/2031	1,140,775	0.06
USD 608,000	Crocs 4.25% 15/3/2029	521,959	0.03
USD 260,000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	218,426	0.01
USD 130,000	Crown Americas 5.25% 1/4/2030	120,827	0.01
USD 474,000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4.25% 30/9/2026	441,092	0.02
USD 340,000	Crown Cork & Seal 7.375% 15/12/2026	349,680	0.02
USD 374,000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	336,012	0.02
USD 6,670,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	6,442,501	0.32
USD 1,706,000	CSC 3.375% 15/2/2031	1,167,714	0.06
USD 6,237,000	CSC 4.125% 1/12/2030	4,461,835	0.22
USD 3,408,000	CSC 4.5% 15/11/2031	2,425,442	0.12
USD 1,403,000	CSC 5.25% 1/6/2024	1,366,031	0.06
USD 1,300,000	CSC 5.5% 15/4/2027	1,133,892	0.06
USD 662,000	CSC 6.5% 1/2/2029	563,478	0.03
USD 2,281,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	2,138,927	0.11
USD 2,786,000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030	2,692,427	0.13
USD 1,158,000	DCP Midstream Operating 6.45% 3/11/2036	1,171,421	0.06
USD 1,986,000	DCP Midstream Operating 6.75% 15/9/2037	2,074,933	0.10
USD 1,133,000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028*	1,028,413	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,045,226	Delta Air Lines / SkyMiles IP 4.75% 20/10/2028	988,346	0.05
USD 2,897,000	Diamondback Energy 4.25% 15/3/2052	2,158,054	0.11
USD 2,248,000	Diamondback Energy 6.25% 15/3/2033	2,282,151	0.12
USD 4,349,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	3,898,797	0.19
USD 545,000	Discover Financial Services 6.7% 29/11/2032	560,920	0.03
USD 261,000	Drawbridge Special Opportunities Fund / Drawbridge Special Opportunities Fin 3.875% 15/2/2026	237,644	0.01
USD 3,219,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	2,763,962	0.14
USD 2,561,000	DT Midstream 4.375% 15/6/2031	2,147,539	0.11
USD 2,621,000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	2,173,344	0.11
USD 1,019,000	Dycom Industries 4.5% 15/4/2029	885,842	0.04
USD 630,000	Edison International 6.95% 15/11/2029	660,390	0.03
USD 948,000	El Paso Natural Gas 3.5% 15/2/2032	789,507	0.04
USD 12,476,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	10,775,147	0.53
USD 675,000	Embecka 6.75% 15/2/2030	609,439	0.03
USD 3,523,000	Enact 6.5% 15/8/2025	3,456,363	0.17
USD 281,000	Encompass Health 4.5% 1/2/2028	257,507	0.01
USD 1,557,000	Encompass Health 4.625% 1/4/2031	1,325,315	0.07
USD 2,741,000	Encompass Health 4.75% 1/2/2030	2,431,247	0.12
GBP 317,000	Encore Capital 4.25% 1/6/2028	307,331	0.02
GBP 100,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026	110,022	0.01
USD 830,000	Energy Transfer 3.75% 15/5/2030	735,005	0.04
USD 2,502,000	Energy Transfer 5% 15/5/2050	2,036,835	0.10
USD 776,000	Energy Transfer 5.3% 15/4/2047	653,869	0.03
USD 454,000	Energy Transfer 5.55% 15/2/2028	452,325	0.02
USD 1,170,000	Energy Transfer 5.75% 15/2/2033	1,149,864	0.06
USD 1,902,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	1,775,260	0.09
USD 2,751,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	2,623,092	0.13
USD 1,168,000	EnLink Midstream 6.5% 1/9/2030	1,153,558	0.06
USD 788,000	EnLink Midstream Partners 4.15% 1/6/2025	758,080	0.04
USD 601,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	570,400	0.03
USD 539,000	EnLink Midstream Partners 5.45% 1/6/2047	423,821	0.02
USD 1,579,000	EnLink Midstream Partners 5.6% 1/4/2044	1,290,169	0.06

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 2,824,000	EnPro Industries 5.75% 15/10/2026	2,697,937	0.13
USD 1,185,000	Entegris 3.625% 1/5/2029	973,804	0.05
USD 948,000	Entegris 4.375% 15/4/2028	838,425	0.04
USD 12,483,000	Entegris Escrow 4.75% 15/4/2029	11,328,265	0.56
USD 977,000	Entegris Escrow 5.95% 15/6/2030	910,113	0.05
USD 955,000	EQM Midstream Partners 4.125% 1/12/2026	848,983	0.04
USD 150,000	EQM Midstream Partners 4.5% 15/1/2029	125,318	0.01
USD 2,156,000	EQM Midstream Partners 4.75% 15/1/2031	1,750,596	0.09
USD 1,033,000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	998,021	0.05
USD 2,728,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	2,575,413	0.13
USD 677,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	646,533	0.03
USD 1,663,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	1,501,399	0.07
USD 1,133,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	972,567	0.05
USD 512,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6.75% 15/1/2030	424,350	0.02
USD 6,125,000	First-Citizens Bank & Trust 6% 1/4/2036	5,792,926	0.29
USD 3,547,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032	2,690,399	0.13
USD 1,352,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	1,268,800	0.06
USD 273,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	238,609	0.01
USD 1,143,000	Ford Motor Credit 2.9% 16/2/2028	953,039	0.05
USD 409,000	Ford Motor Credit 2.9% 10/2/2029	329,755	0.02
USD 809,000	Ford Motor Credit 3.375% 13/11/2025	745,720	0.04
USD 1,990,000	Ford Motor Credit 3.625% 17/6/2031	1,580,532	0.08
USD 502,000	Ford Motor Credit 3.664% 8/9/2024	482,018	0.02
USD 589,000	Ford Motor Credit 3.81% 9/1/2024	576,407	0.03
USD 400,000	Ford Motor Credit 3.815% 2/11/2027	350,469	0.02
USD 357,000	Ford Motor Credit 4% 13/11/2030	297,052	0.02
USD 1,090,000	Ford Motor Credit 4.125% 17/8/2027	973,832	0.05
USD 747,000	Ford Motor Credit 4.134% 4/8/2025	704,500	0.03
USD 1,606,000	Ford Motor Credit 4.271% 9/1/2027	1,456,160	0.07
USD 548,000	Ford Motor Credit 4.389% 8/1/2026	513,865	0.03
GBP 263,000	Ford Motor Credit 4.535% 6/3/2025	307,316	0.02

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 698,000	Ford Motor Credit 4.687% 9/6/2025	668,654	0.03
EUR 300,000	Ford Motor Credit 4.867% 3/8/2027	311,616	0.02
USD 1,549,000	Ford Motor Credit 4.95% 28/5/2027	1,446,278	0.07
USD 799,000	Ford Motor Credit 5.113% 3/5/2029	729,653	0.04
USD 1,171,000	Ford Motor Credit 5.125% 16/6/2025	1,133,699	0.06
USD 2,357,000	Ford Motor Credit 7.35% 6/3/2030	2,392,970	0.12
USD 813,000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	644,286	0.03
USD 3,519,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	3,117,870	0.15
USD 730,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	680,723	0.03
USD 164,000	Frontier Communications 6% 15/1/2030	131,040	0.01
USD 8,327,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	8,438,582	0.42
USD 1,530,000	Garden Spinco 8.625% 20/7/2030	1,617,982	0.08
USD 630,000	Gartner 3.625% 15/6/2029	546,021	0.03
USD 425,000	Gartner 4.5% 1/7/2028	389,791	0.02
USD 2,621,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	2,563,495	0.13
USD 1,707,000	GCI 4.75% 15/10/2028	1,465,331	0.07
USD 692,000	General Motors 5.2% 1/4/2045	572,679	0.03
USD 1,231,000	General Motors 5.4% 1/4/2048	1,021,797	0.05
USD 639,000	General Motors 5.6% 15/10/2032	605,595	0.03
USD 762,000	General Motors 5.95% 1/4/2049	678,674	0.03
USD 838,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 6.5% 1/10/2025	803,989	0.04
USD 605,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7.75% 1/2/2028	577,821	0.03
USD 1,001,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.875% 15/4/2030	1,005,305	0.05
USD 730,000	Global Payments 2.9% 15/5/2030	600,169	0.03
USD 726,000	Global Payments 3.2% 15/8/2029	616,791	0.03
USD 2,755,000	Global Payments 5.4% 15/8/2032	2,625,272	0.13
USD 2,084,000	Global Payments 5.95% 15/8/2052	1,915,379	0.10
USD 2,989,000	GLP Capital / GLP Financing II 3.25% 15/1/2032	2,370,020	0.12
USD 880,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	738,526	0.04
USD 641,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	609,354	0.03
USD 1,226,000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029*	1,061,593	0.05
USD 327,000	Goodyear Tire & Rubber 5.625% 30/4/2033	278,062	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,313,000	Goodyear Tire & Rubber 9.5% 31/5/2025	1,354,367	0.07
USD 1,227,000	GrafTech Finance 4.625% 15/12/2028	1,001,195	0.05
USD 459,000	Graham 5.75% 1/6/2026	448,804	0.02
EUR 596,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029	552,789	0.03
USD 417,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	366,247	0.02
USD 620,000	Graphic Packaging International 4.75% 15/7/2027	583,388	0.03
USD 2,725,000	GTCR AP Finance 8% 15/5/2027	2,618,300	0.13
USD 311,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	304,780	0.01
USD 1,848,000	GYP III 4.625% 1/5/2029	1,590,716	0.08
USD 285,000	H&E Equipment Services 3.875% 15/12/2028	245,400	0.01
USD 1,817,000	Hanesbrands 9% 15/2/2031	1,837,355	0.09
USD 769,000	Harvest Midstream I 7.5% 1/9/2028	745,422	0.04
USD 1,809,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	1,562,117	0.08
USD 1,005,000	HB Fuller 4.25% 15/10/2028	877,115	0.04
USD 2,630,000	HCA 4.625% 15/3/2052	2,045,698	0.10
USD 4,164,000	HealthEquity 4.5% 1/10/2029	3,630,740	0.18
USD 1,065,000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4.625% 1/5/2028	863,037	0.04
USD 1,997,000	Herc 5.5% 15/7/2027	1,886,965	0.09
USD 647,000	Hertz 4.625% 1/12/2026	579,648	0.03
USD 1,159,000	Hertz 5% 1/12/2029	957,421	0.05
USD 1,427,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	1,292,665	0.06
USD 123,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 15/4/2030	111,754	0.00
USD 118,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 1/2/2031	106,643	0.00
USD 827,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	769,185	0.04
USD 155,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 15/4/2032	140,753	0.01
USD 119,000	Hilton Domestic Operating 3.625% 15/2/2032	97,475	0.00
USD 631,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	547,434	0.03
USD 97,000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	82,076	0.00
USD 1,627,000	Hilton Domestic Operating 4.875% 15/1/2030	1,487,342	0.07
USD 777,000	Hilton Domestic Operating 5.375% 1/5/2025	768,765	0.04
USD 974,000	Hilton Domestic Operating 5.75% 1/5/2028	946,229	0.05
USD 1,678,000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	1,175,171	0.06
USD 1,475,000	Howard Hughes 4.125% 1/2/2029	1,231,027	0.06
USD 327,000	Howard Hughes 4.375% 1/2/2031	265,776	0.01
USD 409,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	368,512	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 48,000	Howmet Aerospace 5.125% 1/10/2024	47,688	0.00
USD 454,000	HUB International 5.625% 1/12/2029	390,729	0.02
USD 6,948,000	HUB International 7% 1/5/2026	6,833,257	0.34
USD 1,490,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	1,287,844	0.06
USD 975,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.75% 15/9/2024	948,246	0.05
USD 3,670,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	3,425,431	0.17
USD 1,078,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	1,048,605	0.05
USD 2,828,000	II-VI 5% 15/12/2029	2,475,660	0.12
USD 4,827,000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028	4,325,487	0.21
USD 2,905,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	2,457,217	0.12
USD 664,000	Ingevity 3.875% 1/11/2028	569,112	0.03
USD 820,000	Installed Building Products 5.75% 1/2/2028	763,871	0.04
EUR 336,000	IQVIA 1.75% 15/3/2026	326,701	0.02
EUR 100,000	IQVIA 2.25% 15/3/2029	88,624	0.00
USD 1,965,000	IQVIA 5% 15/10/2026	1,883,551	0.09
USD 519,000	IQVIA 5% 15/5/2027	493,520	0.02
USD 1,466,000	IRB 7% 15/6/2025*	1,463,778	0.07
USD 208,000	Iron Mountain 5% 15/7/2028	188,573	0.01
USD 433,000	Iron Mountain 5.25% 15/7/2030	377,254	0.02
USD 290,000	Iron Mountain 5.625% 15/7/2032	249,203	0.01
USD 1,078,000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	890,320	0.04
USD 3,408,000	ITT 6.5% 1/8/2029	2,799,622	0.14
USD 2,269,000	Jefferies Finance / JFIN Co- Issuer 5% 15/8/2028	1,927,141	0.09
USD 1,152,000	JELD-WEN 6.25% 15/5/2025	1,122,602	0.06
USD 1,408,000	JPMorgan Chase 5.717% 14/9/2033	1,389,391	0.07
USD 1,821,000	K Hovnanian Enterprises 7.75% 15/2/2026	1,774,801	0.09
USD 3,097,000	Kaiser Aluminum 4.5% 1/6/2031	2,404,658	0.12
USD 1,047,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	900,038	0.04
USD 533,000	KB Home 7.25% 15/7/2030	522,759	0.03
USD 943,000	Ken Garff Automotive 4.875% 15/9/2028	812,774	0.04
USD 639,000	Kinder Morgan 4.8% 1/2/2033	589,184	0.03
USD 1,820,000	Kinder Morgan 5.45% 1/8/2052	1,615,025	0.08
USD 3,381,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	3,110,403	0.15
USD 2,429,000	Kobe US Midco 2 9.25% 1/11/2026	1,821,750	0.09
USD 983,000	Kontoor Brands 4.125% 15/11/2029	834,144	0.04
USD 2,177,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	2,017,077	0.10

