

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2019年9月20日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
(愛称：BR Win)

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

(注) 本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー

(ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当り1円です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.24%^{*}（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

（販売会社につきましては、「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

なお、購入時手数料には消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が含まれています（以下同じ。）。

*消費税率が10%になった場合は、3.30%となります。

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

(6)【申込単位】

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

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

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

(7)【申込期間】

2019年9月21日から2020年3月19日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

振替受益権に係る各購入受付日の発行価額の総額は、販売会社によって追加信託が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

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

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度とは、

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、換金、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」（ファンドの愛称を「BR Win」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行いません。

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

<各分類および区分の定義>

．商品分類

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

．属性区分

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

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

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

ファンドの特色

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

主要投資対象ファンドの投資対象

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

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

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

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

■柔軟性の高い運用

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

■リスクコントロール

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

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

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

投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

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

d．原則として、毎月分配を行いません。

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

【イメージ図】



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

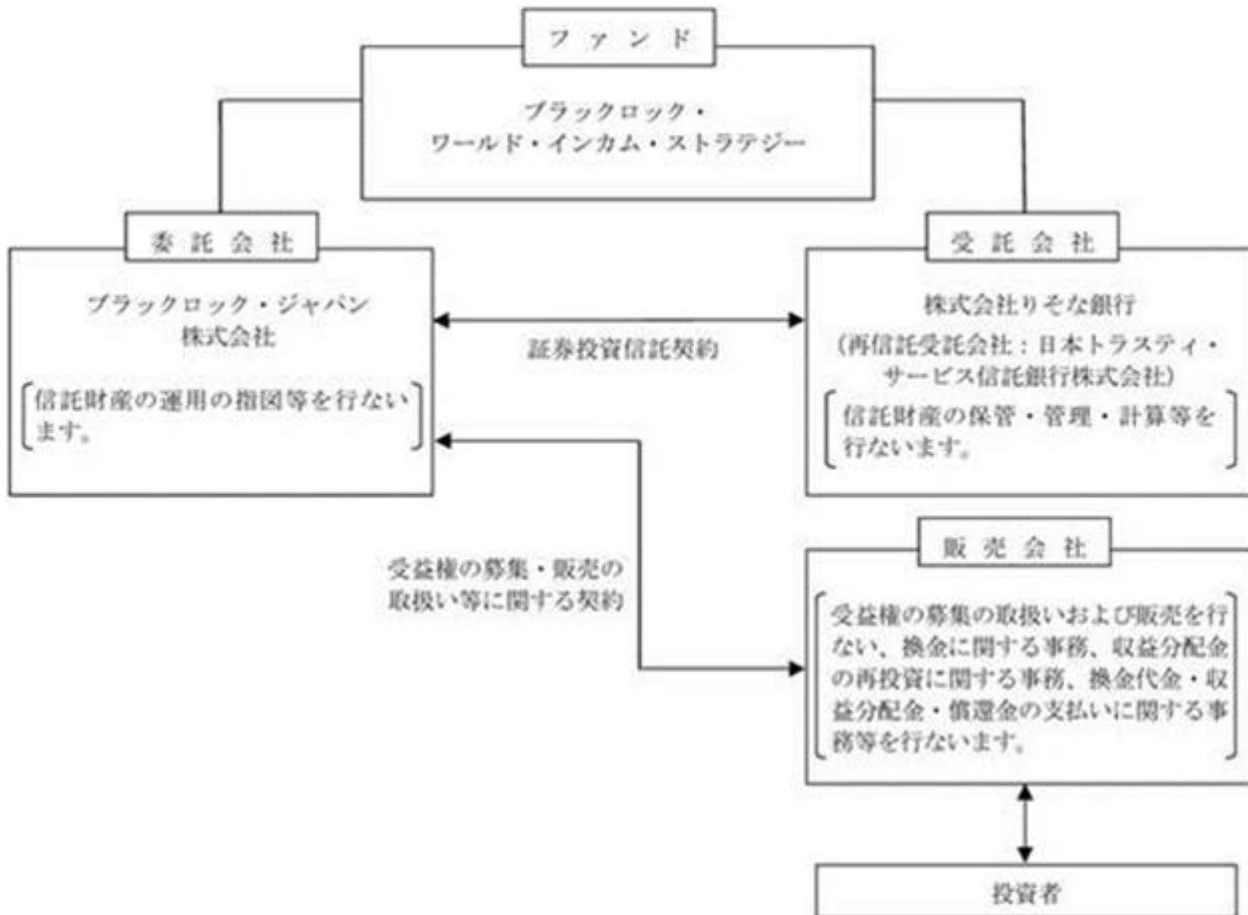
e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

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

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

2019年6月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a. 資本金 3,120百万円

b. 沿革

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

c. 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

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

(2)【投資対象】**投資対象とする資産の種類**

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

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

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

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

(b) BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

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

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

(3)【運用体制】

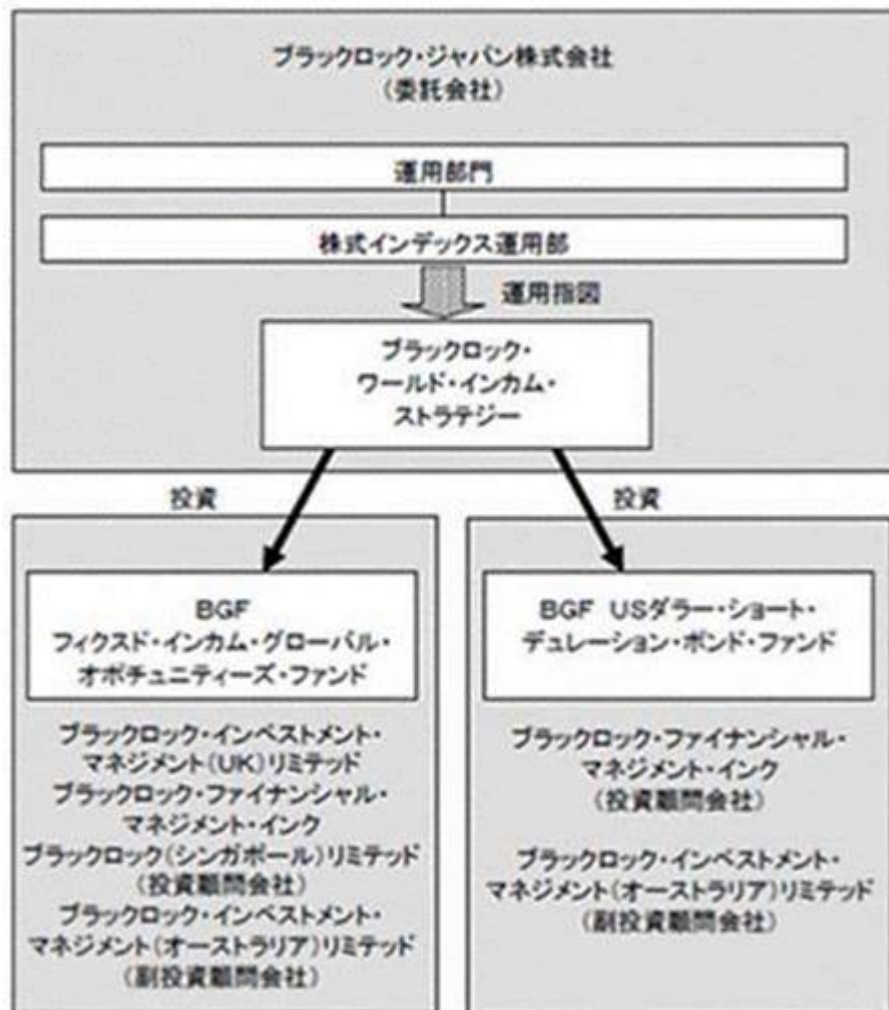
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

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

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

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

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

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



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約6.84兆ドル^{*}（約737兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

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

* 2019年6月末現在。(円換算レートは1ドル=107.74円を使用)

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

a. 分配対象額の範囲

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

b. 分配対象収益についての分配方針

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

c. 留保益の運用方針

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

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

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

b. 時効

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

収益分配金に関する留意事項

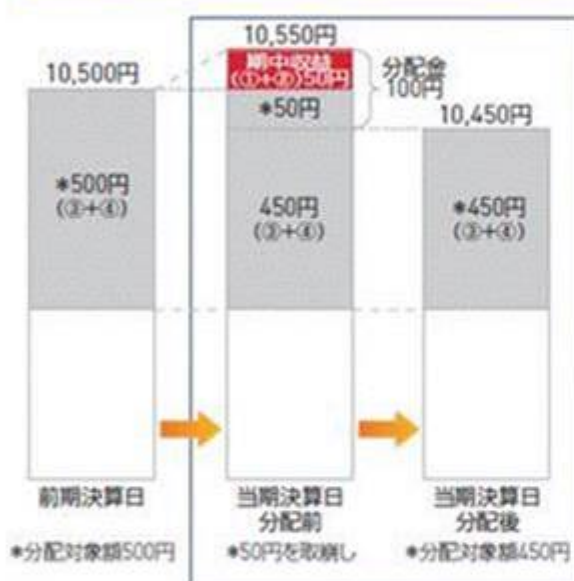
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



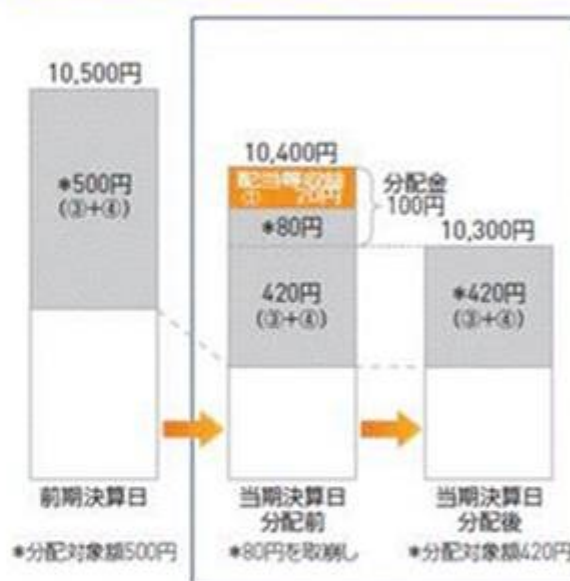
- 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

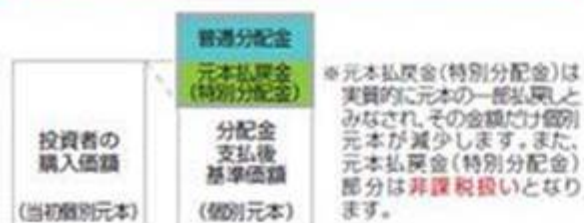


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

(5)【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

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

b．信用リスク

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

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

c．期限前償還リスク

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

d．為替変動リスク

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

e．カントリー・リスク

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

f．デリバティブ取引のリスク

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

ファンド運営上のリスク

a．購入および換金の受付の中止・取消

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

b．ファンドの繰上償還

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

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(2) リスクの管理体制

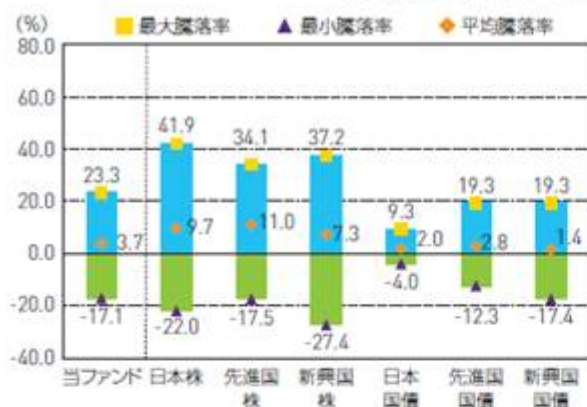
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2014年7月～2019年6月)



※上記グラフは、2014年7月～2019年6月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2014年7月～2019年6月)



※上記グラフは、2014年7月～2019年6月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

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

<各指数について>

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

^{*}消費税率が10%になった場合は、3.30%となります。

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

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

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

<消費税率が10%になった場合は以下の通りとします。>

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.584%（税抜1.44%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社との間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.715% (税抜0.65%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.825% (税抜0.75%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.044% (税抜0.04%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

*消費税率が10%になった場合は、年0.11%となります。

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

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

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

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

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

b. 法人の投資者に対する課税

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

上記は2019年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2019年6月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,815,642,910	99.26
内 ルクセンブルグ	1,815,642,910	99.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,449,481	0.74
純資産総額	1,829,092,391	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/ 地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,646,083	1,087.60	1,790,282,540	1,091.91	1,797,379,795	98.27
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX 投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	11,124	1,638.40	18,227,141	1,641.64	18,263,115	1.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.26

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

2019年6月末現在、同日前1年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第9特定期間	第46期(2009年7月21日)	16,459,175,020	16,522,406,387	0.7809	0.7839
	第47期(2009年8月20日)	16,539,085,565	16,601,108,801	0.8000	0.8030
	第48期(2009年9月24日)	16,495,357,752	16,557,085,526	0.8017	0.8047
	第49期(2009年10月20日)	16,368,225,399	16,429,411,038	0.8026	0.8056
	第50期(2009年11月20日)	15,855,289,033	15,915,097,990	0.7953	0.7983
	第51期(2009年12月21日)	15,727,275,360	15,786,916,559	0.7911	0.7941
第10特定期間	第52期(2010年1月20日)	15,879,099,243	15,938,976,920	0.7956	0.7986
	第53期(2010年2月22日)	15,622,514,310	15,682,374,624	0.7829	0.7859
	第54期(2010年3月23日)	15,153,523,145	15,211,297,623	0.7869	0.7899
	第55期(2010年4月20日)	14,712,789,821	14,767,653,188	0.8045	0.8075
	第56期(2010年5月20日)	14,149,503,857	14,203,706,884	0.7831	0.7861
	第57期(2010年6月21日)	13,688,423,551	13,724,013,776	0.7692	0.7712
第11特定期間	第58期(2010年7月20日)	11,953,075,578	11,984,914,441	0.7508	0.7528
	第59期(2010年8月20日)	11,308,909,494	11,339,059,482	0.7502	0.7522
	第60期(2010年9月21日)	10,792,419,166	10,821,365,833	0.7457	0.7477
	第61期(2010年10月20日)	9,719,515,608	9,733,187,683	0.7109	0.7119
	第62期(2010年11月22日)	8,197,751,787	8,209,183,400	0.7171	0.7181
	第63期(2010年12月20日)	7,552,878,249	7,563,501,906	0.7109	0.7119
第12特定期間	第64期(2011年1月20日)	7,099,765,359	7,109,923,367	0.6989	0.6999
	第65期(2011年2月21日)	6,740,300,864	6,749,866,393	0.7046	0.7056
	第66期(2011年3月22日)	6,459,285,013	6,468,682,205	0.6874	0.6884
	第67期(2011年4月20日)	6,064,782,117	6,073,395,050	0.7041	0.7051
	第68期(2011年5月20日)	5,829,780,579	5,838,139,774	0.6974	0.6984
	第69期(2011年6月20日)	5,472,705,804	5,480,744,958	0.6808	0.6818
第13特定期間	第70期(2011年7月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年8月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年9月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
第14特定期間	第76期(2012年1月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年2月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年3月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年4月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年5月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(2012年6月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(2012年7月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年8月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年9月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第16特定期間	第88期(2013年1月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年2月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年3月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年4月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年5月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年6月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年7月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年8月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年9月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471
第18特定期間	第100期(2014年1月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年2月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年3月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年4月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年5月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年6月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412
第19特定期間	第106期(2014年7月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年8月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年9月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954
第20特定期間	第112期(2015年1月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年2月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年3月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年4月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年5月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年6月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年7月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年8月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年9月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722
第22特定期間	第124期(2016年1月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年2月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年3月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年4月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年5月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年6月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
第23特定期間	第130期(2016年7月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年8月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年9月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第24特定期間	第136期(2017年1月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年2月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年3月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年4月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年5月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年6月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年7月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年8月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年9月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年1月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年2月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年3月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年4月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年5月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年6月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
第27特定期間	第154期(2018年7月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年8月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年9月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596
第28特定期間	第160期(2019年1月21日)	1,573,860,687	1,577,219,906	0.9370	0.9390
	第161期(2019年2月20日)	1,607,828,729	1,611,202,149	0.9532	0.9552
	第162期(2019年3月20日)	1,652,695,868	1,656,126,642	0.9635	0.9655
	第163期(2019年4月22日)	1,797,871,043	1,801,571,397	0.9717	0.9737
	第164期(2019年5月20日)	1,785,780,207	1,789,524,700	0.9538	0.9558
	第165期(2019年6月20日)	1,821,290,712	1,825,152,093	0.9433	0.9453
	2018年6月末現在	1,480,742,419		0.9593	
	2018年7月末現在	1,474,542,440		0.9634	
	2018年8月末現在	1,478,542,859		0.9624	
	2018年9月末現在	1,491,234,339		0.9803	
	2018年10月末現在	1,438,290,221		0.9709	
	2018年11月末現在	1,420,652,398		0.9674	
	2018年12月末現在	1,625,243,792		0.9450	
	2019年1月末現在	1,575,747,592		0.9343	
	2019年2月末現在	1,611,434,089		0.9548	
	2019年3月末現在	1,750,055,984		0.9612	
	2019年4月末現在	1,796,733,966		0.9704	
	2019年5月末現在	1,754,339,050		0.9483	
	2019年6月末現在	1,829,092,391		0.9467	

【分配の推移】

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第9特定期間	第46期	0.0030
	第47期	0.0030
	第48期	0.0030
	第49期	0.0030
	第50期	0.0030
	第51期	0.0030
第10特定期間	第52期	0.0030
	第53期	0.0030
	第54期	0.0030
	第55期	0.0030
	第56期	0.0030
	第57期	0.0020
第11特定期間	第58期	0.0020
	第59期	0.0020
	第60期	0.0020
	第61期	0.0010
	第62期	0.0010
	第63期	0.0010
第12特定期間	第64期	0.0010
	第65期	0.0010
	第66期	0.0010
	第67期	0.0010
	第68期	0.0010
	第69期	0.0010
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010

特定期間	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
	第111期	0.0020
第20特定期間	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020
第28特定期間	第160期	0.0020
	第161期	0.0020
	第162期	0.0020
	第163期	0.0020
	第164期	0.0020
	第165期	0.0020

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第9特定期間	第46期	0.3
	第47期	2.8
	第48期	0.6
	第49期	0.5
	第50期	0.5
	第51期	0.2
第10特定期間	第52期	0.9
	第53期	1.2
	第54期	0.9
	第55期	2.6
	第56期	2.3
	第57期	1.5
第11特定期間	第58期	2.1
	第59期	0.2
	第60期	0.3
	第61期	4.5
	第62期	1.0
	第63期	0.7
第12特定期間	第64期	1.5
	第65期	1.0
	第66期	2.3
	第67期	2.6
	第68期	0.8
	第69期	2.2
第13特定期間	第70期	1.8
	第71期	0.8
	第72期	0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	2.4
	第80期	3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	8.2
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	1.1
	第96期	1.1
	第97期	1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	0.1
	第101期	1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	0.7
	第105期	1.0

特定期間	計算期間	収益率(%)
第19特定期間	第106期	0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	2.3
	第110期	10.9
	第111期	1.4
第20特定期間	第112期	1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	1.5
	第116期	1.4
	第117期	0.8
第21特定期間	第118期	1.5
	第119期	0.9
	第120期	3.5
	第121期	0.3
	第122期	2.8
	第123期	1.9
第22特定期間	第124期	3.8
	第125期	4.7
	第126期	0.3
	第127期	2.0
	第128期	0.9
	第129期	4.8
第23特定期間	第130期	2.5
	第131期	4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
	第135期	5.9
第24特定期間	第136期	1.0
	第137期	1.6
	第138期	0.1
	第139期	3.0
	第140期	2.4
	第141期	0.8
第25特定期間	第142期	0.5
	第143期	2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	0.8
	第147期	1.2
第26特定期間	第148期	1.0
	第149期	3.6
	第150期	1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	1.0
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	1.8
	第156期	1.5
	第157期	0.2
	第158期	0.1
	第159期	0.4
第28特定期間	第160期	1.9
	第161期	1.9
	第162期	1.3
	第163期	1.1
	第164期	1.6
	第165期	0.9

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

(4)【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第9特定期間	第46期	507,272,981	810,590,053	21,077,122,586
	第47期	402,163,674	804,874,200	20,674,412,060
	第48期	261,021,385	359,508,696	20,575,924,749
	第49期	281,412,125	462,123,684	20,395,213,190
	第50期	65,330,184	524,224,140	19,936,319,234
	第51期	720,753,964	776,673,457	19,880,399,741
第10特定期間	第52期	389,853,324	311,027,231	19,959,225,834
	第53期	494,786,499	500,574,086	19,953,438,247
	第54期	105,146,141	800,424,828	19,258,159,560
	第55期	88,919,025	1,059,289,288	18,287,789,297
	第56期	196,668,494	416,781,804	18,067,675,987
	第57期	91,237,133	363,800,184	17,795,112,936
第11特定期間	第58期	144,954,930	2,020,636,276	15,919,431,590
	第59期	79,936,100	924,373,465	15,074,994,225
	第60期	14,236,783	615,897,181	14,473,333,827
	第61期	31,216,474	832,474,826	13,672,075,475
	第62期	6,877,197	2,247,339,525	11,431,613,147
	第63期	14,242,171	822,197,553	10,623,657,765
第12特定期間	第64期	5,601,819	471,251,409	10,158,008,175
	第65期	5,496,284	597,974,968	9,565,529,491
	第66期	503,609,038	671,945,971	9,397,192,558
	第67期	5,663,077	789,922,129	8,612,933,506
	第68期	4,611,140	258,349,047	8,359,195,599
	第69期	4,949,469	324,990,364	8,039,154,704
第13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066

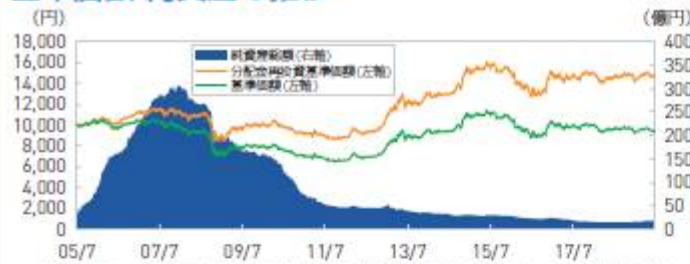
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252		1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	第160期	79,034,742	40,341,196	1,679,609,992
	第161期	7,100,270		1,686,710,262
	第162期	29,344,531	667,493	1,715,387,300
	第163期	159,526,725	24,736,827	1,850,177,198
	第164期	22,070,503	932	1,872,246,769
	第165期	104,913,835	46,469,726	1,930,690,878

(参考情報)

運用実績

2019年6月28日現在

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。
 ※ 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

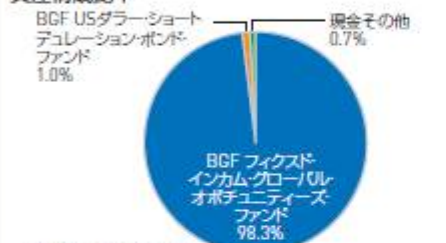
分配の推移

設定来累計		4,060円
直近1年間累計		240円
第161期	2019年2月	20円
第162期	2019年3月	20円
第163期	2019年4月	20円
第164期	2019年5月	20円
第165期	2019年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



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

組入上位10銘柄*(%)

銘柄名	比率
1 UMBS 30YR TBA(REG A)	2.4
2 INDIA (REPUBLIC OF) 7.17 01/08/2028	1.6
3 TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	1.4
4 FRANCE (REPUBLIC OF) 1.5 05/25/2050	0.9
5 JAPAN (GOVERNMENT OF) 10YR #24 0.1 03/10/2029	0.6
6 JAPAN (GOVERNMENT OF) 10YR #23 0.1 03/10/2028	0.6
7 CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 3.29 10/18/2023	0.5
8 WELLS FARGO & COMPANY MTN 3.75 01/24/2024	0.5
9 TREASURY (CPI) NOTE 0.625 04/15/2023	0.5
10 FGOLD 30YR 4% HLB 150K 2016	0.5

債券種別構成比率*(%)

債券	比率
国債	58.9
証券化商品	23.4
投資適格社債	15.7
新興国債	13.9
ハイ・イールド債	10.2
政府系モーゲージ	7.2
現金等	6.1
地方債	5.6

※ 主要投資対象ファンドはデリバティブ取引を活用するため、合計が100%を超える場合があります。

通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国・ドル	94.4
中国・人民元	2.1
日本・円	1.5
インドネシア・ルピア	1.0
メキシコ・ペソ	0.9
その他	3.5
シンガポール・ドル	-0.4
ユーロ	-0.6
オフショア・人民元	-2.5

※ 当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の運用状況です。(2019年6月末現在)
 比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

※ ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。
 ※ 当ファンドにはベンチマークはありません。



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

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

(2) 申込期間

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

(3) 受付時間

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

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

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

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

*消費税率が10%になった場合は、3.30%となります。

- b. 累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

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

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

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

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

(2) 換金不可日

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

(3) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(4) 換金受付の制限

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

(5) 換金代金の支払い

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

(6) 換金の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- c．a．およびb．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d．c．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e．d．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、a．およびb．のファンドの償還を行いません。
- f．委託会社は、当ファンドの償還をしないこととしたときは、償還しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- g．d．～f．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、d．の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
- h．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- i．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。
- j．i．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更d．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- k．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

信託約款の変更

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

運用報告書の作成

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

信託事務の委託

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

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

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

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

(4) 反対者の買取請求権

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

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(2018年12月21日から2019年6月20日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2018年12月20日現在)	当特定期間末 (2019年6月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,166	1,749
金銭信託	76,929,839	19,607,449
投資証券	1,522,837,317	1,808,509,682
派生商品評価勘定	19,629	-
流動資産合計	1,599,787,951	1,828,118,880
資産合計	1,599,787,951	1,828,118,880
負債の部		
流動負債		
未払金	23,265,975	-
未払収益分配金	3,281,832	3,861,381
未払解約金	-	447,478
未払受託者報酬	51,101	65,429
未払委託者報酬	1,788,880	2,290,296
その他未払費用	127,767	163,584
流動負債合計	28,515,555	6,828,168
負債合計	28,515,555	6,828,168
純資産の部		
元本等		
元本	1,640,916,446	1,930,690,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	69,644,050	109,400,166
(分配準備積立金)	224,146,397	212,884,419
元本等合計	1,571,272,396	1,821,290,712
純資産合計	1,571,272,396	1,821,290,712
負債純資産合計	1,599,787,951	1,828,118,880

(2)【損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	前特定期間 (自 2018年 6 月21日 至 2018年12月20日)	当特定期間 (自 2018年12月21日 至 2019年 6 月20日)
営業収益		
受取配当金	24,681,961	32,818,284
受取利息	6,133	20,364
有価証券売買等損益	25,589,618	47,105,830
為替差損益	32,204,140	71,818,836
営業収益合計	31,302,616	8,125,642
営業費用		
受託者報酬	317,536	363,494
委託者報酬	11,115,268	12,723,776
その他費用	1,075,011	1,234,145
営業費用合計	12,507,815	14,321,415
営業利益又は営業損失()	18,794,801	6,195,773
経常利益又は経常損失()	18,794,801	6,195,773
当期純利益又は当期純損失()	18,794,801	6,195,773
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	178,466	692,290
期首剰余金又は期首欠損金()	66,736,457	69,644,050
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,320,626	4,804,719
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,320,626	4,804,719
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,752,408	17,587,711
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,752,408	17,587,711
分配金	18,449,078	21,469,641
期末剰余金又は期末欠損金()	69,644,050	109,400,166

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

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

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (2018年12月20日現在)	当特定期間末 (2019年6月20日現在)
1 当該特定期間の末日における受益権総数	1,640,916,446口	1,930,690,878口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 69,644,050円	元本の欠損 109,400,166円
3 1口当たり純資産額	0.9576円	0.9433円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自 2018年6月21日 至 2018年12月20日)
分配金の計算過程	<p>第154期計算期間(2018年6月21日～2018年7月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,694,367円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(90,919,261円)、分配準備積立金(247,684,633円)により、分配対象収益は342,298,261円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,085,061円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第155期計算期間(2018年7月21日～2018年8月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,141,109円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(89,768,459円)、分配準備積立金(243,659,827円)により、分配対象収益は335,569,395円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,032,448円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第156期計算期間(2018年8月21日～2018年9月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,671,234円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(95,411,972円)、分配準備積立金(242,444,623円)により、分配対象収益は341,527,829円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,080,870円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第157期計算期間(2018年9月21日～2018年10月22日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(1,727,962円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(93,789,082円)、分配準備積立金(238,031,223円)により、分配対象収益は333,548,267円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,020,545円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第158期計算期間(2018年10月23日～2018年11月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,272,770円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(91,778,971円)、分配準備積立金(230,845,742円)により、分配対象収益は324,897,483円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,948,322円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第159期計算期間(2018年11月21日～2018年12月20日) 当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,184,594円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(133,634,262円)、分配準備積立金(225,243,635円)により、分配対象収益は361,062,491円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,281,832円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

項目	当特定期間 (自 2018年12月21日 至 2019年 6月20日)
分配金の計算過程	<p>第160期計算期間(2018年12月21日～2019年 1月21日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,557,935円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(147,329,271円)、分配準備積立金(218,889,276円)により、分配対象収益は368,776,482円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,359,219円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第161期計算期間(2019年 1月22日～2019年 2月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,517,337円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(148,874,257円)、分配準備積立金(218,087,992円)により、分配対象収益は371,479,586円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,373,420円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第162期計算期間(2019年 2月21日～2019年 3月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,404,277円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(155,295,726円)、分配準備積立金(219,145,474円)により、分配対象収益は378,845,477円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,430,774円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第163期計算期間(2019年 3月21日～2019年 4月22日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,824,813円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(187,921,272円)、分配準備積立金(217,127,465円)により、分配対象収益は409,873,550円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,700,354円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第164期計算期間(2019年 4月23日～2019年 5月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,172,044円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(192,767,116円)、分配準備積立金(218,251,815円)により、分配対象収益は415,190,975円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,744,493円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p> <p>第165期計算期間(2019年 5月21日～2019年 6月20日)</p> <p>当期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,470,898円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(211,227,758円)、分配準備積立金(213,274,902円)により、分配対象収益は427,973,558円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,861,381円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (2018年12月20日現在)	当特定期間末 (2019年6月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1)有価証券 同左</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	前特定期間末 (2018年12月20日現在)	当特定期間末 (2019年6月20日現在)
期首元本額	1,543,528,354円	1,640,916,446円
期中追加設定元本額	231,723,860円	401,990,606円
期中一部解約元本額	134,335,768円	112,216,174円