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 110,000	Kronos International 3.75% 15/9/2025	106,112	0.01
USD 1,571,000	LABL 5.875% 1/11/2028	1,365,430	0.07
USD 920,000	Ladder Capital Finance / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	783,201	0.04
USD 591,000	Ladder Capital Finance / Ladder Capital Finance 4.75% 15/6/2029	479,546	0.02
USD 421,000	Lamb Weston 4.125% 31/1/2030	372,172	0.02
USD 2,518,000	Lamb Weston 4.375% 31/1/2032	2,212,416	0.11
USD 2,048,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	1,932,271	0.10
USD 2,701,000	LCM Investments II 4.875% 1/5/2029	2,224,706	0.11
USD 1,183,000	Legacy LifePoint Health 4.375% 15/2/2027	995,944	0.05
USD 2,047,000	Legacy LifePoint Health 6.75% 15/4/2025	1,947,489	0.10
USD 789,000	Legends Hospitality / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	719,781	0.04
USD 2,798,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027*	2,358,106	0.11
USD 1,228,000	Level 3 Financing 3.625% 15/1/2029	793,577	0.04
USD 578,000	Level 3 Financing 3.75% 15/7/2029	370,723	0.02
USD 2,289,000	Level 3 Financing 3.875% 15/11/2029	1,753,706	0.09
USD 1,344,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	926,831	0.05
USD 1,093,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	816,061	0.04
USD 1,330,000	Levi Strauss 3.5% 1/3/2031*	1,088,685	0.05
USD 4,133,000	Liberty Broadband 1.25% 30/9/2050	4,149,532	0.21
USD 7,305,000	Liberty Broadband 2.75% 30/9/2050	7,304,023	0.36
EUR 193,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	192,177	0.01
USD 2,219,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	2,111,648	0.10
USD 2,070,000	Life Time 8% 15/4/2026	1,978,316	0.10
USD 1,984,446	Ligado Networks 15.5% 1/11/2023	530,839	0.03
USD 2,521,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	2,384,715	0.12
USD 5,513,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	3,874,898	0.19
USD 1,152,000	Lithia Motors 3.875% 1/6/2029	963,700	0.05
USD 915,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	799,847	0.04
USD 1,470,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	1,318,920	0.06
USD 297,000	Live Nation Entertainment 4.875% 1/11/2024	288,399	0.01
USD 7,599,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	7,469,529	0.37
USD 1,265,000	LSF11 A5 HoldCo 6.625% 15/10/2029	1,074,662	0.05
USD 4,889,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	3,749,252	0.18
USD 2,392,000	Lumen Technologies 4.5% 15/1/2029	1,255,553	0.06

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 256,000	Lumen Technologies 5.375% 15/6/2029	139,215	0.01
USD 2,487,000	Madison IAQ 5.875% 30/6/2029	1,984,711	0.10
USD 10,651,000	Magallanes 5.141% 15/3/2052	8,295,315	0.41
USD 5,840,000	Magallanes 5.391% 15/3/2062	4,514,442	0.22
USD 248,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	237,731	0.01
USD 1,876,000	MajorDrive IV 6.375% 1/6/2029	1,449,735	0.07
USD 870,000	Marvell Technology 2.95% 15/4/2031	697,433	0.03
USD 1,430,000	MasTec 4.5% 15/8/2028	1,295,143	0.06
USD 2,589,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	2,499,247	0.12
USD 1,022,000	Match II 3.625% 1/10/2031	800,635	0.04
USD 550,000	Match II 4.125% 1/8/2030	457,948	0.02
USD 1,037,000	Match II 4.625% 1/6/2028	922,377	0.04
USD 39,000	Match II 5.625% 15/2/2029	35,897	0.00
USD 628,000	Mattel 3.75% 1/4/2029	543,851	0.03
USD 2,467,000	Mattel 5.45% 1/11/2041	2,067,843	0.10
USD 2,407,000	Mattel 6.2% 1/10/2040	2,135,615	0.11
USD 17,758,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	17,863,305	0.88
USD 725,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	600,633	0.03
USD 7,206,000	Medline Borrower 5.25% 1/10/2029*	5,963,289	0.30
USD 1,547,000	Metis Merger Sub 6.5% 15/5/2029	1,254,934	0.06
USD 1,225,000	MGIC Investment 5.25% 15/8/2028	1,142,172	0.06
USD 1,323,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	1,298,931	0.06
USD 1,249,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	1,250,124	0.06
USD 4,420,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028*	3,673,860	0.18
USD 1,104,000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance 5.375% 15/8/2027	1,013,817	0.05
USD 2,183,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,864,442	0.09
USD 5,918,850	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6.5% 20/6/2027	5,909,972	0.29
USD 2,802,000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	2,524,378	0.12
USD 10,463,000	Minerva Merger Sub 6.5% 15/2/2030	8,289,180	0.41
USD 404,000	Molina Healthcare 3.875% 15/11/2030	341,727	0.02
USD 534,000	Molina Healthcare 3.875% 15/5/2032	436,134	0.02
USD 983,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	884,356	0.04
USD 3,726,000	MPLX 4.95% 14/3/2052	3,071,563	0.15
USD 450,000	MPLX 5% 1/3/2033	420,824	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
EUR 106,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 0.993% 15/10/2026	83,217	0.00
GBP 100,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2.55% 5/12/2023	115,140	0.01
EUR 100,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3.325% 24/3/2025	92,568	0.00
USD 7,373,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3.5% 15/3/2031	5,002,728	0.25
USD 3,597,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	2,702,318	0.13
USD 298,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	265,293	0.01
USD 397,000	MSCI 3.25% 15/8/2033	312,004	0.02
USD 1,247,000	MSCI 3.875% 15/2/2031	1,079,715	0.05
USD 653,000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	571,794	0.03
USD 704,000	Murphy Oil 5.875% 1/12/2027	674,252	0.03
USD 196,000	Murphy Oil 6.125% 1/12/2042	155,360	0.01
USD 2,908,000	Nabors Industries 5.75% 1/2/2025	2,765,654	0.14
USD 4,024,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	3,913,340	0.19
USD 367,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	283,009	0.01
USD 906,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031	709,919	0.03
USD 88,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	81,051	0.00
USD 518,000	Navient 5.5% 15/3/2029	438,503	0.02
USD 386,000	Navient 5.875% 25/10/2024	377,703	0.02
USD 381,000	Navient 6.125% 25/3/2024	377,527	0.02
USD 264,000	Navient 7.25% 25/9/2023	264,914	0.01
USD 1,354,000	NCR 5% 1/10/2028	1,176,078	0.06
USD 104,000	NCR 5.125% 15/4/2029	88,293	0.00
USD 54,000	NCR 5.75% 1/9/2027	52,432	0.00
USD 408,000	NCR 6.125% 1/9/2029	395,344	0.02
USD 1,923,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	1,819,542	0.09
USD 2,151,000	NESCO II 5.5% 15/4/2029	1,927,361	0.10
EUR 200,000	Netflix 3.625% 15/6/2030	196,914	0.01
USD 1,019,000	New Enterprise Stone & Lime 5.25% 15/7/2028	932,216	0.05
USD 1,108,000	New Enterprise Stone & Lime 9.75% 15/7/2028	1,061,180	0.05
USD 9,792,000	New Fortress Energy 6.5% 30/9/2026	8,897,648	0.44
USD 6,856,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	6,374,477	0.32
USD 1,604,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	1,553,698	0.08
USD 65,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/9/2024	60,915	0.00
USD 3,745,000	NFP 4.875% 15/8/2028	3,280,097	0.16
USD 11,795,000	NFP 6.875% 15/8/2028	10,059,366	0.50
USD 789,000	NFP 7.5% 1/10/2030	752,391	0.04
USD 3,228,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7.5% 1/2/2026	3,078,880	0.15

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,233,000	NGPL PipeCo 7.768% 15/12/2037	1,327,021	0.06
USD 546,000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	559,336	0.03
USD 3,151,000	NMG / Neiman Marcus 7.125% 1/4/2026	3,029,459	0.15
USD 1,555,000	Northern Trust 6.125% 2/11/2032	1,634,980	0.08
USD 2,142,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	1,870,034	0.09
USD 3,423,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 6% 15/2/2028*	2,710,640	0.13
USD 769,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 10.75% 1/6/2028	712,930	0.03
USD 5,216,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	4,590,456	0.23
USD 3,114,000	Novelis 3.875% 15/8/2031	2,511,986	0.12
USD 4,889,000	Novelis 4.75% 30/1/2030	4,283,155	0.21
USD 274,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	242,969	0.01
USD 501,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	471,183	0.02
USD 2,307,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	2,223,349	0.11
USD 811,000	NuStar Logistics 6% 1/6/2026	775,774	0.04
USD 228,000	NuStar Logistics 6.375% 1/10/2030	212,737	0.01
USD 926,000	Occidental Petroleum 5.875% 1/9/2025	924,718	0.04
USD 4,600,000	Occidental Petroleum 6.2% 15/3/2040	4,496,005	0.22
USD 1,466,000	Occidental Petroleum 6.45% 15/9/2036	1,467,976	0.07
USD 554,000	Occidental Petroleum 6.6% 15/3/2046	563,072	0.03
USD 4,706,000	Occidental Petroleum 6.625% 1/9/2030	4,850,686	0.24
USD 286,000	Occidental Petroleum 6.95% 1/7/2024	288,514	0.01
USD 729,000	Occidental Petroleum 7.5% 1/5/2031	781,247	0.04
USD 927,000	Occidental Petroleum 8.875% 15/7/2030	1,051,828	0.05
USD 797,000	OneMain Finance 3.5% 15/1/2027	672,497	0.03
USD 819,000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	621,827	0.03
USD 435,000	OneMain Finance 5.375% 15/11/2029	367,001	0.02
USD 1,130,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	1,053,262	0.05
USD 1,859,000	OneMain Finance 6.875% 15/3/2025	1,819,621	0.09
USD 1,515,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	1,474,868	0.07
USD 392,000	ONEOK 4.35% 15/3/2029	363,370	0.02
USD 775,000	ONEOK 4.95% 13/7/2047	631,969	0.03
USD 1,417,000	Option Care Health 4.375% 31/10/2029	1,210,168	0.06
USD 1,792,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	1,480,444	0.07

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 3,222,000	Oracle 3.6% 1/4/2050	2,164,014	0.10
USD 4,147,000	Oracle 3.95% 25/3/2051	2,948,254	0.15
USD 1,872,000	Oracle 6.25% 9/11/2032	1,939,580	0.10
USD 3,448,000	Oracle 6.9% 9/11/2052	3,684,913	0.18
USD 2,319,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	2,043,257	0.10
USD 2,138,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5.125% 30/4/2031	1,831,699	0.09
USD 1,144,000	OT Merger 7.875% 15/10/2029*	688,059	0.03
USD 1,465,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	1,206,281	0.06
USD 520,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	426,283	0.02
USD 2,202,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	1,976,970	0.10
USD 625,000	Ovintiv 6.625% 15/8/2037	618,981	0.03
USD 428,000	Owl Rock Capital 3.4% 15/7/2026	381,236	0.02
USD 1,199,000	Owl Rock Capital 3.75% 22/7/2025	1,121,330	0.06
USD 288,000	OWL Rock Core Income 3.125% 23/9/2026	249,041	0.01
USD 1,456,000	OWL Rock Core Income 5.5% 21/3/2025	1,411,848	0.07
USD 2,191,000	OWL Rock Core Income 7.75% 16/9/2027	2,185,619	0.11
USD 991,000	Pacific Gas and Electric 6.75% 15/1/2053	977,812	0.05
USD 1,794,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	1,603,343	0.08
USD 555,000	PDC Energy 6.125% 15/9/2024	550,342	0.03
USD 1,483,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	1,388,518	0.07
USD 708,000	PetSmart / PetSmart Finance 4.75% 15/2/2028	648,613	0.03
USD 4,192,000	PetSmart / PetSmart Finance 7.75% 15/2/2029	4,081,651	0.20
USD 1,712,000	Picasso Finance Sub 6.125% 15/6/2025	1,680,617	0.08
USD 1,001,000	Pilgrim's Pride 3.5% 1/3/2032	777,843	0.04
USD 1,094,000	Plains All American Pipeline / PAA Finance 3.55% 15/12/2029	947,828	0.05
USD 1,550,000	Plains All American Pipeline / PAA Finance 5.15% 1/6/2042	1,266,120	0.06
USD 458,000	Plains All American Pipeline / PAA Finance 6.65% 15/1/2037	451,372	0.02
USD 328,000	Post 4.625% 15/4/2030	284,807	0.01
USD 16,000	Post 5.75% 1/3/2027	15,651	0.00
USD 3,204,000	PRA Health Sciences 2.875% 15/7/2026	2,854,985	0.14
USD 1,047,000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5.625% 1/9/2029	763,985	0.04
USD 1,268,000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5.875% 1/9/2031	900,065	0.04
USD 1,320,000	Prestige Brands 3.75% 1/4/2031	1,073,853	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 292,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	287,214	0.01
USD 832,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	804,889	0.04
USD 2,492,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	2,315,230	0.11
USD 1,235,000	PTC 3.625% 15/2/2025	1,174,383	0.06
USD 3,162,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	2,369,130	0.12
USD 8,229,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6.5% 15/9/2028	3,881,321	0.19
USD 930,000	Range Resources 4.875% 15/5/2025	904,875	0.04
USD 1,628,000	Raptor Acquisition / Raptor Co- Issuer 4.875% 1/11/2026	1,508,339	0.07
USD 1,349,000	Realogy / Realogy Co- Issuer 5.25% 15/4/2030	925,879	0.05
USD 2,040,000	Realogy / Realogy Co- Issuer 5.75% 15/1/2029	1,476,073	0.07
USD 550,000	Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	544,602	0.03
USD 3,955,000	Regal Rexnord 6.05% 15/4/2028	3,870,097	0.19
USD 1,260,000	Regal Rexnord 6.3% 15/2/2030	1,236,581	0.06
USD 1,845,000	Regal Rexnord 6.4% 15/4/2033	1,808,219	0.09
USD 445,000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	366,965	0.02
USD 1,016,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	886,125	0.04
USD 2,046,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	1,882,934	0.09
USD 1,250,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	1,125,266	0.06
USD 374,000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	305,335	0.02
USD 2,238,000	Rockcliff Energy II 5.5% 15/10/2029	2,056,051	0.10
USD 4,118,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	3,533,985	0.17
USD 380,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	331,124	0.02
USD 554,000	Royal Caribbean Cruises 4.25% 1/7/2026	482,501	0.02
USD 1,319,000	Ryan Specialty 4.375% 1/2/2030	1,129,273	0.06
USD 560,000	Sabine Pass Liquefaction 5.9% 15/9/2037	557,804	0.03
USD 1,297,000	Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	1,217,480	0.06
USD 2,246,000	Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	2,212,380	0.11
USD 871,000	Sabre GLBL 11.25% 15/12/2027	868,654	0.04
USD 2,459,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	2,018,670	0.10
USD 4,984,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	4,527,628	0.22
USD 2,708,000	Science Applications International 4.875% 1/4/2028	2,470,301	0.12
USD 1,067,000	Scientific Games International 7% 15/5/2028	1,040,048	0.05
USD 132,000	Scientific Games International 7.25% 15/11/2029	130,350	0.01

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,738,000	Scientific Games International 8.625% 1/7/2025	1,778,788	0.09
USD 2,302,000	SCIL IV / SCIL USA 5.375% 1/11/2026	2,063,630	0.10
USD 1,077,000	Scotts Miracle-Gro 4% 1/4/2031	868,294	0.04
USD 268,000	Scotts Miracle-Gro 4.375% 1/2/2032	216,653	0.01
USD 796,000	Sealed Air 4% 1/12/2027	713,050	0.03
USD 968,000	Sealed Air 6.125% 1/2/2028	952,125	0.05
USD 3,260,000	Sensata Technologies 4.375% 15/2/2030	2,887,160	0.14
USD 1,336,000	Service International/US 3.375% 15/8/2030	1,085,079	0.05
USD 1,938,000	Service International/US 4% 15/5/2031	1,637,998	0.08
USD 578,000	Service International/US 5.125% 1/6/2029	538,985	0.03
USD 3,198,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	2,951,050	0.15
USD 1,296,000	Simmons Foods /Simmons Prepared Foods /Simmons Pet Food /Simmons Feed 4.625% 1/3/2029	1,057,549	0.05
USD 4,422,000	Sinclair Television 4.125% 1/12/2030	3,375,755	0.17
USD 2,203,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	1,943,949	0.10
USD 1,923,000	Sirius XM Radio 3.875% 1/9/2031	1,494,959	0.07
USD 913,000	Sirius XM Radio 4.125% 1/7/2030	742,721	0.04
USD 2,798,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	2,559,488	0.12
USD 566,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	507,884	0.02
USD 2,166,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	2,185,022	0.11
USD 1,548,000	SLM 3.125% 2/11/2026	1,337,116	0.07
USD 528,000	SM Energy 5.625% 1/6/2025	508,520	0.02
USD 1,192,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	1,101,784	0.05
USD 187,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	177,031	0.01
USD 1,518,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	1,461,234	0.07
USD 7,556,000	Sotheby 's 7.375% 15/10/2027 Sotheby 's/Bidfair 5.875% 1/6/2029	7,134,980	0.35
USD 2,795,000	Southwestern Energy 4.75% 1/2/2032	2,365,811	0.12
USD 5,000	Southwestern Energy 5.375% 1/2/2029	4,279	0.00
USD 1,553,000	Southwestern Energy 5.7% 23/1/2025	1,438,156	0.07
USD 141,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	139,847	0.01
USD 766,000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	699,880	0.03
USD 1,972,000	Sprint 7.625% 1/3/2026	1,703,974	0.08
USD 2,293,000	Sprint Capital 6.875% 15/11/2028	2,386,238	0.12
USD 6,418,000	Sprint Capital 8.75% 15/3/2032	6,713,228	0.33
USD 8,396,000		10,003,414	0.49

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 6,033,000	SRM Escrow Issuer 6% 1/11/2028	5,317,697	0.26
USD 3,355,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	2,938,499	0.14
USD 2,645,000	SRS Distribution 6% 1/12/2029 SRS Distribution 6.125%	2,202,551	0.11
USD 5,228,000	1/7/2029	4,395,652	0.22
USD 4,694,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	4,422,976	0.22
USD 921,000	Stagwell Global 5.625% 15/8/2029	788,332	0.04
EUR 168,000	Standard Industries 2.25% 21/11/2026	156,133	0.01
USD 382,000	Standard Industries 3.375% 15/1/2031	294,601	0.01
USD 2,464,000	Standard Industries 4.375% 15/7/2030	2,053,695	0.10
USD 121,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	109,024	0.01
USD 873,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	807,679	0.04
USD 2,241,000	Staples 7.5% 15/4/2026	1,997,000	0.10
USD 759,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	659,366	0.03
USD 1,522,000	Starwood Property Trust 5.5% 1/11/2023	1,509,571	0.07
USD 1,247,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	1,096,473	0.05
USD 2,234,000	Station Casinos 4.625% 1/12/2031	1,822,117	0.09
USD 350,000	Stericycle 3.875% 15/1/2029	299,975	0.01
USD 1,487,000	Stevens 6.125% 1/10/2026	1,510,014	0.07
USD 686,000	Suburban Propane Partners /Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	571,074	0.03
USD 386,000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5.25% 15/1/2029	354,751	0.02
USD 334,000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	327,721	0.02
USD 2,564,000	Surgery Center 6.75% 1/7/2025*	2,533,232	0.13
USD 1,553,000	Surgery Center 10% 15/4/2027	1,577,835	0.08
USD 3,244,000	SWF Escrow Issuer 6.5% 1/10/2029*	2,106,037	0.10
USD 1,662,000	Synaptics 4% 15/6/2029	1,380,079	0.07
USD 222,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5.5% 15/1/2028	199,329	0.01
USD 368,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	340,845	0.02
USD 252,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	216,251	0.01
USD 1,097,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	937,935	0.05
USD 7,965,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	7,325,530	0.36
USD 1,181,000	Targa Resources 6.25% 1/7/2052	1,117,450	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 2,331,000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 4% 15/1/2032	1,978,180	0.10
USD 305,000	Taylor Morrison Communities 5.125% 1/8/2030	268,779	0.01
USD 2,825,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	2,726,436	0.13
USD 285,000	TEGNA 4.75% 15/3/2026	271,246	0.01
USD 2,372,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	2,142,947	0.11
USD 308,000	Teleflex 4.625% 15/11/2027	288,444	0.01
USD 3,221,000	Tempo Acquisition / Tempo Acquisition Finance 5.75% 1/6/2025	3,201,776	0.16
USD 1,682,000	Tempur Sealy International 3.875% 15/10/2031	1,348,148	0.07
USD 635,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	544,512	0.03
USD 338,000	Tenet Healthcare 4.25% 1/6/2029	296,561	0.01
USD 1,337,000	Tenet Healthcare 4.375% 15/1/2030	1,167,651	0.06
USD 265,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/7/2024	261,910	0.01
USD 1,033,000	Tenet Healthcare 4.625% 1/9/2024	1,020,516	0.05
USD 566,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	513,917	0.03
USD 3,379,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	3,227,604	0.16
USD 964,000	Tenet Healthcare 5.125% 1/11/2027	905,985	0.04
USD 496,000	Tenet Healthcare 6.125% 1/10/2028*	460,402	0.02
USD 2,221,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	2,107,551	0.10
USD 1,405,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	1,369,903	0.07
USD 3,439,000	Terex 5% 15/5/2029	3,151,012	0.16
USD 340,000	TerraForm Power Operating 5% 31/1/2028	312,710	0.01
USD 614,000	Titan International 7% 30/4/2028	582,545	0.03
USD 9,034,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	8,194,380	0.40
USD 561,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	519,615	0.03
USD 461,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	430,049	0.02
USD 6,946,000	Triumph 8.875% 1/6/2024	7,265,829	0.36
USD 1,076,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	1,090,765	0.05
USD 446,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	374,452	0.02
USD 4,179,000	Twilio 3.875% 15/3/2031	3,417,371	0.17
USD 3,259,000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	2,846,007	0.14
USD 5,177,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	4,583,768	0.23
USD 853,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	839,250	0.04
USD 3,223,000	Uber Technologies 7.5% 15/5/2025	3,253,390	0.16

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 4,198,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	4,238,930	0.21
USD 1,980,000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	2,022,501	0.10
EUR 237,000	UGI International 2.5% 1/12/2029	199,234	0.01
USD 2,950,000	United Airlines 4.375% 15/4/2026	2,780,124	0.14
USD 6,098,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	5,425,677	0.27
USD 4,398,175	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15/4/2029	4,372,506	0.22
USD 387,072	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4.875% 15/7/2027	375,460	0.02
USD 637,000	United Natural Foods 6.75% 15/10/2028	603,897	0.03
USD 9,770,000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	9,770,733	0.48
USD 3,059,000	Uniti / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	3,063,818	0.15
USD 1,173,000	Univision Communications 5.125% 15/2/2025*	1,143,335	0.06
USD 636,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	604,983	0.03
USD 816,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030	771,697	0.04
USD 306,000	US Foods 4.625% 1/6/2030	267,459	0.01
USD 1,049,000	US Foods 4.75% 15/2/2029	944,326	0.05
USD 1,089,000	US Foods 6.25% 15/4/2025	1,087,463	0.05
USD 5,353,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	5,157,779	0.25
USD 2,570,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/9/2027	2,419,158	0.12
USD 1,166,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	1,164,033	0.06
USD 6,279,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	5,408,009	0.27
USD 7,467,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 1/11/2033	6,057,604	0.30
USD 6,967,000	Venture Global Calcasieu Pass 4.125% 15/8/2031	5,948,697	0.30
USD 1,900,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	1,467,893	0.07
USD 13,913,000	Verscend Escrow 9.75% 15/8/2026	14,012,617	0.69
USD 5,668,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	4,925,605	0.24
USD 3,233,000	Viavi Solutions 3.75% 1/10/2029	2,703,541	0.13
USD 1,428,000	VICI Properties 4.95% 15/2/2030	1,334,252	0.07
USD 2,829,000	VICI Properties 5.625% 15/5/2052	2,499,315	0.12
USD 818,000	VICI Properties / VICI Note 3.5% 15/2/2025	772,604	0.04
USD 382,000	VICI Properties / VICI Note 3.875% 15/2/2029	331,954	0.02
USD 1,847,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	1,593,698	0.08

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 713,000	VICI Properties / VICI Note 4.25% 1/12/2026	660,541	0.03
USD 551,000	VICI Properties / VICI Note 4.5% 15/1/2028	506,483	0.02
USD 347,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 15/6/2025	332,746	0.02
USD 3,612,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	3,249,987	0.16
USD 355,000	VICI Properties / VICI Note 5.625% 1/5/2024	352,245	0.02
USD 1,600,000	VistaJet Malta Finance / XO Management 6.375% 1/2/2030	1,405,137	0.07
USD 1,992,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	1,734,661	0.09
USD 6,790,000	Waste Pro USA 5.5% 15/2/2026	6,201,918	0.31
USD 4,590,000	WESCO Distribution 7.125% 15/6/2025	4,638,735	0.23
USD 3,002,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	3,044,589	0.15
USD 500,000	Western Midstream Operating 3.95% 1/6/2025	475,533	0.02
USD 272,000	Western Midstream Operating 4.75% 15/8/2028	251,897	0.01
USD 1,725,000	Western Midstream Operating 5.3% 1/3/2048	1,429,844	0.07
USD 1,832,000	Western Midstream Operating 5.45% 1/4/2044	1,548,864	0.08
USD 849,000	Western Midstream Operating 5.5% 15/8/2048	709,360	0.03
USD 5,370,000	Western Midstream Operating 5.5% 1/2/2050	4,397,090	0.22
USD 8,895,000	White Cap Buyer 6.875% 15/10/2028	8,072,580	0.40
USD 2,399,000	White Cap Parent 8.25% 15/3/2026*	2,264,435	0.11
USD 895,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	861,254	0.04
USD 1,700,000	Williams Scotsman International 4.625% 15/8/2028	1,531,530	0.08
USD 1,233,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	1,132,819	0.06
USD 9,271,000	WR Grace 5.625% 15/8/2029	7,465,666	0.37
USD 933,000	WR Grace 7.375% 1/3/2031	927,169	0.05
USD 1,059,000	Wyndham Hotels & Resorts 4.375% 15/8/2028	955,033	0.05
USD 2,100,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	1,955,488	0.10
USD 3,455,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	3,079,055	0.16
USD 649,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.125% 15/2/2031	647,919	0.03
USD 595,000	XPO Escrow Sub 7.5% 15/11/2027	608,007	0.03
USD 119,000	Yum! Brands 4.75% 15/1/2030	108,570	0.01
USD 17,550,000	Zayo 4% 1/3/2027	13,531,050	0.67