2 有価証券関係

前特定期間末(2018年12月20日現在)

売買目的有価証券

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

当特定期間末(2019年6月20日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	19,298,751
合計	19,298,751

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前特定期間末（2018年12月20日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 アメリカドル	23,241,047	-	23,260,676	19,629
合計		23,241,047	-	23,260,676	19,629

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

当特定期間末(2019年6月20日現在)

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オパ チュニティーズ・ファンド クラスJ投資証 券	1,646,083.790	16,608,985.440	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ U Sダラー・ショート・デュレーション・ボ ンド・ファンド クラスX投資証券	11,124.910	169,098.630	
	アメリカドル	小計	1,657,208.700	16,778,084.070 (1,808,509,682)	
投資証券	合計			1,808,509,682 (1,808,509,682)	
合計				1,808,509,682 (1,808,509,682)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラス」投資証券」及び「ブラックロック・グローバル・ファンズ USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)同ファンドは、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、同ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2018年8月31日に終了する計算期間(2017年9月1日から2018年8月31日まで)に係る財務書類であります。

(2)当該財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2018年8月31日現在の財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

純資産計算書 2018年8月31日現在

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資産			
投資有価証券 - 取得原価		10,664,072,180	1,981,469,735
未実現評価損		(127,256,907)	(26,652,493)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	10,536,815,273	1,954,817,242
銀行預金	2 (a)	1,133,211,059	5,536,021
ブローカーに対する債権	15	37,550,561	598,000
未収利息および未収配当金	2 (a)	78,174,885	9,344,942
売却投資有価証券未収金	2 (a)	4,894,945,724*	12,053,587*
販売投資証券未収金	2 (a)	11,358,946	2,452,297
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	84,029,693	477,932
差金決済契約	2 (c)	12,998	-
事後通告証券契約の時価	2 (c)	-	77,333,026
スワップの時価	2 (c)	24,892,786	2,721,009
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	115,613,406	186,498
その他の資産	2 (a, c)	10,820	-
資産合計		16,916,616,151	2,065,520,554
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	92,915	-
ブローカーに対する債務	15	61,206,121	3,188,392
未払収益分配金	2 (a)	3,270,675	188,934
購入投資有価証券未払金	2 (a)	4,278,477,952*	89,080,400*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	3,498,601	3,557,058
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	1,557,799	63,290
事後通告証券契約の時価	2 (c)	626,772,967	-
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	90,796,960	-
その他の負債	5, 6, 7, 8	21,068,394	1,214,539
負債合計		5,086,742,384	97,292,613
純資産合計		11,829,873,767	1,968,227,941

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2018年8月31日現在

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

	通貨	2018年	2017年	2016年
		8月31日現在	8月31日現在	8月31日現在
純資産合計	米ドル	11,829,873,767	9,265,244,959	7,839,045,320
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	9.78	9.94	9.80
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.50	9.91	9.95
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	9.95	10.11	9.97
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	9.94	10.10	9.96
クラスA 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.98	10.15	10.01
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.00	7.31	7.34
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.43	14.80	14.66
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	豪ドル	9.29	9.61	9.59
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	人民元	95.75	99.07	97.07
クラスA 安定分配型投資証券	米ドル	12.06	12.40	12.32
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	香港ドル	91.83	95.54	95.50
クラスA 無分配投資証券	米ドル	13.95	13.86	13.34
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	9.88	10.12	9.96
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.83	10.03	9.83
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,030	1,047	1,024
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	15.29	15.32	14.69
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	99.93	102.02	100.12
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	20.21	20.25	19.58
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.19	10.29	10.00
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	9.95	10.11	9.97
クラスC 毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.92	10.09	9.95
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.09	12.16	11.85
クラスD 毎年分配型投資証券	米ドル	13.24	13.46	13.27
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	9.71	9.94	9.85
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.50	9.91	9.95
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.72	4.88	4.86
クラスD 毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.49	10.67	10.52
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.59	-	-
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	7.02	7.33	7.36
クラスD 無分配投資証券	米ドル	14.35	14.18	13.59

3 会計年度末における純資産価額の概要 2018年8月31日現在(続き)

	通貨	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド (続き)		
		2018年 8月31日現在	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.55	10.75	10.53
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.37	10.53	10.26
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.96	11.02	10.66
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	15.75	15.70	14.98
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	20.81	20.74	19.95
クラスE無分配投資証券	米ドル	13.13	13.11	12.68
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.29	9.52	9.38
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.61	9.83	9.75
クラスI毎四半期分配型投資証券	米ドル	9.77	9.94	9.80
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.31	9.72	9.76
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	日本円	981	-	-
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.39	11.25	10.75
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	9.93	-	-
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.73	10.66	10.25
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.23	11.42	11.16
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.67	10.81	10.52
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.03	11.08	10.70
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,063	1,073	1,043
クラスJ毎月分配型投資証券	米ドル	9.95	10.11	9.97
クラスX毎月分配型投資証券	米ドル	9.95	10.11	9.97
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.49	10.67	10.45
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.38	9.78	9.82
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.63	-	-
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.55	9.88	9.84
クラスX無分配投資証券	米ドル	11.02	10.82	10.29
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	11.61	11.41	10.78
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	10.72	10.60	10.14
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.52	11.66	11.35
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.17	11.26	10.91
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	10.79	10.78	10.36
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	10.38	10.48	10.16

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2018年8月31日現在(続き)

	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド			
	通貨	2018年 8月31日現在	2017年 8月31日現在	2016年 8月31日現在
純資産合計	米ドル	1,968,227,941	1,693,798,830	1,532,772,836
以下の1口当たり純資産価額:				
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	8.41 [*]	8.57	8.60
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	8.40 [*]	8.56	8.59
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	9.56 [*]	9.82	9.90
クラスA無分配投資証券	米ドル	13.19 [*]	13.18	12.98
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.92 [*]	10.18	10.20
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	8.42 [*]	8.58	8.61
クラスC無分配投資証券	米ドル	10.82 [*]	10.95	10.92
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	9.64 [*]	9.83	9.86
クラスD無分配投資証券	米ドル	13.45 [*]	13.40	13.15
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.82 [*]	10.04	10.03
クラスE無分配投資証券	米ドル	12.09 [*]	12.15	12.02
クラスI無分配投資証券	米ドル	10.24 [*]	10.19	10.00
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.85 [*]	10.06	10.04
クラスX無分配投資証券	米ドル	14.63 [*]	14.50	14.16

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

* 希薄化調整を含む。詳細については注記2(g)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。

損益および純資産変動計算書 2018年8月31日に終了した会計年度

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
期首純資産		9,265,244,959	1,693,798,830
収益			
預金利息	2 (b)	6,208,440	239,105
債券利息	2 (b)	389,708,429	54,197,383
スワップ利息	2 (c)	117,298,909	5,369,061
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	1,488,226	790,446
集団投資スキームによる収益	2 (b)	1,109,954	-
配当金、源泉徴収税控除後	2 (b)	2,367,044	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)	95,921	-
有価証券貸付による収益	2 (b)	2,354,084	241,604
投資運用報酬リベート	5	59,861	-
収益合計	2 (b)	520,690,868	60,837,599
費用			
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)	21,812	-
スワップ利息	2 (c)	124,352,650	3,336,150
金融資産のネガティブ・イールド	2 (b)	647	-
管理事務代行報酬、補助金控除後	7	9,255,891	1,081,818
保管および預託報酬	2 (h), 8	2,394,701	318,385
販売報酬	6	6,540,332	1,037,613
税金	9	3,241,651	625,666
投資運用報酬	5	58,039,360	7,236,092
費用合計		203,847,044	13,635,724
純利益		316,843,824	47,201,875
以下に係る実現純評価益 / (損) :			
投資有価証券	2 (a)	(81,077,141)	(18,061,113)
事後通告証券契約	2 (c)	15,413,938	(1,844,767)
差金決済取引	2 (c)	(1,301,584)	-
上場先物取引	2 (c)	43,572,386	10,036,298
オプション / スワップション契約	2 (c)	109,114,126	(301,567)
スワップ取引	2 (c)	(28,924,247)	(3,671,950)
先渡為替予約	2 (c)	(299,062,484)	(7,123,956)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(71,704,025)	886,140
当期実現純評価損		(313,969,031)	(20,080,915)
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)	(279,254,077)	(25,724,018)
事後通告証券契約	2 (c)	5,234,631	(364,304)
差金決済取引	2 (c)	305,756	-
上場先物取引	2 (c)	9,035,056	1,023,829
オプション / スワップション契約	2 (c)	(14,716,662)	(22,363)
スワップ取引	2 (c)	23,386,559	1,299,977
先渡為替予約	2 (c)	101,341,601	(279,018)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(874,019)	(75,688)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(155,541,155)	(24,141,585)
運用成績による純資産の増加 / (減少)		(152,666,362)	2,979,375

損益および純資産変動計算書 2018年8月31日に終了した会計年度(続き)

	注記	フィクスト・インカム・グローバル・オポ チュニティーズ・ファン ド	USダラー・ショー ト・デュレーション・ ボンド・ファンド
		米ドル	米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		6,981,493,647	1,160,681,834
投資証券買戻しによる正味支払額		(4,207,447,797)	(887,102,292)
資本の変動による純資産の増加		2,774,045,850	273,579,542
配当金宣言額	16	(56,750,680)	(2,129,806)
期末純資産		11,829,873,767	1,968,227,941

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2018年8月31日に終了した会計年度

	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎年分配型投資証券	111,166	26,719	54,765	83,120
クラスA ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,853,518	661,580	1,220,946	1,294,152
クラスA 毎日分配型投資証券	4,287,136	1,669,827	1,700,022	4,256,941
クラスA 毎月分配型投資証券	437,596	153,123	98,437	492,282
クラスA 毎四半期分配型投資証券	8,268,365	1,847,100	2,155,064	7,960,401
クラスA ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	633,802	1,286,750	278,474	1,642,078
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	219,380	209,297	161,544	267,133
クラスA 豪ドル・ヘッジ金利差分配型投資証券	200,024	33,849	24,296	209,577
クラスA 中国人民元・ヘッジ金利差分配型投資証券	308	47,012	-	47,320
クラスA 安定分配型投資証券	211,044	573,703	569,506	215,241
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定分配型投資証券	125,123	2,709	63,971	63,861
クラスA 無分配投資証券	57,688,811	23,726,851	26,107,179	55,308,483
クラスA スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,847,863	2,042,475	788,139	5,102,199
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	30,182,699	36,845,483	30,414,527	36,613,655
クラスA 日本円ヘッジ無分配投資証券	500,954	2,510	-	503,464
クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	17,781,375	27,707,635	30,922,864	14,566,146
クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	1,042,412	219,913	239,434	1,022,891
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	3,073,974	1,879,017	862,225	4,090,766
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	227,910	245,989	70,502	403,397
クラスC 毎日分配型投資証券	677,090	136,163	262,321	550,932
クラスC 毎四半期分配型投資証券	1,194,663	151,409	264,878	1,081,194
クラスC 無分配投資証券	10,098,995	1,203,938	3,666,517	7,636,416
クラスD 毎年分配型投資証券	94,690	68,967	34,973	128,684
クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	494,741	562,373	49,288	1,007,826
クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,839,798	1,409,683	680,507	2,568,974
クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	1,746,527	2,825,532	1,019,640	3,552,419
クラスD 毎四半期分配型投資証券	20,368,127	7,497,851	9,860,635	18,005,343
クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	-	741,440	5,100	736,340
クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	959,211	670,182	249,677	1,379,716
クラスD 無分配投資証券	61,912,646	35,784,909	29,065,690	68,631,865
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	7,521,461	4,909,033	2,240,619	10,189,875
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	59,113,852	56,197,312	59,429,435	55,881,729
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	3,401,457	4,301,254	2,089,631	5,613,080

発行済投資証券口数変動表 2018年8月31日に終了した会計年度(続き)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファン
ド (続き)

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配 投資証券	37	41,000	-	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配 投資証券	37,627	18,350	21,379	34,598
クラスE無分配投資証券	27,747,603	5,006,898	10,969,348	21,785,153
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	58,796,711	24,058,182	21,436,806	61,418,087
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資 証券	610	44,320	-	44,930
クラスI 毎四半期分配型投資証券	42,308,982	25,405,237	5,756,891	61,957,328
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資 証券	1,602,179	3,604,618	1,932,987	3,273,810
クラスI 日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証 券	-	535	-	535
クラスI 無分配投資証券	41,975,895	75,664,195	46,281,142	71,358,948
クラスI 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	-	655	-	655
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証 券	10,075	40,882	-	50,957
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資 証券	1,545,599	5,205,629	950,363	5,800,865
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	59,783,511	71,943,796	43,267,793	88,459,514
クラスI 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	51,694,197	13,060,530	2,230,301	62,524,426
クラスI 日本円ヘッジ無分配投資証券	48,092,480	11,200,761	5,796,324	53,496,917
クラスJ 毎月分配型投資証券	1,473,375	257,502	468,497	1,262,380
クラスX 毎月分配型投資証券	1,965,036	34,860,592	687,765	36,137,863
クラスX 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,797,207	68,189	324,921	1,540,475
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	230,758	127,742	85,743	272,757
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資 証券	-	4,995,436	-	4,995,436
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投 資証券	27,007,730	3,827,870	3,065,535	27,770,065
クラスX 無分配投資証券	5,944,343	29,138,618	147,654	34,935,307
クラスX 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	11,980,552	2,960,379	2,470,564	12,470,367
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証 券	50,031,450	62,595,767	3,841,864	108,785,353
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資 証券	881,847	2,967,297	-	3,849,144
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,301,125	5,203,803	624,653	5,880,275
クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	34,879,935	13,800,601	596,358	48,084,178
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無 分配投資証券	132,011,682	29,263,082	61,968,446	99,306,318

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2018年8月31日に終了した会計年度(続き)

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	3,743,674	2,524,088	2,777,242	3,490,520
クラスA 毎月分配型投資証券	1,826,408	1,145,417	1,535,410	1,436,415
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	24,264	25,336	21,040	28,560
クラスA 無分配投資証券	34,218,017	15,484,962	19,292,633	30,410,346
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,413,454	900,933	1,597,384	1,717,003
クラスC 毎日分配型投資証券	409,818	108,316	153,578	364,556
クラスC 無分配投資証券	1,283,018	436,367	996,465	722,920
クラスD 毎月分配型投資証券	3,412,948	6,003,939	3,840,584	5,576,303
クラスD 無分配投資証券	21,129,612	15,275,333	13,366,141	23,038,804
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	958,523	766,212	1,184,970	539,765
クラスE 無分配投資証券	18,095,574	3,003,147	9,242,001	11,856,720
クラスI 無分配投資証券	3,925,873	838,220	1,999,838	2,764,255
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,033,821	15,491,962	5,234,632	11,291,151
クラスX 無分配投資証券	37,791,259	28,092,713	9,630,838	56,253,134

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2018年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
米国			
80,000	SPDR S&P 500 Trust - ETF*	23,214,400	0.20
ファンド合計		23,214,400	0.20
普通/優先株式およびワラント			
カナダ			
5,883	Norbord Inc	228,555	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	22,169	0.00
		250,724	0.00
ケイマン諸島			
428,221	Sentinel Energy Services Inc	4,389,265	0.04
147,094	Vantage Drilling Co	2,207	0.00
		4,391,472	0.04
フランス			
9,271	BNP Paribas SA	545,053	0.00
ドイツ			
3,699	Tele Columbus AG	13,947	0.00
ギリシャ			
613,197	Eurobank Ergasias SA*	520,207	0.00
インドネシア			
46,754,889	Bumi Resources Tbk PT	761,790	0.01
イタリア			
372,050	Intesa Sanpaolo SpA	921,777	0.01
353,750	Telecom Italia SpA/Milano*	226,087	0.00
133,192	UniCredit SpA	1,929,418	0.02
		3,077,282	0.03
日本			
3	Wessex Ltd (Wts 24/6/2019)	19,629	0.00
ルクセンブルグ			
176,733	Aroundtown SA	1,575,415	0.01
オランダ			
39,245	ABN AMRO Group NV	1,064,116	0.01
78,864	ALTICE EUROPE NV*	238,250	0.00
76,750	ING Groep NV ADR*	1,043,032	0.01
53,187	NXP Semiconductors NV	4,917,670	0.04
		7,263,068	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国		
34,746	Cushman & Wakefield Plc	618,131	0.01
	米国		
424,956	Altice USA Inc	7,687,454	0.07
23,040	American Airlines Group Inc	926,669	0.01
317,071	Bank of America Corp	9,718,226	0.08
428,355	Caesars Entertainment Corp*	4,444,183	0.04
15,490	Cardinal Health Inc	813,070	0.01
28,868	Citigroup Inc	2,043,854	0.02
8,010	CME Group Inc	1,389,334	0.01
28,280	Comcast Corp	1,043,249	0.01
21,711	Delek US Holdings Inc	1,170,223	0.01
3,326	Dell Technologies Inc Class V	319,662	0.00
137,437	DR Horton Inc	6,142,059	0.05
72,818	Energen Corp	5,566,208	0.05
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp	552,756	0.01
87,600	Federal National Mortgage Association (Pref)	543,120	0.00
117,352	FTS International Inc	1,254,493	0.01
1,831	Golden Entertainment Inc*	51,891	0.00
6,610	Home Depot Inc/The	1,322,661	0.01
10,260	JB Hunt Transport Services Inc	1,230,790	0.01
44,300	JPMorgan Chase & Co	5,053,744	0.04
111,557	Leisure Acquisition Corp	1,137,881	0.01
94,400	Lennar Corp*	4,886,144	0.04
154,967	Liberty Oilfield Services Inc	3,011,784	0.03
13,460	Lowe's Cos Inc	1,460,141	0.01
40,400	Micron Technology Inc	2,144,432	0.02
84,800	PulteGroup Inc	2,369,312	0.02
39,902	Pure Acquisition Corp	412,587	0.00
22,530	Robert Half International Inc	1,753,285	0.02
17,360	Ross Stores Inc	1,651,110	0.01
14,550	Scientific Games Corp*	445,957	0.00
48,730	SLM Corp	570,628	0.01
36,080	Synchrony Financial	1,137,242	0.01
44,000	Toll Brothers Inc	1,601,160	0.01
59,230	Under Armour Inc 'A' *	1,220,138	0.01
9,310	Union Pacific Corp	1,398,827	0.01
17,930	United Continental Holdings Inc	1,562,779	0.01
47,462	Vistra Energy Corp	1,113,458	0.01
38,433	William Lyon Homes 'A' *	749,828	0.01
174,339	Williams Cos Inc/The	5,153,461	0.04
51,598	Williams-Sonoma Inc	3,574,193	0.03
24,020	Zions Bancorporation*	1,272,580	0.01
		89,900,573	0.76
普通ノ優先株式およびワラント合計		108,937,291	0.92

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 6,340,000	AT&T Inc 6/12/2018 (Zero Coupon)	6,295,541	0.06
USD 6,340,000	AT&T Inc 7/3/2019 (Zero Coupon)	6,249,797	0.05
USD 26,190,000	JP Morgan Securities LLC 2.533% 15/4/2019	26,209,768	0.22
USD 22,880,000	Societe Generale 12/4/2019 (Zero Coupon)	22,516,780	0.19
USD 22,880,000	Sumitoto Mitsui Banking Corp 17/4/2019 (Zero Coupon)	22,511,632	0.19
		83,783,518	0.71
コマーシャル・ペーパー合計			
		83,783,518	0.71
預託証書			
カナダ			
USD 26,190,000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.66% 16/4/2019	26,204,360	0.22
USD 22,880,000	Royal Bank of Canada (New York Branch) FRN 18/4/2019	22,898,911	0.20
USD 22,880,000	Toronto Dominion Bank (New York Branch) FRN 17/4/2019	22,898,830	0.19
		72,002,101	0.61
フランス			
USD 22,880,000	BNP Paribas SA (New York Branch) 2.66% 18/4/2019	22,896,620	0.19
スイス			
USD 26,190,000	Credit Suisse AG FRN 16/4/2019	26,237,009	0.22
米国			
USD 26,190,000	Mitsubishi UFJ Trust and Banking Corp 2.68% 17/4/2019	26,211,012	0.22
USD 19,120,000	Wells Fargo Bank FRN 16/4/2019	19,135,660	0.16
USD 19,120,000	Wells Fargo Bank 2.7% 16/4/2019	19,147,332	0.17
		64,494,004	0.55
預託証書合計			
		185,629,734	1.57
債券			
アルゼンチン			
USD 1,961,000	Aeropuertos Argentina 2000 SA '144A' 6.875% 1/2/2027	1,769,802	0.01
USD 1,122,000	Arcor SAIC '144A' 6% 6/7/2023	1,065,900	0.01
ARS 15,983,000	Argentina Bonar Bonds FRN 11/3/2019	434,744	0.00
ARS 31,967,000	Argentina Bonar Bonds FRN 1/3/2020	800,308	0.01
USD 8,037,040	Argentina Bonar Bonds 8% 8/10/2020	7,675,373	0.06
USD 10,714,733	Argentina Bonar Bonds 8.75% 7/5/2024	10,939,287	0.09
USD 7,972,886	Argentina Bonar Bonds 9% 29/11/2018	7,992,579	0.07
CHF 1,290,000	Argentine Republic Government International Bond 3.375% 12/10/2020	1,276,555	0.01
USD 3,921,000	Argentine Republic Government International Bond 4.625% 11/1/2023	3,092,689	0.03
EUR 1,167,000	Argentine Republic Government International Bond 5.25% 15/1/2028	976,107	0.01
USD 33,626,000	Argentine Republic Government International Bond 5.625% 26/1/2022	28,413,970	0.24

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		アルゼンチン(続き)		
USD	17,542,000	Argentine Republic Government International Bond 6.25% 22/4/2019*	17,147,305	0.14
USD	28,366,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 22/4/2021	25,458,485	0.22
USD	11,687,000	Argentine Republic Government International Bond 6.875% 11/1/2048	8,069,873	0.07
ARS	120,373,000	Banco Hipotecario SA '144A' FRN 7/11/2022	2,568,745	0.02
ARS	78,553,000	Bonos de la Nacion Argentina con Ajuste por CER 4% 6/3/2020	2,199,998	0.02
USD	1,115,000	Cablevision SA '144A' 6.5% 15/6/2021	1,053,675	0.01
USD	7,081,000	Generacion Mediterraneo SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	5,948,040	0.05
USD	7,081,000	Genneia SA '144A' 8.75% 20/1/2022	6,266,685	0.05
USD	3,600,000	Provincia de Rio Negro '144A' 7.75% 7/12/2025	2,619,090	0.02
USD	5,666,000	Tarjeta Naranja SA '144A' FRN 11/4/2022	2,209,711	0.02
USD	3,544,000	Tecpetrol SA '144A' 4.875% 12/12/2022	3,118,720	0.03
USD	4,690,000	YPF SA '144A' 8.5% 23/3/2021*	4,502,400	0.04
USD	1,317,000	YPF SA 8.75% 4/4/2024	1,228,103	0.01
USD	3,996,000	YPF SA '144A' 8.75% 4/4/2024*	3,726,270	0.03
USD	4,426,000	YPF SA '144A' 8.875% 19/12/2018*	4,414,935	0.04
			154,969,349	1.31
		オーストラリア		
USD	4,200,000	Asciano Finance Ltd 4.75% 22/3/2028	4,117,827	0.03
EUR	1,850,000	BHP Billiton Finance Ltd FRN 22/4/2076	2,347,517	0.02
EUR	1,400,000	Cromwell SPV Finance Pty Ltd 2.5% 29/3/2025	1,617,256	0.01
USD	187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	65,625	0.00
USD	1,275,000	Macquarie Bank Ltd '144A' 2.4% 21/1/2020	1,260,694	0.01
EUR	775,000	National Australia Bank Ltd 0.625% 30/8/2023	900,440	0.01
USD	1,281,000	Newcastle Coal Infrastructure Group Pty Ltd 4.4% 29/9/2027	1,183,130	0.01
EUR	600,000	Origin Energy Finance Ltd FRN 16/9/2074*	720,436	0.01
USD	777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046*	777,299	0.01
USD	1,322,000	Santos Finance Ltd 4.125% 14/9/2027	1,245,370	0.01
USD	200,000	Shandong Energy Australia Pty Ltd 4.55% 26/7/2020	195,250	0.00
			14,430,844	0.12
		オーストリア		
EUR	2,400,000	BAWAG Group AG FRN 14/5/2025 (Perpetual)*	2,656,774	0.02
USD	3,534,000	Eldorado Intl. Finance GmbH '144A' 8.625% 16/6/2021	3,648,855	0.03
EUR	2,000,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)	2,734,743	0.02
EUR	800,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)	1,010,109	0.01
EUR	2,600,000	Raiffeisen Bank International AG FRN 15/12/2022 (Perpetual)	3,093,751	0.03
EUR	200,000	Sappi Papier Holding GmbH 4% 1/4/2023	241,181	0.00
			13,385,413	0.11
		バーレーン		
USD	1,293,000	Bahrain Government International Bond '144A' 6.75% 20/9/2029	1,181,479	0.01
USD	623,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047	556,027	0.00

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
バーレーン(続き)				
USD	913,000	CBB International Sukuk Co 7SPC '144A' 6.875% 5/10/2025	922,130	0.01
			2,659,636	0.02
ベルギー				
EUR	420,000	KBC Group NV FRN 19/3/2019 (Perpetual)*	497,991	0.00
EUR	2,500,000	KBC Group NV 1% 26/4/2021	2,970,993	0.03
EUR	400,000	Nyrstar NV 5% 11/7/2022	417,389	0.00
			3,886,373	0.03
パミューダ				
USD	200,000	Binhai Investment Co Ltd 4.45% 30/11/2020	187,500	0.00
USD	200,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 6.75% 17/10/2018	193,400	0.00
USD	519,000	China Singyes Solar Technologies Holdings Ltd 7.95% 15/2/2019*	418,042	0.00
USD	7,090,000	Digicel Group Ltd '144A' 7.125% 1/4/2022*	4,324,900	0.04
USD	2,489,000	GCL New Energy Holdings Ltd 7.1% 30/1/2021	2,212,099	0.02
HKD	44,000,000	Haitong International Securities Group Ltd 25/10/2021 (Zero Coupon)	5,417,896	0.05
USD	2,510,000	Inkia Energy Ltd '144A' 5.875% 9/11/2027	2,434,700	0.02
HKD	4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	439,985	0.00
HKD	348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	42,593	0.00
			15,671,115	0.13
ブラジル				
USD	1,425,000	Oi SA 10% 27/7/2025	1,544,344	0.01
USD	3,524,000	Samarco Mineracao SA (Defaulted) 4.125% 1/11/2022	2,519,660	0.02
			4,064,004	0.03
英領バージン諸島				
USD	5,070,000	Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	4,214,373	0.04
USD	5,395,000	CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,135,463	0.04
USD	2,050,000	Chang Development International Ltd 3.625% 20/1/2020	1,997,501	0.02
USD	4,176,000	China Reinsurance Finance Corp Ltd 3.375% 9/3/2022	3,982,031	0.03
USD	3,450,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022	3,318,368	0.03
USD	900,000	Easy Tactic Ltd 7% 25/4/2021*	882,261	0.01
USD	3,300,000	Excel Capital Global Ltd FRN 17/5/2021 (Perpetual)	3,291,750	0.03
USD	1,050,000	Greenland Global Investment Ltd 6.75% 22/5/2019*	1,056,563	0.01
USD	5,435,000	Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022	5,191,566	0.04
EUR	2,875,000	Huarong Universe Investment Holding Ltd 1.625% 5/12/2022	3,268,360	0.03
USD	648,000	Knight Castle Investments Ltd 7.99% 23/1/2021	550,800	0.00
USD	2,500,000	Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)*	2,397,695	0.02
USD	1,545,000	New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020	1,394,475	0.01
USD	741,000	New Metro Global Ltd 6.5% 23/4/2021	728,959	0.01
USD	3,218,000	Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	2,480,008	0.02
USD	1,189,000	Rock International Investment Inc 6.625% 27/3/2020	995,803	0.01
USD	657,000	Shandong Iron And Steel Xinheng International Co Ltd 6.5% 14/6/2021	625,813	0.01
USD	4,500,000	Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	4,608,000	0.04