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 10,829,000	Zayo 6.125% 1/3/2028 *	6,836,131	0.34
USD 5,477,000	ZoomInfo Technologies /ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	4,563,262	0.23
債券合計		1,523,077,420	75.01
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合計		1,940,092,596	95.52
その他の譲渡可能な有価証券			
普通株式 / 優先株式およびワラント			
3,743	英国 New Topco **	-	0.00
2,388	米国 Alliant **	2,198,132	0.11
315,073	AMP PIPE **	1,528,104	0.07
974	Archibald Candy **	-	0.00
8,000	Australis Media (Wts 15/5/2003) ** ****	-	0.00
65,370	Critical Care Systems International **	-	0.00
26	IssuerCo-U **	-	0.00
22,200	Loral Space & Communications (Wts 26/12/2006) ** ****	-	0.00
1,368	Verscend Intermediate **	1,689,069	0.08
普通株式 / 優先株式およびワラント合計		5,415,305	0.26
債券			
USD 4,000,000	カナダ Consolidated Hydro 0% 31/12/2049 **	-	0.00
USD 197,801	米国 Archibald Candy 10% 31/12/2049 **	-	0.00
USD 850,000	Erscrew Adelpia 0% 31/12/2049 **	-	0.00
USD 1,610,000	Lehman Brothers 0% 1/3/2015 ** ****	6,038	0.00
USD 5,760,000	Lehman Brothers 5.75% 17/5/2013 ** ****	21,600	0.00
EUR 7,165,000	Lehman Brothers 4.75% 16/1/2014 ** ****	41,918	0.00
EUR 14,950,000	Lehman Brothers 0% 5/2/2014 ** ****	87,463	0.01
EUR 1,250,000	Lehman Brothers 5.375% 17/10/2012 ** ****	7,313	0.00
USD 290,000	Mirant Escrow 0% 15/7/2049 **	-	0.00
USD 240,000	Southern Energy Homes 7.9% 15/7/2009 ** ****	-	0.00
USD 115,000	Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9.625% 15/12/2014 ** ****	-	0.00
USD 4,000,000	Wheeling Pittsburgh Steel Escrow 0% 31/12/2049 **	-	0.00
債券合計		164,332	0.01
債券合計		164,332	0.01
その他の譲渡可能な有価証券合計		5,579,637	0.27
投資有価証券合計		1,956,304,077	96.32
その他の純資産		74,700,105	3.68
純資産合計(米ドル)		2,031,004,182	100.00

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

** 注記2(j)に記載されるとおり、公正価値評価の対象となる有価証券。

*** 当該有価証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2023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	7,491,102	GBP	6,128,000	Morgan Stanley	15/3/2023	50,470
USD	70,226,996	EUR	65,589,000	Deutsche Bank	15/3/2023	401,788
USD	426,074	EUR	401,000	State Street	15/3/2023	(825)
USD	183,666	GBP	149,000	Bank of America	15/3/2023	2,749
USD	205,555	GBP	166,000	State Street	15/3/2023	3,998
USD	185,916	GBP	150,000	BNY Mellon	15/3/2023	3,786
USD	88,153	EUR	82,000	JP Morgan	15/3/2023	857
USD	310,716	EUR	288,000	Morgan Stanley	15/3/2023	4,114
未実現純評価益						466,937
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	80,224,951	USD	56,042,346	BNY Mellon	15/3/2023	(1,909,667)
USD	1,552,562	AUD	2,249,447	BNY Mellon	15/3/2023	34,732
未実現純評価損						(1,874,935)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	6,501,050	USD	4,849,915	BNY Mellon	15/3/2023	(66,495)
USD	105,957	CAD	142,052	BNY Mellon	15/3/2023	1,437
未実現純評価損						(65,058)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	4,708,038	USD	5,136,769	BNY Mellon	15/3/2023	(95,780)
USD	177,205	CHF	163,342	BNY Mellon	15/3/2023	2,313
未実現純評価損						(93,467)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,544,603	USD	670,645	BNY Mellon	15/3/2023	(16,151)
USD	14,833	CNY	101,522	BNY Mellon	15/3/2023	213
未実現純評価損						(15,938)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	62,323,345	USD	67,204,520	BNY Mellon	15/3/2023	(855,177)
USD	20,010,234	EUR	18,827,762	BNY Mellon	15/3/2023	(33,532)
未実現純評価損						(888,709)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	30,527,486	USD	37,106,191	BNY Mellon	15/3/2023	(39,636)
USD	5,814,064	GBP	4,810,836	BNY Mellon	15/3/2023	(27,256)
未実現純評価損						(66,892)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	211,488,868	USD	27,003,409	BNY Mellon	15/3/2023	(40,557)
USD	720,073	HKD	5,642,278	BNY Mellon	15/3/2023	736
未実現純評価損						(39,821)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	3,039,131	USD	1,934,926	BNY Mellon	15/3/2023	(56,699)
USD	57,828	NZD	91,764	BNY Mellon	15/3/2023	1,116
未実現純評価損						(55,583)
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	26,135,349	USD	19,775,568	BNY Mellon	15/3/2023	(369,710)
USD	464,670	SGD	619,591	BNY Mellon	15/3/2023	4,617
未実現純評価損						(365,093)
ヘッジを使用した南アフリカ・ランド建投資証券クラス						
USD	239,499	ZAR	4,340,121	BNY Mellon	15/3/2023	3,391
ZAR	137,918,993	USD	7,775,126	BNY Mellon	15/3/2023	(272,363)
未実現純評価損						(268,972)
未実現純評価損合計						(3,267,531)

未決済上場先物取引 2023年2月28日現在

取引数	通貨	取引/摘要	満期日	未実現評価益 /(損) (米ドル)
(23)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2023年3月	(55,501)
(127)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2023年3月	343,963
(20)	USD	US Long Bond (CBT)	2023年6月	48,996
(457)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年6月	176,898
(21)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年6月	10,251
(241)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年6月	126,137
(16)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年6月	6,510
合計				657,254

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・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現 評価益 /(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (67,564)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	797	(16,023)
CDS	EUR (120,000)	ファンドはLoxamに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	(780)	(9,931)
CDS	EUR (103,978)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	1,124	(14,785)
CDS	USD (1,194,000)	ファンドはLumen Technologiesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2023	54,693	(41,326)
CDS	EUR (55,219)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive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	20/12/2026	(6,047)	(3,716)
CDS	EUR (40,611)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	340	(9,631)
CDS	EUR (114,152)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	956	(27,071)
CDS	EUR (107,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2023	(8,350)	(18,330)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	5,964	(1,531)
CDS	EUR (33,123)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2027	516	(7,855)
CDS	EUR (78,946)	ファンドはJaguar Land Rover Automotiveに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(8,839)	(5,313)
CDS	EUR (135,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotiveに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(14,666)	(9,085)
CDS	EUR (190,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	9,760	18,654
CDS	EUR (57,325)	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	3,378	(878)
CDS	EUR (32,675)	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	2,097	(500)
CDS	USD (30,265,097)	ファンドはCDX.NA.HY.39.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	20/12/2027	371,585	457,811
CDS	EUR 247,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(12,125)	6,078
CDS	EUR (75,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	2,785	(4,646)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2023	7,948	(17,131)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはSaipem Finance Internationalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	26,330	20,239
CDS	EUR (120,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(8,638)	7,112
CDS	EUR (170,000)	ファンドはK&S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	20/12/2026	3,209	17,791
CDS	EUR (90,000)	ファンドはLadbrokes Coralに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	6,025	(4,149)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現 評価益 /(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはLadbrokes Coralに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	10,427	(4,610)
CDS	EUR (230,000)	ファンドはLadbrokes Coralに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	29,869	(10,603)
CDS	EUR (126,022)	ファンドはUnited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	20/12/2027	2,734	(17,920)
CDS	EUR (150,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	13,944	(9,291)
CDS	EUR (50,260)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2027	469	(11,919)
TRS	USD 2,275,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/6/2023	24,249	15,131
TRS	USD 9,295,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	BNP Paribas	20/6/2023	123,681	84,735
TRS	USD 8,198,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/6/2023	97,921	63,572
TRS	USD 4,618,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	58,302	38,953
TRS	USD 8,897,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	(45,884)	(88,520)
合計					753,774	395,312

CDS : クレジット・デフォルト・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。

[次へ](#)

財務書類に対する注記

1. 組織

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

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

2023年2月28日現在、当社は103のサブファンド(以下それぞれを「ファンド」という。)における投資証券を発行しており、以下総称して「当ファンド」という。各ファンドは、それぞれ個別の資産プールである。各ファンドは、アペンディクスに詳述のとおり投資証券クラスに分類されており、それぞれ個別の投資証券により表象されている。

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

当期に生じた重要な事象

スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドは、今後も継続して新規および既存の投資主に対する投資証券販売を以後の通知があるまで中止する。投資主は、従来通り当社の英文目論見書に沿って払戻しはできる。

2022年9月6日付で、オフショア人民元建てのチャイナ・オンショア・ボンド・ファンドが設定された。

2022年9月13日付で、英文目論見書の補遺が発行された。

2022年9月22日付で、米ドル建のシステムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンドが設定された。

2022年10月4日付で、米ドル建のサステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンドが設定された。

2022年10月6日付で、ユーロ建のインパクト・ボンド・ファンドが設定された。

2022年10月6日付で、ベッティーナ・マッツォッキが当社の取締役会に任命された。

2022年12月2日付で、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドを2023年3月2日付で終了するとした取締役会決議を通知する投資主通知が発行された。

2022年12月15日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2022年12月15日付で、システムティック・グローバル・スモールキャップ・ファンドはシステムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンドに、システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンドはESGシステムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンドに、またワールド・ボンド・ファンドはサステイナブル・ワールド・ボンド・ファンドに名称を変更した。

2022年12月29日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

取締役会および投資顧問会社は、ロシアのウクライナへの侵攻に起因する地政学的緊張を考慮して、ファンドの投資目的に沿った投資パフォーマンスを引き続き監視している。当ファンドの運用および純資

産価額の公表は、BGFエマージング・ヨーロッパ・ファンド(本パラグラフの残りの部分では「ファンド」という。)を除いて継続されている。ロシアに対するファンドの重大な投資エクスポージャーにより、ファンドの取引条件は重大な影響を受けた。したがって、取締役会は、ファンドのすべての投資証券クラスの販売、買戻し、転換、および純資産価額の決定については、英文目論見書に基づくファンドの裁量に基づき、2022年3月1日からそれ以降の通知までの期間、一時的に停止されることが、ファンドおよびその投資家の利益になると考えた。2022年3月3日、取締役会は、ファンドが保有するロシアの有価証券の価値をさらに大幅に評価減することを決定した。2022年3月9日、運用会社の取締役会は、ファンドの評価、販売および買戻しについて、ブラックロックのウェブサイトを通じてさらなる通知がなされるまで停止する一方で、ファンドに関連する投資運用報酬および年次サービス料を放棄する(2022年3月1日発効)という追加の例外的な決定を下した。2023年1月以降、月末の想定純資産価額はブラックロックのウェブサイトで公表されている。半期報告書に開示されている純資産価額は2023年2月28日現在のファンドの想定純資産価額である。2023年2月28日現在、取締役会はファンドを終了する計画はないため、これらの財務書類は継続企業の前提に基づき作成されている。

2. 重要な会計方針の要約

当社の財務書類は、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドを除き継続企業の前提に基づいて作成されている。アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドは、期末後にファンドを終了するという取締役の決定に伴い、非継続企業の前提に基づいて作成されている。詳細については注記1を参照のこと。この財務書類は、ルクセンブルグの投資法人のためにルクセンブルグの関係官庁が規定した財務書類の作成に関連する法律および規制上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針を含む。