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英領バージン諸島(続き)		
HKD	4,000,000	Smart Insight International Ltd 27/1/2019 (Zero Coupon)	502,650	0.00
USD	764,000	Studio City Finance Ltd 8.5% 1/12/2020	774,505	0.01
USD	2,400,000	Tewoo Group NO 5 Ltd FRN 15/3/2021 (Perpetual)*	2,202,600	0.02
USD	1,400,000	Yingde Gases Investment Ltd 7.25% 28/2/2020	1,414,305	0.01
USD	1,850,000	Yunnan Energy Investment Overseas Finance Co Ltd 4.25% 14/11/2022	1,671,017	0.01
USD	631,000	Zhaohai Investment BVI Ltd 4% 23/7/2020	610,408	0.00
			53,295,274	0.45
		カナダ		
USD	3,546,124	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5% 15/12/2023	3,544,661	0.03
EUR	106,000	Bausch Health Cos Inc 4.5% 15/5/2023	121,280	0.00
USD	568,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.5% 1/11/2025	568,369	0.00
USD	1,099,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5.625% 1/12/2021	1,094,879	0.01
USD	3,896,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6.5% 15/3/2022	4,037,035	0.03
USD	6,610,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7% 15/3/2024	6,998,337	0.06
USD	4,946,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7.5% 15/7/2021	5,033,816	0.04
USD	3,379,000	Brookfield Residential Properties Inc '144A' 6.5% 15/12/2020	3,407,721	0.03
USD	422,000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp '144A' 6.125% 1/7/2022	427,275	0.00
USD	6,874,000	Canbriam Energy Inc '144A' 9.75% 15/11/2019	6,908,370	0.06
USD	3,114,000	Frontera Energy Corp '144A' 9.7% 25/6/2023*	3,258,022	0.03
USD	690,000	Largo Resources Ltd '144A' 9.25% 1/6/2021	726,225	0.01
USD	3,643,000	Masonite International Corp '144A' 5.625% 15/3/2023	3,743,182	0.03
USD	110,000	Masonite International Corp '144A' 5.75% 15/9/2026	111,375	0.00
USD	4,250,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 4.875% 1/6/2024	4,149,063	0.04
USD	6,147,000	NOVA Chemicals Corp '144A' 5.25% 1/8/2023	6,183,575	0.05
USD	10,497,000	Stoneway Capital Corp '144A' 10% 1/3/2027*	9,467,612	0.08
USD	3,662,000	Stoneway Capital Corp 10% 1/3/2027*	3,302,886	0.03
USD	765,000	Suncor Energy Inc 4% 15/11/2047	726,784	0.01
			63,810,467	0.54
		ケイマン諸島		
USD	1,450,000	Agile Group Holdings Ltd FRN 7/3/2023 (Perpetual)	1,353,178	0.01
USD	2,297,000	Agile Group Holdings Ltd 8.5% 18/7/2021	2,363,039	0.02
USD	4,007,663	Ambac LSNI LLC '144A' FRN 12/2/2023	4,052,749	0.03
USD	732,000	Anton Oilfield Services Group/Hong Kong 9.75% 5/12/2020*	754,905	0.01
USD	2,000,000	Bizlink Holding Inc 1/2/2023 (Zero Coupon)	1,939,781	0.02
USD	3,800,000	Central China Real Estate Ltd 6.875% 23/10/2020	3,757,250	0.03
HKD	50,000,000	China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	5,916,770	0.05
USD	1,052,000	China Evergrande Group 6.25% 28/6/2021*	1,011,235	0.01
USD	1,633,000	China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023*	1,479,906	0.01
USD	1,165,000	China Evergrande Group 8.75% 28/6/2025*	1,045,587	0.01
USD	716,000	China Huiyuan Juice Group Ltd 6.5% 16/8/2020*	540,174	0.01
USD	4,000,000	China Overseas Finance Investment Cayman V Ltd 5/1/2023 (Zero Coupon)	4,223,500	0.04
USD	1,400,000	China SCE Group Holdings Ltd 7.45% 17/4/2021	1,384,124	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ケイマン諸島(続き)		
HKD	29,000,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 12/2/2019 (Zero Coupon)	3,650,937	0.03
USD	2,800,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 6.375% 2/5/2020	2,800,000	0.02
USD	3,050,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 6.875% 23/4/2021	3,033,863	0.03
USD	682,000	Ctrip.com International Ltd 1.25% 15/9/2022	666,645	0.01
USD	1,177,000	Energuate Trust ' 144A ' 5.875% 3/5/2027	1,128,449	0.01
USD	1,835,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.25% 13/2/2019	1,805,181	0.02
USD	2,037,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.375% 4/10/2021	1,673,905	0.01
USD	1,981,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022*	1,610,102	0.01
USD	1,780,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 8/3/2021	1,538,242	0.01
HKD	21,800,000	Future Land Development Holdings Ltd 2.25% 10/2/2019	2,770,155	0.02
USD	1,275,000	Future Land Development Holdings Ltd 5% 16/2/2020	1,260,656	0.01
USD	733,000	FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)	669,779	0.01
USD	6,125,000	Gol Finance Inc ' 144A ' 7% 31/1/2025*	5,083,750	0.04
USD	2,800,000	Guorui Properties Ltd 7% 21/3/2020	2,411,821	0.02
USD	2,250,000	Haitian International Holdings Ltd 2% 13/2/2019	2,197,485	0.02
HKD	33,000,000	Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	4,085,473	0.03
USD	2,500,000	Jingrui Holdings Ltd 9.45% 23/4/2021	2,396,875	0.02
USD	299,000	Kaisa Group Holdings Ltd 7.25% 30/6/2020	275,968	0.00
USD	1,598,000	Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	1,328,250	0.01
USD	3,000,000	King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	2,760,000	0.02
USD	615,000	Logan Property Holdings Co Ltd 6.875% 24/4/2021	604,065	0.01
USD	1,250,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	1,237,033	0.01
USD	2,410,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	2,418,901	0.02
USD	2,540,400	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd ' 144A ' 6.35% 1/12/2021	2,489,592	0.02
USD	2,254,387	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd ' 144A ' 6.72% 1/12/2022	2,124,760	0.02
USD	62,600	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd ' 144A ' 7.72% 1/12/2026	17,684	0.00
USD	337,306	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd ' 144A ' 1/10/2018 (Perpetual) (Zero Coupon)	6,156	0.00
USD	4,805,000	Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd FRN 10/10/2020 (Perpetual)	4,663,853	0.04
USD	3,250,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	3,206,248	0.03
USD	580,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	574,682	0.01
USD	1,690,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	1,691,101	0.01
USD	2,200,000	Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	2,000,438	0.02
USD	2,000,000	Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	1,951,990	0.02
HKD	14,000,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 11/2/2019 (Zero Coupon)	1,783,173	0.02
USD	1,400,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 6.95% 17/4/2021	1,318,130	0.01
USD	2,710,000	Redco Group 6.375% 27/2/2019*	2,674,770	0.02
USD	900,000	Redco Group 7% 14/11/2018	903,375	0.01
USD	200,000	Ronshine China Holdings Ltd 6.95% 8/12/2019	198,500	0.00
USD	1,500,000	RR 3 Ltd 28/7/2026 (Zero Coupon)	1,182,990	0.01
USD	3,970,000	RR 3 Ltd 28/7/2026 (Zero Coupon)	2,888,175	0.02
USD	3,400,000	Sands China Ltd 5.4% 8/8/2028*	3,444,897	0.03

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ケイマン諸島(続き)		
USD	2,000,000	Shui On Development Holding Ltd FRN 4/6/2020 (Perpetual)	2,025,500	0.02
USD	3,236,000	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	2,950,666	0.03
USD	2,601,000	Sunac China Holdings Ltd 6.875% 8/8/2020	2,535,975	0.02
USD	1,311,000	Sunac China Holdings Ltd 8.625% 27/7/2020	1,315,231	0.01
USD	474,000	Times China Holdings Ltd 5.75% 26/4/2022	427,531	0.00
USD	416,000	Times China Holdings Ltd 6.25% 17/1/2021	399,926	0.00
GBP	800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	921,712	0.01
USD	1,091,000	Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15/1/2024	1,103,274	0.01
USD	7,953,450	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.75% 15/10/2024	8,430,657	0.07
USD	557,600	Transocean Proteus Ltd '144A' 6.25% 1/12/2024	573,335	0.01
EUR	884,700	UPCB Finance IV Ltd 4% 15/1/2027	1,061,259	0.01
EUR	230,000	UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029*	266,252	0.00
USD	1,345,000	VLL International Inc 5.75% 28/11/2024	1,257,575	0.01
USD	500,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 8.125% 30/8/2019	471,535	0.00
USD	1,442,000	Xinyuan Real Estate Co Ltd 9.875% 19/3/2020*	1,334,008	0.01
USD	2,690,000	Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020	2,629,475	0.02
USD	3,884,000	Yuzhou Properties Co Ltd 7.9% 11/5/2021	3,861,026	0.03
USD	1,800,000	Zhen Ding Technology Holding Ltd 26/6/2019 (Zero Coupon)	1,822,500	0.02
			143,737,684	1.22
		中国		
EUR	2,900,000	Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd 2.5% 20/3/2021	3,257,735	0.03
CNH	10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,441,579	0.01
USD	947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	879,353	0.01
USD	3,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 29/1/2021 (Zero Coupon)	3,237,750	0.03
CNY	15,000,000	China Railway Construction Corp Ltd 1.5% 21/12/2021	2,112,305	0.02
USD	5,500,000	CRRC Corp Ltd 5/2/2021 (Zero Coupon)	5,442,250	0.05
USD	2,000,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,813,833	0.01
USD	2,362,000	Huachen Energy Co Ltd 6.625% 18/5/2020	1,765,595	0.01
USD	687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	646,910	0.01
USD	2,409,000	Postal Savings Bank of China Co Ltd FRN 27/9/2022 (Perpetual)	2,250,006	0.02
USD	1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	1,016,425	0.01
EUR	5,700,000	Zhejiang Expressway Co Ltd 21/4/2022 (Zero Coupon)	6,301,546	0.05
			30,165,287	0.26
		コロンビア		
USD	22,899,000	Colombia Government International Bond 4.375% 12/7/2021	23,465,750	0.20
USD	2,996,000	Credivalores-Crediservicios SAS '144A' 9.75% 27/7/2022	3,044,580	0.02
			26,510,330	0.22
		チェコ共和国		
EUR	672,000	Residomo SRO 3.375% 15/10/2024	790,427	0.01

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
デンマーク				
EUR	543,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2020 (Perpetual)	660,781	0.01
EUR	420,000	Danske Bank A/S FRN 6/4/2022 (Perpetual)	528,717	0.01
EUR	2,050,000	DKT Finance ApS 7% 17/6/2023	2,545,392	0.02
EUR	2,432,000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 14/7/2021	2,867,969	0.02
EUR	130,000	TDC A/S 3.75% 2/3/2022	165,796	0.00
			6,768,655	0.06
ドミニカ共和国				
USD	1,143,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029*	1,188,720	0.01
エジプト				
EUR	3,216,000	Egypt Government International Bond '144A' 4.75% 16/4/2026	3,513,295	0.03
USD	7,288,000	Egypt Government International Bond '144A' 5.577% 21/2/2023*	7,069,360	0.06
USD	7,367,000	Egypt Government International Bond 5.75% 29/4/2020	7,440,302	0.06
USD	19,000,000	Egypt Government International Bond 6.125% 31/1/2022	18,988,125	0.16
EGP	678,000,000	Egypt Treasury Bills 4/9/2018 (Zero Coupon)	37,788,595	0.32
EGP	91,725,000	Egypt Treasury Bills 16/10/2018 (Zero Coupon)	5,003,630	0.04
EGP	61,825,000	Egypt Treasury Bills 13/11/2018 (Zero Coupon)	3,325,418	0.03
EGP	29,100,000	Egypt Treasury Bills 27/11/2018 (Zero Coupon)	1,554,366	0.01
EGP	125,000,000	Egypt Treasury Bills 4/12/2018 (Zero Coupon)	6,531,643	0.06
EGP	62,700,000	Egypt Treasury Bills 5/3/2019 (Zero Coupon)	3,193,917	0.03
			94,408,651	0.80
フィンランド				
EUR	200,000	Stora Enso OYJ 2.5% 7/6/2027	243,888	0.00
EUR	351,000	Stora Enso OYJ 2.5% 21/3/2028	422,852	0.01
			666,740	0.01
フランス				
EUR	200,000	Accor SA 2.625% 5/2/2021	246,119	0.00
EUR	992,000	Altice France SA/France 5.875% 1/2/2027*	1,198,082	0.01
EUR	200,000	APRR SA 1.125% 15/1/2021	238,384	0.00
EUR	360,000	Autodis SA FRN 1/5/2022	424,189	0.00
EUR	150,000	Autodis SA 4.375% 1/5/2022	177,901	0.00
EUR	1,000,000	BNP Paribas Cardif SA FRN 25/11/2025 (Perpetual)	1,229,014	0.01
EUR	3,300,000	BNP Paribas Cardif SA 1% 29/11/2024	3,675,817	0.03
EUR	1,400,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)*	1,816,568	0.02
USD	1,800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)	1,894,500	0.02
USD	670,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 16/8/2028 (Perpetual)	671,675	0.01
USD	2,685,000	BNP Paribas SA FRN 16/8/2028 (Perpetual)	2,691,713	0.02
EUR	371,000	Burger King France SAS FRN 1/5/2023	438,065	0.00
EUR	265,000	Burger King France SAS 6% 1/5/2024*	329,973	0.00
EUR	300,000	Capgemini SE 1.75% 1/7/2020	359,242	0.00
EUR	300,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024	309,748	0.00
EUR	600,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.561% 25/1/2023*	636,697	0.01
EUR	125,000	Constantin Investissement 3 SASU 5.375% 15/4/2025	137,114	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	フランス(続き)		
EUR 500,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 14/10/2025 (Perpetual)	622,015	0.01
EUR 1,207,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,550,339	0.01
EUR 1,700,000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 25/10/2029	1,857,390	0.02
EUR 1,400,000	Credit Mutuel Arkea SA 3.5% 9/2/2029	1,659,013	0.01
EUR 334,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.25% 1/2/2023	398,287	0.00
EUR 382,000	Crown European Holdings SA '144A' 2.875% 1/2/2026	438,993	0.00
EUR 227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	274,837	0.00
EUR 1,100,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2020 (Perpetual)	1,336,480	0.01
EUR 400,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2022 (Perpetual)	492,423	0.01
EUR 400,000	Engie SA FRN 2/6/2024 (Perpetual)	495,684	0.01
EUR 715,000	Europcar Mobility Group 4.125% 15/11/2024*	836,553	0.01
EUR 160,000	Europcar Mobility Group 5.75% 15/6/2022	191,990	0.00
EUR 180,000	Faurecia SA 3.625% 15/6/2023	218,455	0.00
EUR 3,500,000	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	4,077,753	0.04
EUR 31,050,000	French Republic Government Bond OAT 25/2/2020 (Zero Coupon)	36,432,252	0.31
EUR 400,000	Groupama SA FRN 28/5/2024 (Perpetual)	527,625	0.01
EUR 600,000	Groupama SA 6% 23/1/2027	849,330	0.01
EUR 167,000	Loxam SAS 3.5% 15/4/2022*	201,095	0.00
EUR 200,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023*	241,377	0.00
EUR 452,000	Loxam SAS 4.25% 15/4/2024	557,241	0.01
EUR 217,000	Loxam SAS 6% 15/4/2025	269,687	0.00
EUR 1,020,000	Orange SA FRN 7/2/2024 (Perpetual)	1,331,897	0.01
EUR 2,100,000	Orano SA 4.875% 23/9/2024	2,601,219	0.02
EUR 322,000	Paprec Holding SA 4% 31/3/2025*	378,902	0.00
EUR 404,000	Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	465,051	0.00
EUR 360,000	RCI Banque SA FRN 12/4/2021	420,975	0.00
EUR 511,000	Rexel SA 3.5% 15/6/2023	620,909	0.01
EUR 700,000	Sanofi FRN 21/3/2020	817,382	0.01
EUR 500,000	Sanofi 21/3/2020 (Zero Coupon)	583,425	0.01
EUR 75,816	SMCP Group SAS 5.875% 1/5/2023*	93,270	0.00
USD 248,000	Societe Generale SA '144A' FRN 13/9/2021 (Perpetual)	258,850	0.00
USD 200,000	Societe Generale SA FRN 18/12/2023 (Perpetual)	210,500	0.00
EUR 510,000	Solvay Finance SA FRN 2/6/2021 (Perpetual)*	647,767	0.01
EUR 100,000	Solvay Finance SA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	130,438	0.00
EUR 300,000	Solvay Finance SA FRN 3/6/2024 (Perpetual)	394,857	0.00
EUR 300,000	SPIE SA 3.125% 22/3/2024*	352,677	0.00
EUR 1,000,000	Teleperformance 1.875% 2/7/2025	1,174,211	0.01
EUR 1,760,000	TOTAL SA FRN 26/2/2021 (Perpetual)	2,101,140	0.02
EUR 160,000	TOTAL SA FRN 5/5/2023 (Perpetual)	192,986	0.00
EUR 900,000	Unibail-Rodamco SE 0.125% 14/5/2021	1,050,899	0.01
EUR 850,000	WFS Global Holding SAS 9.5% 15/7/2022	1,045,080	0.01
		84,876,055	0.72