(a) 投資有価証券およびその他の資産の評価

当社の投資有価証券およびその他の資産は以下のとおり評価されている。

- 公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券は、評価日における最新の入手可能な市場価格に基づき評価される。評価時点後に終了した市場で取引された有価証券については、評価時点またはそれに相応する時点での最新の価格を使うことができる。当該投資有価証券またはその他の資産が複数の証券取引所または規制市場で上場または取引されている場合、取締役会はその裁量により、評価目的でかかる証券取引所または規制市場のいずれか1つを選択することができる。一部のファンドの純資産価額の計算時に該当する市場が終了している場合、または政府が外国投資に財務上の費用または取引費用を課す場合に有価証券価額の相違が生じることがある。そのため、取締役は、これらの投資有価証券の公正価値を見積るために公正価値の評価技法を利用した。かかる有価証券およびデリバティブは、適格者(取締役)が決定する実現性の高い価額で評価される。公正価値評価プロセスに固有の不確実性により、これらの見積価額は、当該有価証券にとっての整備された市場が存在する場合に使用されたであろう価額や最終的に回収される価額と著しく異なる可能性がある。
- 上場されていない有価証券、またはいかなる証券取引所もしくはその他の規制市場において売買もしくは取引されていない有価証券(クローズドエンド型ファンドの有価証券を含む)および評価額が入手できないその他の市場における上場または非上場有価証券、または取締役が、市場価格が公正市場価格を反映していないと判断した有価証券に関しては、取締役が、処分価格または取得価格の予測額に基づき、慎重かつ誠実に価値を決定する。
- 証券取引所に上場していない、またはその他の規制市場で売買されていない債券は、1社以上のディーラーまたは価格提供サービス会社から取得した入手可能な最終の仲値または利回り相当額で評価される。OTC市場で売買されている有価証券は、入手可能な最終の買呼値で評価される。有価証券が複数の取引所で売買されている場合は、運用会社の取締役会によってまたはその指示にお

いて主たる市場として指定された取引所で評価される。OTC市場と証券取引所の両方で売買されているポートフォリオ有価証券は、最も広範囲で最も代表的な市場に従って評価される。

- ・ 有価証券貸付：有価証券は貸付代理店の指示により第三者ブローカーに受渡しされるが、当ファンドのポートフォリオの一部として引き続き評価される。
- ・ 短期金融商品は、額面金額に利息を加えた金額が償却原価に基づいて評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドで保有されている短期金融商品は、時価基準で評価される。これが不可能な場合、資産は評価モデルによる評価基準を用いて保守的に評価される。
- ・ 定期預金は、償却原価で評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ 現金、預金、要求払手形およびその他の債務ならびに前払費用は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未収利息および未収配当金、売却投資有価証券未収金ならびに販売投資証券未収金を含む資産は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未払費用、未払収益分配金、購入投資有価証券未払金および買戻し投資証券未払金を含む負債は、それらの額面金額で評価される。

投資の処分による実現損益は平均原価法を用いて計算され、損益および純資産変動計算書に反映される。

(b) 投資有価証券からの収益/費用

当社は以下の方法で投資有価証券からの収益を会計処理している。

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

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

(c) デリバティブ商品

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

当ファンドはカバード・コール・オプションおよびプット・オプションの売却、コール・オプションおよびプット・オプションの購入を実施できる。当ファンドはまたスプレッド・オプションおよびシンセティック・キャップ・オプションにも投資することができる。スプレッド・オプションは、2つ以上の資産の価格の差異から価値が生じる種類のオプションである。シンセティック・キャップ・オプションは、購入者に金利上限または利払上限を提供する二者間の契約である。レート・キャップ自体は、参照インデックス・レートが行使レートを上回るプラスの金額に基づいて定期的に支払われる。当ファン

ドがオプションを売却および/または購入する時点で、当ファンドによる受取または支払プレミアムと同額が負債または資産として反映される。その後、売建オプションに係る負債および買建オプションに係る資産は、現在価値を反映するよう時価評価される。見積実現価額を最もよく反映する方法として、取締役は最終取引価格ではなく仲値または決済値に基づいて、市場で取引されるオプションを評価することに合意している。上場されていないオプションは第三者の値付機関から入手する日次価格に基づいて評価する。有価証券がオプション行使によって売却される場合、受取(支払)プレミアムが売却有価証券から控除(に加算)される。オプションが失効する場合(または当ファンドが決済取引を行った場合)、当ファンドはオプションに係る損益を、受取または支払プレミアムの分だけ(もしくは決済取引のコストが受取または支払プレミアムを超過する分だけ)実現する。

2023年2月28日現在、当ファンドは差金決済取引契約(以下「CFD」という。)を締結している。CFDにより、投資家は変動証拠金でシンセティック・ロングポジションまたはシンセティック・ショートポジションを取ることができる。株式と違い、CFDにおいては、購入者は証拠金として支払った金額を大幅に上回る金額について責任を負う可能性がある。そのため、当ファンドは取引相手から受け取った現金を様々な金融機関に預け入れており、これは英文目論見書にも記載されている。締結されたCFDポジションには、該当するベンチマーク以上またはそれ以下の事前に合意されたレートを適用する金融費用が日々、課される。関連する受取配当金または支払配当金は、損益および純資産変動計算書に源泉徴収税控除後の金額で開示される。

CFDの時価は、原証券や原資産が取引されるまたは取引を認められる証券取引所における最終の取引価格により決定される。評価時刻後に終了する市場で取引される原証券については、その時点またはその他の時点における最終の周知の価格が使用される場合がある。時価の変動は(もしあれば)、損益および純資産変動計算書に未実現評価益/(損)の純変動額として計上される。CFDの満期または解約時における実現損益は損益および純資産変動計算書上に表示される。

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

当ファンドは1つの商品から発生する利益を他の投資より発生する利益と交換するために、スワップ契約を締結している。クレジット・デフォルト・スワップの場合、信用事由の発生による偶発的な支払い(当該契約にあらかじめ定義されている)と引き換えに、一連のプレミアムがプロテクションの売り手に支払われる。スワップは可能な限り、第三者の値付機関から入手し、実際のマーケット・メーカーに確認した日々の価格に基づいて時価評価される。こうした時価が入手できない場合、スワップはマーケット・メーカーから入手する日々の相場に基づいて値付される。いずれの場合も、価格の変動は損益および純資産変動計算書に未実現評価益/(損)の純変動額として計上される。スワップの満期または解約時における実現損益およびスワップに関連して稼得または負担した利息は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

当期において、当ファンドはスワップ取引を開始した。スワップ取引によって、買い手は一定期間内に予め設定された利率で金利スワップ取引を行う権利(義務ではない)を得る。スワップ取引の買い手は当該権利について売り手にプレミアムを支払う。売建スワップにより買い手は変動金利を支払い、固定金利を受け取る権利を得る。買建スワップにより買い手は固定金利を支払い、変動金利を受け取る権利を得る。ファンドがスワップを売る、または買う場合、ファンドが受け取る、または支払うプレミアムと同額の負債または資産が純資産計算書において計上される。

当期において、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンドおよびグローバル・マルチアセット・インカム・ファンドは複数の株式連動債を取得した。一度または複数回の固定クーポンの支払いと引き換えに、原株式の約定日付の市場価格で元本をブローカーに支払う。満期時に、ファンドは当該元本に原株式の価値の変動を加減算した金額(契約書に定められた約定キャップ・レベルを上限として)を受け取ることになる。

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

当ファンドは、適切と思われる場合は決済前に契約を処分することがある。T B Aの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。T B A売却契約が残存している間、当該取引をカバーするために、相応の交付可能有価証券または相殺対象となる(売却契約日以前に交付可能な)T B A購入契約を保有する。二者の取引相手が同一のT B A契約に対して相殺対象となる取引を行っている場合、これらの取引は相殺される。決済日において売り手は、約定日の2日前に指定された有価証券を引渡し、約定日に指定された現金を受け取る。ただし実務上は、ほとんどのT B A取引において、最終的に不動産担保証券現物の引渡しは行われず、満期前に残存取引を解消または「ロール」する。

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

2023年2月28日現在、当ファンドは未決済のT B Aを有していた。これは、純資産計算書の「売却投資有価証券未収金」および「購入投資有価証券未払金」に含まれている。

T B Aの時価は純資産計算書上に表示される。T B Aの未実現評価損益の純変動額およびT B Aの売却に係る実現評価損益は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

(d) 為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、2023年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートで換算されている。

(e) 結合財務書類

各ファンドの財務書類はファンドの基準通貨で表示されている。

当社の結合数値は米ドルで表示されており、各ファンドの財務書類の合計を含んでいる。純資産計算書の換算レートは、2023年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9401	0.8238	136.5900	0.9354	6.9499

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

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9695	0.8484	138.4699	0.9530	7.0050

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

損益および純資産変動計算書の結合数値は、期中の平均為替レートを用いて算定されている。その結果生じる為替換算調整額1,949,649,745米ドルは、2022年8月31日と2023年2月28日の間の為替レートの変動を表す。これは想定金額であり、個々のファンドの純資産に対する影響はない。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2023年2月28日現在、当ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産ならびにその他の負債を換算するために使用された。

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民幣元
UAEディルハム	0.2243	0.2723	0.2560	37.1889	0.2547	1.8922
アルゼンチン・ペソ (公式レート)	0.0042	0.0051	0.0048	0.6927	0.0047	0.0352
豪ドル	0.5556	0.6744	0.6340	92.1173	0.6309	4.6871
ブラジル・レアル	0.1581	0.1919	0.1804	26.2060	0.1795	1.3334
カナダ・ドル	0.6061	0.7357	0.6916	100.4888	0.6882	5.1130
スイス・フラン	0.8807	1.0690	1.0050	146.0208	1.0000	7.4298
チリ・ペソ	0.0010	0.0012	0.0011	0.1646	0.0011	0.0084
オフショア中国人民幣元	0.1185	0.1439	0.1353	19.6535	0.1346	1.0000
中国人民幣元	0.1187	0.1441	0.1355	19.6832	0.1348	1.0015
コロンビア・ペソ	0.0002	0.0002	0.0002	0.0284	0.0002	0.0014
チェコ・コルナ	0.0373	0.0453	0.0425	6.1821	0.0423	0.3146
デンマーク・クローネ	0.1177	0.1429	0.1344	19.5204	0.1337	0.9932
ドミニカ・ペソ	0.0148	0.0180	0.0169	2.4571	0.0168	0.1250
エジプト・ポンド	0.0269	0.0326	0.0307	4.4594	0.0305	0.2269
ユーロ	0.8763	1.0637	1.0000	145.2914	0.9950	7.3927
英ポンド	1.0000	1.2139	1.1412	165.8066	1.1355	8.4365
ガーナ・セディ	0.0646	0.0784	0.0737	10.7129	0.0734	0.5451
香港ドル	0.1050	0.1274	0.1198	17.4022	0.1192	0.8855
ハンガリー・フォリント	0.0023	0.0028	0.0027	0.3852	0.0026	0.0196
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0090	0.0001	0.0005
イスラエル・シェケル	0.2250	0.2731	0.2567	37.2985	0.2554	1.8978
インド・ルピー	0.0100	0.0121	0.0114	1.6523	0.0113	0.0841
アイスランド・クローナ	0.0058	0.0070	0.0066	0.9538	0.0065	0.0485
日本円	0.0060	0.0073	0.0069	1.0000	0.0068	0.0509
ケニア・シリング	0.0065	0.0079	0.0074	1.0759	0.0074	0.0547
韓国ウォン	0.0006	0.0008	0.0007	0.1032	0.0007	0.0053
クウェート・ディナール	2.6842	3.2584	3.0632	445.0586	3.0479	22.6453
カザフスタン・テンゲ	0.0019	0.0022	0.0021	0.3068	0.0021	0.0156
スリランカ・ルピー	0.0023	0.0028	0.0026	0.3773	0.0026	0.0192
メキシコ・ペソ	0.0450	0.0546	0.0513	7.4538	0.0510	0.3793
マレーシア・リンギット	0.1836	0.2228	0.2095	30.4380	0.2084	1.5487
ナイジェリア・ナイラ	0.0018	0.0022	0.0020	0.2965	0.0020	0.0151
ノルウェー・クローネ	0.0798	0.0969	0.0911	13.2335	0.0906	0.6733
ニュージーランド・ドル	0.5091	0.6180	0.5810	84.4122	0.5781	4.2950
ペルー・新ソル	0.2165	0.2628	0.2470	35.8939	0.2458	1.8263
フィリピン・ペソ	0.0149	0.0181	0.0170	2.4677	0.0169	0.1256
ポーランド・ズロチ	0.1861	0.2259	0.2123	30.8523	0.2113	1.5698
カタール・リヤル	0.2262	0.2746	0.2581	37.5064	0.2569	1.9084
ルーマニア・レイ	0.1780	0.2161	0.2032	29.5171	0.2021	1.5019
ロシア・ルーブル	0.0110	0.0133	0.0125	1.8182	0.0125	0.0925
サウジ・リアル	0.2195	0.2665	0.2505	36.3982	0.2493	1.8520

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
スウェーデン・クローネ	0.0791	0.0960	0.0902	13.1099	0.0898	0.6671
シンガポール・ドル	0.6115	0.7423	0.6978	101.3860	0.6943	5.1587
タイ・バーツ	0.0233	0.0283	0.0266	3.8649	0.0265	0.1967
新トルコ・リラ	0.0436	0.0530	0.0498	7.2337	0.0495	0.3681
台湾ドル	0.0270	0.0328	0.0309	4.4828	0.0307	0.2281
ウクライナ・フリヴニャ	0.0224	0.0272	0.0256	3.7166	0.0255	0.1891
米ドル	0.8238	1.0000	0.9401	136.5900	0.9354	6.9499
ウルグアイ・ペソ	0.0212	0.0257	0.0242	3.5149	0.0241	0.1788
ベトナム・ドン	0.0000	0.0000	0.0000	0.0057	0.0000	0.0003
南アフリカ・ランド	0.0449	0.0545	0.0512	7.4398	0.0510	0.3785
ザンビア・クワチャ	0.0416	0.0505	0.0474	6.8933	0.0472	0.3507