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ		
EUR 980,000	Adler Pelzer Holding GmbH 4.125% 1/4/2024	1,149,756	0.01
EUR 300,000	ADLER Real Estate AG 1.5% 6/12/2021*	352,904	0.00
EUR 1,000,000	ADLER Real Estate AG 1.875% 27/4/2023*	1,153,526	0.01
EUR 1,587,000	ADLER Real Estate AG 2.125% 6/2/2024*	1,827,368	0.02
EUR 1,400,000	ADLER Real Estate AG 3% 27/4/2026	1,618,301	0.01
EUR 108,000	ADLER Real Estate AG 4.75% 8/4/2020	128,927	0.00
EUR 600,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075	693,113	0.01
EUR 3,500,000	Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 23/4/2075*	4,118,872	0.04
EUR 504,000	Blitz F18-674 GmbH 6% 30/7/2026	592,380	0.01
EUR 50,968,110	Bundesobligation 14/4/2023 (Zero Coupon)*	60,152,792	0.51
EUR 31,050,000	Bundesschatzanweisungen 13/12/2019 (Zero Coupon)	36,433,305	0.31
EUR 450,000	Commerzbank AG 4% 30/3/2027	563,881	0.00
EUR 360,000	Daimler AG 0.5% 9/9/2019	421,495	0.00
EUR 2,175,000	Deutsche Bank AG 1.125% 30/8/2023*	2,530,775	0.02
USD 1,815,000	Deutsche Bank AG 2.95% 20/8/2020	1,778,909	0.02
EUR 1,100,000	Deutsche Bank AG 4.5% 19/5/2026	1,349,358	0.01
USD 10,750,000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN 1/12/2032	9,322,938	0.08
EUR 12,472,000	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	16,827,125	0.14
EUR 2,400,000	Deutsche Pfandbriefbank AG FRN 28/4/2023 (Perpetual)*	2,698,388	0.02
EUR 100,000	Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	120,147	0.00
EUR 4,900,000	DVB Bank SE 1.25% 22/4/2020	5,782,269	0.05
EUR 345,000	IHO Verwaltungs GmbH 2.75% 15/9/2021	407,448	0.00
EUR 696,423	IHO Verwaltungs GmbH 3.25% 15/9/2023	833,953	0.01
EUR 1,515,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/9/2026*	1,814,984	0.02
EUR 7,100,000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028*	8,236,306	0.07
EUR 200,000	Mahle GmbH 2.5% 14/5/2021	243,168	0.00
EUR 155,000	Merck Financial Services GmbH 4.5% 24/3/2020	193,202	0.00
EUR 1,579,000	Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023*	1,812,111	0.02
EUR 590,000	RWE AG FRN 21/4/2075	701,755	0.01
EUR 1,685,000	Senvion Holding GmbH 3.875% 25/10/2022*	1,730,192	0.01
EUR 200,000	TLG Immobilien AG 1.375% 27/11/2024	230,932	0.00
EUR 4,292,000	Unitymedia GmbH 3.75% 15/1/2027*	5,279,335	0.04
USD 200,000	Unitymedia GmbH '144A' 6.125% 15/1/2025	210,000	0.00
EUR 182,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 3.5% 15/1/2027	224,057	0.00
EUR 600,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 4% 15/1/2025*	735,095	0.01
USD 6,981,000	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH '144A' 5% 15/1/2025	7,129,346	0.06
EUR 856,800	Unitymedia Hessen GmbH & Co KG / Unitymedia NRW GmbH 6.25% 15/1/2029*	1,128,251	0.01
EUR 400,000	Volkswagen Bank GmbH FRN 15/6/2021	463,975	0.00
EUR 2,500,000	Volkswagen Bank GmbH 0.625% 8/9/2021	2,921,720	0.02
EUR 2,451,000	Volkswagen Financial Services AG 0.375% 12/4/2021	2,855,403	0.02
EUR 1,250,000	Volkswagen Leasing GmbH 0.25% 16/2/2021	1,452,636	0.01
EUR 775,000	Volkswagen Leasing GmbH 1% 16/2/2023	900,278	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ドイツ(続き)			
EUR	625,000 Volkswagen Leasing GmbH 1.625% 15/8/2025	724,430	0.01
		189,845,106	1.60
ギリシャ			
EUR	805,000 Hellenic Republic Government Bond '144A' 3.375% 15/2/2025	905,553	0.01
EUR	293,760 Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	344,017	0.00
EUR	1,037,658 Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028	1,152,142	0.01
EUR	1,084,012 Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	1,124,754	0.01
EUR	1,794,193 Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037	1,782,192	0.02
EUR	1,678,985 Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	1,668,887	0.01
		6,977,545	0.06
ガーンジー			
USD	513,711 Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust '144A' 5.25% 30/5/2023	523,273	0.01
USD	2,525,000 EFG International Guernsey Ltd FRN 5/4/2027*	2,484,714	0.02
EUR	236,000 Summit Germany Ltd 2% 31/1/2025	260,183	0.00
		3,268,170	0.03
ホンジュラス			
USD	1,319,000 Inversiones Atlantida SA '144A' 8.25% 28/7/2022	1,340,434	0.01
香港			
USD	4,600,000 Bagan Capital Ltd 23/9/2021 (Zero Coupon)	4,389,964	0.04
USD	1,550,000 Chalico Hong Kong Corp Ltd FRN 15/1/2020 (Perpetual)	1,550,852	0.01
USD	2,205,000 Chong Hing Bank Ltd FRN 26/7/2027	2,115,309	0.02
USD	2,445,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.125% 19/7/2027	2,325,097	0.02
USD	6,425,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.625% 14/3/2023	6,501,595	0.06
USD	607,000 CNAC HK Finbridge Co Ltd 5.125% 14/3/2028	613,376	0.01
USD	6,047,000 CNAC HK Synbridge Co Ltd 5% 5/5/2020*	6,108,921	0.05
USD	2,443,000 HBIS Group Hong Kong Co Ltd 4.25% 7/4/2020	2,403,851	0.02
USD	1,430,000 Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/10/2018 (Perpetual)	1,108,582	0.01
USD	2,945,000 Hongkong Xiangyu Investment Co Ltd 4.5% 30/1/2023	2,683,116	0.02
USD	1,465,000 Hubei Science & Technology Investment Group Hong Kong Ltd 4.375% 5/3/2021	1,419,607	0.01
USD	1,846,000 Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)	1,707,546	0.01
		32,927,816	0.28
インド			
USD	985,000 Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4% 30/7/2027*	908,543	0.01
USD	2,705,000 Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,451,506	0.02
INR	400,000,000 Food Corp of India 9.95% 7/3/2022	5,862,662	0.05
USD	250,000 Glenmark Pharmaceuticals Ltd 2% 28/6/2022	256,030	0.00
USD	219,000 Hindustan Petroleum Corp Ltd 4% 12/7/2027	202,368	0.00
INR	168,830,000 India Government Bond 7.17% 8/1/2028	2,259,259	0.02
INR	1,479,000,000 India Government Bond 7.59% 20/3/2029	20,092,343	0.17
USD	4,400,000 Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027*	3,925,391	0.03
INR	500,000,000 Power Finance Corp Ltd 7.44% 11/6/2027	6,484,560	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
インド(続き)			
USD 600,000	Rural Electrification Corp Ltd 3.875% 7/7/2027	546,398	0.00
USD 4,400,000	Rural Electrification Corp Ltd 4.625% 22/3/2028*	4,203,451	0.04
USD 1,500,000	Suzlon Energy Ltd (Step-up coupon) 5.75% 16/7/2019	1,338,691	0.01
USD 116,049	Videocon Industries Ltd (Step-up coupon) 2.8% 31/12/2020	35,166	0.00
USD 4,900,000	Yes Bank Ifsc Banking Unit Branch 3.75% 6/2/2023	4,725,703	0.04
		53,292,071	0.45
インドネシア			
USD 295,000	ABM Investama Tbk PT 7.125% 1/8/2022	273,690	0.00
USD 1,535,000	Bukit Makmur Mandiri Utama PT 7.75% 13/2/2022*	1,544,594	0.01
USD 138,773	Bumi Resources Tbk PT 11/12/2022 (Zero Coupon)	68,230	0.00
USD 6,025,000	Indonesia Government International Bond 3.7% 8/1/2022*	6,017,469	0.05
USD 11,647,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	11,654,279	0.10
USD 4,185,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021	4,336,706	0.04
USD 7,462,000	Indonesia Government International Bond 4.875% 5/5/2021	7,721,327	0.07
USD 5,882,000	Indonesia Government International Bond 5.875% 13/3/2020*	6,146,690	0.05
IDR 265,918,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	15,597,633	0.13
IDR 6,668,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	389,553	0.00
IDR 248,333,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	15,109,789	0.13
IDR 58,610,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	3,954,086	0.03
IDR 28,480,000,000	Jasa Marga Persero Tbk PT 7.5% 11/12/2020	1,851,848	0.02
IDR 30,260,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	1,946,839	0.02
		76,612,733	0.65
国際機関			
EUR 400,000	European Investment Bank 1.375% 15/9/2021*	488,937	0.00
アイルランド			
USD 1,922,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	1,893,159	0.02
EUR 826,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)	1,063,364	0.01
EUR 743,000	Allied Irish Banks Plc FRN 26/11/2025	917,420	0.01
EUR 575,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.125% 15/5/2023	700,011	0.01
USD 3,206,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.25% 15/9/2022*	3,169,933	0.03
USD 6,911,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.625% 15/5/2023*	6,861,241	0.06
GBP 372,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027	471,979	0.00
EUR 525,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 6.75% 15/5/2024	663,275	0.01
USD 250,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 7.25% 15/5/2024	263,825	0.00
EUR 686,000	Aurium CLO II DAC FRN 13/10/2029	792,724	0.01
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	164,054	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	169,102	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	493,236	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		アイルランド(続き)		
EUR	760,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	833,806	0.01
EUR	1,400,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	1,603,818	0.01
EUR	600,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	662,931	0.00
EUR	750,000	Bank of Ireland FRN 18/6/2020 (Perpetual)	947,536	0.01
EUR	832,000	Bank of Ireland FRN 11/6/2024	993,776	0.01
GBP	1,370,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	1,721,954	0.01
USD	1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027	1,842,984	0.01
EUR	850,000	Bank of Ireland Group Plc 1.375% 29/8/2023	984,330	0.01
EUR	340,000	Cadogan Square CLO XI DAC FRN 15/2/2031	388,321	0.00
EUR	100,000	Caterpillar International Finance DAC 0.75% 13/10/2020	118,442	0.00
EUR	1,120,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	933,607	0.01
EUR	462,000	eircom Finance DAC 4.5% 31/5/2022	552,257	0.00
EUR	700,000	Halcyon Loan Advisors European Funding FRN 18/10/2031	805,978	0.01
EUR	720,000	OZLME IV DAC FRN 27/7/2032	830,683	0.01
EUR	977,000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.875% 15/1/2026*	1,169,097	0.01
EUR	666,373	Taurus 2016-2 DEU DAC ' Series 2016-DE2 C ' FRN 3/1/2027	783,203	0.01
EUR	708,144	Taurus 2016-2 DEU DAC ' Series 2016-DE2 D ' FRN 3/1/2027	834,303	0.01
GBP	693,000	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5.5% 15/9/2024	896,362	0.01
GBP	350,000	Virgin Media Receivables Financing Notes II DAC 5.75% 15/4/2023*	466,389	0.00
			34,993,100	0.30
		マン島		
USD	3,055,000	Gohl Capital Ltd 4.25% 24/1/2027	2,931,843	0.02
		イタリア		
GBP	200,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/2/2022 (Perpetual)	266,137	0.00
EUR	1,200,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 12/12/2042	1,634,666	0.01
EUR	203,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	244,903	0.00
EUR	700,000	Assicurazioni Generali SpA 4.125% 4/5/2026	842,580	0.01
EUR	350,000	Banca IFIS SpA FRN 17/10/2027	377,997	0.00
EUR	380,000	Banca IFIS SpA 2% 24/4/2023	415,990	0.00
EUR	1,960,000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA FRN 18/1/2028*	1,822,832	0.02
EUR	630,000	Banco BPM SpA 1.75% 24/4/2023	686,395	0.01
EUR	600,000	Banco BPM SpA 2.75% 27/7/2020	704,450	0.01
EUR	200,000	Banco BPM SpA 4.25% 30/1/2019	235,177	0.00
GBP	297,000	Enel SpA FRN 10/9/2075	426,235	0.00
EUR	6,120,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 19/1/2021 (Perpetual)*	7,361,124	0.06
EUR	8,410,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)*	10,208,508	0.09
EUR	1,750,000	Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 20/3/2028	1,806,029	0.02
EUR	2,050,000	Intesa Sanpaolo SpA 2.125% 30/8/2023	2,384,219	0.02
USD	3,844,000	Intesa Sanpaolo SpA ' 144A ' 3.375% 12/1/2023	3,553,849	0.03
USD	2,250,000	Intesa Sanpaolo SpA ' 144A ' 4.375% 12/1/2048	1,734,089	0.02
EUR	150,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.15% 16/7/2020	184,889	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR	200,000 Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13/9/2023	264,526	0.00
EUR	8,300,000 Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.2% 1/6/2027	8,964,334	0.08
EUR	451,000 LKQ Italia Bondco SpA 3.875% 1/4/2024*	558,826	0.01
EUR	562,000 Nexi Capital SpA FRN 1/5/2023	653,841	0.01
EUR	180,000 Nexi Capital SpA 4.125% 1/11/2023*	211,282	0.00
EUR	1,884,000 Sisal Group SpA 7% 31/7/2023*	2,269,185	0.02
EUR	320,000 Snaitech SpA 6.375% 7/11/2021	388,932	0.00
EUR	5,550,000 Taurus 2018-1 IT SRL ' Series 2018-IT1 A ' FRN 18/5/2030	6,456,026	0.06
EUR	1,205,000 Taurus 2018-1 IT SRL ' Series 2018-IT1 B ' FRN 18/5/2030	1,402,635	0.01
EUR	3,600,000 Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	3,987,255	0.03
EUR	475,000 Telecom Italia SpA/Milano 2.875% 28/1/2026*	551,443	0.01
EUR	1,155,000 Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	1,417,364	0.01
EUR	267,000 Telecom Italia SpA/Milano 3.625% 19/1/2024	332,000	0.00
USD	1,218,000 Telecom Italia SpA/Milano ' 144A ' 5.303% 30/5/2024	1,219,096	0.01
GBP	200,000 Telecom Italia SpA/Milano 5.875% 19/5/2023*	287,416	0.00
EUR	950,000 UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)*	1,102,815	0.01
EUR	3,935,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	5,074,897	0.04
EUR	4,455,000 UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)*	5,044,655	0.04
EUR	972,000 UniCredit SpA FRN 28/10/2025	1,183,904	0.01
EUR	740,000 UniCredit SpA FRN 3/1/2027	876,637	0.01
EUR	900,000 UniCredit SpA 6.95% 31/10/2022	1,192,589	0.01
EUR	200,000 Wind Tre SpA FRN 20/1/2024	219,502	0.00
EUR	450,000 Wind Tre SpA 2.625% 20/1/2023	501,916	0.00
EUR	900,000 Wind Tre SpA 3.125% 20/1/2025	981,690	0.01
		80,032,835	0.68
日本			
JPY	20,000,000 ANA Holdings Inc 16/9/2022 (Zero Coupon)	181,806	0.00
JPY	160,000,000 ANA Holdings Inc 19/9/2024 (Zero Coupon)	1,456,252	0.01
JPY	80,000,000 Chugoku Electric Power Co Inc/The 25/1/2022 (Zero Coupon)	772,709	0.01
USD	1,800,000 Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The FRN 24/7/2026 (Perpetual)	1,696,500	0.01
JPY	240,000,000 Daio Paper Corp 17/9/2020 (Zero Coupon)	2,373,662	0.02
JPY	40,000,000 Ezaki Glico Co Ltd 30/1/2024 (Zero Coupon)	371,792	0.00
JPY	40,000,000 HIS Co Ltd 30/8/2019 (Zero Coupon)	365,054	0.00
JPY	500,000,000 HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	4,651,167	0.04
JPY	80,000,000 Hosiden Corp 20/9/2024 (Zero Coupon)	716,870	0.01
JPY	290,000,000 Iida Group Holdings Co Ltd 18/6/2020 (Zero Coupon)	2,657,764	0.02
JPY	4,142,350,000 Japan Government Two Year Bond 0.1% 15/3/2020	37,514,805	0.32
JPY	11,530,400,000 Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2027	110,430,800	0.93
JPY	2,619,200,000 Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2028	24,891,769	0.21
JPY	250,000,000 Kansai Paint Co Ltd 17/6/2019 (Zero Coupon)	2,273,138	0.02
JPY	230,000,000 Kansai Paint Co Ltd 17/6/2022 (Zero Coupon)	2,105,817	0.02
JPY	90,000,000 Kyushu Electric Power Co Inc 31/3/2022 (Zero Coupon)	839,411	0.01
JPY	230,000,000 LIXIL Group Corp 4/3/2020 (Zero Coupon)	2,063,005	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		日本(続き)		
JPY	100,000,000	LIXIL Group Corp 4/3/2022 (Zero Coupon)	895,379	0.01
JPY	490,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,613,244	0.04
JPY	140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,341,545	0.01
USD	1,635,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.535% 26/7/2021	1,641,241	0.01
USD	1,905,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp '144A' 2.45% 16/10/2019	1,893,138	0.02
USD	900,000	Mitsui OSK Lines Ltd 24/4/2020 (Zero Coupon)	866,825	0.01
JPY	170,000,000	Nagoya Railroad Co Ltd 11/12/2024 (Zero Coupon)	1,614,774	0.01
USD	1,330,000	Nippon Life Insurance Co FRN 20/1/2046	1,323,350	0.01
JPY	380,000,000	Resorttrust Inc 1/12/2021 (Zero Coupon)	3,410,158	0.03
JPY	40,000,000	Sapporo Holdings Ltd 27/4/2021 (Zero Coupon)	357,854	0.00
JPY	380,000,000	SBI Holdings Inc/Japan 13/9/2023 (Zero Coupon)	3,809,260	0.03
JPY	150,000,000	Shimizu Corp 16/10/2020 (Zero Coupon)	1,383,173	0.01
USD	600,000	Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	600,900	0.01
EUR	1,225,000	SoftBank Group Corp 4% 20/4/2023*	1,497,926	0.01
EUR	681,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	822,985	0.01
EUR	660,000	SoftBank Group Corp 5% 15/4/2028	770,413	0.01
JPY	240,000,000	T&D Holdings Inc 5/6/2020 (Zero Coupon)	2,176,797	0.02
JPY	80,000,000	Takashimaya Co Ltd 11/12/2018 (Zero Coupon)	721,173	0.01
JPY	50,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2018 (Zero Coupon)	449,014	0.00
JPY	320,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	2,852,810	0.02
JPY	120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,092,460	0.01
USD	3,000,000	Yamaguchi Financial Group Inc FRN 26/3/2020	3,044,610	0.03
			232,541,350	1.97
		ジャージー		
GBP	3,277,000	AA Bond Co Ltd 2.75% 31/7/2023	3,982,870	0.03
GBP	130,000	AA Bond Co Ltd 4.249% 31/7/2020	174,031	0.00
GBP	440,000	AA Bond Co Ltd 4.875% 31/7/2024	576,671	0.01
EUR	1,855,000	Adient Global Holdings Ltd 3.5% 15/8/2024*	2,031,381	0.02
GBP	5,838,000	CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022*	7,583,124	0.06
GBP	157,000	CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	203,620	0.00
USD	2,200,000	HBOS Capital Funding LP 6.85% 23/12/2018 (Perpetual)	2,224,750	0.02
EUR	1,127,501	LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024	1,310,521	0.01
EUR	442,000	Lincoln Finance Ltd 6.875% 15/4/2021	532,231	0.00
EUR	700,000	PT Jersey Ltd 0.5% 19/11/2019	788,741	0.01
USD	1,800,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	2,216,214	0.02
			21,624,154	0.18
		ルクセンブルグ		
USD	2,545,000	Allergan Funding SCS 3.45% 15/3/2022	2,526,708	0.02
USD	1,559,000	Altice Financing SA '144A' 6.625% 15/2/2023	1,568,744	0.01
USD	3,650,000	Altice Financing SA '144A' 7.5% 15/5/2026*	3,485,750	0.03
EUR	1,510,000	Altice Finco SA 4.75% 15/1/2028*	1,484,216	0.01
USD	700,000	Altice Finco SA '144A' 7.625% 15/2/2025	618,625	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
USD	2,082,000 Altice Luxembourg SA ' 144A ' 7.75% 15/5/2022*	2,019,540	0.02
EUR	2,432,000 ArcelorMittal 2.875% 6/7/2020	2,971,266	0.03
EUR	855,000 ArcelorMittal 3% 9/4/2021	1,058,245	0.01
USD	180,000 ArcelorMittal 5.25% 5/8/2020	185,419	0.00
EUR	200,000 ARD Finance SA 6.625% 15/9/2023*	240,825	0.00
GBP	200,000 B&M European Value Retail SA 4.125% 1/2/2022	263,100	0.00
EUR	125,000 BMBG Bond Finance SCA 3% 15/6/2021	147,309	0.00
GBP	100,000 Cabot Financial Luxembourg SA 6.5% 1/4/2021	130,342	0.00
GBP	1,154,000 Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023*	1,476,346	0.01
EUR	624,000 Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 1/11/2021*	685,090	0.01
USD	1,940,000 Codere Finance 2 Luxembourg SA ' 144A ' 7.625% 1/11/2021	1,792,317	0.02
EUR	534,000 ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 1/8/2023	622,837	0.01
EUR	880,000 DEA Finance SA 7.5% 15/10/2022	1,105,734	0.01
USD	3,092,630 Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	3,040,303	0.03
EUR	12,840,000 European Financial Stability Facility 0.875% 26/7/2027	15,247,887	0.13
EUR	819,000 Fiat Chrysler Finance Europe SA 4.75% 15/7/2022	1,069,054	0.01
EUR	280,000 Fiat Chrysler Finance Europe SA 6.75% 14/10/2019	349,718	0.00
EUR	150,000 FMC Finance VII SA 5.25% 15/2/2021	195,856	0.00
EUR	460,000 Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023*	480,239	0.00
USD	5,338,000 Gilex Holding Sarl ' 144A ' 8.5% 2/5/2023	5,571,591	0.05
USD	3,544,000 Hidrovias International Finance SARL ' 144A ' 5.95% 24/1/2025*	3,233,900	0.03
EUR	325,000 Horizon Parent Holdings Sarl 8.25% 15/2/2022*	397,021	0.00
EUR	500,000 INEOS Group Holdings SA 5.375% 1/8/2024	614,843	0.01
USD	2,143,000 Intelsat Connect Finance SA ' 144A ' 9.5% 15/2/2023	2,140,300	0.02
USD	422,000 Intelsat Jackson Holdings SA 7.25% 15/10/2020	423,055	0.00
USD	138,000 Intelsat Jackson Holdings SA 7.5% 1/4/2021	140,070	0.00
USD	139,000 Intelsat Jackson Holdings SA ' 144A ' 8% 15/2/2024	146,645	0.00
USD	458,000 Intelsat SA ' 144A ' 4.5% 15/6/2025	681,717	0.01
EUR	282,000 LHMC Finco Sarl 6.25% 20/12/2023	338,305	0.00
EUR	67,000 Matterhorn Telecom SA FRN 1/2/2023	78,203	0.00
EUR	505,000 Matterhorn Telecom SA 3.875% 1/5/2022	600,972	0.00
EUR	775,000 Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027*	865,348	0.01
USD	5,770,000 Puma International Financing SA ' 144A ' 5% 24/1/2026*	5,117,817	0.04
USD	1,069,000 Rede D ' or Finance Sarl ' 144A ' 4.95% 17/1/2028*	938,047	0.01
USD	3,903,000 Rumo Luxembourg Sarl ' 144A ' 5.875% 18/1/2025	3,546,851	0.03
USD	4,451,000 Rumo Luxembourg Sarl ' 144A ' 7.375% 9/2/2024	4,462,127	0.04
EUR	186,000 SCHMOLZ + BICKENBACH Luxembourg Finance SA 5.625% 15/7/2022	225,935	0.00
EUR	2,300,000 SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)*	2,776,941	0.02
USD	1,020,000 Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033	1,042,312	0.01
USD	370,000 Telecom Italia Capital SA 7.175% 18/6/2019	380,637	0.00
EUR	933,000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033*	1,489,609	0.01
EUR	999,000 Telenet Finance VI Luxembourg SCA 4.875% 15/7/2027*	1,250,580	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		ルクセンブルグ(続き)		
USD	1,498,000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.75% 15/7/2025	1,404,375	0.01
			80,632,671	0.68
		マレーシア		
USD	3,200,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	3,272,000	0.02
USD	1,000,000	Cahaya Capital Ltd 18/9/2021 (Zero Coupon)	994,486	0.01
USD	8,874,000	Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	8,192,508	0.07
USD	972,000	Press Metal Labuan Ltd 4.8% 30/10/2022	916,951	0.01
			13,375,945	0.11
		モルディブ		
USD	2,680,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	2,559,400	0.02
		モーリシャス		
USD	3,596,000	Greenko Investment Co 4.875% 16/8/2023	3,262,112	0.03
USD	650,000	Lodha Developers International Ltd 12% 13/3/2020	674,976	0.01
USD	4,445,000	UPL Corp Ltd 4.5% 8/3/2028*	4,138,588	0.03
			8,075,676	0.07
		メキシコ		
USD	1,231,000	Alpha Holding SA de CV '144A' 10% 19/12/2022	1,111,193	0.01
USD	1,886,000	Axtel SAB de CV 6.375% 14/11/2024*	1,834,135	0.01
USD	4,895,000	Axtel SAB de CV '144A' 6.375% 14/11/2024*	4,760,387	0.04
USD	5,052,000	Cydsa SAB de CV '144A' 6.25% 4/10/2027	4,742,363	0.04
USD	1,297,000	Cydsa SAB de CV 6.25% 4/10/2027	1,217,507	0.01
USD	1,569,000	Docuformas SAPI de CV '144A' 9.25% 11/10/2022	1,427,790	0.01
USD	2,872,000	Grupo Bimbo SAB de CV '144A' FRN 17/4/2023 (Perpetual)	2,882,519	0.02
USD	6,027,000	Grupo KUO SAB De CV '144A' 5.75% 7/7/2027	5,755,785	0.05
MXN	999,004	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	4,603,821	0.04
USD	2,380,000	Mexichem SAB de CV '144A' 5.5% 15/1/2048	2,195,550	0.02
USD	14,756,000	Petroleos Mexicanos '144A' 5.35% 12/2/2028	13,833,750	0.12
USD	17,602,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 21/1/2021	18,077,254	0.15
USD	3,454,000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	3,212,220	0.03
USD	1,135,000	Trust F/1401 6.95% 30/1/2044*	1,161,956	0.01
USD	3,506,000	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR '144A' FRN 29/1/2025 (Perpetual)	3,304,405	0.03
			70,120,635	0.59
		モンゴル		
USD	473,991	Energy Resources LLC FRN 30/9/2022	466,325	0.00
		オランダ		
EUR	1,000,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	1,247,043	0.01
EUR	2,600,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2027 (Perpetual)*	2,949,002	0.03
EUR	2,432,000	ABN AMRO Bank NV 6.375% 27/4/2021	3,276,477	0.03
EUR	700,000	ALME Loan Funding V BV FRN 15/7/2031	813,695	0.01
USD	3,750,000	AT Securities BV FRN 21/7/2023 (Perpetual)*	3,499,669	0.03
EUR	400,000	ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)	473,862	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	オランダ(続き)		
EUR	423,000 Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	509,655	0.00
EUR	1,000,000 Bayer Capital Corp BV 1.5% 26/6/2026	1,163,418	0.01
EUR	700,000 Bayer Capital Corp BV 2.125% 15/12/2029	819,883	0.01
GBP	200,000 Cable & Wireless International Finance BV 8.625% 25/3/2019	267,540	0.00
EUR	600,000 Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	676,030	0.01
EUR	300,000 Cairn CLO IX BV FRN 21/3/2032	337,916	0.00
EUR	880,000 Ceva Logistics Finance BV 5.25% 1/8/2025	1,021,785	0.01
EUR	609,000 Constellium NV 4.25% 15/2/2026	722,901	0.01
EUR	907,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2020 (Perpetual)	1,127,711	0.01
EUR	400,000 Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/6/2021 (Perpetual)	524,824	0.00
EUR	575,000 Daimler International Finance BV 1.5% 9/2/2027	669,377	0.01
USD	3,844,000 Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 1.95% 19/9/2021	3,679,740	0.03
EUR	798,000 Diamond BC BV 5.625% 15/8/2025*	873,218	0.01
EUR	229,000 Dryden 32 Euro CLO 2014 B.V. FRN 15/8/2031	266,492	0.00
EUR	150,000 E.ON International Finance BV 5.75% 7/5/2020	191,702	0.00
EUR	2,025,000 ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG FRN 29/9/2047	2,409,862	0.02
EUR	500,000 Encavis Finance BV FRN 13/9/2023 (Perpetual)	601,643	0.01
USD	415,000 Enel Finance International NV '144A' 3.625% 25/5/2027	382,619	0.00
EUR	769,000 Energizer Gamma Acquisition BV 4.625% 15/7/2026	926,142	0.01
EUR	540,000 Fiat Chrysler Automobiles NV 3.75% 29/3/2024	680,526	0.01
USD	573,000 Fiat Chrysler Automobiles NV 4.5% 15/4/2020	578,014	0.01
EUR	200,000 Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	243,986	0.00
EUR	1,200,000 Gas Natural Fenosa Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)*	1,388,644	0.01
EUR	200,000 Goodyear Dunlop Tires Europe BV 3.75% 15/12/2023	240,567	0.00
EUR	360,000 Heineken NV 1.25% 10/9/2021	432,232	0.00
EUR	1,651,000 Hertz Holdings Netherlands BV 5.5% 30/3/2023	1,960,209	0.02
USD	2,580,000 ING Groep NV FRN 16/4/2020 (Perpetual)	2,565,810	0.02
USD	3,600,000 ING Groep NV FRN 22/3/2028*	3,593,034	0.03
EUR	2,400,000 ING Groep NV FRN 22/3/2030	2,751,384	0.02
EUR	490,000 InterXion Holding NV 4.75% 15/6/2025*	595,025	0.01
USD	567,000 Jababeka International BV 6.5% 5/10/2023	457,845	0.00
EUR	360,000 Koninklijke Ahold Delhaize NV FRN 19/3/2021	419,733	0.00
EUR	832,000 Koninklijke KPN NV FRN 14/9/2018 (Perpetual)	970,762	0.01
GBP	420,000 Koninklijke KPN NV FRN 14/3/2073	579,117	0.01
EUR	1,250,000 NN Group NV FRN 13/6/2024 (Perpetual)	1,546,235	0.01
USD	2,437,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	2,421,769	0.02
USD	200,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 15/6/2020	202,250	0.00
USD	11,202,000 NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	11,244,007	0.10
EUR	2,546,000 Nyrstar Netherlands Holdings BV 6.875% 15/3/2024*	2,638,358	0.02
EUR	484,000 OCI NV 5% 15/4/2023	593,070	0.01
EUR	175,000 OI European Group BV 3.125% 15/11/2024	209,926	0.00
USD	5,547,000 Petrobras Global Finance BV 5.999% 27/1/2028	5,033,486	0.04

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		オランダ(続き)		
USD	4,400,000	Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022	4,485,800	0.04
USD	5,547,000	Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027*	5,531,746	0.05
USD	5,547,000	Petrobras Global Finance BV 8.75% 23/5/2026	5,938,063	0.05
EUR	634,000	Promontoria Holding 264 BV 6.75% 15/8/2023	738,533	0.01
EUR	3,236,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2021 (Perpetual)	3,947,311	0.03
EUR	704,000	Repsol International Finance BV FRN 25/3/2075	880,745	0.01
USD	538,000	Royal Capital BV FRN 5/5/2024 (Perpetual)	511,773	0.00
USD	1,882,000	Royal Capital BV 5.875% 5/5/2022 (Perpetual)	1,764,375	0.02
USD	2,585,000	Shell International Finance BV 2.25% 10/11/2020	2,549,909	0.02
EUR	4,400,000	Telefonica Europe BV FRN 4/12/2019 (Perpetual)	5,293,182	0.05
GBP	400,000	Telefonica Europe BV FRN 26/11/2020 (Perpetual)	557,505	0.00
EUR	800,000	Telefonica Europe BV FRN 18/9/2021 (Perpetual)	1,075,562	0.01
EUR	2,400,000	Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)	2,830,815	0.02
EUR	400,000	Telefonica Europe BV FRN 7/6/2023 (Perpetual)	435,534	0.00
EUR	1,100,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	1,385,758	0.01
USD	1,107,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 1.7% 19/7/2019	1,090,312	0.01
EUR	215,000	Unilever NV 1.75% 5/8/2020	259,276	0.00
EUR	1,174,000	United Group BV FRN 1/7/2023	1,379,774	0.01
EUR	1,071,000	United Group BV 4.375% 1/7/2022	1,291,350	0.01
EUR	454,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024	543,936	0.00
EUR	1,950,000	UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029*	2,200,201	0.02
USD	1,400,000	UPC Holding BV ' 144A ' 5.5% 15/1/2028	1,310,750	0.01
EUR	400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 30/3/2019	465,949	0.00
EUR	1,400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,618,977	0.01
EUR	2,500,000	Volkswagen International Finance NV 0.5% 30/3/2021	2,924,895	0.03
EUR	365,000	Volkswagen International Finance NV 2% 26/3/2021	443,460	0.00
USD	1,280,000	Volkswagen International Finance NV ' 144A ' 4% 12/8/2020	1,296,653	0.01
EUR	753,000	Ziggo Bond Co BV 7.125% 15/5/2024	941,100	0.01
EUR	300,000	Ziggo Bond Finance BV 4.625% 15/1/2025	348,303	0.00
EUR	2,720,000	Ziggo BV 4.25% 15/1/2027*	3,174,467	0.03
USD	8,437,000	Ziggo BV ' 144A ' 5.5% 15/1/2027	7,951,872	0.07
			135,946,081	1.15
		ノルウェー		
USD	225,000	Aker BP ASA ' 144A ' 5.875% 31/3/2025*	234,281	0.00
USD	400,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2020 (Perpetual)	401,854	0.00
USD	600,000	DNB Bank ASA FRN 26/3/2022 (Perpetual)	619,905	0.01
EUR	760,000	SpareBank 1 SMN 0.75% 8/6/2021*	897,243	0.01
			2,153,283	0.02
		パナマ		
USD	553,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA ' 144A ' 5.625% 18/5/2036	575,820	0.00
USD	624,000	AES Panama SRL ' 144A ' 6% 25/6/2022	643,500	0.01
USD	3,156,000	Avianca Holdings SA / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd 8.375% 10/5/2020	3,171,780	0.03

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		パナマ(続き)		
USD	2,935,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	2,980,368	0.02
			7,371,468	0.06
		ペルー		
USD	2,351,000	Orazul Energy Egenor S en C por A '144A' 5.625% 28/4/2027	2,162,920	0.02
		ポルトガル		
EUR	200,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 2.625% 8/5/2017	72,151	0.00
EUR	1,800,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) 4% 21/1/2019	638,882	0.00
EUR	2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4.75% 15/1/2018	651,683	0.01
EUR	18,700,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4% 21/1/2019	6,637,279	0.06
EUR	900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,093,864	0.01
EUR	500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	587,446	0.00
EUR	8,592,864	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta IV 2.423% 12/2/2021	10,194,055	0.09
EUR	16,405,475	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta V 0.85% 12/2/2022	19,081,916	0.16
			38,957,276	0.33
		ロシア連邦		
USD	17,400,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5% 29/4/2020	17,748,000	0.15
		サウジアラビア		
USD	1,824,000	Saudi Government International Bond '144A' 4.5% 17/4/2030	1,844,156	0.02
		シンガポール		
USD	1,056,241	Eterna Capital Pte Ltd 8% 11/12/2022	1,022,851	0.01
USD	2,701,000	Global Prime Capital Pte Ltd 7.25% 26/4/2021	2,706,041	0.02
USD	4,075,000	Medco Straits Services Pte Ltd 8.5% 17/8/2022	4,166,801	0.03
USD	762,000	Modernland Overseas Pte Ltd 6.95% 13/4/2024	650,557	0.01
EUR	3,175,000	Mulhacen Pte Ltd 6.5% 1/8/2023*	3,713,286	0.03
USD	480,000	Oil India International Pte Ltd 4% 21/4/2027*	443,654	0.00
USD	3,855,000	SSMS Plantation Holdings Pte Ltd 7.75% 23/1/2023*	3,553,019	0.03
SGD	4,750,000	Suntec Real Estate Investment Trust 1.75% 30/11/2024	3,376,722	0.03
USD	3,325,000	United Overseas Bank Ltd FRN 19/10/2023 (Perpetual)	3,122,175	0.03
			22,755,106	0.19
		南アフリカ		
USD	7,758,000	Eskom Holdings SOC Ltd '144A' 6.35% 10/8/2028*	7,784,144	0.07
ZAR	465,731,000	Republic of South Africa Government Bond 6.25% 31/3/2036	22,594,629	0.19
ZAR	516,693,921	Republic of South Africa Government Bond 6.5% 28/2/2041*	24,641,006	0.21
ZAR	170,184,000	Republic of South Africa Government Bond 8.5% 31/1/2037	10,330,434	0.09
ZAR	94,520,000	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 28/2/2048	5,753,633	0.05

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
南アフリカ(続き)				
USD	22,651,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.5% 9/3/2020	23,160,648	0.19
USD	10,209,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	10,642,883	0.09
USD	17,645,000	Republic of South Africa Government International Bond 6.875% 27/5/2019	18,086,125	0.15
			122,993,502	1.04
韓国				
USD	1,994,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2047	1,800,305	0.01
KRW	1,600,000,000	Kakao Corp 11/5/2021 (Zero Coupon)	1,568,335	0.01
USD	3,200,000	KDB Life Insurance Co Ltd FRN 21/5/2048	3,087,960	0.03
EUR	1,100,000	LG Chem Ltd 16/4/2021 (Zero Coupon)	1,300,894	0.01
USD	4,200,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 13/8/2023 (Perpetual)	4,193,700	0.04
USD	6,500,000	Woori Bank FRN 16/5/2022 (Perpetual)*	6,358,625	0.05
USD	1,900,000	Woori Bank 5.125% 6/8/2028	1,920,434	0.02
			20,230,253	0.17
スペイン				
EUR	400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 19/2/2019 (Perpetual)	471,530	0.00
EUR	4,600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)*	5,961,174	0.05
EUR	2,600,000	Banco de Sabadell SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	3,080,831	0.03
EUR	2,800,000	Banco de Sabadell SA 0.875% 5/3/2023	3,202,649	0.03
EUR	2,800,000	Banco de Sabadell SA 5.625% 6/5/2026	3,686,117	0.03
EUR	600,000	Banco Santander SA FRN 12/3/2019 (Perpetual)	706,388	0.01
EUR	1,900,000	Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)*	2,389,502	0.02
EUR	8,200,000	Banco Santander SA FRN 19/3/2025 (Perpetual)*	8,529,761	0.07
EUR	3,800,000	Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	4,502,753	0.04
EUR	900,000	Bankia SA FRN 22/5/2024	1,073,825	0.01
EUR	800,000	Bankia SA FRN 15/3/2027	953,059	0.01
EUR	1,100,000	Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	1,260,298	0.01
EUR	400,000	Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	434,051	0.00
EUR	3,800,000	CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)	4,766,976	0.04
EUR	800,000	CaixaBank SA FRN 23/3/2026 (Perpetual)*	859,906	0.01
EUR	100,000	CaixaBank SA FRN 15/2/2027	122,555	0.00
EUR	500,000	CaixaBank SA FRN 14/7/2028	592,741	0.01
EUR	900,000	Cellnex Telecom SA 1.5% 16/1/2026	1,102,960	0.01
EUR	400,000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 1.625% 28/11/2025	451,738	0.00
EUR	500,000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 2.5% 28/11/2029	570,819	0.00
EUR	210,000	NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023	256,295	0.00
EUR	400,000	SRF 2017-1 FT FRN 26/4/2063	467,406	0.00
EUR	900,000	SRF 2017-1 FT 'Series 2017-1 B' FRN 26/4/2063	1,059,781	0.01
EUR	200,000	SRF 2017-1 FT 'Series 2017-1 C' FRN 26/4/2063	234,514	0.00
EUR	960,000	Tendam Brands SAU 5% 15/9/2024*	1,088,337	0.01
			47,825,966	0.40

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		スリランカ		
LKR	368,000,000	Sri Lanka Government Bonds 10% 15/3/2023	2,286,448	0.02
LKR	398,010,000	Sri Lanka Government Bonds 11% 1/8/2021	2,551,091	0.02
LKR	526,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.5% 15/12/2021	3,420,511	0.03
LKR	324,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.5% 1/9/2028	2,160,341	0.02
LKR	98,000,000	Sri Lanka Government Bonds 11.75% 15/6/2027	661,067	0.01
USD	300,000	SriLankan Airlines Ltd 5.3% 27/6/2019	298,943	0.00
			11,378,401	0.10
		スウェーデン		
EUR	200,000	Akelius Residential Property AB FRN 5/10/2078	230,749	0.00
SEK	5,094,267	Bluestep Mortgage Securities No2 Ltd FRN 10/11/2055	563,189	0.01
EUR	934,000	Intrum AB 2.75% 15/7/2022	1,063,568	0.01
EUR	120,000	Intrum AB 3.125% 15/7/2024	133,516	0.00
USD	2,570,000	Nordea Bank AB '144A' 2.5% 17/9/2020	2,532,753	0.02
USD	600,000	Swedbank AB FRN 17/3/2020 (Perpetual)	602,250	0.01
USD	400,000	Swedbank AB FRN 17/3/2022 (Perpetual)*	402,812	0.00
EUR	2,008,000	Telia Co AB 4.75% 16/11/2021	2,673,534	0.02
EUR	641,000	Unilabs Subholding AB 5.75% 15/5/2025	723,082	0.01
EUR	202,500	Verisure Holding AB 6% 1/11/2022	244,900	0.00
EUR	360,000	Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023*	422,576	0.00
EUR	2,380,000	Volvo Car AB 2% 24/1/2025*	2,747,705	0.02
			12,340,634	0.10
		スイス		
USD	3,885,000	Credit Suisse AG 6.5% 8/8/2023	4,168,642	0.04
USD	2,905,000	Credit Suisse AG/New York NY 4.375% 5/8/2020	2,967,687	0.03
USD	3,645,000	Credit Suisse Group AG FRN 29/7/2022 (Perpetual)	3,771,919	0.03
USD	7,425,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 17/7/2023 (Perpetual)	7,696,013	0.07
USD	300,000	Credit Suisse Group AG FRN 17/7/2023 (Perpetual)	310,950	0.00
USD	2,700,000	Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	2,885,625	0.03
USD	400,000	Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)	401,500	0.00
EUR	1,025,000	UBS AG/London FRN 23/4/2021	1,200,131	0.01
EUR	2,530,000	UBS AG/London 0.25% 10/1/2022	2,940,900	0.03
USD	400,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 22/3/2021 (Perpetual)	415,462	0.00
USD	420,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 10/8/2021 (Perpetual)	439,066	0.00
EUR	1,100,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	1,422,503	0.01
USD	1,675,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 31/1/2023 (Perpetual)	1,451,470	0.01
USD	200,000	UBS Group Funding Switzerland AG FRN 19/2/2025 (Perpetual)	212,738	0.00
USD	1,335,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 3.491% 23/5/2023	1,316,610	0.01
EUR	1,800,000	Zuercher Kantonalbank FRN 15/6/2027	2,166,733	0.02
			33,767,949	0.29

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		台湾		
USD	2,400,000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,306,730	0.02
USD	2,100,000	Neo Solar Power Corp 27/10/2019 (Zero Coupon)	2,046,188	0.02
			4,352,918	0.04
		タイ		
USD	2,800,000	PTTEP Treasury Center Co Ltd FRN 17/7/2022 (Perpetual)	2,704,156	0.02
USD	2,900,000	Singha Estate PCL 2% 20/7/2022	2,758,772	0.03
			5,462,928	0.05
		トルコ		
USD	3,127,000	Petkim Petrokimya Holding AS '144A' 5.875% 26/1/2023*	2,688,907	0.02
USD	11,539,000	Turkey Government International Bond 6.25% 26/9/2022	10,500,490	0.09
USD	1,649,711	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.2% 15/3/2027	1,518,990	0.01
			14,708,387	0.12
		アラブ首長国連邦		
USD	5,180,000	Abu Dhabi Government International Bond 4.125% 11/10/2047	4,963,087	0.04
		英国		
GBP	1,100,000	Ardonagh Midco 3 Plc 8.375% 15/7/2023	1,424,795	0.01
EUR	254,000	Arrow Global Finance Plc FRN 1/4/2025	274,591	0.00
EUR	174,000	Arrow Global Finance Plc FRN 1/3/2026*	193,617	0.00
GBP	896,000	Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	1,068,624	0.01
USD	2,560,000	Barclays Bank Plc 2.65% 11/1/2021	2,514,605	0.02
EUR	2,800,000	Barclays Plc FRN 15/12/2020 (Perpetual)	3,615,865	0.03
USD	527,000	Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	549,304	0.01
GBP	1,780,000	Barclays Plc FRN 15/3/2023 (Perpetual)	2,394,773	0.02
USD	9,150,000	Barclays Plc FRN 15/9/2023 (Perpetual)*	9,275,813	0.08
EUR	400,000	Barclays Plc FRN 11/11/2025	470,263	0.00
EUR	2,432,000	Barclays Plc 1.875% 23/3/2021	2,936,571	0.03
EUR	100,000	BAT International Finance Plc 4% 7/7/2020	124,868	0.00
EUR	570,000	Boparan Finance Plc 4.375% 15/7/2021*	617,508	0.01
GBP	496,000	Boparan Finance Plc 5.5% 15/7/2021*	595,535	0.01
USD	2,345,000	BP Capital Markets Plc 1.676% 3/5/2019	2,332,083	0.02
USD	435,000	BP Capital Markets Plc 2.237% 10/5/2019	433,819	0.00
GBP	133,771	Brass No 3 Plc FRN 16/4/2051	173,619	0.00
GBP	1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,119,449	0.01
GBP	4,392,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	5,108,158	0.04
GBP	666,297	Castell 2017-1 Plc 'Series 2017-1 X' FRN 25/10/2044	864,505	0.01
EUR	3,239,000	Centrica Plc FRN 10/4/2076	3,866,664	0.03
GBP	1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,395,358	0.02
EUR	3,925,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,668,410	0.04
EUR	2,625,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	3,149,708	0.03
EUR	360,000	Coca-Cola European Partners Plc FRN 16/11/2021	419,258	0.00
GBP	200,000	Cognita Financing Plc 7.75% 15/8/2021	266,363	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 345,000	Coventry Building Society FRN 1/11/2019 (Perpetual)	459,229	0.00
EUR 360,000	Diageo Finance Plc 17/11/2020 (Zero Coupon)	418,952	0.00
GBP 1,450,112	Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	2,003,219	0.02
GBP 350,000	Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	438,758	0.00
EUR 713,000	EC Finance Plc 2.375% 15/11/2022*	835,906	0.01
GBP 923,100	E-CARAT 5 Plc FRN 18/4/2023	1,203,950	0.01
GBP 10,240,000	EI Group Plc 6% 6/10/2023	14,463,766	0.12
GBP 565,000	EI Group Plc 6.375% 15/2/2022	759,018	0.01
GBP 390,000	EI Group Plc 6.875% 15/2/2021	552,444	0.01
GBP 308,640	Eurosail 2006-4np Plc ' Series 2006-4X A3C ' FRN 10/12/2044	396,808	0.00
GBP 2,214,135	Eurosail-UK 2007-4bl Plc ' Series 2007-4X A3 ' FRN 13/6/2045	2,872,575	0.02
GBP 1,054,234	Eurosail-UK 2007-4bl Plc ' Series 2007-4X A4 ' FRN 13/6/2045	1,352,743	0.01
EUR 400,000	Experian Finance Plc 4.75% 4/2/2020	497,398	0.00
GBP 1,325,000	Finsbury Square 2016-1 Plc ' Series 2016-1 B ' FRN 16/2/2058	1,746,625	0.02
GBP 781,000	Finsbury Square 2016-2 Plc ' Series 2016-2 B ' FRN 16/8/2058	1,022,308	0.01
GBP 967,000	Finsbury Square 2016-2 Plc ' Series 2016-2 C ' FRN 16/8/2058	1,268,698	0.01
GBP 949,979	Finsbury Square 2017-1 Plc ' Series 2017-1 C ' FRN 12/3/2059	1,244,640	0.01
GBP 1,385,970	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,799,501	0.02
GBP 2,185,952	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	2,834,702	0.02
GBP 455,000	Gemgarto 2015-2 Plc ' Series 2015-2 B ' FRN 16/2/2054	592,181	0.01
GBP 885,000	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	1,128,751	0.01
GBP 306,000	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	388,986	0.00
GBP 2,700,000	GKN Holdings Plc 3.375% 12/5/2032	3,599,933	0.03
EUR 400,000	GlaxoSmithKline Capital Plc 12/9/2020 (Zero Coupon)	466,234	0.00
EUR 400,000	GlaxoSmithKline Capital Plc 0.625% 2/12/2019	469,933	0.00
GBP 615,000	Gosforth Funding 2014-1 Plc ' Series 2014-1 A2 ' FRN 19/10/2056	798,470	0.01
GBP 5,390,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc ' Series 2007-2X BA ' FRN 18/6/2039	6,322,660	0.05
GBP 9,991,824	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	13,120,087	0.11
GBP 1,325,547	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	1,830,738	0.02
GBP 3,220,000	Hawksmoor Mortgages 2016-1 Plc ' Series 2016-1 B ' FRN 25/5/2053	4,202,415	0.04
USD 200,000	HSBC Holdings Plc FRN 17/1/2020 (Perpetual)	200,500	0.00
EUR 600,000	HSBC Holdings Plc FRN 16/9/2022 (Perpetual)	745,098	0.01
USD 550,000	HSBC Holdings Plc FRN 23/3/2023 (Perpetual)	554,813	0.01
USD 800,000	HSBC Holdings Plc FRN 17/9/2024 (Perpetual)	800,000	0.01
USD 600,000	HSBC Holdings Plc FRN 30/3/2025 (Perpetual)	603,000	0.01
USD 575,000	HSBC Holdings Plc FRN 23/3/2028 (Perpetual)	564,219	0.01
EUR 400,000	HSBC Holdings Plc FRN 4/7/2029 (Perpetual)	461,113	0.00
USD 1,335,000	HSBC Holdings Plc 3.6% 25/5/2023	1,329,981	0.01
EUR 200,000	Imperial Brands Finance Plc 0.5% 27/7/2021	233,972	0.00
EUR 561,000	INEOS Finance Plc 4% 1/5/2023	667,962	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 849,000	International Game Technology Plc 3.5% 15/7/2024*	1,002,334	0.01
EUR 170,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	215,259	0.00
USD 3,108,000	International Game Technology Plc '144A' 5.625% 15/2/2020*	3,177,930	0.03
USD 949,000	International Game Technology Plc '144A' 6.25% 15/2/2022	984,113	0.01
GBP 280,000	Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	344,929	0.00
GBP 1,094,000	Jerrold Finco Plc 6.125% 15/1/2024*	1,409,546	0.01
GBP 1,042,000	Jerrold Finco Plc 6.25% 15/9/2021*	1,384,749	0.01
EUR 2,202,500	Kensington Mortgage Securities Plc 'Series 2007-1X A3B' ' FRN 14/6/2040	2,500,583	0.02
GBP 850,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023*	1,164,769	0.01
EUR 296,000	Leeds Building Society 2.625% 1/4/2021	363,585	0.00
USD 300,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 1/10/2035 (Perpetual)*	301,485	0.00
USD 87,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	89,828	0.00
USD 513,000	Lloyds Banking Group Plc '144A' FRN 21/5/2037 (Perpetual)	529,673	0.01
USD 1,775,000	Lloyds Banking Group Plc 4.344% 9/1/2048*	1,584,589	0.01
EUR 887,447	Ludgate Funding Plc 'Series 2007-1 BB' FRN 1/1/2061	933,419	0.01
EUR 760,669	Ludgate Funding Plc 'Series 2007-1 MB' FRN 1/1/2061	801,441	0.01
USD 7,835,000	MARB BondCo Plc '144A' 6.875% 19/1/2025*	7,306,138	0.06
GBP 161,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2016-1 Plc ' Series 2016-1 B' FRN 20/10/2024	209,640	0.00
GBP 599,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2017-1 Plc FRN 20/12/2027	780,265	0.01
GBP 669,000	Marketplace Originated Consumer Assets 2017-1 Plc FRN 20/12/2027	869,893	0.01
GBP 410,000	Matalan Finance Plc 6.75% 31/1/2023	491,463	0.00
GBP 1,555,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,512,466	0.01
GBP 2,137,000	Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,793,420	0.02
GBP 426,000	Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	554,562	0.01
GBP 355,000	Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	456,394	0.00
USD 1,000,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/11/2018 (Perpetual)	813,770	0.01
GBP 29,213	Nationwide Building Society FRN 20/12/2018 (Perpetual)	5,767,973	0.05
USD 960,000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15/5/2025	933,600	0.01
GBP 2,200,000	Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/7/2025	2,867,153	0.02
GBP 1,750,000	Newday Funding 2017-1 Plc 'Series 2017-1 D' FRN 15/7/2025	2,289,098	0.02
EUR 1,212,599	Newgate Funding Plc 'Series 2006-1 BB' FRN 1/12/2050	1,306,645	0.01
EUR 402,000	OTE Plc 3.5% 9/7/2020	491,913	0.00
EUR 104,857	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	117,862	0.00
EUR 386,510	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	431,166	0.00
EUR 461,411	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	515,008	0.00
EUR 1,165,000	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,268,685	0.01
EUR 2,795,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,915,551	0.03
GBP 742,751	Paragon Mortgages NO 23 Plc FRN 15/1/2043	965,038	0.01
EUR 687,782	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'A1' FRN 15/1/2043	803,243	0.01
GBP 1,175,000	Paragon Mortgages NO 23 Plc 'C' FRN 15/1/2043	1,537,419	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		英国(続き)		
GBP	2,635,000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'B' FRN 15/5/2050	3,361,291	0.03
GBP	2,100,000	Paragon Mortgages No 25 Plc 'C' FRN 15/5/2050	2,694,759	0.02
GBP	282,000	PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 B' FRN 15/6/2022	367,691	0.00
GBP	179,000	PCL Funding II Plc 'Series 2017-1 C' FRN 15/6/2022	233,772	0.00
GBP	470,000	PCL Funding III Plc 'Series 2017-2 C' FRN 15/6/2023	606,980	0.01
GBP	1,062,000	PCL Funding III Plc '2017-2 B' FRN 15/6/2023	1,378,260	0.01
GBP	1,173,000	Pinnacle Bidco Plc 6.375% 15/2/2025	1,562,688	0.01
GBP	162,351	Precise Mortgage Funding 2014-1 Plc 'Series 2014-1 A' FRN 12/9/2047	210,777	0.00
EUR	100,000	Rentokil Initial Plc 3.25% 7/10/2021	126,368	0.00
GBP	799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	1,046,021	0.01
GBP	2,981,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc 'B' FRN 20/12/2046	3,898,617	0.03
GBP	180,000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 20/3/2050	234,165	0.00
GBP	1,480,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	1,923,878	0.02
GBP	15,000,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	19,467,137	0.17
EUR	67,838	RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2006-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	75,753	0.00
EUR	1,015,808	RMAC Securities No 1 Plc 'Series 2007-NS1X M1C' FRN 12/6/2044	1,116,248	0.01
USD	489,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2020 (Perpetual)	502,448	0.00
USD	3,572,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 15/8/2021 (Perpetual)	3,832,399	0.03
USD	1,700,000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN 10/8/2025 (Perpetual)*	1,808,800	0.02
GBP	300,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 24/6/2022 (Perpetual)	409,628	0.00
USD	1,285,000	Schlumberger Oilfield UK Plc '144A' 4.2% 15/1/2021	1,309,382	0.01
GBP	1,850,000	Shop Direct Funding Plc 7.75% 15/11/2022*	2,050,021	0.02
GBP	662,223	Small Business Origination Loan Trust 2018-1 DAC FRN 15/12/2026	859,998	0.01
GBP	475,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	652,213	0.01
GBP	4,567,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2031	5,834,054	0.05
EUR	2,432,000	Standard Chartered Plc 1.625% 13/6/2021	2,939,855	0.03
GBP	209,000	Stanlinton No 1 Plc 'Series 2017-1 E' FRN 12/6/2046	280,791	0.00
GBP	1,875,000	Stonegate Pub Co Financing Plc FRN 15/3/2022	2,421,089	0.02
GBP	425,000	Stonegate Pub Co Financing Plc 4.875% 15/3/2022*	547,816	0.01
EUR	302,000	Synlab Bondco Plc 6.25% 1/7/2022	364,440	0.00
EUR	183,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	227,359	0.00
EUR	2,426,721	Taurus 2015-2 DEU Ltd 'Series 2015-DE2 A' FRN 1/2/2026	2,827,301	0.02
EUR	1,821,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd 'Series 2015-DE2 D' FRN 1/2/2026	2,130,663	0.02
EUR	2,309,000	Taurus 2015-2 DEU Ltd 'Series 2015-DE2 E' FRN 1/2/2026	2,706,646	0.02
GBP	3,641,938	Taurus 2017-2 UK DAC 'Series 2017-UK2 B' FRN 17/11/2027	4,731,312	0.04
GBP	1,741,883	Taurus 2017-2 UK DAC 'Series 2017-UK2 C' FRN 17/11/2027	2,263,456	0.02
GBP	200,000	Tesco Plc 5% 24/3/2023*	286,207	0.00
EUR	200,000	Tesco Plc 5.125% 10/4/2047	291,051	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP	20,000 Tesco Plc 5.5% 13/1/2033	30,573	0.00
GBP	929,276 Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,598,282	0.01
GBP	2,157,850 Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,199,279	0.03
GBP	976,990 Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,472,416	0.01
EUR	480,000 Titan Global Finance Plc 2.375% 16/11/2024	540,370	0.01
EUR	100,000 Titan Global Finance Plc 3.5% 17/6/2021	121,712	0.00
GBP	360,000 Trinity Square 2015-1 Plc 'Series 2015-1X B' FRN 15/7/2051	469,811	0.00
USD	200,000 Tullow Oil Plc '144A' 7% 1/3/2025	193,290	0.00
GBP	3,914,785 Unique Pub Finance Co Plc/The 5.659% 30/6/2027	5,638,215	0.05
GBP	12,850,000 Unique Pub Finance Co Plc/The 6.464% 30/3/2032	16,352,390	0.14
GBP	2,708,480 Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	3,699,086	0.03
GBP	1,084,000 Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,565,915	0.01
EUR	1,400,000 Virgin Media Finance Plc 4.5% 15/1/2025*	1,662,436	0.01
GBP	410,000 Virgin Media Finance Plc 6.375% 15/10/2024	550,648	0.01
GBP	432,000 Virgin Media Secured Finance Plc 4.875% 15/1/2027	546,384	0.01
GBP	100,000 Virgin Media Secured Finance Plc 5.125% 15/1/2025	132,560	0.00
GBP	378,000 Virgin Media Secured Finance Plc 5.5% 15/1/2025*	502,288	0.00
GBP	2,054,000 Virgin Media Secured Finance Plc 6.25% 28/3/2029	2,789,085	0.02
GBP	1,900,000 Vodafone Group Plc 26/11/2020 (Zero Coupon)	2,356,461	0.02
USD	8,932,000 Vodafone Group Plc 3.75% 16/1/2024	8,885,969	0.08
GBP	510,000 Vue International Bidco Plc 7.875% 15/7/2020	664,244	0.01
GBP	5,762,247 Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'A' FRN 21/9/2049	7,508,180	0.06
GBP	6,200,000 Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc 'B' FRN 21/9/2049	8,093,497	0.07
GBP	3,700,000 Warwick Finance Residential Mortgages No Two Plc FRN 21/9/2049	4,829,962	0.04
GBP	550,000 Wellcome Trust Ltd/The 2.517% 7/2/2118	684,701	0.01
GBP	4,795,000 Westfield Stratford City Finance Plc FRN 4/11/2019	6,238,232	0.05
		338,800,329	2.86
米国			
USD	4,630,000 245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P E' '144A' FRN 5/6/2037	4,184,711	0.04
USD	7,000,000 245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P XA' '144A' FRN 5/6/2037	105,665	0.00
USD	9,750,000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 'Series 2017-280P E' '144A' FRN 15/9/2034	9,715,469	0.08
USD	2,535,000 Abbott Laboratories 2.8% 15/9/2020	2,521,150	0.02
USD	4,440,000 Accredited Mortgage Loan Trust 2006-1 'Series 2006-1 M2' FRN 25/4/2036	2,360,498	0.02
USD	1,353,679 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series '2003-MH1 B2' '144A' 15/8/2030 (Zero Coupon)	1,030,314	0.01
USD	2,438,653 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 'Series 2007-HE4 A2A' FRN 25/5/2037	784,457	0.01
USD	1,580,000 Adams & Weld Counties School District No 27J Brighton/CO 5% 1/12/2042	1,809,993	0.02
USD	2,060,000 Adams Mill CLO Ltd 'Series 2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	2,060,287	0.02
USD	1,154,000 AHS Hospital Corp 5.024% 1/7/2045	1,320,780	0.01
USD	250,000 AIMCO CLO Series 2014-A 'Series 2014-AA DR' '144A' FRN 20/7/2026	250,449	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,500,000	AJAX Mortgage Loan Trust 'Series 2018-B B' 26/2/2057 (Zero Coupon)	654,573	0.01
USD 7,223,868	AJAX Mortgage Loan Trust (Step-up coupon) 'Series 2017-A A' '144A' 3.47% 25/4/2057	7,202,251	0.06
USD 7,500,000	AJAX Mortgage Loan Trust 'Series 2018-B A' 3.75% 26/2/2057	7,500,000	0.06
USD 1,770,913	Ajax Mortgage Loan Trust 2016-1 (Step-up coupon) 'Series 2016-1 A' '144A' 4.25% 25/7/2047	1,785,479	0.02
USD 3,329,160	Ajax Mortgage Loan Trust 2016-A (Step-up coupon) 'Series 2016-A A' '144A' 4.25% 25/8/2064	3,344,811	0.03
USD 2,292,457	Ajax Mortgage Loan Trust 2016-B (Step-up coupon) 'Series 2016-B A' '144A' 4% 25/9/2065	2,302,144	0.02
USD 1,525,831	Ajax Mortgage Loan Trust 2016-C (Step-up coupon) 'Series 2016-C A' '144A' 4% 25/10/2057	1,535,089	0.01
USD 10,626,550	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 'Series 2017-D A' '144A' FRN 25/12/2057	10,610,543	0.09
USD 1,734,576	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 'Series 2017-D B' '144A' FRN 25/12/2057	1,070,060	0.01
USD 2,612,029	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 'Series 2018-A B' '144A' FRN 25/4/2058	1,900,774	0.02
USD 7,953,233	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 'Series 2018-A A' '144A' 3.85% 25/4/2058	7,758,778	0.07
USD 1,050,000	Allegro CLO II Ltd 'Series 2014-1A CR' '144A' FRN 21/1/2027	1,050,122	0.01
USD 280,000	Allegro CLO II Ltd 'Series 2014-1A D' '144A' FRN 21/1/2027	280,023	0.00
USD 810,000	Allegro CLO II-S Ltd 'Series 2014-1RA B' '144A' FRN 21/10/2028	810,000	0.01
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S Ltd 'Series 2014-1RA C' '144A' FRN 21/10/2028	2,270,000	0.02
USD 250,000	Allegro CLO IV Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 15/1/2029	251,765	0.00
USD 700,000	Allegro CLO V Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 16/10/2030	701,256	0.01
USD 2,590,000	Allegro CLO VI Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 17/1/2031	2,591,362	0.02
USD 630,000	Allegro CLO VIII Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 15/7/2031	631,257	0.01
USD 2,545,000	Allergan Finance LLC 3.25% 1/10/2022	2,499,830	0.02
USD 142,000	Ally Financial Inc 3.25% 5/11/2018	142,000	0.00
USD 2,080,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	2,074,873	0.02
USD 1,700,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A BR3' '144A' FRN 18/10/2027	1,691,504	0.01
USD 811,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A A2R3' '144A' FRN 15/7/2026	811,059	0.01
USD 2,620,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A CR3' '144A' FRN 15/7/2026	2,620,145	0.02
USD 3,100,000	ALM VI Ltd 'Series 2012-6A DR3' '144A' FRN 15/7/2026	3,100,312	0.03
USD 5,070,000	ALM VII Ltd 'Series 2012-7A A1R' '144A' FRN 15/10/2028	5,099,910	0.04
USD 6,275,000	ALM VII Ltd 'Series 2012-7A SUB' '144A' FRN 15/10/2028	3,406,704	0.03
USD 1,440,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A A1R2' '144A' FRN 16/4/2027	1,437,135	0.01
USD 1,293,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A BR2' '144A' FRN 16/4/2027	1,284,457	0.01
USD 950,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A C1R2' '144A' FRN 16/4/2027	943,483	0.01
USD 460,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A C2R2' '144A' FRN 16/4/2027	458,369	0.00
USD 340,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	337,279	0.00
USD 3,051,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	3,037,910	0.03
USD 750,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '144A' FRN 15/7/2027	749,437	0.01
USD 2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC '144A' FRN 15/7/2027	2,237,657	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 800,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A BR' '144A' FRN 18/1/2028	800,027	0.01
USD 720,000	ALM XVII Ltd 'Series 2015-17A CR' '144A' FRN 18/1/2028	722,592	0.01
USD 620,000	ALM XVIII Ltd 'Series 2016-18A A2R' '144A' FRN 15/1/2028	620,000	0.01
USD 3,551,307	Alternative Loan Trust 2005-22T1 'Series 2005-22T1 A1' FRN 25/6/2035	3,240,758	0.03
USD 1,349,398	Alternative Loan Trust 2005-38 'Series 2005-38 A3' FRN 25/9/2035	1,270,362	0.01
USD 3,347,488	Alternative Loan Trust 2005-72 'Series 2005-72 A3' FRN 25/1/2036	2,880,300	0.02
USD 1,121,378	Alternative Loan Trust 2005-76 'Series 2005-76 2A1' FRN 25/2/2036	1,024,735	0.01
USD 3,223,500	Alternative Loan Trust 2005-J4 'Series 2005-J4 B1' FRN 25/7/2035	3,261,370	0.03
USD 5,039,243	Alternative Loan Trust 2006-11CB 'Series 2006-11CB 3A1' 6.5% 25/5/2036	4,043,993	0.03
USD 1,411,859	Alternative Loan Trust 2006-15CB 'Series 2006-15CB A1' 6.5% 25/6/2036	1,064,031	0.01
USD 2,096,382	Alternative Loan Trust 2006-23CB 'Series 2006-23CB 2A5' FRN 25/8/2036	835,948	0.01
USD 1,266,994	Alternative Loan Trust 2006-J7 'Series 2006-J7 2A1' FRN 20/11/2046	876,305	0.01
USD 883,354	Alternative Loan Trust 2006-0A11 'Series 2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046	788,181	0.01
USD 5,588,053	Alternative Loan Trust 2006-0A14 'Series 2006-0A14 1A1' FRN 25/11/2046	4,830,428	0.04
USD 3,632,139	Alternative Loan Trust 2006-0A16 'Series 2006-0A16 A4C' FRN 25/10/2046	2,362,638	0.02
USD 2,775,721	Alternative Loan Trust 2006-0A6 'Series 2006-0A6 1A2' FRN 25/7/2046	2,676,413	0.02
USD 758,447	Alternative Loan Trust 2006-0A8 'Series 2006-0A8 1A1' FRN 25/7/2046	714,144	0.01
USD 1,517,117	Alternative Loan Trust 2006-0C10 'Series 2006-0C10 2A3' FRN 25/11/2036	1,202,387	0.01
USD 6,221,833	Alternative Loan Trust 2006-0C7 'Series 2006-0C7 2A3' FRN 25/7/2046	5,000,262	0.04
USD 4,707,601	Alternative Loan Trust 2007-25 'Series 2007-25 1A3' 6.5% 25/11/2037	3,611,795	0.03
USD 7,711,341	Alternative Loan Trust 2007-3T1 'Series 2007-3T1 1A1' 6% 25/4/2037	5,769,428	0.05
USD 4,598,683	Alternative Loan Trust 2007-9T1 'Series 2007-9T1 1A1' 6% 25/5/2037	3,388,858	0.03
USD 6,839,768	Alternative Loan Trust 2007-0A2 'Series 2007-0A2 1A1' FRN 25/3/2047	5,645,127	0.05
USD 1,547,911	Alternative Loan Trust 2007-0A3 'Series 2007-0A3 1A1' FRN 25/4/2047	1,492,143	0.01
USD 229,351	Alternative Loan Trust 2007-0A3 'Series 2007-0A3 2A2' FRN 25/4/2047	46,835	0.00
USD 424,015	Alternative Loan Trust 2007-0A8 'Series 2007-0A8 2A1' FRN 25/6/2047	325,459	0.00
USD 598,352	Alternative Loan Trust 2007-0H2 'Series 2007-0H2 A2A' FRN 25/8/2047	454,508	0.00
USD 8,219,886	Alternative Loan Trust 2007-0H3 'Series 2007-0H3 A1A' FRN 25/9/2047	7,738,796	0.07
USD 4,500,000	Altice US Finance I Corp '144A' 5.375% 15/7/2023	4,561,875	0.04
USD 671,973	Ambac Assurance Corp '144A' 5.1% 7/6/2020	913,884	0.01
USD 2,363,000	American Airlines Group Inc '144A' 4.625% 1/3/2020	2,386,039	0.02
USD 280,000	American Airlines Group Inc '144A' 5.5% 1/10/2019	284,900	0.00
USD 1,264,964	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 'Series 2006-3 2A11' FRN 25/10/2046	1,152,819	0.01
USD 2,795,179	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 'Series 2006-4 1A12' FRN 25/10/2046	2,058,199	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	4,314,798	American Home Mortgage Assets Trust 2006-5 'Series 2006-5 A1' FRN 25/11/2046	2,378,727	0.02
USD	808,810	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 'Series 2007-1 A1' FRN 25/2/2047	512,469	0.00
USD	1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 'Series 2014-SFR2 E' '144A' 6.231% 17/10/2036	2,062,994	0.02
USD	5,203,091	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 'Series 2015-SFR1 XS' '144A' FRN 17/4/2052	52	0.00
USD	725,000	American Municipal Power Inc 6.449% 15/2/2044	942,924	0.01
USD	1,345,000	American Municipal Power Inc 7.834% 15/2/2041	1,995,065	0.02
USD	5,445,000	American Tower Corp 5% 15/2/2024	5,720,228	0.05
USD	550,000	Americold 2010 LLC 'Series 2010-ARTA C' '144A' 6.811% 14/1/2029	580,531	0.01
USD	3,832,000	Amgen Inc 3.625% 15/5/2022	3,863,696	0.03
USD	530,000	AMMC CLO 15 Ltd 'Series 2014-15A D' '144A' FRN 9/12/2026	534,347	0.00
USD	260,000	Ammc Clo 19 Ltd 'Series 2016-19A C' '144A' FRN 15/10/2028	261,767	0.00
USD	750,000	Ammc Clo 20 Ltd 'Series 2017-20A E' '144A' FRN 17/4/2029	750,879	0.01
USD	530,000	AMMC CLO 21 Ltd 'Series 2017-21A A' '144A' FRN 2/11/2030	531,053	0.00
USD	1,880,000	AMMC CLO XI Ltd 'Series 2012-11A A1R2' '144A' FRN 30/4/2031	1,874,402	0.02
USD	1,675,000	AMMC CLO XII Ltd 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 10/11/2030	1,677,390	0.01
USD	3,100,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013-13A A1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,105,307	0.03
USD	3,050,000	AMMC CLO XIV Ltd 'Series 2014-14A A1LR' '144A' FRN 25/7/2029	3,054,948	0.03
USD	2,127,428	Amortizing Residential Collateral Trust 2002-BC8 'Series 2002-BC8 A1' FRN 25/11/2032	2,108,268	0.02
USD	1,110,000	AMSR 2016-SFR1 Trust 'Series 2016-SFR1 E' '144A' FRN 17/11/2033	1,116,935	0.01
USD	410,000	AMSR 2016-SFR1 Trust 'Series 2016-SFR1 F' '144A' FRN 17/11/2033	413,395	0.00
USD	1,480,000	AMSR 2016-SFR1 Trust 'Series 2016-SFR1 G' '144A' FRN 17/11/2033	1,497,756	0.01
USD	3,020,000	Anadarko Petroleum Corp 4.85% 15/3/2021	3,114,437	0.03
USD	2,555,000	Analog Devices Inc 2.95% 12/1/2021	2,541,235	0.02
USD	6,270,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA A1' '144A' FRN 13/4/2031	6,253,285	0.05
USD	1,560,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA SUB' '144A' FRN 13/4/2031	1,421,040	0.01
USD	840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A1R' '144A' FRN 13/10/2030	841,595	0.01
USD	340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A BR' '144A' FRN 13/10/2030	340,740	0.00
USD	417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A CR' '144A' FRN 13/10/2030	417,330	0.00
USD	1,040,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A DR' '144A' FRN 13/10/2030	1,060,022	0.01
USD	1,050,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,045,650	0.01
USD	1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA B' '144A' FRN 28/1/2031	1,645,269	0.01
USD	2,375,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA C' '144A' FRN 28/1/2031	2,379,060	0.02
USD	1,000,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA D' '144A' FRN 28/1/2031	986,719	0.01
USD	1,500,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd 'Series 2014-3RA E' '144A' FRN 28/1/2031	1,481,180	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,560,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA A' '144A' FRN 28/1/2031	1,556,088	0.01
USD 1,830,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA C' '144A' FRN 28/1/2031	1,814,460	0.02
USD 1,750,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd 'Series 2014-4RA D' '144A' FRN 28/1/2031	1,729,827	0.01
USD 5,475,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA B' '144A' FRN 15/1/2030	5,439,402	0.05
USD 1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA C' '144A' FRN 15/1/2030	1,298,984	0.01
USD 1,720,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd 'Series 2014-5RA E' '144A' FRN 15/1/2030	1,729,737	0.01
USD 1,570,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A AR' '144A' FRN 15/7/2030	1,573,470	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A DR' '144A' FRN 15/7/2030	594,296	0.01
USD 500,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A ER' '144A' FRN 15/7/2030	504,929	0.00
USD 780,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd 'Series 2015-6A SUB2' '144A' FRN 15/7/2030	478,978	0.00
USD 12,950,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A AR' '144A' FRN 15/10/2027	12,936,274	0.11
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A B1R' '144A' FRN 15/10/2027	1,490,096	0.01
USD 3,328,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A CR' '144A' FRN 15/10/2027	3,311,174	0.03
USD 2,915,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A DR' '144A' FRN 15/10/2027	2,907,355	0.02
USD 2,250,000	Anchorage Capital CLO 7 Ltd 'Series 2015-7A ER' '144A' FRN 15/10/2027	2,272,760	0.02
USD 1,150,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A AR' '144A' FRN 28/7/2028	1,150,056	0.01
USD 2,520,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A BR' '144A' FRN 28/7/2028	2,519,802	0.02
USD 5,810,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A CR' '144A' FRN 28/7/2028	5,810,183	0.05
USD 1,850,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A DR' '144A' FRN 28/7/2028	1,850,038	0.02
USD 4,030,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd 'Series 2016-8A ER' '144A' FRN 28/7/2028	4,029,929	0.03
USD 640,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd 'Series 2016-9A D' '144A' FRN 15/1/2029	644,957	0.01
USD 590,000	Anchorage Capital CLO 9 Ltd 'Series 2016-9A E' '144A' FRN 15/1/2029	598,386	0.01
USD 3,162,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.25% 15/1/2025	3,249,429	0.03
USD 286,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 5.5% 15/10/2019	292,335	0.00
USD 3,538,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	3,666,252	0.03
USD 190,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.375% 1/5/2024	201,875	0.00
USD 4,995,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.625% 17/1/2023	4,831,289	0.04
USD 3,844,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 2.65% 1/2/2021	3,799,861	0.03
USD 45,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.65% 1/2/2026	44,132	0.00
USD 1,000,000	Antero Resources Corp 5% 1/3/2025	1,012,500	0.01
USD 843,000	Antero Resources Corp 5.125% 1/12/2022	855,645	0.01
USD 809,000	Antero Resources Corp 5.375% 1/11/2021	825,180	0.01
USD 1,047,000	Antero Resources Corp 5.625% 1/6/2023	1,078,410	0.01
USD 2,040,000	Apache Corp 4.375% 15/10/2028	2,024,437	0.02
USD 11,799,000	Apidos CLO XII 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 15/4/2031	11,790,593	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,290,000	Apidos CLO XV 'Series 2013-15A A1RR' '144A' FRN 20/4/2031	1,286,617	0.01
USD 1,120,000	Apidos CLO XV 'Series 2013-15A ERR' '144A' FRN 20/4/2031	1,123,540	0.01
USD 475,000	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A CR' '144A' FRN 19/1/2025	475,410	0.00
USD 433,272	Apidos CLO XVII 'Series 2014-17A A1R' '144A' FRN 17/4/2026	433,471	0.00
USD 1,030,000	Apidos CLO XVIII 'Series 2014-18A A1R' '144A' FRN 22/7/2026	1,030,141	0.01
USD 420,000	Apidos CLO XVIII 'Series 2014-18A CR' '144A' FRN 22/7/2026	420,713	0.00
USD 1,845,000	Apidos CLO XVIII 'Series 2014-18A D' '144A' FRN 22/7/2026	1,855,988	0.02
USD 500,000	Apidos CLO XXI 'Series 2015-21A CR' '144A' FRN 18/7/2027	500,054	0.00
USD 380,000	Apidos CLO XXII 'Series 2015-22A D' '144A' FRN 20/10/2027	383,526	0.00
USD 1,070,000	Apidos CLO XXIII 'Series 2015-23A D2' '144A' FRN 15/1/2027	1,072,614	0.01
USD 640,000	Apidos CLO XXIX 'Series 2018-29A D' '144A' FRN 25/7/2030	628,730	0.01
USD 920,000	Apidos Clo XXV 'Series 2016-25A A2A' '144A' FRN 20/10/2028	921,483	0.01
USD 597,000	Apple Inc 3.85% 4/8/2046	580,341	0.01
USD 6,040,301	APS Resecuritization Trust 2016-1 'Series 2016-1 1MZ' '144A' FRN 31/7/2057	1,482,604	0.01
USD 6,051,646	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 3A' '144A' FRN 27/9/2046	6,372,870	0.05
USD 1,603,740	APS Resecuritization Trust 2016-3 'Series 2016-3 4A' '144A' FRN 27/4/2047	1,678,616	0.01
USD 3,460,000	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017-FL3 Ltd 'Series 2017-FL3 A' '144A' FRN 15/12/2027	3,466,558	0.03
USD 3,160,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd 'Series 2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	3,174,190	0.03
USD 1,330,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL2 Ltd 'Series 2017-FL2 A' '144A' FRN 15/8/2027	1,333,387	0.01
USD 280,000	Arconic Inc 5.4% 15/4/2021	288,050	0.00
USD 1,520,000	Arconic Inc 5.87% 23/2/2022	1,573,960	0.01
USD 7,540,000	Arconic Inc 5.9% 1/2/2027	7,672,704	0.07
USD 233,000	Arconic Inc 6.15% 15/8/2020	243,194	0.00
USD 3,539,624	AREIT 2018-CRE1 Trust 'Series 2018-CRE1 A' '144A' FRN 14/2/2035	3,545,119	0.03
USD 7,265,000	Ares Capital Corp 4.25% 1/3/2025	7,038,822	0.06
USD 940,000	Ares XL CLO Ltd 'Series 2016-40A C' '144A' FRN 15/10/2027	946,722	0.01
USD 530,000	Ares XL CLO Ltd 'Series 2016-40A D' '144A' FRN 15/10/2027	535,648	0.00
USD 400,000	Ares XLI Clo Ltd 'Series 2016-41A D' '144A' FRN 15/1/2029	407,359	0.00
USD 870,000	Ares XLIII CLO Ltd 'Series 2017-43A E' '144A' FRN 15/10/2029	881,310	0.01
USD 200,000	ARES XLIV CLO Ltd 'Series 2017-44A D' '144A' FRN 15/10/2029	204,263	0.00
USD 375,000	ARES XLV CLO Ltd 'Series 2017-45A C' '144A' FRN 15/10/2030	375,914	0.00
USD 380,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A A2R' '144A' FRN 5/12/2025	380,597	0.00
USD 250,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A B2R' '144A' FRN 5/12/2025	252,000	0.00
USD 1,125,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 5/12/2025	1,139,403	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 800,000	Ares XXXIII CLO Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 5/12/2025	812,269	0.01
USD 840,000	Ares XXXIX CLO Ltd 'Series 2016-39A E' '144A' FRN 18/7/2028	854,730	0.01
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A A1R' '144A' FRN 15/10/2030	1,501,668	0.01
USD 1,445,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A CR' '144A' FRN 15/10/2030	1,431,624	0.01
USD 2,195,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A DR' '144A' FRN 15/10/2030	2,230,910	0.02
USD 770,000	Ares XXXVII CLO Ltd 'Series 2015-4A SUB' '144A' FRN 15/10/2030	598,675	0.01
USD 5,151,112	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 'Series 2005-W1 A2' FRN 25/5/2035	4,889,302	0.04
USD 2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,800,000	0.02
USD 1,905,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,804,721	0.02
USD 1,060,000	Arizona State University 5% 1/7/2043	1,213,530	0.01
USD 3,210,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 'Series 2018-ASHF D' '144A' FRN 15/4/2035	3,228,221	0.03
USD 596,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.125% 15/8/2025	576,630	0.01
USD 250,000	Ashtead Capital Inc '144A' 4.375% 15/8/2027	241,250	0.00
USD 1,788,000	Ashtead Capital Inc '144A' 5.625% 1/10/2024	1,863,990	0.02
USD 4,010,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.875% 15/2/2021	4,070,150	0.03
USD 196,320	Asset Securitization Corp 'Series 1997-D5 B2' 6.93% 14/2/2043	197,218	0.00
USD 370,000	ASSURANT CLO III Ltd 'Series 2018-2A C' '144A' FRN 20/10/2031	370,000	0.00
USD 250,000	ASSURANT CLO III Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 20/10/2031	247,550	0.00
EUR 2,200,000	AT&T Inc FRN 3/8/2020	2,567,379	0.02
USD 5,910,000	AT&T Inc FRN 12/6/2024	5,922,633	0.05
USD 4,360,000	AT&T Inc '144A' 5.15% 15/2/2050	4,111,242	0.03
USD 2,935,000	AT&T Inc 5.875% 1/10/2019	3,027,276	0.03
USD 820,000	Atlas Senior Loan Fund IV Ltd 'Series 2013-2A A2RR' '144A' FRN 17/2/2026	820,183	0.01
USD 1,655,000	Atlas Senior Loan Fund Ltd 'Series 2017-8A E' '144A' FRN 16/1/2030	1,634,875	0.01
USD 5,170,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 'Series 2017-ATRM D' '144A' FRN 15/12/2036	5,182,951	0.04
USD 2,230,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 'Series 2017-ATRM E' '144A' FRN 15/12/2036	2,236,969	0.02
USD 1,490,000	Atrium Hotel Portfolio Trust 2018-ATRM 'Series 2018-ATRM E' '144A' FRN 15/6/2035	1,501,597	0.01
USD 1,900,000	Atrium IX '144A' FRN 28/5/2030	1,903,183	0.02
USD 1,710,000	Atrium VIII '144A' FRN 23/10/2024	1,724,130	0.01
USD 1,110,000	Atrium VIII '144A' FRN 23/10/2024	1,124,819	0.01
USD 520,000	Atrium XI '144A' FRN 23/10/2025	520,080	0.00
USD 985,000	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	979,949	0.01
USD 1,385,000	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	1,373,755	0.01
USD 340,000	Atrium XIII '144A' FRN 21/11/2030	344,202	0.00
USD 5,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM D' '144A' FRN 5/12/2032	5,082,152	0.04
USD 1,310,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM E' '144A' FRN 5/12/2032	1,331,524	0.01
USD 2,160,000	Avery Point V CLO Ltd 'Series 2014-5A AR' '144A' FRN 17/7/2026	2,159,225	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 520,000	Avery Point V CLO Ltd 'Series 2014-5A BR' '144A' FRN 17/7/2026	519,036	0.00
USD 2,800,000	Avery Point VI CLO Ltd 'Series 2015-6A AR' '144A' FRN 5/8/2027	2,801,400	0.02
USD 2,930,000	Avery Point VI CLO Ltd 'Series 2015-6A BR' '144A' FRN 5/8/2027	2,932,198	0.02
USD 1,330,000	Avery Point VII CLO Ltd 'Series 2015-7A A1' '144A' FRN 15/1/2028	1,332,639	0.01
USD 6,735,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 3.875% 1/5/2023	6,727,181	0.06
USD 780,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 7.125% 15/10/2020	836,384	0.01
USD 628,579	B2R Mortgage Trust 2015-1 'Series 2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	620,851	0.01
USD 10,963,408	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 XA' '144A' FRN 15/11/2048	364,150	0.00
USD 915,184	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	912,746	0.01
USD 1,110,000	Babson CLO Ltd 2015-I 'Series 2015-IA AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,105,736	0.01
USD 1,150,000	Babson CLO Ltd 2015-I 'Series 2015-IA BR' '144A' FRN 20/1/2031	1,134,885	0.01
USD 1,250,000	Babson CLO Ltd 2015-II 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 20/10/2030	1,251,692	0.01
USD 720,000	Babson CLO Ltd 2016-II 'Series 2016-2A C' '144A' FRN 20/7/2028	723,292	0.01
USD 690,000	Babson CLO Ltd 2016-II 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 20/7/2028	698,363	0.01
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 'Series 2018-2A A1' '144A' FRN 19/7/2031	1,788,216	0.02
USD 2,030,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2013-DSNY 'Series 2013-DSMZ M' '144A' FRN 15/9/2018	2,033,786	0.02
USD 2,430,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2013-DSNY 'Series 2013-DSNY A' '144A' FRN 15/9/2026	2,430,124	0.02
USD 2,667,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2013-DSNY 'Series 2013-DSNY F' '144A' FRN 15/9/2026	2,665,565	0.02
USD 2,657,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P 'Series 2015-200P F' '144A' FRN 14/4/2033	2,490,378	0.02
USD 5,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ 'Series 2016-ISQ E' '144A' FRN 14/8/2034	4,548,259	0.04
USD 3,820,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH 'Series 2017-SCH CL' '144A' FRN 15/11/2032	3,828,058	0.03
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH 'Series 2017-SCH DL' '144A' FRN 15/11/2032	1,782,632	0.02
USD 490,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2006-1 'Series 2006-1 F' '144A' FRN 10/9/2045	505,763	0.00
USD 353,136	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2007-1 'Series 2007-1 AMFX' FRN 15/1/2049	355,001	0.00
USD 4,054,636	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 'Series 2015-UBS7 XA' FRN 15/9/2048	190,196	0.00
USD 2,030,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 'Series 2016-UB10 C' FRN 15/7/2049	2,085,582	0.02
USD 19,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 'Series 2017-BNK3 XB' FRN 15/2/2050	895,945	0.01
USD 4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 'Series 2017-BNK3 XD' '144A' FRN 15/2/2050	356,660	0.00
USD 638,825	Banc of America Funding 2006-A Trust 'Series 2006-A 3A2' FRN 20/2/2036	605,182	0.01
USD 16,416,407	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 'Series 2014-R2 1C' '144A' FRN 26/11/2036	2,986,982	0.03
USD 2,260,000	Bancorp Commercial Mortgage 2018-CRE3 Trust/The 'Series 2018-CR3 A' '144A' FRN 15/1/2033	2,261,856	0.02
EUR 1,670,000	Banff Merger Sub Inc 8.375% 1/9/2026	1,959,864	0.02
USD 625,000	Banff Merger Sub Inc '144A' 9.75% 1/9/2026	628,906	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,660,000	BANK 2018-BNK13 'Series 2018-BN13 A5' 4.217% 15/8/2061	1,735,652	0.01
USD 9,155,000	Bank of America Corp FRN 1/10/2021	8,974,811	0.08
EUR 4,862,000	Bank of America Corp FRN 7/2/2022	5,728,112	0.05
EUR 360,000	Bank of America Corp FRN 4/5/2023	421,977	0.00
USD 11,850,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2024	11,916,840	0.10
USD 17,310,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2029*	17,084,632	0.14
USD 12,810,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2029	12,948,848	0.11
USD 2,555,000	Bank of America Corp 2.151% 9/11/2020	2,503,274	0.02
USD 5,110,000	Bank of America Corp 2.625% 19/4/2021	5,031,633	0.04
USD 2,560,000	Bank of America Corp 2.65% 1/4/2019	2,561,092	0.02
USD 10,685,000	Bank of America Corp 4.183% 25/11/2027	10,483,540	0.09
USD 2,560,000	Bank of America Corp 4.25% 22/10/2026	2,542,065	0.02
USD 15,135,000	Bank of America Corp 4.45% 3/3/2026	15,248,444	0.13
USD 317,000	Bank of New York Mellon Corp/The FRN 20/9/2026 (Perpetual)	306,856	0.00
USD 6,615,000	Bank of New York Mellon Corp/The 3.5% 28/4/2023	6,645,059	0.06
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1997-2 B1' FRN 10/2/2022	1,315,947	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ' Series 1998-2 B1' FRN 10/12/2025	1,667,211	0.01
USD 790,000	Barings CLO Ltd 2018-III FRN 20/7/2031	787,998	0.01
EUR 360,000	BAT Capital Corp FRN 16/8/2021	419,746	0.00
USD 3,827,000	BAT Capital Corp '144A' 2.764% 15/8/2022	3,709,241	0.03
USD 4,440,000	Battalion CLO VII Ltd 'Series 2014-7A A1RR' '144A' FRN 17/7/2028	4,440,194	0.04
USD 2,840,000	Battalion CLO VII Ltd 'Series 2014-7A BRR' '144A' FRN 17/7/2028	2,840,066	0.02
USD 1,000,000	Battalion CLO X Ltd 'Series 2016-10A C' '144A' FRN 24/1/2029	1,009,287	0.01
USD 1,250,000	Battalion CLO X Ltd 'Series 2016-10A D' '144A' FRN 24/1/2029	1,265,068	0.01
USD 1,970,000	Battalion CLO XI Ltd 'Series 2017-11A E' '144A' FRN 24/10/2029	1,985,263	0.02
USD 3,535,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	4,825,293	0.04
USD 3,180,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	4,709,198	0.04
USD 680,000	Bayer US Finance II LLC '144A' 3.5% 25/6/2021	679,497	0.01
USD 1,780,000	Baylor Scott & White Holdings 4.185% 15/11/2045	1,808,976	0.02
USD 317,953	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A A1' '144A' FRN 25/1/2036	299,326	0.00
USD 89,474	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A A2' '144A' FRN 25/1/2036	84,674	0.00
USD 236,468	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 'Series 2005-4A M1' '144A' FRN 25/1/2036	222,320	0.00
USD 354,159	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A A2' '144A' FRN 25/4/2036	339,546	0.00
USD 1,018,208	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M2' '144A' FRN 25/4/2036	965,741	0.01
USD 245,011	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M3' '144A' FRN 25/4/2036	232,157	0.00
USD 1,339,264	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A M4' '144A' FRN 25/4/2036	1,273,527	0.01
USD 1,365,084	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A1' '144A' FRN 25/10/2036	1,310,602	0.01
USD 612,013	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 'Series 2006-3A A2' '144A' FRN 25/10/2036	588,783	0.01