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

（g）希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引および仲介手数料、税金および関税、市場の動き、原資産の購入価格と売却価格間のスプレッド等の要因により、当該ファンドにおける原資産の帳簿価額を逸脱している場合に生じる。希薄化は、ファンドの価値に悪影響を及ぼし、その結果投資主に影響を与える可能性がある。投資証券1口当たり純資産価額を調整することにより、この影響を軽減または回避して、投資主を希薄化による影響から保護することができる。いずれかの取引日において、当該ファンドの全投資証券クラスの総取引の価値によって、当該ファンドに対して取締役が設定する1つ以上の基準値を超える投資証券の純増減が生じた場合、取締役は当該ファンドの純資産価額を調整することがある。ある取引日にファンドの純資産価額を調整できる金額は、当該ファンドの市場取引の予想コストに関連している。このような状況において、関連するファンドの純資産価額は、純資産価額の1.50%（債券ファンドの場合は3%）を超えない金額で調整されることがある。例外的な状況において取締役は、投資主の利益のため、上記の最大変動要因を一時的に引き上げ、その旨を投資家に通知する場合がある。純変動により当ファンドの全投資証券の価値が増加した場合は加算調整となり、価値が減少した場合には減算調整となる。特定の株式市場および管轄区域においては、特に関税および税金に関して、買い手側と売り手側で課金構造が異なる場合があるため、結果として生じる調整は、販売純額（流入）と買戻し純額（流出）で異なることがある。さらに、取締役は、調整額に特別な財務上の費用を含めることに同意することもある。これらの特別な財務上の費用は市場ごとに異なり、現時点ではその純資産価額の2.5%を超えないものと予想されている。ファンドが主に国債や短期金融証券などの特定の資産タイプに投資する場合、取締役はそのような調整を行うことが適切でないと判断する可能性がある。

英文目論見書のアペンディクスBの17.3（訳注：原文の参照番号）に従い、2023年2月28日現在、かかる希薄化調整はユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、ニュートリション・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケッツ・コーポレート・ボンド・ファンドおよびワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンドに適用されていた。2023年2月28日に終了した期間において、か

かる希薄化調整は、チャイナ・イノベーション・ファンド、チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、ユーロ・リザーブ・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、インパクト・ボンド・ファンド、サステイナブル・エネルギー・ファンドおよびUSダラー・リザーブ・ファンドを除くすべてのファンドに適用された。

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

(h) 取引費用

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

有価証券の購入または売却に係る取引費用は、預託銀行の取引手数料を除いて、各ファンドの損益および純資産変動計算書の実現純評価益/(損)または未実現評価益/(損)の純変動額に含まれる。預託銀行の取引手数料はファンドの損益および純資産変動計算書の預託報酬に含まれている。

(i) その他の取引に係る外国通貨

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

(j) 公正価値評価

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

公正価値評価された証券は、投資有価証券明細表において「**」と示されている。

2023年2月28日現在、以下のとおり公正価値調整が行われた。

ファンド	通貨	公正価値評価された証券の時価	純資産比率(%)
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	-	0.00
アジアン・ドラゴン・ファンド	米ドル	10,130,605	1.23
アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	13,771	0.02
アジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	68,220	0.84
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	131,785,900	0.43
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	オフショア 中国人民元	9,941,320	1.89
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	ユーロ	32,759	0.07
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	931,954	0.03
エマージング・ヨーロッパ・ファンド ⁽²⁾	ユーロ	26,579	0.01
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファン ド	米ドル	573	0.00
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	33,846,077	1.40
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイ ティ・ファンド	米ドル	68	0.00
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド	ユーロ	612,519	0.13
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	207,633	0.13
ESGマルチアセット・ファンド	ユーロ	17,665,857	0.27
ユーロ・リザーブ・ファンド	ユーロ	1,000,000	0.82
ユーロ・マーケット・ファンド	ユーロ	1,612,388	0.12
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	-	0.00
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	ユーロ	8,617	0.16
フィンテック・ファンド	米ドル	3,433	0.00
フィクسد・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	64,684,107	0.83
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	386,605,004	2.63
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	1,580	0.00
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	10,479,961	2.65
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,197,990	0.14
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	21,295,650	0.41
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	-	0.00
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ ファンド	米ドル	305	0.00
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	米ドル	2,012	0.01
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	70,899,751	2.87
ニュートリション・ファンド	米ドル	1	0.00
サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレ ート・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	-	0.00
サステイナブル・フィクسد・インカム・グローバル・オ ポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	768,306	0.15
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファン ド	米ドル	210,800	0.19
システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・イン カム・ファンド	米ドル	60,849	0.00
システムティック・サステイナブル・グローバル・スモー ルキャップ・ファンド ⁽³⁾	米ドル	2,758	0.00
ユナイテッド・キングダム・ファンド	英ポンド	-	0.00

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	5,579,637	0.27
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	902	0.00
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	2,281	0.00
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	42,418,505	1.11
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	738,840	0.01
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	12,796,119	0.21
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	米ドル	78,459	0.05
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	164,981,737	2.02

当該ファンドは時価がゼロで公正価値評価された証券を保有している。

- (1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (2) 一時的に停止されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (3) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(k) 特別買収目的会社に関するコミットメント

特別買収目的会社(以下「SPAC」という。)とは、事業を有せずに、SPACの新規株式公開による調達資金を用いて他の企業の合併または買収を行うこと目的として株式公開される会社をいう。当該ファンドは、SPACとの間で、上場企業の私募増資(以下「PIPE」という。)取引に関するコミットメントを締結することがあり、SPACが合併または買収を完了した時点で当該コミットメントを履行する。PIPE取引を通じて購入された証券は、有価証券届出書が提出され有効であると宣言されるまで取引が制限され、流動性が低いものとみなされる。

SPACに対する未履行のPIPEコミットメントは時価評価され、当該コミットメントから生じる利益/損失は、純資産計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)」、ならびに損益および純資産変動計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)の純変動」に計上される。2023年2月28日現在において、そのようなコミットメントはなかった。

3. 運用会社

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

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

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

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

4. 投資運用報酬

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

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年率の投資運用報酬を支払っている。投資運用報酬の水準は0.00%から1.75%の間であり、投資家が購入するファンドおよび投資証券クラスに応じて異なる。これらの報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき(該当する場合、英文目論見書のアペンディクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号)に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。投資顧問会社への報酬を含む特定の費用および報酬は、投資運用報酬より支払われる。クラスJおよびクラスX投資証券について請求される投資運用報酬はない。クラスS R投資証券については、継続的経費(ongoing charge)の金額の一部を構成する単一の報酬(投資運用報酬と年次サービス料から構成される)が請求される。

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

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

2022年3月9日付で、運用会社の取締役会は、エマージング・ヨーロッパ・ファンドの停止により、その投資運用報酬を放棄した。

当期において、ブラックロックが運用するターゲット・ファンドに対する投資に関連して投資運用報酬リベートの対象になっているファンドは以下のとおりである。

クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ESGマルチアセット・ファンド、システムティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ファンド、ユーロ・ボンド・ファンド、ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンドおよびUSドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

2023年2月28日現在の未払投資運用報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

5. 販売報酬

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年間販売報酬を支払っている。販売報酬の水準は、0.00%から1.25%の間である。クラスA、D、I、J、S、XおよびZ投資証券では、販売報酬を支払わない。ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドのクラスC投資証券では、販売報酬を支払わない。当該報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき(該当する場合、英文目論見書のアペンディクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号)に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。

当社は、損益および純資産変動計算書において詳述されているとおり、販売報酬を支払う。2023年2月28日現在の未払販売報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

6. 年次サービス料

当社は年次サービス料を運用会社に支払っている。

年次サービス料の水準は、運用会社との合意に基づく取締役の裁量によって変更される場合があり、当社が発行する様々なファンドと投資証券クラスのそれぞれに異なる比率で適用されることになる。ただし、取締役と運用会社の間で、現在支払われている年次サービス料の上限を年率0.25%とすることが合意されている。年次サービス料は、該当する投資証券クラスの純資産価額に基づき（該当する場合、英文目論見書のアペンディクスBの17.3項（訳注：原文の参照番号）に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している）、毎日発生し、毎月支払われる。

取締役および運用会社は、各ファンドの市場部門および競合他社と比較したファンドの業績といった複数の基準を考慮に入れ、ファンドの投資家が入手可能な類似する投資商品の市場全体について比較した場合に各ファンドの継続的経費（ongoing charge）が確実に競争優位性を保てることを目標とした料率で、年次サービス料の水準を設定している。

継続的経費（ongoing charge）は、投資証券クラスごとの総費用（銀行利息、取引費用および金融資産に係るマイナス利回りの費用を除き、年次サービス料補助金を含む）を各投資証券クラスの平均純資産で除した額に基づいて計算され、パーセンテージで表示される。

アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド、チャイナ・イノベーション・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、ESGシステムティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ファンド、ヨーロピアン・フォーカス・ファンド、ヨーロピアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド、フィンテック・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド、ニュートリション・ファンド、サステイナブル・アジアン・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、サステイナブル・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、システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド、システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド、システムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド、USドル・ボンド・ファンドおよびUSサステイナブル・エクイティ・ファンドの継続的経費（ongoing charge）は、損益および純資産変動計算書の年次サービス料と相殺される差額に上限が定められている。

年次サービス料は、預託報酬、販売報酬、有価証券貸付手数料、借入金から生じるすべての手数料（疑義を避けるために明記すると、貸し手に支払う可能性のあるコミットメント報酬を含む。）、欧州連合（以下「EU」という。）および非EUの源泉徴収税還付請求に関連する費用とその税金またはその利息、ならびに投資レベルまたは会社のレベルで課される税金を除き、当社が負担したすべての固定および変動の営業費用および管理費に充てる目的で運用会社が使用する。

当社は、欧州連合の源泉徴収税還付請求に関連する専門家費用を支払っている。源泉徴収税還付請求に関連するすべての費用は該当ファンドに均等かつ公正に配分される。当社のEUにおける（当社が支払った）源泉徴収税還付請求は今まで認められる確率が高く、非EUの源泉徴収税還付請求に関連する費用に

については年次サービス料から負担されなくなり、現在では当社が支払い、該当ファンドに均等かつ公正に配分されている。

また、年次サービス料は、監査ならびに投資家による報告およびその他の税金に係る順守事項に関連するサービスに対してアーンスト・アンド・ヤング S.A. に支払われる報酬に充てるために使われる。

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

運用会社は、ファンドの継続的経費(ongoing charge)の競争優位性を確実に維持するという財務リスクを負っている。したがって、すべての期間において当社が運用会社に支払った年次サービス料の金額のうち、期中に発生した実際の費用を超える額について運用会社は返還する義務を負わず、一方で期中に発生した実際の費用のうち、当社が運用会社に支払った年次サービス料を超える額については、運用会社または他のブラックロック・グループ会社が負担しなければならない。

ブラックロック・グループの従業員でない取締役は、遂行した役務の対価として報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員でない当社の取締役は、税込みで年間55,000ユーロから60,000ユーロの範囲の報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員である取締役は、取締役報酬を受ける権利を有していない。

特定の管轄地域に適用される税金も、ファンドに直接請求される(注記8参照)。

年次サービス料は、損益および純資産変動計算書において開示されている。

2023年2月28日現在の未払年次サービス料は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

7. 預託報酬

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

預託報酬はファンドに直接請求される。2023年2月28日現在の未払保管および預託報酬は純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

8. 税金

ルクセンブルグ

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

い。2023年2月28日に終了した期間において、ルクセンブルグの税金に関連して29,588,003米ドルが費用計上された。

ベルギー

当社は金融市場に関する2012年8月3日法第154条に基づき、ベルギーの金融サービス市場機構に登録されている。ベルギーにおいて一般向け販売のために登録されたファンドには、前年の12月31日現在、ベルギーの仲介業者を通じてベルギーで販売された口数の純資産価額に対して年率0.0925%の税金が課される。この税金は、毎年3月に支払われる。

英国

報告型ファンド(Reporting Funds)

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

<http://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>より入手可能である。

その他の取引税

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

源泉徴収税

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

9. 投資顧問会社

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

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

「BAMNA」という。)およびブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(以下「BLKAUS」という。)