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)				
USD	7,379,503	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 'Series 2006-4A A1' '144A' FRN 25/12/2036	7,141,449	0.06
USD	4,858,229	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 'Series 2007-1 A1' '144A' FRN 25/3/2037	4,670,694	0.04
USD	25,131,797	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 'Series 2007-4A A1' '144A' FRN 25/9/2037	24,198,889	0.20
USD	7,313,860	Bayview Commercial Asset Trust 2007-5 'Series 2007-5A A3' '144A' FRN 25/10/2037	7,327,195	0.06
USD	1,590,000	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 'Series 2007-6A A4A' '144A' FRN 25/12/2037	1,215,715	0.01
USD	7,861,207	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 'Series 2004-B A1' '144A' FRN 28/5/2039	7,380,401	0.06
USD	2,693,356	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 'Series 2004-B A2' '144A' FRN 28/5/2039	2,548,633	0.02
USD	4,947,124	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 'Series 2005-A A1' '144A' FRN 28/2/2040	4,809,375	0.04
USD	1,187,431	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 'Series 2005-E A1' '144A' FRN 28/12/2040	1,142,858	0.01
USD	880,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 'Series 2018-CHRS E' '144A' FRN 5/8/2038	754,824	0.01
USD	877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL A' '144A' FRN 15/3/2037	877,610	0.01
USD	1,060,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 'Series 2018-TALL D' '144A' FRN 15/3/2037	1,062,620	0.01
USD	20,840,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XA' '144A' FRN 10/8/2035	1,382,213	0.01
USD	11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 'Series 2015-SRCH XB' '144A' FRN 10/8/2035	196,084	0.00
USD	100,000	BBCMS Trust 2015-STP 'Series 2015-STP E' '144A' FRN 10/9/2028	96,345	0.00
USD	1,627,548	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A2' FRN 15/6/2030	588,652	0.01
USD	1,510,990	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A3' FRN 15/6/2030	592,653	0.01
USD	2,587,019	BCMSC Trust 2000-A 'Series 2000-A A4' FRN 15/6/2030	1,073,717	0.01
USD	130,000	Bean Creek CLO Ltd 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/4/2031	126,914	0.00
USD	945,569	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 'Series 2006-6 1A1' FRN 25/11/2036	968,546	0.01
USD	150,301	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 'Series 2004-5 2A' FRN 25/7/2034	149,510	0.00
USD	212,126	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-HE7 'Series 2004-HE7 M2' FRN 25/8/2034	213,979	0.00
USD	3,679,136	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-AC9 (Step-up coupon) 'Series 2005-AC9 A5' 6.25% 25/12/2035	3,611,359	0.03
USD	4,319,004	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-AC1 (Step-up coupon) 'Series 2006-AC1 1A2' 6.25% 25/2/2036	3,860,084	0.03
USD	2,429,751	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-EC2 'Series 2006-EC2 M2' FRN 25/2/2036	2,397,005	0.02
USD	1,512,582	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE1 'Series 2006-HE1 1M4' FRN 25/12/2035	1,790,493	0.02
USD	4,708,869	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE7 'Series 2006-HE7 1A2' FRN 25/9/2036	5,774,849	0.05
USD	1,261,034	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-FS1 'Series 2007-FS1 1A3' FRN 25/5/2035	1,319,811	0.01
USD	800,726	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 21A2' FRN 25/1/2037	787,123	0.01
USD	867,322	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 1A4' FRN 25/3/2037	658,864	0.01
USD	1,111,118	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 22A' FRN 25/3/2037	1,078,894	0.01
USD	2,544,670	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 'Series 2007-HE2 23A' FRN 25/3/2037	2,552,215	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 940,256	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ' Series 2007-HE3 1A3 ' FRN 25/4/2037	978,807	0.01
USD 5,404,275	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ' Series 2007-HE3 1A4 ' FRN 25/4/2037	4,299,218	0.04
USD 226,713	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-4 ' Series 2005-4 M2 ' FRN 25/1/2036	224,476	0.00
USD 1,160,377	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 ' Series 2006-SL1 A1 ' FRN 25/8/2036	1,164,707	0.01
USD 648,280	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 ' Series 2007-AR2 A1 ' FRN 25/3/2037	586,341	0.01
USD 993,355	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 ' Series 2007-AR3 1A1 ' FRN 25/3/2037	962,030	0.01
USD 799,169	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 ' Series 2007-AR4 2A1 ' FRN 25/6/2037	767,369	0.01
USD 1,198,965	Bear Stearns Second Lien Trust 2007-SV1 ' Series 2007- SV1A M1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	1,176,512	0.01
USD 3,226,000	Beazer Homes USA Inc 8.75% 15/3/2022	3,418,560	0.03
USD 2,555,000	Becton Dickinson and Co 2.675% 15/12/2019	2,543,321	0.02
USD 410,000	Becton Dickinson and Co 3.125% 8/11/2021	405,219	0.00
EUR 320,000	Belden Inc 2.875% 15/9/2025*	371,266	0.00
EUR 410,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	507,757	0.00
USD 200,000	BENCHMARK 2018-B3 Mortgage Trust ' Series 2018-B3 D ' ' 144A ' 3.057% 10/4/2051	170,593	0.00
USD 2,900,000	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust ' Series 2018-B5 A4 ' 4.208% 15/7/2051	3,019,610	0.03
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd ' Series 2013-IIA CR ' ' 144A ' FRN 15/7/2029	504,258	0.00
USD 3,415,000	Benefit Street Partners CLO IV Ltd ' Series 2014-IVA A1R ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	3,421,953	0.03
USD 500,000	Benefit Street Partners CLO IX Ltd ' Series 2016-9A ER ' ' 144A ' FRN 20/7/2031	488,620	0.00
USD 1,250,000	Benefit Street Partners CLO V-B Ltd ' Series 2018-5BA A1A ' ' 144A ' FRN 20/4/2031	1,249,399	0.01
USD 5,972,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA A1R ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	5,989,560	0.05
USD 1,440,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA A2R ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	1,442,082	0.01
USD 610,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd ' Series 2015-VIA CR ' ' 144A ' FRN 18/10/2029	616,477	0.01
USD 1,770,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' Series 2015-VIIA A1AR ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	1,760,518	0.02
USD 2,370,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd ' Series 2015-VIIA D ' ' 144A ' FRN 18/7/2027	2,375,810	0.02
USD 1,110,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd ' Series 2015-8A A1AR ' ' 144A ' FRN 20/1/2031	1,108,976	0.01
USD 370,000	Benefit Street Partners Clo XII Ltd ' Series 2017-12A D ' ' 144A ' FRN 15/10/2030	375,406	0.00
USD 1,630,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2047	1,783,978	0.02
USD 1,550,000	Berks County Industrial Development Authority 5% 1/11/2050	1,692,654	0.01
USD 3,920,000	BHMS 2018-ATLS ' Series 2018-ATLS A ' ' 144A ' FRN 15/7/2035	3,927,350	0.03
USD 850,000	BHMS 2018-ATLS ' Series 2018-ATLS C ' ' 144A ' FRN 15/7/2035	851,594	0.01
USD 1,274,000	Biogen Inc 3.625% 15/9/2022	1,284,607	0.01
USD 280,000	Birchwood Park CLO Ltd ' Series 2014-1A D1 ' ' 144A ' FRN 15/7/2026	280,071	0.00
USD 1,960,000	BlueLine Rental Finance Corp / BlueLine Rental LLC ' 144A ' 9.25% 15/3/2024	2,063,586	0.02
USD 330,000	BlueMountain CLO 2012-2 Ltd ' Series 2012-2A DR ' ' 144A ' FRN 20/11/2028	332,630	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国（続き）		
USD	2,970,000	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,973,695	0.03
USD	450,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A B1R' '144A' FRN 29/10/2025	450,634	0.00
USD	1,940,000	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A CR' '144A' FRN 29/10/2025	1,944,254	0.02
USD	790,000	BlueMountain CLO 2014-2 Ltd 'Series 2014-2A AR' '144A' FRN 20/7/2026	789,849	0.01
USD	1,593,000	BlueMountain CLO 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A D' '144A' FRN 15/10/2026	1,596,841	0.01
USD	480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	481,872	0.00
USD	889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	892,099	0.01
USD	530,000	BlueMountain CLO 2015-3 Ltd 'Series 2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2031	529,937	0.00
USD	250,000	BlueMountain CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/8/2028	251,056	0.00
USD	250,000	BlueMountain CLO 2016-3 Ltd 'Series 2016-3A E' '144A' FRN 15/11/2027	253,450	0.00
USD	630,000	BlueMountain CLO XXII Ltd 'Series 2018-22A E' '144A' FRN 15/7/2031	605,723	0.01
EUR	209,000	BlueMountain Fuji EUR CLO III DAC FRN 15/1/2031	230,813	0.00
USD	2,474,000	Boston University 4.061% 1/10/2048	2,525,807	0.02
USD	4,875,000	Boyd Gaming Corp 6.875% 15/5/2023	5,143,125	0.04
USD	3,758,000	Brinker International Inc '144A' 5% 1/10/2024	3,636,617	0.03
USD	750,000	Bristol Park CLO Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	773,658	0.01
USD	6,674,000	Bristow Group Inc '144A' 8.75% 1/3/2023*	6,390,355	0.05
USD	3,680,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.2% 15/1/2021	3,566,926	0.03
USD	11,080,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	10,954,381	0.09
USD	5,777,000	Bruin E&P Partners LLC '144A' 8.875% 1/8/2023	5,993,637	0.05
USD	2,487,215	BSPRT 2017-FL1 Issuer Ltd 'Series 2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	2,496,373	0.02
USD	1,305,689	BSPRT 2017-FL2 Issuer Ltd 'Series 2017-FL2 A' '144A' FRN 15/10/2034	1,305,892	0.01
USD	4,270,000	BSPRT 2018-FL3 Issuer Ltd 'Series 2018-FL3 A' '144A' FRN 15/3/2028	4,260,188	0.04
USD	4,430,000	Buckeye Tobacco Settlement Financing Authority 5.875% 1/6/2047	4,458,086	0.04
USD	820,000	Buena Park School District 5% 1/8/2047	938,387	0.01
USD	250,000	Burnham Park Clo Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/10/2029	253,054	0.00
USD	3,962,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 F' '144A' FRN 10/3/2033	3,794,848	0.03
USD	2,810,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 A2' '144A' 3.454% 10/3/2033	2,796,581	0.02
USD	2,730,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 D' '144A' 3.633% 10/3/2033	2,653,160	0.02
USD	14,000,000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 'Series 2013-1515 E' '144A' 3.717% 10/3/2033	13,503,597	0.11
USD	2,002,000	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust 'Series 2015-1740 E' '144A' FRN 10/1/2035	1,905,048	0.02
EUR	797,000	BWAY Holding Co 4.75% 15/4/2024	953,742	0.01
USD	4,552,000	BWAY Holding Co '144A' 5.5% 15/4/2024	4,552,000	0.04
USD	1,340,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017-CC D' '144A' FRN 13/8/2037	1,270,393	0.01
USD	4,820,000	BXP Trust 2017-CC 'Series 2017-CC E' '144A' FRN 13/8/2037	4,482,946	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 990,000	BNP Paribas 'Series 2017-GM E' '144A' FRN 13/6/2039	894,995	0.01
USD 1,005,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2033	1,167,760	0.01
USD 1,560,000	California Health Facilities Financing Authority 5% 15/8/2047	1,737,130	0.01
USD 700,000	California Infrastructure & Economic Development Bank 5% 15/5/2047	805,563	0.01
USD 680,000	California Infrastructure & Economic Development Bank 5% 15/5/2052	779,491	0.01
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority '144A' 5% 21/11/2045	2,077,010	0.02
USD 1,735,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,557,702	0.02
USD 1,520,000	Calpine Corp 5.375% 15/1/2023	1,453,500	0.01
USD 1,930,000	Calpine Corp '144A' 5.875% 15/1/2024	1,951,712	0.02
USD 2,170,000	Calpine Corp '144A' 6% 15/1/2022	2,221,537	0.02
USD 1,285,000	Campbell Soup Co 3.3% 15/3/2021	1,274,387	0.01
USD 930,000	Canyon Capital CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 15/10/2028	939,126	0.01
USD 460,000	Canyon CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A E' '144A' FRN 15/7/2031	449,036	0.00
USD 1,477,000	Capital One Bank USA NA 2.25% 13/2/2019	1,474,724	0.01
USD 992,000	Capital One NA 2.95% 23/7/2021	977,346	0.01
EUR 400,000	Cargill Inc 1.875% 4/9/2019	474,517	0.00
USD 4,309,000	Carlson Travel Inc '144A' 6.75% 15/12/2023	4,341,318	0.04
USD 210,000	Carlson Travel Inc '144A' 9.5% 15/12/2024	196,854	0.00
USD 1,455,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-3 Ltd 'Series 2012-3A CR' '144A' FRN 14/10/2028	1,467,624	0.01
USD 870,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2012-4 Ltd 'Series 2012-4X INC' FRN 20/1/2029	673,738	0.01
USD 2,260,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A AR' '144A' FRN 18/1/2029	2,254,045	0.02
USD 2,020,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 17/4/2031	2,014,424	0.02
USD 520,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-2R Ltd 'Series 2014-2RA D' '144A' FRN 15/5/2031	512,695	0.00
USD 4,670,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-3R Ltd 'Series 2014-3RA A1A' '144A' FRN 27/7/2031	4,656,154	0.04
USD 450,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A BR' '144A' FRN 20/4/2027	449,869	0.00
USD 1,310,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 20/4/2027	1,312,458	0.01
USD 525,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' FRN 20/4/2027	525,678	0.00
USD 485,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A E1' '144A' FRN 20/4/2027	488,364	0.00
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 27/4/2027	250,236	0.00
USD 250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 27/4/2027	248,171	0.00
USD 2,380,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd 'Series 2015-3A A2R' '144A' FRN 28/7/2028	2,380,101	0.02
USD 370,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd 'Series 2015-4A D' '144A' FRN 20/10/2027	373,044	0.00
USD 500,375	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd 'Series 2015-4A SBB1' '144A' FRN 20/10/2027	496,300	0.00
USD 1,250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 20/4/2027	1,249,983	0.01
USD 750,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D2R' '144A' FRN 15/7/2027	750,736	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 260,000	Carlyle US Clo 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 20/7/2031	265,243	0.00
USD 4,750,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd 'Series 2017-4A A1' '144A' FRN 15/1/2030	4,753,774	0.04
USD 4,787,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	4,770,621	0.04
USD 1,841,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2005-FRE1 'Series 2005-FRE1 M1' FRN 25/12/2035	1,838,825	0.02
USD 1,885,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE1 'Series 2006-FRE1 A4' FRN 25/4/2036	1,546,891	0.01
USD 1,124,498	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A2' FRN 25/10/2036	858,450	0.01
USD 3,200,877	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A3' FRN 25/10/2036	2,454,480	0.02
USD 2,973,572	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A5' FRN 25/10/2036	2,259,661	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 'Series 2006-NC1 M2' FRN 25/1/2036	380,005	0.00
USD 1,014,284	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 'Series 2006-NC4 A3' FRN 25/10/2036	954,905	0.01
USD 2,629,110	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC5 'Series 2006-NC5 A3' FRN 25/1/2037	2,083,097	0.02
USD 669,612	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-HE1 'Series 2007-HE1 A2' FRN 25/6/2037	666,114	0.01
USD 1,690,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-RFC1 'Series 2007-RFC1 A4' FRN 25/10/2036	1,147,550	0.01
USD 1,305,000	Carrizo Oil & Gas Inc 7.5% 15/9/2020	1,309,894	0.01
USD 2,015,000	Caterpillar Financial Services Corp 1.7% 9/8/2021	1,941,669	0.02
USD 2,555,000	Caterpillar Financial Services Corp 1.9% 22/3/2019	2,546,767	0.02
USD 525,000	Caterpillar Financial Services Corp 2.25% 1/12/2019	522,236	0.00
USD 1,285,000	Catholic Health Initiatives 4.35% 1/11/2042	1,216,317	0.01
USD 7,500,000	CBAM 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 20/7/2030	7,517,610	0.06
USD 780,000	CBAM 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A B1' '144A' FRN 17/10/2029	779,986	0.01
USD 1,050,000	CBAM 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A A' '144A' FRN 17/10/2029	1,051,769	0.01
USD 250,000	CBAM 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A B1' '144A' FRN 17/10/2029	250,303	0.00
USD 470,000	CBAM 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A E1' '144A' FRN 17/10/2029	477,325	0.00
USD 1,670,000	CBAM 2018-6 Ltd 'Series 2018-6A A' '144A' FRN 15/7/2031	1,669,551	0.01
USD 640,000	CBAM 2018-6 Ltd 'Series 2018-6A B1' '144A' FRN 15/7/2031	639,815	0.01
USD 5,419,653	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) 'Series 2007-CB1 AF2' 3.645% 25/1/2037	2,732,055	0.02
USD 370,448	C-BASS 2007-CB1 TRUST (Step-up coupon) 'Series 2007-CB1 AF4' 3.645% 25/1/2037	186,687	0.00
USD 276,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.125% 15/2/2023	277,035	0.00
USD 1,081,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 1/5/2027	1,036,409	0.01
USD 3,478,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.25% 30/9/2022	3,508,433	0.03
USD 138,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 5.75% 15/1/2024	140,588	0.00
USD 6,270,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.75% 15/2/2026	6,301,350	0.05
USD 530,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT D' '144A' FRN 10/4/2029	524,220	0.00
USD 16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT X' '144A' FRN 10/4/2029	473,750	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 572,000	CCUBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 'Series 2017-C1 A4' FRN 15/11/2050	564,486	0.00
USD 1,374,084	CD 2006-CD3 Mortgage Trust 'Series 2006-CD3 AM' 5.648% 15/10/2048	1,422,493	0.01
USD 1,960,000	CD 2018-CD7 Mortgage Trust 'Series 2018-CD7 A4' 4.279% 15/8/2051	2,049,072	0.02
USD 1,724,000	CDK Global Inc 3.8% 15/10/2019	1,726,155	0.01
USD 1,157,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	1,187,371	0.01
USD 1,600,000	Cedar Funding II CLO Ltd 'Series 2013-1A BR' '144A' FRN 9/6/2030	1,599,499	0.01
USD 6,610,000	Cedar Funding IX CLO Ltd 'Series 2018-9A A1' '144A' FRN 20/4/2031	6,578,602	0.06
USD 580,000	Cedar Funding IX CLO Ltd 'Series 2018-9A E' '144A' FRN 20/4/2031	570,683	0.01
USD 9,480,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A A1' '144A' FRN 17/10/2030	9,498,116	0.08
USD 580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A B' '144A' FRN 17/10/2030	581,159	0.01
USD 890,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A C' '144A' FRN 17/10/2030	892,795	0.01
USD 700,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd 'Series 2017-8A D' '144A' FRN 17/10/2030	703,885	0.01
USD 2,555,000	Celgene Corp 2.25% 15/5/2019	2,548,063	0.02
USD 3,400,000	Cent CLO 17 Ltd '144A' FRN 30/4/2031	3,385,390	0.03
USD 500,000	Cent CLO 17 Ltd '144A' FRN 30/4/2031	499,728	0.00
USD 5,200,000	Cent CLO 24 Ltd 'Series 2015-24A A1R' '144A' FRN 15/10/2026	5,201,765	0.04
USD 10,926,000	Centennial Resource Production LLC '144A' 5.375% 15/1/2026	10,762,110	0.09
USD 1,650,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2050	1,847,563	0.02
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2045	806,371	0.01
USD 740,000	Central Texas Regional Mobility Authority 5% 1/1/2046	808,642	0.01
USD 977,000	Century Communities Inc 6.875% 15/5/2022	1,005,138	0.01
USD 5,430,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 'Series 2016-C3 XD' '144A' FRN 10/1/2048	570,014	0.01
USD 330,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 'Series 2016-C3 A3' 3.865% 10/1/2048	334,196	0.00
USD 2,270,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 C' FRN 10/5/2058	2,347,339	0.02
USD 5,557,421	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XA' FRN 10/5/2058	557,539	0.00
USD 5,439,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XB' FRN 10/5/2058	261,534	0.00
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 'Series 2018-TAN C' '144A' 5.295% 15/2/2033	1,105,003	0.01
USD 3,990,000	CGBAM Commercial Mortgage Trust 2015-SMRT 'Series 2015-SMRT E' '144A' FRN 10/4/2028	3,966,852	0.03
USD 2,500,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	2,502,255	0.02
USD 4,100,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC D' '144A' FRN 15/7/2032	4,105,356	0.03
USD 4,960,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC E' '144A' FRN 15/7/2032	4,965,273	0.04
USD 1,855,000	Chaparral Energy Inc '144A' 8.75% 15/7/2023	1,850,362	0.02
USD 188,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital FRN 1/2/2024	192,218	0.00
USD 14,661,757	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 'Series 2007-S6 1A1' 6% 25/12/2037	11,378,370	0.10
EUR 1,739,000	Chemours Co/The 4% 15/5/2026*	2,049,411	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	8,531,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.125% 30/6/2027	8,712,284	0.07
USD	4,244,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7% 30/6/2024	4,710,840	0.04
USD	14,456,205	Cheniere Energy Inc '144A' 4.875% 28/5/2021	15,280,859	0.13
USD	5,331,000	Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025	5,331,000	0.05
USD	730,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2041	825,685	0.01
USD	575,000	Chesapeake Bay Bridge & Tunnel District 5% 1/7/2051	636,594	0.01
USD	1,908,000	Chesapeake Energy Corp 5.5% 15/9/2026	1,860,561	0.02
USD	238,000	Chesapeake Energy Corp 6.125% 15/2/2021	243,950	0.00
USD	2,922,000	Chesapeake Energy Corp 6.625% 15/8/2020	3,046,185	0.03
USD	10,593,000	Chesapeake Energy Corp '144A' 8% 15/12/2022	11,145,743	0.09
USD	2,786,141	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A4 'Series 2006-0A4 A1' FRN 25/4/2046	1,415,763	0.01
USD	697,760	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A5 'Series 2006-0A5 3A1' FRN 25/4/2046	642,148	0.01
USD	8,038,106	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 'Series 2007-15 2A2' 6.5% 25/9/2037	6,218,177	0.05
USD	250,000	CIFC Funding 2013-I Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 16/7/2030	250,275	0.00
USD	7,500,000	CIFC Funding 2013-II Ltd 'Series 2013-2A A1LR' '144A' FRN 18/10/2030	7,510,958	0.06
USD	772,000	CIFC Funding 2013-II Ltd 'Series 2013-2A B1LR' '144A' FRN 18/10/2030	774,074	0.01
USD	250,000	CIFC Funding 2014 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 18/1/2031	250,064	0.00
USD	280,000	CIFC Funding 2014-III Ltd 'Series 2014-3A B1R' '144A' FRN 22/7/2026	280,184	0.00
USD	1,013,000	CIFC Funding 2014-III Ltd 'Series 2014-3A C1R' '144A' FRN 22/7/2026	1,014,345	0.01
USD	745,000	CIFC Funding 2014-IV Ltd 'Series 2014-4A D' '144A' FRN 17/10/2026	746,796	0.01
USD	4,825,000	CIFC Funding 2014-V Ltd 'Series 2014-5A A1R' '144A' FRN 17/1/2027	4,825,134	0.04
USD	280,000	CIFC Funding 2014-V Ltd 'Series 2014-5A CR' '144A' FRN 17/1/2027	280,537	0.00
USD	950,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	944,467	0.01
USD	1,940,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 15/4/2027	1,918,932	0.02
USD	940,000	CIFC Funding 2016-I Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 21/10/2028	951,087	0.01
USD	2,270,000	CIFC Funding 2018-I Ltd 'Series 2018-1A A' '144A' FRN 18/4/2031	2,254,898	0.02
USD	19,405,905	CIM Trust 2017-6 'Series 2017-6 A1' '144A' FRN 25/6/2057	19,084,639	0.16
USD	4,065,000	Citibank NA 3.4% 23/7/2021	4,072,392	0.03
USD	2,382,883	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-9 'Series 2007-9 1A1' 6.25% 25/12/2037	2,136,060	0.02
USD	2,870,086	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2008-2 'Series 2008-2 1A1' 6.5% 25/6/2038	2,504,073	0.02
USD	2,290,000	Citicorp Residential Mortgage Trust Series 2007-2 (Step-up coupon) 'Series 2007-2 M1' 5.166% 25/6/2037	2,191,136	0.02
USD	190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 'Series 2013-375P D' '144A' FRN 10/5/2035	186,840	0.00
USD	1,700,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 'Series 2014-GC19 C' FRN 10/3/2047	1,774,057	0.02
USD	4,250,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 'Series 2015-GC27 C' FRN 10/2/2048	4,198,298	0.04
USD	300,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SHP2 'Series 2015-SHP2 F' '144A' FRN 15/7/2027	305,509	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 563,500	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SSHP ' Series 2015-SSHP D ' ' 144A ' FRN 15/9/2027	565,979	0.00
USD 1,190,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1 ' Series 2016-C1 C ' FRN 10/5/2049	1,230,103	0.01
USD 1,340,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 ' Series 2016-GC37 D ' ' 144A ' 2.788% 10/4/2049	1,015,910	0.01
USD 100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ' Series 2016-P3 C ' FRN 15/4/2049	102,994	0.00
USD 260,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-SMPL ' Series 2016-SMPL D ' ' 144A ' 3.52% 10/9/2031	259,774	0.00
USD 500,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-SMPL ' Series 2016-SMPL E ' ' 144A ' 4.509% 10/9/2031	499,510	0.00
USD 5,917,294	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 ' Series 2017-P8 XA ' FRN 15/9/2050	385,058	0.00
EUR 2,670,000	Citigroup Inc 1.375% 27/10/2021	3,223,050	0.03
USD 5,110,000	Citigroup Inc 2.35% 2/8/2021	4,976,432	0.04
USD 2,560,000	Citigroup Inc 2.55% 8/4/2019	2,557,900	0.02
USD 695,000	Citigroup Inc 4.45% 29/9/2027	689,469	0.01
USD 7,795,000	Citigroup Inc 4.65% 23/7/2048	7,987,186	0.07
USD 4,230,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-NC1 ' Series 2006-NC1 A2D ' FRN 25/8/2036	4,141,527	0.04
USD 6,121,948	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 ' Series 2007-AHL2 A3B ' FRN 25/5/2037	4,477,872	0.04
USD 2,098,579	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 ' Series 2007-AHL2 A3C ' FRN 25/5/2037	1,548,373	0.01
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 ' Series 2007-WFH2 M3 ' FRN 25/3/2037	2,593,812	0.02
USD 2,610,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc ' Series 2006-WFH4 M3 ' FRN 25/11/2036	2,239,991	0.02
USD 1,115,000	Citizens Bank NA/Providence RI 3.7% 29/3/2023	1,116,223	0.01
USD 2,700,000	City & County of Denver CO 5% 1/8/2044	3,027,105	0.03
USD 840,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2040	940,682	0.01
USD 2,400,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2041	2,763,132	0.02
USD 1,580,000	City of Atlanta GA Water & Wastewater Revenue 5% 1/11/2047	1,809,558	0.02
USD 3,280,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2041	3,716,502	0.03
USD 3,170,000	City of Aurora CO Water Revenue 5% 1/8/2046	3,591,864	0.03
USD 1,560,000	City of Austin TX Water & Wastewater System Revenue 5% 15/11/2043	1,736,038	0.01
USD 1,620,000	City of Cartersville GA 5% 1/6/2048	1,859,404	0.02
USD 840,000	City of Colorado Springs CO Utilities System Revenue 5% 15/11/2042	964,660	0.01
USD 1,240,000	City of Columbia SC Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/2/2042	1,435,337	0.01
USD 1,340,000	City of Columbia SC Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/2/2048	1,543,995	0.01
USD 2,350,000	City of New York NY 5% 1/4/2040	2,700,620	0.02
USD 140,000	City of New York NY 5% 1/4/2045	159,770	0.00
USD 500,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	556,097	0.00
USD 1,105,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,612,770	0.01
USD 800,000	City of San Antonio TX Electric & Gas Systems Revenue 5% 1/2/2048	871,452	0.01
USD 1,700,000	Clark County School District 5% 15/6/2030	1,976,879	0.02
USD 1,830,000	Clark County School District 5% 15/6/2031	2,117,996	0.02
USD 2,020,000	Clark County School District 5% 15/6/2033	2,321,364	0.02