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ドラゴン・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BSL	-
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BSL、 BIMLLC	BAMNA、 BLKAUS
アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
チャイナ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA
チャイナ・ファンド	BIMUK	BAMNA
チャイナ・インパクト・ファンド*	BIMUK	BAMNA
チャイナ・イノベーション・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	BSL	-
サーキュラー・エコノミー・ファンド	BIMUK	-
クライメイト・アクション・エクイティ・ファン*	BIMUK	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド*	BIMUK	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	BIMUK	-
ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ ファンド*	BIMUK	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、 BSL	BAMNA、 BIMAL
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・ファンド ⁽²⁾	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFMLLC	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファン ド	BIMUK、BSL、BFM	BAMNA
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・モデルート・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGグローバル・コンサパティブ・インカム・ファンド*	BFM、BIMUK	-
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド*	BIMUK、BIMLLC、 BSL、BFM	BAMNA
ESGマルチアセット・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BFM、BSL	BIMAL
ESGシステムティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ ファンド ⁽²⁾	BIMLLC、BIMUK、 BFM	-
ユーロ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	BIMUK	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・マーケッツ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュウ・ファンド	BIMUK	-
フィンテック・ファンド	BIMUK	-
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BLKAUS
フューチャー・コンシューマー・ファンド*	BIMUK	-
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC、BSL	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	BIMAL
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	-
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、 BSL	BAMNA、 BIMAL
インパクト・ボンド・ファンド ⁽¹⁾ *	BIMUK、BFM	-
インドア・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA、 BLKJap
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・ オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	BLKJap
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
マルチテマ・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-
ニュートリション・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド*	BSL	-
サステイナブル・エマージング・マーケッツ・ブレンデッド・ボ ンド・ ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケッツ・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケッツ・コーポレート・ボ ンド・ ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケッツ・ローカル・カレン シー・ ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・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*	BIMUK、BSL、BFM	BLKAUS

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド ^{(1)*}	BIMUK、BIMLLC、 BSL	-
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・グローバル・インフラストラクチャー・ ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BLKAus
サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド ⁽²⁾	BIMUK、BFM、BSL	BIMAL
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・ オポチュニティーズ・ファンド ⁽³⁾	BIMUK	-
システマティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ ファンド	BIMLLC	-
システマティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ ファンド	BIMUK	-
システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アン ド・グロース・ファンド ^{(1)*}	BIMUK、BFM	-
システマティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャ ップ・ファンド ⁽²⁾	BIMLLC	-
ユナイテッド・キングダム・ファンド	BIMUK	-
USベーシック・バリュー・ファンド	BIMLLC	-
USDollar・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
USDollar・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BFM	-
USDollar・リザーブ・ファンド	BFM	-
USDollar・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BFM	-
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	BFM	-
USグロース・ファンド	BIMLLC	-
USミッドキャップ・バリュー・ファンド	BIMLLC	-
USサステイナブル・エクイティ・ファンド [*]	BIMLLC	-
ワールド・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ゴールド・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	BIMLLC	-
ワールド・マイニング・ファンド	BIMUK	-
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BIMAL
ワールド・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-

* 当該ファンドは香港では認可されておらず、2023年2月28日現在、香港では一般に公開されていない。

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 一時的に停止されたたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(3) 販売中止になったファンド。詳細については注記1を参照のこと。

10. 関連当事者との取引

運用会社、主販売会社、投資顧問会社および副投資顧問会社の最終的な持株会社は、米国デラウェア州で設立されたブラックロック・インクである。当期において、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社または当社の取締役の関連当事者であるブローカーを通じて当社に影響を及ぼす取引はなかった。当期において当社は、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社または当社の取締役、もしくはこれらの関連当事者との間で、これらが本人となる取引を行わなかった。

投資顧問会社、または共通管理・支配により投資顧問会社と関係している会社、もしくは実質的な直接・間接保有により投資顧問会社と関係している会社が直接または委任により管理するその他のUCITSおよび/またはその他の集団投資事業(以下「UCI」という。)のユニットに当ファンドが投資している場合、かかるその他のUCITSおよび/またはUCIのユニットに対する投資について、当社は発行手数料または買戻し手数料を請求されることはない。当ファンドは、可能な場合、投資運用報酬の対象ではないクラスX投資証券に投資する。これらの投資は、当ファンドの投資有価証券明細表において「~」と示されている。

ファンドがその純投資の大部分をその他のUCITSおよび/またはその他のUCIに投資している場合、投資顧問会社は、当該ファンドに対して費用計上された投資運用報酬合計(パフォーマンス報酬がある場合は、それを除く。)(当該ファンドが投資しているその他のUCITSおよびUCIからの投資運用報酬を含む。)が当該ファンドの純資産価額の1.50%を超過しない旨保証する。

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

当期末において、当社の取締役であるキース・サルダニャが、以下の投資証券を保有していた。

ファンド	投資証券クラス	投資証券口数	金額
チャイナ・ボンド・ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	493	4,255英ポンド
チャイナ・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	593	8,219ユーロ
フューチャー・オブ・トランスポート・ ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報 告型投資証券	644	8,894英ポンド
ネクスト・ジェネレーション・ テクノロジー・ファンド	クラスD無分配投資証券	1,228	17,646米ドル
サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	409	5,697英ポンド
ワールド・マイニング・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	82	3,856英ポンド

他の取締役による当ファンドの投資証券の保有はなかった。

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

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

ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドは、ブラックロック(チャネル・アイランズ)リミテッドに一部の管理事務代行を任命した。

ファンドの中にはクロス・インベストメント・テクニクを使用しているものもあり、ファンドがアンブレラ構造の他のファンドに投資することを意味している。

結合後の純資産計算書と結合後の損益および純資産変動計算書は、クロス・インベストメントの影響を排除するために調整されていない。

2023年2月28日現在、以下のファンドは、当ファンドの投資有価証券明細表において「 」と示されているとおり、クロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.14%に相当する。

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	通貨	時価	純資産比率 (%)
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・ボンド・ファンド	米ドル	3,291,093	4.74
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	米ドル	5,063,031	0.16
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	7,866,567	0.27
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	49,350,600	5.09
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	米ドル	26,800	0.02
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	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	19,388,733	0.25
グローバル・アロケーション・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	32,662,700	0.22
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	37,878,157	0.73
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サークュラー・エコノミー・ファンド	米ドル	18,088,394	9.99
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フィンテック・ファンド	米ドル	7,071,459	3.91
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フェチャー・オブ・トランスポート・ファンド	米ドル	3,646,744	2.01
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	1,811,140	1.00
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ニュートリション・ファンド	米ドル	5,410,155	2.99
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	27,155,597	14.99
サステイナブル・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	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	ユーロ	1,870,162	0.36

2023年2月28日に終了した期間において、預託銀行の関連当事者である、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌビイは、外国為替取引および通貨管理/ヘッジ・プログラムにおける当ファンドの保管銀行であった。これらの取引に関連して支払った手数料合計は6,499,770米ドルであり、平均手数料率は0.15bpsであった。預託銀行の関連当事者との総取引価額は4,300億米ドルであり、当ファンドが行ったこれら取引の合計価額の73%を占める。預託銀行の関連当事者との取引はすべて、通常の業務過程において標準的な取引条件に基づいて行われた。

その他の払戻し

当会計期間において当社の一部のファンドは、証券決済の遅延に伴い証券決済機関から当ファンドに課された課徴金について、ブラックロック・グループの関連会社から払戻しを受けた。当会計期間において

当ファンドが受取った当該払戻しは、損益および純資産変動計算書の「その他の払戻し」にて開示されている。

11. コミッションの使用

適用される規制により認められている場合(疑義を避けるために明記すると、MIFIDの対象ファンドを除く。)、ファンドの投資顧問会社を務めているブラックロック・グループの一部の会社は、一定の管轄区域の特定のブローカーと株式を取引するときに発生するコミッションを受け取ることができる。コミッションは適格なリサーチ・サービスを購入するために再配分することができる。リサーチに資金提供した人だけでなく広範な顧客もリサーチの利用が可能のため、かかる取り決めにより1つのファンドだけでなく他のファンドも恩恵を受けることができる。ブラックロック・グループは、適格なサービスのみを購入し、過度のコミッションは適格なサービス提供者に再配分する(該当があれば)ようにするため、コミッションの使用に関する方針を設定している。当期に締結したソフト・ダラー契約はなかった。

12. デリバティブ商品

当ファンドは、英文目論見書に詳述されているとおり、デリバティブ商品を売買することがある。2023年2月28日現在において保有しているデリバティブ商品についてはファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

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

当ファンドが担保として差入れた、または保証として引渡した有価証券は当ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当該有価証券はファンドの投資有価証券明細表において「†」と示されており、2023年2月28日現在、その評価額は587,923,074米ドルである。

システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンドについて、売建コール・オプションの担保は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド、メリルリンチ・インターナショナルおよびバンク・オブ・ニューヨーク・メロン(インターナショナル)リミテッドの三者間契約に基づき差入れられる。担保はファンドの投資有価証券明細表において「^」と示されており、2023年2月28日現在、その評価額は67,508,395米ドルである。

ファンドが保証として受取った有価証券の詳細は、以下の表のとおりである。2023年2月28日現在、これらの有価証券の評価額は3,170,900米ドルである。

ファンド	額面金額	銘柄	通貨	評価額 (単位:米ドル)
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	1,503,000	United States Treasury Note/Bond 0.5% 28/2/2026	米ドル	1,299,432
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	1,454,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 31/1/2024	米ドル	1,399,986
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	349,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/3/2028	米ドル	295,677
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	71,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 31/12/2023	米ドル	69,601
サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	122,000	United States Treasury Note/Bond 0.25% 30/9/2025	米ドル	106,204

14. 現金担保

当ファンドは様々な取引相手とデリバティブの取引を行っている。デリバティブの取引相手は、投資有価証券明細表に示されている。デリバティブの取引相手は以下のとおりである。オーストラリア・ニュージーランド銀行、バンク・オブ・アメリカ、パークレイズ、BNPパリバ、BNYメロン、シティバンク、シティグループ、クレディ・スイス、コモンウェルス・バンク・オブ・オーストラリア、ドイツ銀行、ゴールドマン・サックス、香港上海銀行、JPモルガン、モルガン・スタンレー、野村、RBS、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、ソシエテ・ジェネラル、スタンダードチャータード銀行、ステート・ストリート、トロント・ドミニオン、UBSおよびウエストパックである。スワップ契約、CFD、先物取引、売建オプション(プットおよびコール)、買建オプション(プットおよびコール)およびスワップに係る担保/証拠金について、取引相手が当社へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が支払われ、当社が取引相手へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が受取られる。「ブローカーに対する債権」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよび様々な取引相手に支払った現金担保からなる。「ブローカーに対する債務」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよび様々な取引相手から受取った現金担保からなる。先物取引の「ブローカーに対する債権」は、純資産計算書の「銀行預金」の一部を、また先物取引の「ブローカーに対する債務」は純資産計算書の「当座借越」の一部を構成する。

2023年2月28日現在の保有CFD、スワップ契約および店頭オプション取引に関連するブローカーからの/(に対する)現金担保残高は、以下の表のとおりである。先物取引現金残高は、ブローカーが保有する現金に関連しており、2023年2月28日現在、証拠金要件を満たすために一部使用されている。

ファンド	通貨	ブローカー からのCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
アジア・グロース・リーダーズ・ ファンド	米ドル	-	-	13	-
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファン ド	米ドル	17,892,351	(3,058,927)	1,234,000	(380,279)
アジア・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	299,902	-	141,585	(20)
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	18,562,474	(2,502,577)	278,293	(5)
チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民幣	14,144,964	(25,575,682)	86,992,067	(2,930,563)
チャイナ・ファンド	米ドル	2,610,000	-	-	-
チャイナ・インパクト・ファンド	米ドル	-	-	7	-
チャイナ・オンショア・ボンド・ファン ド(1)	オフショア 中国人民幣	-	-	1,263,656	-
クライメイト・アクション・マルチアセ ット・ファンド	ユーロ	-	-	409,903	(38,000)
コンチネンタル・ヨーロッパ・ フレキシブル・ファンド	ユーロ	-	-	1,687,807	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファン ド	米ドル	-	-	17,498,737	-
エマージング・ヨーロッパ・ファン ド(1)	ユーロ	-	-	-	(4)
エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	米ドル	3,839	(6,740,000)	3,832,000	(1,276,813)
エマージング・マーケット・コーポレ ート・ボンド・ファンド	米ドル	-	(5,060,000)	295,000	(11,318)
エマージング・マーケット・エクイティ・ インカム・ファンド	米ドル	-	-	446,840	-
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	7,140,000	(240,000)	1,714,801	-
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	4,057,417	(3,577,428)	1,434,057	-
エマージング・マーケット・サステイナ ブル・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	67,093	-
ESGグローバル・コンサバティブ・イン カム・ファンド	ユーロ	-	-	3,778,206	-
ESGグローバル・マルチアセット・イン カム・ファンド	米ドル	-	-	1,257,414	(338,805)
ESGマルチアセット・ファンド	ユーロ	26,300,000	(6,280,000)	51,807,875	(87,770)
ESGシステムティック・マルチ・アロー ケーション・クレジット・ファンド(2)	米ドル	-	-	190,531	(30,128)
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	7,435,608	(1,662,807)	25,429,045	(237,094)
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファン ド	ユーロ	65,625,832	(7,933,085)	5,965,631	(2,100,226)
ユーロ・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	ユーロ	11,844,720	(992,330)	20,529,981	(334,673)
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	ユーロ	1,203,000	(36,723)	8,410	-
フィクسد・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	151,069,058	(13,067,634)	89,488,559	(10,169,054)
グローバル・アロケーション・ファン ド	米ドル	39,717,952	(20,690,103)	47,232,874	(2,430,229)
グローバル・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	2,553,405	(3,112,844)	7,646,291	(942,471)
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ ファンド	米ドル	-	-	3,213,390	(22,686)