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,900,000	Clark County School District 5% 15/6/2034	2,174,873	0.02
USD	1,375,000	Clear Creek CLO Ltd 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2030	1,390,509	0.01
USD	1,195,000	CLNS Trust 2017-IKPR 'Series 2017-IKPR E' '144A' FRN 11/6/2032	1,205,424	0.01
USD	1,270,000	Coca-Cola Co/The 3.15% 15/11/2020	1,278,384	0.01
EUR	710,000	Colfax Corp 3.25% 15/5/2025	847,724	0.01
USD	720,000	Colorado Health Facilities Authority 5.25% 1/2/2031	756,493	0.01
USD	120,987	COLT 2015-1 LLC 'Series 2015-1 A1V' '144A' FRN 26/12/2045	121,374	0.00
USD	390,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust 'Series 2005-C6 F' '144A' ' FRN 10/6/2044	396,969	0.00
USD	100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 'Series 2013-300P D' ' 144A' FRN 10/8/2030	101,346	0.00
USD	640,000	COMM 2013-GAM 'Series 2013-GAM A2' '144A' 3.367% 10/2/2028	635,279	0.01
USD	1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust 'Series 2013-WWP D' ' 144A' 3.898% 10/3/2031	1,787,786	0.02
USD	1,500,000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 'Series 2014-CR15 C' FRN 10/2/2047	1,549,804	0.01
USD	1,280,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 'Series 2014-LC15 A4' 4.006% 10/4/2047	1,319,464	0.01
USD	1,447,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT D' ' 144A' FRN 13/8/2027	1,447,461	0.01
USD	1,020,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT E' ' 144A' FRN 13/8/2027	1,027,794	0.01
USD	8,430,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT F' ' 144A' FRN 13/8/2027	8,427,238	0.07
USD	3,585,000	COMM 2014-PAT Mortgage Trust 'Series 2014-PAT G' ' 144A' FRN 13/8/2027	3,586,452	0.03
USD	1,155,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust 'Series 2014-TWC E' ' 144A' FRN 13/2/2032	1,171,376	0.01
USD	1,314,000	COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS4 C' FRN 10/8/2047	1,307,974	0.01
USD	550,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 C' FRN 10/5/2048	546,387	0.00
USD	210,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CMC' ' '144A' FRN 10/5/2048	210,232	0.00
USD	5,150,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CMD' ' '144A' FRN 10/5/2048	5,118,271	0.04
USD	1,950,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 CME' ' '144A' FRN 10/5/2048	1,927,951	0.02
USD	5,320,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 D' FRN 10/5/2048	4,454,805	0.04
USD	880,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'Series 2015-CR25 C' FRN 10/8/2048	876,481	0.01
USD	505,000	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'Series 2015-CR25 D' FRN 10/8/2048	423,756	0.00
USD	23,188,079	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 'Series 2015-CR25 XA' FRN 10/8/2048	1,106,424	0.01
USD	2,890,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 'Series 2015-LC19 C' FRN 10/2/2048	2,877,571	0.02
USD	3,336,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 'Series 2015-LC19 D' ' 144A' FRN 10/2/2048	2,876,349	0.02
USD	1,631,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 'Series 2015-LC19 A4' 3.183% 10/2/2048	1,607,358	0.01
USD	1,500,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 C' FRN 10/7/2048	1,475,964	0.01
USD	360,000	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 'Series 2015-LC23 A4' 3.774% 10/10/2048	365,522	0.00
USD	1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 'Series 2016-667M D' ' 144A' FRN 10/10/2036	1,015,752	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 116,665,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 'Series 2016-667M XA' '144A' FRN 10/10/2036	635,824	0.01
USD 6,515,874	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust 'Series 2017-COR2 XA' FRN 10/9/2050	545,998	0.00
USD 740,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust 'Series 2017-COR2 D' '144A' 3% 10/9/2050	617,630	0.01
USD 1,660,000	COMM 2017-DLTA Mortgage Trust 'Series 2017-DLTA E' '144A' FRN 15/8/2035	1,648,986	0.01
USD 1,520,000	COMM 2017-DLTA Mortgage Trust 'Series 2017-DLTA F' '144A' FRN 15/8/2035	1,502,842	0.01
USD 3,050,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 'Series 2018-COR3 XD' '144A' FRN 10/5/2051	404,598	0.00
USD 1,497,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	1,467,060	0.01
USD 5,416,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,050,420	0.04
USD 91,206	Commercial Mortgage Trust 2006-GG7 'Series 2006-GG7 AM' FRN 10/7/2038	91,337	0.00
USD 2,100,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	2,074,338	0.02
USD 1,455,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	1,465,862	0.01
USD 1,640,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/11/2042	1,876,882	0.02
USD 2,230,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/1/2045	2,549,392	0.02
USD 1,710,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/11/2045	1,951,153	0.02
USD 3,260,000	Commonwealth of Massachusetts Transportation Fund Revenue 5% 1/6/2048	3,756,498	0.03
USD 8,975,000	Commonwealth of Puerto Rico 8% 1/7/2035	4,891,375	0.04
USD 2,075,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,262,414	0.02
USD 1,400,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,507,940	0.01
USD 1,943,590	Conseco Finance Corp 'Series 1997-3 M1' FRN 15/3/2028	1,932,015	0.02
USD 1,137,425	Conseco Finance Corp 'Series 1997-6 M1' FRN 15/1/2029	1,139,817	0.01
USD 1,427,101	Conseco Finance Corp 'Series 1999-5 A5' FRN 1/3/2030	1,059,223	0.01
USD 1,044,309	Conseco Finance Corp 'Series 1999-5 A6' FRN 1/3/2030	750,410	0.01
USD 286,088	Conseco Finance Corp 'Series 1998-4 M1' FRN 1/4/2030	258,218	0.00
USD 700,487	Conseco Finance Corp 'Series 1998-6 M1' FRN 1/6/2030	655,611	0.01
USD 2,191,355	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 M1' FRN 1/9/2030	1,907,664	0.02
USD 1,154,587	Conseco Finance Corp 'Series 1998-8 A1' 6.28% 1/9/2030	1,239,008	0.01
USD 1,339,817	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-1 A5' FRN 1/9/2029	683,577	0.01
USD 1,659,547	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A6' FRN 1/5/2032	831,709	0.01
USD 1,971,150	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A6' 7.96% 1/5/2031	1,236,473	0.01
USD 4,627,775	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-4 A5' 7.97% 1/5/2032	2,227,147	0.02
USD 3,587,521	Conseco Finance Securitizations Corp 'Series 2000-5 A7' 8.2% 1/5/2031	2,310,266	0.02
USD 2,540,000	Consolidated Edison Co of New York Inc 6.65% 1/4/2019	2,595,437	0.02
USD 143	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	155	0.00
USD 139,687	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	139,774	0.00
USD 2,793,000	Continental Resources Inc/OK 5% 15/9/2022	2,837,978	0.02
USD 890,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,126,540	0.01
USD 8,992,000	Core Industrial Trust 2015-CALW 'Series 2015-CALW G' '144A' FRN 10/2/2034	8,560,249	0.07