ファンド	通貨	ブローカー からのCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
グローバル・ガバメント・ボンド・ ファンド	米ドル	2,296,388	(578,685)	5,578,597	(289,774)
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	5,393,000	(1,093,539)	2,536,695	(306,914)
グローバル・インフレーション・リンク ド・ ボンド・ファンド	米ドル	524,563	(42,071)	630,048	(133,431)
グローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	916,158	(14,640)	24,647,567	(691,346)
インバクト・ボンド・ファンド ⁽¹⁾	ユーロ	59,000	(20,641)	171,018	(114,270)
インドニア・ファンド	米ドル	-	-	3	-
サステイナブル・アジア・ボンド・ ファンド	米ドル	195,511	-	84,609	-
サステイナブル・エマージング・マーケッ ツ・ブレンデッド・ボンド・ファンド	米ドル	246,565	-	91,569	(12,226)
サステイナブル・エマージング・ マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	-	(2,611,076)	1,495,000	(509,266)
サステイナブル・エマージング・ マーケット・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	-	(660,000)	21,000	(632)
サステイナブル・エマージング・ マーケット・ローカル・カレンシー・ ボンド・ファンド	米ドル	1,687,657	(1,170,698)	380,808	-
サステイナブル・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	ユーロ	8,309,430	(900,035)	5,832,009	(983,008)
サステイナブル・グローバル・アローケー ション・ファンド ⁽¹⁾	米ドル	134,683	-	817,507	-
サステイナブル・グローバル・ボンド・ インカム・ファンド	米ドル	267,305	(13,185)	950,000	(208,103)
サステイナブル・ワールド・ボンド・ ファンド ⁽²⁾	米ドル	17,419,467	(590,489)	7,991,329	(82,743)
システムティック・チャイナ・A株式・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	-	-	1,164,468	(3)
システムティック・グローバル・ エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	173,800,833	(98,585)
システムティック・グローバル・サステイ ナブル・インカム・アンド・グロース・ ファンド ⁽¹⁾	米ドル	-	-	628,074	(426)
システムティック・サステイナブル・ グローバル・スモールキャップ・ファンド ⁽²⁾	米ドル	-	-	329,508	-
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	400,570	(475,884)	2,424,857	(226,486)
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	3,169,000	(682,065)	4,238,474	(186,424)
USドル・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	米ドル	1,569,945	(339,911)	6,472,677	(1,224,917)
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	480,000	-	-	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	4,750,000	-	-	-

- (1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (1) 一時的に停止されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (2) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

15. 配当金

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

ファンドが英国報告型であり報告収益が分配額を超過する場合は、当該剰余金がみなし配当金として処理され、投資家の税務上の立場に応じて課税されることになる。

分配型投資証券を発行するファンドについては、ファンドの種類により、配当金の支払頻度が決定される。配当金の支払に関する詳細については、英文目論見書に記載されている。

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

16. 信用供与

JPMorgan・チェース銀行・エヌ・エー(以下「JPMorgan」という。)によって設定された21.50億米ドルの信用供与により、当社は約定済み12.25億米ドルのトランシェにこれを利用することができる。信用供与枠の一部である12.25億米ドルが、2022年4月22日付の割当通知に基づき当ファンドに割り当てられる予定である。

当ファンドは、この信用供与枠を一時的な資金調達目的で利用し、その目的には、例えば、投資家からの買戻しの資金を含むがこれに限定されない。かかる信用供与枠からの引出に関連する利息や未使用枠の手数料は、関連するファンドの資産により支払われる。新規設定ファンドには自動的に信用枠が供与されないため、併合プロセスにより合算しなければならない。かかるプロセスにおいては、新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するため、特に信用供与者が必要なデューデリジェンスを行う。当期において新規設定ファンドは信用枠を供与されず、引出すこともなかった。さらに、信用供与者が必ずしも新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するとは限らず、また、信用枠は当ファンドと信用契約に参加しているその他のブラックロックのファンドとの間で(公正な配分で)使用可能かどうかにかかっているため、ファンドがかかる信用枠を使用することができるとは限らない。したがって、一部のファンドはかかる信用供与を受けない場合があり、それに関連する費用も発生しない。

この信用供与に関してローン・コミットメント・フィーが請求され、損益および純資産変動計算書において「ローン・コミットメント・フィー」の科目に含まれている。ローン・コミットメント・フィーは、未使用残高に対して0.10%で請求される。

2022年9月1日から2023年2月28日までの期間において使用した信用供与枠はなかった。

17. 下引受けに係る収益

当社は、保管銀行の同意のもと下引受契約を締結することがある。下引受契約により、当社は報酬と引き換えに他の引受人による投資に先立ち、投資証券発行が担保される。当期において、下引受契約に係る収益を受け取ったファンドはなかった。

18. 後発事象

2023年3月2日付で、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドが終了した。

2023年3月3日付で、ヴァシリキ・パチャトゥリディが当社の取締役会に任命された。

アペンディクス - 投資証券クラス

投資証券クラスの設定および再開

以下に開示されている設定日は、投資証券のファンドの各クラスにおける初回発行日を示している。当該設定日より前にクラスの販売開始が可能な場合がある。

設定日	ファンド	種類
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA オフショア中国人民元安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA オフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスI オフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスX オフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスX米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月7日	エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスS R米ドル毎月分配型投資証券
2022年9月7日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスD米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年9月14日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスXユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスSユーロ毎四半期総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスS米ドル毎四半期総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスSユーロ無分配投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスS米ドル無分配投資証券
2022年9月21日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスI英ポンド毎年分配英国報告型投資証券
2022年9月21日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスI英ポンド無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル毎四半期総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスD米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスI米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスX米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスZ I米ドル無分配英国報告型投資証券

設定日	ファンド	種類
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ毎年分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスA米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスDユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスD米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスEユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスI米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスX米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスZ I米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスZ Iユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスAユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスDユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスIユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスXユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスX米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスZユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスZ Iユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月12日	エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	クラスIユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・プレジデント・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・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Z Iユーロ無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・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Z I米ドル・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスZ I米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年10月19日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスZ I オフショア 中国人民元無分配投資証券
2022年10月19日	サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券

設定日	ファンド	種類
2022年10月19日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月19日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスZ Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2022年10月19日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスZ Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	ワールド・エネルギー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月19日	ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月19日	ワールド・ゴールド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	チャイナ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	USベシック・バリュー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・テクノロジー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスA 香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA 香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2022年11月23日	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年1月4日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスD米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2023年1月18日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年1月18日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年2月1日	アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ Iユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	デベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ Iユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	デベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ Iユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ I米ドル無分配投資証券

設定日	ファンド	種類
2023年2月1日	ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	USサステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	USサステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月15日	インパクト・ボンド・ファンド	クラスEユーロ無分配投資証券
2023年2月15日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券

発行済投資証券クラス

2023年2月28日現在、当社は以下の投資証券クラスを発行している。二つ以上の取引通貨があるファンドの場合、追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

クラスA

クラスA 毎年総収益分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA スイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 毎年分配型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスA 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	クラスA 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスA カナダ・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 毎日分配型投資証券	クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 毎日分配英国報告型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎日分配英国報告型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 毎月総収益分配型投資証券	クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 毎月分配型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA トータル・リターン分配型投資証券
クラスA カナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA カナダ・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA 英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA 香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA 米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA 豪ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA 基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期 総収益分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期 総収益分配型投資証券
クラスA米ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA無分配投資証券
クラスA毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスAスイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスAカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA毎四半期分配型投資証券	クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券
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	クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスA豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	クラスA香港ドル無分配投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA円ヘッジ無分配投資証券
クラスA英ポンド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	クラスAポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ無分配投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差 毎月総収益分配英国報告型投資証券	クラスA無分配英国報告型投資証券
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスA豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月 総収益分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスA I	
クラスA I 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA Iユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスA Iユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA I無分配投資証券
クラスA I 毎四半期分配型投資証券	クラスA Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスC	
クラスC 毎日分配型投資証券	クラスC 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスCユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券	クラスC 無分配投資証券
クラスC 毎月分配型投資証券	クラスCユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスC 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスC米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスCシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期 総収益分配型投資証券	クラスC 無分配英国報告型投資証券
クラスC 毎四半期分配型投資証券	
クラスD	
クラスD 毎年総収益分配型投資証券	クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型 投資証券	クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスDユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券	クラスD 毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD 毎年総収益分配英国報告型投資証券	クラスD 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
クラスD 毎年分配型投資証券	クラスD 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスD 英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスD 毎年分配英国報告型投資証券	クラスD 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスD 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスD 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスD 基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスD 毎月分配型投資証券	クラスD 無分配投資証券
クラスD 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスD 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスD ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスD 香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスD 毎月分配英国報告型投資証券	クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスD ユーロ・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスD 香港ドル無分配投資証券
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスD ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスD 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスD 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスD 無分配英国報告型投資証券
クラスD 毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスD ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD 毎四半期分配型投資証券	クラスD 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	
クラスE	
クラスE 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスE 無分配投資証券
クラスE ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスE 毎四半期分配型投資証券	クラスE 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスE ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスE ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスE ユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスE 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスE 安定毎月総収益分配型投資証券	クラスE 無分配英国報告型投資証券
クラスE 基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券	クラスE ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスE ユーロ・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券	
クラスI*	
クラスI 毎年総収益分配型投資証券	クラスI 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスI 毎年分配型投資証券	クラスI ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスI シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	クラスI 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI 基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスI 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI 無分配投資証券
クラスI 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI 毎月総収益分配型投資証券	クラスI ブラジル・レアル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI 毎月分配型投資証券	クラスI カナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI カナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスI スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスI 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスI円ヘッジ無分配投資証券
クラスI 毎四半期分配型投資証券	クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスI米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスI無分配英国報告型投資証券
クラスI 毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスIスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスI米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスJ [*]	
クラスJ 毎月分配型投資証券	クラスJ 無分配投資証券
クラスS	
クラスS 毎年分配型投資証券	クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスS英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスS英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスSシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスS 毎四半期分配型投資証券	クラスS無分配英国報告型投資証券
クラスS 毎四半期総収益分配型投資証券	クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS無分配投資証券	クラスSユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	クラスS英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS I	
クラスS I 無分配投資証券	クラスS I米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスS R	
クラスS R 毎年総収益分配英国報告型投資証券	クラスS Rユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	クラスS R香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスS Rシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスS R米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R 毎月分配型投資証券	クラスS R無分配投資証券
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	クラスS R無分配英国報告型投資証券
クラスS R英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスS Rユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS R安定毎月総収益分配型投資証券	クラスS R米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS R安定毎月総収益分配英国報告型投資証券	
クラスX [*]	
クラスX 毎年分配型投資証券	クラスX トータル・リターン分配型投資証券
クラスXユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスX無分配投資証券
クラスX 毎年分配英国報告型投資証券	クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎月分配型投資証券	クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券
クラスX毎四半期総収益分配英国報告型投資証券
クラスX毎四半期分配型投資証券
クラスXスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
クラスX豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
クラスX安定毎月総収益分配型投資証券
クラスXユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスX円ヘッジ無分配投資証券
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX無分配英国報告型投資証券
クラスX米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスZ

クラスZ無分配投資証券
クラスZスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスZ米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスZ無分配英国報告型投資証券
クラスZスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスZ I

クラスZ I米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
クラスZ I安定毎月総収益分配型投資証券
クラスZ I無分配投資証券
クラスZ Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスZ I米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスZ I無分配英国報告型投資証券
クラスZ Iユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

* 機関投資家が購入可能

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2023年3月末日前1年間におけるファンド証券の販売および買戻しの実績ならびに2023年3月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

クラスA 毎月分配型投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2022年4月1日～	3,778,178	10,253,481	14,577,441
2023年3月31日	(3,759,495)	(10,242,341)	(14,479,688)

(注1) ()内の数は、本邦外における販売、買戻しおよび発行済口数である。

(注2) 上記の各数値は、未決済の取引を含まず、また小数点以下を四捨五入して記載している。これらの理由により、上記の各数値が本書の中の他の箇所に記載された数値と一致しない場合がある。

クラスA 無分配投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2022年4月1日～	10,416,372	13,757,034	7,778,006
2023年3月31日	(10,416,372)	(11,135,463)	(6,568,571)

[次へ](#)

(2) その他の訂正

下線の部分は訂正箇所を示します。

第一部 証券情報

第1 外国投資証券(外国新投資口予約権証券及び外国投資法人債券を除く。)

(1) 外国投資法人の名称

<訂正前>

ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

(BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund)

(注) USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(以下「サブ・ファンド」ということがある。)は、アンブレラ・ファンドであるブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「ファンド」という。)のサブ・ファンドである。2022年12月29日現在、ファンドは、USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドを含む104個のサブ・ファンドにより構成されている。

<訂正後>

ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

(BlackRock Global Funds - US Dollar High Yield Bond Fund)

(注) USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド(以下「サブ・ファンド」ということがある。)は、アンブレラ・ファンドであるブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「ファンド」という。)のサブ・ファンドである。2023年3月末日現在、ファンドは、USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドを含む103個のサブ・ファンドにより構成されている。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

<訂正前>

日本

2023年2月末日現在、日本の投資主に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)

<訂正後>

日本

2023年5月末日現在、日本の投資主に対する課税については、以下のような取扱いとなる。

(後略)