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)				
USD	2,480,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW D' '144A' FRN 10/2/2034	2,481,990	0.02
USD	1,269,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW E' '144A' FRN 10/2/2034	1,255,693	0.01
USD	5,140,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW F' '144A' FRN 10/2/2034	5,003,664	0.04
USD	13,340,000	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW XA' '144A' FRN 10/2/2034	310,088	0.00
USD	424,000	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST E' '144A' FRN 10/2/2037	416,933	0.00
USD	27,146,221	Core Industrial Trust 2015-WEST 'Series 2015-WEST XA' '144A' FRN 10/2/2037	1,452,187	0.01
USD	4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 'Series 2006-BC4 M1' FRN 25/11/2036	4,048,709	0.03
USD	2,486,321	Countrywide Asset-Backed Certificates 'Series 2007-S3 A3' FRN 25/5/2037	2,334,233	0.02
USD	1,835,255	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) 'Series 2006-S3 A4' 6.652% 25/1/2029	1,941,521	0.02
USD	1,580,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2047	1,819,899	0.02
USD	1,345,000	County of Clark NV 5% 1/5/2048	1,538,922	0.01
USD	1,460,000	County of Franklin OH Sales Tax Revenue 5% 1/6/2043	1,696,973	0.01
USD	2,880,000	County of Franklin OH Sales Tax Revenue 5% 1/6/2048	3,334,320	0.03
USD	1,020,000	County of King WA Sewer Revenue 5% 1/7/2042	1,168,588	0.01
USD	1,670,000	County of King WA Sewer Revenue 5% 1/7/2047	1,860,038	0.02
USD	750,000	County of Miami-Dade FL 5% 1/7/2035	851,655	0.01
USD	2,015,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.504% 1/10/2024	1,916,960	0.02
USD	455,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	434,338	0.00
USD	835,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	799,492	0.01
USD	780,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	740,442	0.01
USD	1,545,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,548,283	0.01
USD	1,810,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	1,987,127	0.02
USD	1,560,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2040	1,745,702	0.01
USD	1,136,000	Cox Communications Inc '144A' 3.5% 15/8/2027	1,074,574	0.01
USD	1,864,000	Cox Communications Inc '144A' 4.6% 15/8/2047	1,751,361	0.02
USD	1,175,872	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A 'Series 2013-A B' '144A' 2.5% 25/1/2030	1,091,815	0.01
USD	1,450,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C3 C' FRN 15/7/2037	1,429,627	0.01
USD	510,000	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2004-C4 F' '144A' FRN 15/10/2039	512,704	0.00
USD	84,249	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C2 AMFX' 4.877% 15/4/2037	83,334	0.00
USD	6,740	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ' Series 2005-C3 B' 4.882% 15/7/2037	6,734	0.00
USD	7,509,583	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 'Series 2009-12R 3A1' '144A' 6.5% 27/10/2037	4,641,897	0.04
USD	2,433,711	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' Series 2007-CB6 A4' '144A' FRN 25/7/2037	1,673,596	0.01
USD	865,079	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC ' Series 2007-RP1 A' '144A' FRN 25/5/2046	769,960	0.01
USD	425,305	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-CB2 AF4' 3.449% 25/12/2036	368,410	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 3,941,137	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-SL1 A2' '144A' 5.556% 25/9/2036	697,482	0.01
USD 705,000	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC (Step-up coupon) 'Series 2006-MH1 B1' '144A' 6.25% 25/10/2036	712,795	0.01
USD 6,890,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	6,531,107	0.06
USD 2,120,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15/10/2025	2,069,650	0.02
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2027	320,126	0.00
USD 5,452,000	CSC Holdings LLC '144A' 6.625% 15/10/2025	5,697,340	0.05
USD 372,000	CSC Holdings LLC 8.625% 15/2/2019	381,531	0.00
USD 2,808,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.125% 15/1/2023	3,085,290	0.03
USD 4,502,000	CSC Holdings LLC '144A' 10.875% 15/10/2025	5,284,222	0.04
USD 1,178,640	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-10 'Series 2005-10 10A1' FRN 25/11/2035	451,098	0.00
USD 122,260,000	CSMC 2014-USA OA LLC 'Series 2014-USA X2' '144A' FRN 15/9/2037	706,663	0.01
USD 409,074	CSMC 2016-MFF 'Series 2016-MFF A' '144A' FRN 15/11/2033	411,387	0.00
USD 15,177,963	CSMC 2017-1 TR 4.5% 25/3/2021	15,288,580	0.13
USD 770,000	CSMC 2017-TIME 'Series 2017-TIME A' '144A' 3.646% 13/11/2039	760,210	0.01
USD 2,335,488	CSMC Mortgage-Backed Trust 2007-5 'Series 2007-5 1A11' FRN 25/8/2037	1,883,170	0.02
USD 74,525	CSMC Series 2010-20R 'Series 2010-20R 9A1' '144A' FRN 27/1/2036	75,116	0.00
USD 3,785,784	CSMC Series 2014-11R 'Series 2014-11R 16A1' '144A' FRN 27/9/2047	3,844,228	0.03
USD 870,000	CSMC Series 2014-4R 'Series 2014-4R 16A3' '144A' FRN 27/2/2036	810,472	0.01
USD 1,556,109	CSMC Series 2014-9R 'Series 2014-9R 9A1' '144A' FRN 27/8/2036	1,430,104	0.01
USD 1,650,000	CSMC Series 2015-4R 'Series 2015-4R 1A4' '144A' FRN 27/10/2036	1,165,644	0.01
USD 570,000	CSMC Series 2015-4R 'Series 2015-4R 1A2' '144A' FRN 27/11/2036	486,400	0.00
USD 435,432	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A1' '144A' FRN 27/3/2036	434,707	0.00
USD 2,708,147	CSMC Series 2015-6R 'Series 2015-6R 5A2' '144A' FRN 27/3/2036	1,799,452	0.02
USD 1,689,000	CSMC Trust 2017-CHOP 'Series 2017-CHOP E' '144A' FRN 15/7/2032	1,702,416	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 'Series 2017-PFHP A' '144A' FRN 15/12/2030	790,497	0.01
USD 1,214,000	CSWF 2018-TOP 'Series 2018-TOP A' '144A' FRN 15/8/2035	1,226,140	0.01
USD 530,000	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2028	524,570	0.00
USD 333,500	Cumberland Park CLO Ltd 'Series 2015-2A ER' '144A' FRN 20/7/2028	336,056	0.00
USD 286,000	CVR Refining LLC / Coffeyville Finance Inc 6.5% 1/11/2022	293,150	0.00
USD 6,430,000	CVS Health Corp 3.125% 9/3/2020	6,434,073	0.05
USD 5,110,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	5,111,855	0.04
USD 7,625,103	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 1AF' FRN 25/5/2036	7,492,830	0.06
USD 1,781,933	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 'Series 2005-16 2AF3' FRN 25/5/2036	1,746,650	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 5,297,415	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 (Step-up coupon) 'Series 2005-17 1AF4' 4.384% 25/5/2036	5,224,393	0.04
USD 255,772	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 'Series 2006-11 3AV2' FRN 25/9/2046	252,367	0.00
USD 938,965	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 'Series 2004-U 2A' FRN 15/3/2034	900,086	0.01
USD 162,704	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S2 'Series 2006-S2 A3' 5.841% 25/7/2027	240,439	0.00
USD 235,206	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A4' 5.842% 25/6/2035	236,538	0.00
USD 666,911	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A5' 6.155% 25/6/2035	731,268	0.01
USD 658,310	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2007-S1 'Series 2007-S1 A3' FRN 25/11/2036	662,005	0.01
USD 9,518,617	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1A' '144A' FRN 15/5/2035	8,971,692	0.08
USD 314,215	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5B1B' '144A' FRN 15/5/2035	310,450	0.00
USD 1,561,895	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 'Series 2006-RES 5F1A' '144A' FRN 15/12/2035	1,549,928	0.01
USD 961,037	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 'Series 2005-B 2A' FRN 15/5/2035	931,368	0.01
USD 4,045,265	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 'Series 2006-C 2A' FRN 15/5/2036	3,926,258	0.03
USD 1,965,153	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 'Series 2006-H 1A' FRN 15/11/2036	1,625,074	0.01
USD 400,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 2.7% 3/8/2020	395,680	0.00
USD 1,460,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2041	1,647,720	0.01
USD 1,970,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,216,467	0.02
USD 340,000	Dallas/Fort Worth International Airport 5% 1/11/2043	358,108	0.00
USD 6,195,000	DaVita Inc 5.125% 15/7/2024	5,985,919	0.05
USD 2,150,000	DaVita Inc 5.75% 15/8/2022	2,184,938	0.02
USD 1,412,000	DBJPM 16-C3 Mortgage Trust 'Series 2016-C3 D' '144A' FRN 10/8/2049	1,218,754	0.01
USD 4,600,000	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust 'Series 2017-C6 XD' FRN 10/6/2050	299,621	0.00
USD 900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust 'Series 2011-LC1A E' '144A' FRN 10/11/2046	931,319	0.01
USD 9,600,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK E' '144A' FRN 10/10/2034	9,018,340	0.08
USD 2,040,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK F' '144A' FRN 10/10/2034	1,866,535	0.02
USD 2,170,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 'Series 2017-BRBK A' '144A' 3.452% 10/10/2034	2,164,537	0.02
USD 187,000	DCP Midstream Operating LP '144A' 5.35% 15/3/2020	191,441	0.00
USD 8,184,200	DCP Rights LLC 'Series 2014-1A A' '144A' 5.463% 25/10/2044	8,182,604	0.07
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A' '144A' FRN 20/10/2030	500,618	0.00
USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/10/2030	506,529	0.00
USD 510,000	Dell Inc 5.875% 15/6/2019	520,200	0.00
USD 273,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 5.875% 15/6/2021	281,545	0.00
USD 1,880,000	Dell International LLC / EMC Corp '144A' 8.35% 15/7/2046	2,314,299	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,217,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,200,589	0.02
USD 2,068,000	Delta Air Lines Inc 3.625% 15/3/2022	2,049,684	0.02
USD 2,430,000	Denton Independent School District 5% 15/8/2043	2,771,998	0.02
USD 260,373	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT 'Series 2007-RS1 A2 ' '144A' FRN 27/1/2037	247,029	0.00
USD 10,075,967	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE 'Series 2007-OA4 A2A' FRN 25/8/2047	6,708,322	0.06
USD 553,918	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 'Series 2006-AB3 A3' FRN 25/7/2036	497,756	0.00
USD 353,573	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 'Series 2006-AB3 A8' FRN 25/7/2036	317,766	0.00
USD 1,000,000	Dewolf Park Clo Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/10/2030	1,017,186	0.01
USD 3,862,000	Diamondback Energy Inc 5.375% 31/5/2025	3,982,687	0.03
USD 4,071,000	Dignity Health 2.637% 1/11/2019	4,058,785	0.03
USD 2,385,000	Discover Bank FRN 9/8/2028	2,383,855	0.02
USD 7,740,000	Discovery Communications LLC 5.2% 20/9/2047	7,569,743	0.06
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,057,091	0.01
USD 945,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,054,459	0.01
USD 2,500,000	District of Columbia 5% 1/6/2042	2,861,175	0.02
USD 1,360,000	District of Columbia Water & Sewer Authority 5% 1/10/2049	1,568,978	0.01
USD 1,507,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A BR' '144A' FRN 20/4/2028	1,495,900	0.01
USD 640,000	Dorchester Park CLO DAC 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 20/4/2028	639,477	0.01
USD 250,000	Dryden 36 Senior Loan Fund 'Series 2014-36A CR' ' 144A' FRN 15/1/2028	251,796	0.00
USD 500,000	Dryden 36 Senior Loan Fund 'Series 2014-36A DR' ' 144A' FRN 15/1/2028	504,582	0.00
USD 19,231,000	Dryden 53 CLO Ltd 'Series 2017-53A A' '144A' FRN 15/1/2031	19,254,368	0.16
USD 510,000	Dryden 55 CLO Ltd 'Series 2018-55A A1' '144A' FRN 15/4/2031	509,165	0.00
USD 1,246,000	Dryden 64 CLO Ltd 'Series 2018-64A A' '144A' FRN 18/4/2031	1,239,511	0.01
USD 250,000	Dryden Senior Loan Fund 'Series 2017-47A E' '144A' FRN 15/4/2028	252,794	0.00
USD 3,100,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A ARR' ' 144A' FRN 15/10/2027	3,101,832	0.03
USD 500,000	Dryden XXV Senior Loan Fund 'Series 2012-25A CRR' ' 144A' FRN 15/10/2027	499,307	0.00
USD 530,000	Dryden XXVI Senior Loan Fund 'Series 2013-26A AR' ' 144A' FRN 15/4/2029	528,266	0.00
USD 6,505,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 'Series 2013-28A A1LR' '144A' FRN 15/8/2030	6,511,302	0.06
USD 1,875,000	DTE Energy Co 3.7% 1/8/2023	1,887,934	0.02
USD 3,190,000	Duke University 3.299% 1/10/2046	2,904,552	0.02
USD 2,175,000	Dutchess County Local Development Corp 5% 1/7/2046	2,385,605	0.02
USD 720,000	Elevation CLO 2016-5 Ltd 'Series 2016-5A D' '144A' FRN 15/7/2028	721,706	0.01
USD 650,000	Elevation CLO 2016-5 Ltd 'Series 2016-5A E' '144A' FRN 15/7/2028	652,861	0.01
USD 1,560,000	Elevation CLO 2017-8 Ltd 'Series 2017-8A A1' '144A' FRN 25/10/2030	1,560,840	0.01
USD 2,375,000	Elevation CLO 2017-8 Ltd 'Series 2017-8A C' '144A' FRN 25/10/2030	2,334,597	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 960,000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust ' Series 2015-11MD A ' ' 144A ' FRN 10/9/2035	963,015	0.01
USD 1,099,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ' 144A ' 5.5% 30/1/2026	1,101,747	0.01
USD 11,093,000	Energen Corp 4.625% 1/9/2021	11,259,395	0.10
USD 4,110,000	EnLink Midstream Partners LP FRN 15/12/2022 (Perpetual)	3,790,967	0.03
USD 935,000	Enterprise Development Authority/The ' 144A ' 12% 15/7/2024	912,794	0.01
USD 1,190,000	Enterprise Products Operating LLC 5.2% 1/9/2020	1,236,111	0.01
EUR 732,000	Equinix Inc 2.875% 15/3/2024	859,093	0.01
EUR 680,000	Equinix Inc 2.875% 1/10/2025	779,488	0.01
USD 377,000	Equinix Inc 5.375% 1/1/2022	389,177	0.00
USD 2,494,000	Equinix Inc 5.375% 1/4/2023	2,571,937	0.02
USD 4,410,000	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd ' Series 2018-RS06 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2035	4,410,894	0.04
USD 3,030,000	Exelon Corp 3.497% 1/6/2022	2,994,566	0.03
USD 1,275,000	Expedia Group Inc 5.95% 15/8/2020	1,336,739	0.01
USD 2,551,000	Express Scripts Holding Co 2.6% 30/11/2020	2,508,866	0.02
USD 2,551,000	Express Scripts Holding Co 4.75% 15/11/2021	2,637,344	0.02
USD 2,705,000	Extraction Oil & Gas Inc ' 144A ' 7.375% 15/5/2024	2,765,862	0.02
USD 610,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2016-C02 1M2 ' FRN 25/9/2028	719,181	0.01
USD 3,746,971	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2016-C04 1M2 ' FRN 25/1/2029	4,248,221	0.04
USD 3,395,727	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2016-C06 1M2 ' FRN 25/4/2029	3,880,912	0.03
USD 1,366,931	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C01 1B1 ' FRN 25/7/2029	1,658,024	0.01
USD 2,579,861	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C01 1M2 ' FRN 25/7/2029	2,819,353	0.02
USD 2,240,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C03 1B1 ' FRN 25/10/2029	2,586,098	0.02
USD 236,698	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C03 1M2 ' FRN 25/10/2029	254,679	0.00
USD 3,060,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C05 1B1 ' FRN 25/1/2030	3,257,328	0.03
USD 1,789,604	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C05 1M2 ' FRN 25/1/2030	1,845,745	0.02
USD 5,000,000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities ' Series 2017-C07 1B1 ' FRN 25/5/2030	5,340,145	0.05
USD 2,197,907	Fannie Mae Pool ' 890694 ' 4% 1/9/2045	2,263,557	0.02
USD 12,323,594	Fannie Mae Pool ' 890751 ' 4% 1/9/2046	12,652,387	0.11
USD 1,664,053	Fannie Mae Pool ' AB8742 ' 4% 1/3/2043	1,716,503	0.01
USD 895,612	Fannie Mae Pool ' AB8900 ' 3.5% 1/4/2043	897,381	0.01
USD 2,302,505	Fannie Mae Pool ' AB9076 ' 4% 1/4/2043	2,374,232	0.02
USD 8,701,958	Fannie Mae Pool ' AB9727 ' 2.5% 1/6/2028	8,516,108	0.07
USD 4,262,180	Fannie Mae Pool ' AE0625 ' 4% 1/12/2040	4,387,255	0.04
USD 589,965	Fannie Mae Pool ' AK8634 ' 3.5% 1/4/2042	591,134	0.01
USD 317,623	Fannie Mae Pool ' AK9393 ' 3.5% 1/4/2042	318,252	0.00
USD 5,479,313	Fannie Mae Pool ' AL5624 ' 4.5% 1/8/2044	5,787,319	0.05
USD 74,031	Fannie Mae Pool ' AL6583 ' 3% 1/3/2030	73,845	0.00
USD 406,473	Fannie Mae Pool ' AL7969 ' 3% 1/2/2031	404,279	0.00
USD 6,451,870	Fannie Mae Pool ' AL8195 ' 4.5% 1/2/2046	6,806,779	0.06

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

保有高		銘柄		時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)					
USD	12,839,438	Fannie Mae Pool	' AL9235 ' 4.5% 1/7/2046	13,545,814	0.11
USD	2,737,911	Fannie Mae Pool	' AL9276 ' 4% 1/9/2046	2,815,508	0.02
USD	5,488,387	Fannie Mae Pool	' AL9281 ' 4.5% 1/9/2046	5,745,515	0.05
USD	23,350,487	Fannie Mae Pool	' AL9470 ' 4% 1/7/2046	23,931,892	0.20
USD	7,235,642	Fannie Mae Pool	' AL9520 ' 4% 1/2/2046	7,434,300	0.06
USD	19,632,031	Fannie Mae Pool	' AL9980 ' 4% 1/2/2046	20,159,109	0.17
USD	167,157	Fannie Mae Pool	' A08031 ' 3.5% 1/7/2042	167,487	0.00
USD	2,975,779	Fannie Mae Pool	' AP6347 ' 4% 1/9/2042	3,075,146	0.03
USD	1,000,126	Fannie Mae Pool	' AQ4032 ' 3.5% 1/11/2042	1,002,050	0.01
USD	1,136,150	Fannie Mae Pool	' AS3707 ' 4% 1/11/2044	1,164,408	0.01
USD	6,384,819	Fannie Mae Pool	' AS4067 ' 4% 1/12/2044	6,586,158	0.06
USD	66,168	Fannie Mae Pool	' AS5728 ' 3% 1/9/2030	66,001	0.00
USD	3,144,024	Fannie Mae Pool	' AS5848 ' 4.5% 1/9/2045	3,317,062	0.03
USD	5,427,829	Fannie Mae Pool	' AS6016 ' 4% 1/10/2045	5,570,905	0.05
USD	3,125,117	Fannie Mae Pool	' AS6220 ' 4% 1/11/2045	3,211,072	0.03
USD	250,000	Fannie Mae Pool	' AS6767 ' 3% 1/3/2031	248,650	0.00
USD	3,151,346	Fannie Mae Pool	' AS6840 ' 4% 1/3/2046	3,223,972	0.03
USD	8,508,418	Fannie Mae Pool	' AS6991 ' 4% 1/4/2046	8,720,372	0.07
USD	10,482,878	Fannie Mae Pool	' AS7628 ' 3% 1/7/2031	10,426,293	0.09
USD	8,625,295	Fannie Mae Pool	' AS7756 ' 4% 1/8/2046	8,838,833	0.07
USD	6,169,907	Fannie Mae Pool	' AS7867 ' 4% 1/9/2046	6,322,591	0.05
USD	4,466,503	Fannie Mae Pool	' AS7940 ' 4% 1/9/2046	4,568,978	0.04
USD	11,614,170	Fannie Mae Pool	' AS8375 ' 4% 1/11/2046	11,901,770	0.10
USD	4,953,597	Fannie Mae Pool	' AS8376 ' 4% 1/11/2046	5,067,632	0.04
USD	7,320,979	Fannie Mae Pool	' AS8377 ' 4% 1/11/2046	7,490,073	0.06
USD	231,683	Fannie Mae Pool	' AS8703 ' 2.5% 1/2/2032	225,163	0.00
USD	4,568,707	Fannie Mae Pool	' AS9410 ' 4% 1/4/2047	4,696,992	0.04
USD	10,234,203	Fannie Mae Pool	' AS9676 ' 4% 1/5/2047	10,458,377	0.09
USD	424,677	Fannie Mae Pool	' AS9685 ' 3% 1/6/2032	422,419	0.00
USD	458,643	Fannie Mae Pool	' AS9879 ' 3% 1/6/2032	456,167	0.00
USD	10,877,329	Fannie Mae Pool	' AS9920 ' 4% 1/7/2047	11,130,227	0.09
USD	5,058,938	Fannie Mae Pool	' AT5860 ' 3.5% 1/6/2043	5,068,965	0.04
USD	8,128,693	Fannie Mae Pool	' AZ6438 ' 3% 1/1/2031	8,084,816	0.07
USD	6,813,090	Fannie Mae Pool	' AZ6625 ' 3% 1/12/2030	6,776,314	0.06
USD	9,785,765	Fannie Mae Pool	' AZ6662 ' 3% 1/1/2031	9,732,944	0.08
USD	433,236	Fannie Mae Pool	' AZ9987 ' 3% 1/11/2030	430,939	0.00
USD	23,733,364	Fannie Mae Pool	' BA4567 ' 3% 1/12/2030	23,605,256	0.20
USD	22,940,973	Fannie Mae Pool	' BA6533 ' 3% 1/1/2031	22,817,142	0.19
USD	1,869,089	Fannie Mae Pool	' BC0170 ' 4% 1/1/2046	1,913,862	0.02
USD	80,046	Fannie Mae Pool	' BC0725 ' 3% 1/2/2031	79,614	0.00
USD	2,353,809	Fannie Mae Pool	' BC0908 ' 4% 1/5/2046	2,404,936	0.02
USD	4,413,380	Fannie Mae Pool	' BC1222 ' 4% 1/7/2046	4,530,681	0.04
USD	612,171	Fannie Mae Pool	' BC1462 ' 3% 1/7/2031	608,867	0.01
USD	373,332	Fannie Mae Pool	' BC1774 ' 3% 1/1/2031	371,317	0.00
USD	7,522,350	Fannie Mae Pool	' BC2863 ' 2.5% 1/9/2031	7,314,808	0.06

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

保有高		銘柄		時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)					
USD	7,365,120	Fannie Mae Pool	' BC4193 ' 3% 1/3/2031	7,325,364	0.06
USD	806,344	Fannie Mae Pool	' BC6961 ' 4.5% 1/3/2046	845,804	0.01
USD	194,289	Fannie Mae Pool	' BD0979 ' 4.5% 1/5/2046	204,970	0.00
USD	2,061,993	Fannie Mae Pool	' BD2383 ' 4.5% 1/12/2046	2,175,519	0.02
USD	1,638,303	Fannie Mae Pool	' BD2444 ' 4.5% 1/1/2047	1,718,434	0.01
USD	287,255	Fannie Mae Pool	' BD6043 ' 4% 1/8/2046	294,856	0.00
USD	1,212,280	Fannie Mae Pool	' BD9054 ' 3% 1/9/2032	1,207,710	0.01
USD	373,161	Fannie Mae Pool	' BE2555 ' 2.5% 1/11/2031	362,660	0.00
USD	3,314,822	Fannie Mae Pool	' BE3193 ' 4% 1/2/2047	3,398,157	0.03
USD	22,301,897	Fannie Mae Pool	' BE3696 ' 4% 1/6/2047	22,819,969	0.19
USD	4,060,738	Fannie Mae Pool	' BE5013 ' 4% 1/2/2045	4,172,443	0.04
USD	1,621,479	Fannie Mae Pool	' BE5047 ' 4% 1/11/2046	1,670,000	0.01
USD	5,767,891	Fannie Mae Pool	' BE5588 ' 4% 1/1/2047	5,912,796	0.05
USD	428,602	Fannie Mae Pool	' BE5966 ' 4.5% 1/2/2047	449,574	0.00
USD	1,748,374	Fannie Mae Pool	' BE6351 ' 3% 1/6/2032	1,738,945	0.01
USD	2,477,480	Fannie Mae Pool	' BE8203 ' 4.5% 1/4/2047	2,613,942	0.02
USD	3,144,290	Fannie Mae Pool	' BE8818 ' 4% 1/7/2047	3,223,429	0.03
USD	947,374	Fannie Mae Pool	' BE9708 ' 3% 1/4/2032	942,260	0.01
USD	11,396,230	Fannie Mae Pool	' BF0182 ' 4% 1/1/2057	11,731,820	0.10
USD	315,999	Fannie Mae Pool	' BH0353 ' 3% 1/4/2032	314,320	0.00
USD	2,687,973	Fannie Mae Pool	' BH0948 ' 4.5% 1/5/2047	2,836,649	0.02
USD	2,130,004	Fannie Mae Pool	' BH1036 ' 4.5% 1/5/2047	2,247,219	0.02
USD	1,773,059	Fannie Mae Pool	' BH1461 ' 3% 1/5/2032	1,763,489	0.02
USD	2,735,966	Fannie Mae Pool	' BH2193 ' 4.5% 1/6/2047	2,887,026	0.02
USD	1,725,239	Fannie Mae Pool	' BH2401 ' 3% 1/5/2032	1,716,057	0.01
USD	4,809,541	Fannie Mae Pool	' BH2512 ' 3% 1/7/2032	4,784,020	0.04
USD	1,809,841	Fannie Mae Pool	' BH2539 ' 4.5% 1/9/2047	1,910,099	0.02
USD	2,090,600	Fannie Mae Pool	' BH2624 ' 4% 1/8/2047	2,149,303	0.02
USD	209,573	Fannie Mae Pool	' BH3388 ' 3% 1/7/2032	208,584	0.00
USD	451,416	Fannie Mae Pool	' BH3653 ' 4.5% 1/6/2047	475,168	0.00
USD	2,068,960	Fannie Mae Pool	' BH4087 ' 4.5% 1/10/2047	2,177,829	0.02
USD	244,535	Fannie Mae Pool	' BH5140 ' 4.5% 1/9/2047	258,082	0.00
USD	1,087,167	Fannie Mae Pool	' BH5263 ' 3% 1/9/2032	1,081,392	0.01
USD	2,752,663	Fannie Mae Pool	' BH5276 ' 4.5% 1/8/2047	2,897,508	0.02
USD	1,756,594	Fannie Mae Pool	' BH5562 ' 4.5% 1/7/2047	1,832,740	0.02
USD	1,632,152	Fannie Mae Pool	' BH5759 ' 4.5% 1/11/2047	1,718,036	0.01
USD	1,467,063	Fannie Mae Pool	' BH5766 ' 4.5% 1/11/2047	1,548,336	0.01
USD	1,616,097	Fannie Mae Pool	' BH5775 ' 3% 1/11/2032	1,607,524	0.01
USD	3,087,293	Fannie Mae Pool	' BH5980 ' 4.5% 1/8/2047	3,233,008	0.03
USD	116,831	Fannie Mae Pool	' BH6415 ' 3% 1/3/2033	116,210	0.00
USD	13,728,213	Fannie Mae Pool	' BH6737 ' 3% 1/8/2032	13,655,442	0.12
USD	799,555	Fannie Mae Pool	' BH7525 ' 3% 1/9/2032	795,317	0.01
USD	5,484,186	Fannie Mae Pool	' BH7526 ' 3% 1/9/2032	5,454,583	0.05
USD	1,849,860	Fannie Mae Pool	' BH7546 ' 3% 1/10/2032	1,840,063	0.02
USD	175,069	Fannie Mae Pool	' BH7687 ' 3% 1/12/2032	174,124	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 13,332,005	Fannie Mae Pool 'BH8135' 3% 1/10/2032	13,260,041	0.11
USD 1,717,591	Fannie Mae Pool 'BH8500' 3% 1/11/2032	1,708,497	0.01
USD 1,950,156	Fannie Mae Pool 'BH9218' 4% 1/1/2048	2,005,345	0.02
USD 1,413,637	Fannie Mae Pool 'BH9223' 4.5% 1/1/2048	1,487,923	0.01
USD 1,188,899	Fannie Mae Pool 'BH9235' 3% 1/1/2033	1,182,587	0.01
USD 1,060,377	Fannie Mae Pool 'BH9670' 4.5% 1/9/2047	1,119,120	0.01
USD 1,024,918	Fannie Mae Pool 'BH9821' 3% 1/9/2032	1,019,385	0.01
USD 191,258	Fannie Mae Pool 'BJ0439' 3% 1/10/2032	190,226	0.00
USD 471,796	Fannie Mae Pool 'BJ0718' 4.5% 1/10/2047	497,932	0.00
USD 2,728,758	Fannie Mae Pool 'BJ0726' 4.5% 1/10/2047	2,863,246	0.02
USD 83,449	Fannie Mae Pool 'BJ1314' 3% 1/10/2032	82,998	0.00
USD 195,227	Fannie Mae Pool 'BJ1461' 3% 1/10/2032	194,173	0.00
USD 986,798	Fannie Mae Pool 'BJ1471' 3% 1/10/2032	981,471	0.01
USD 865,154	Fannie Mae Pool 'BJ1792' 4.5% 1/11/2047	907,797	0.01
USD 891,562	Fannie Mae Pool 'BJ2046' 4.5% 1/11/2047	940,952	0.01
USD 761,529	Fannie Mae Pool 'BJ2086' 4.5% 1/11/2047	801,599	0.01
USD 1,563,707	Fannie Mae Pool 'BJ2469' 3% 1/12/2032	1,555,416	0.01
USD 38,265	Fannie Mae Pool 'BJ2996' 3% 1/1/2033	38,062	0.00
USD 1,585,635	Fannie Mae Pool 'BJ3146' 3% 1/11/2032	1,577,076	0.01
USD 97,613	Fannie Mae Pool 'BJ3419' 3% 1/1/2033	97,095	0.00
USD 1,986,409	Fannie Mae Pool 'BJ3439' 3% 1/2/2033	1,975,849	0.02
USD 79,925	Fannie Mae Pool 'BJ3762' 3% 1/12/2032	79,501	0.00
USD 1,984,998	Fannie Mae Pool 'BJ3804' 3% 1/1/2033	1,974,476	0.02
USD 98,267	Fannie Mae Pool 'BJ3975' 3% 1/1/2033	97,745	0.00
USD 1,274,522	Fannie Mae Pool 'BJ4268' 3% 1/12/2032	1,267,777	0.01
USD 24,273,375	Fannie Mae Pool 'BJ4568' 4% 1/1/2048	24,791,416	0.21
USD 1,382,383	Fannie Mae Pool 'BJ4573' 3% 1/1/2033	1,374,921	0.01
USD 2,375,362	Fannie Mae Pool 'BJ4685' 3% 1/1/2033	2,362,752	0.02
USD 1,533,991	Fannie Mae Pool 'BJ4725' 3% 1/1/2033	1,525,711	0.01
USD 111,506	Fannie Mae Pool 'BJ4774' 3% 1/2/2033	110,860	0.00
USD 2,473,582	Fannie Mae Pool 'BJ4856' 3% 1/2/2033	2,460,446	0.02
USD 1,906,447	Fannie Mae Pool 'BJ5006' 4.5% 1/12/2047	2,007,921	0.02
USD 1,388,608	Fannie Mae Pool 'BJ5029' 4.5% 1/12/2047	1,465,537	0.01
USD 1,375,715	Fannie Mae Pool 'BJ5474' 3% 1/12/2032	1,368,422	0.01
USD 1,490,273	Fannie Mae Pool 'BJ5519' 3% 1/3/2033	1,482,373	0.01
USD 1,323,777	Fannie Mae Pool 'BJ5608' 3% 1/12/2032	1,316,748	0.01
USD 118,297	Fannie Mae Pool 'BJ5705' 3% 1/3/2033	117,669	0.00
USD 66,619	Fannie Mae Pool 'BJ5753' 3% 1/5/2033	66,265	0.00
USD 1,114,342	Fannie Mae Pool 'BJ5865' 3% 1/12/2032	1,108,421	0.01
USD 1,840,241	Fannie Mae Pool 'BJ7059' 3% 1/8/2033	1,830,308	0.02
USD 1,513,941	Fannie Mae Pool 'BJ8048' 3% 1/2/2033	1,505,899	0.01
USD 1,801,918	Fannie Mae Pool 'BJ8578' 3% 1/4/2033	1,792,353	0.02
USD 116,839	Fannie Mae Pool 'BJ8594' 3% 1/4/2033	116,218	0.00
USD 1,428,220	Fannie Mae Pool 'BJ8602' 3% 1/4/2033	1,420,644	0.01
USD 149,958	Fannie Mae Pool 'BJ8655' 3% 1/1/2033	149,163	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 543,216	Fannie Mae Pool 'BJ9182' 3% 1/5/2033	540,284	0.00
USD 1,586,316	Fannie Mae Pool 'BJ9925' 3% 1/3/2033	1,577,901	0.01
USD 1,496,562	Fannie Mae Pool 'BK0742' 3% 1/3/2033	1,488,483	0.01
USD 1,800,638	Fannie Mae Pool 'BK1074' 3% 1/6/2033	1,789,939	0.02
USD 56,876	Fannie Mae Pool 'BK1097' 3% 1/7/2033	56,574	0.00
USD 1,702,143	Fannie Mae Pool 'BK1935' 3% 1/3/2033	1,693,090	0.01
USD 1,257,391	Fannie Mae Pool 'BK2012' 4% 1/4/2048	1,285,204	0.01
USD 1,517,891	Fannie Mae Pool 'BK2013' 4% 1/4/2048	1,550,903	0.01
USD 1,923,746	Fannie Mae Pool 'BK3332' 3% 1/3/2033	1,913,524	0.02
USD 946,251	Fannie Mae Pool 'BK3356' 3% 1/3/2033	941,143	0.01
USD 1,699,235	Fannie Mae Pool 'BK3714' 3% 1/3/2033	1,690,228	0.01
USD 1,966,036	Fannie Mae Pool 'BK3751' 3% 1/5/2033	1,955,580	0.02
USD 93,974	Fannie Mae Pool 'BK3757' 3% 1/5/2033	93,474	0.00
USD 1,906,683	Fannie Mae Pool 'BK4213' 4% 1/7/2048	1,951,394	0.02
USD 2,433,781	Fannie Mae Pool 'BK4674' 3% 1/7/2033	2,420,843	0.02
USD 33,061,904	Fannie Mae Pool 'BK4789' 3% 1/8/2033	32,886,156	0.28
USD 1,594,506	Fannie Mae Pool 'BK4983' 3% 1/6/2033	1,586,042	0.01
USD 1,707,871	Fannie Mae Pool 'BK5161' 3% 1/6/2033	1,698,794	0.01
USD 2,608,383	Fannie Mae Pool 'BK5466' 3% 1/5/2033	2,594,510	0.02
USD 1,873,381	Fannie Mae Pool 'BK5472' 3% 1/6/2033	1,863,423	0.02
USD 44,272	Fannie Mae Pool 'BK5480' 3% 1/8/2033	44,033	0.00
USD 1,868,324	Fannie Mae Pool 'BK6720' 3% 1/6/2033	1,858,240	0.02
USD 124,481	Fannie Mae Pool 'BK7383' 3% 1/7/2033	123,809	0.00
USD 1,260,382	Fannie Mae Pool 'BK7481' 4% 1/7/2048	1,292,469	0.01
USD 121,482	Fannie Mae Pool 'BK7750' 3% 1/7/2033	120,826	0.00
USD 4,954,935	Fannie Mae Pool 'BM1043' 4.5% 1/4/2047	5,214,064	0.04
USD 8,437,917	Fannie Mae Pool 'BM1262' 4.5% 1/5/2047	8,902,219	0.08
USD 113,720	Fannie Mae Pool 'BM1269' 3% 1/5/2032	113,115	0.00
USD 4,940,577	Fannie Mae Pool 'BM1347' 4.5% 1/5/2047	5,200,289	0.04
USD 8,830,193	Fannie Mae Pool 'BM1549' 4.5% 1/7/2047	9,261,995	0.08
USD 1,703,285	Fannie Mae Pool 'BM1833' 4.5% 1/10/2047	1,797,646	0.02
USD 879,860	Fannie Mae Pool 'BM1834' 4.5% 1/10/2047	926,158	0.01
USD 9,670,321	Fannie Mae Pool 'BM1876' 5.041% 1/9/2044	10,186,323	0.09
USD 5,904,426	Fannie Mae Pool 'BM1892' 2.5% 1/9/2028	5,762,043	0.05
USD 7,959,297	Fannie Mae Pool 'BM1895' 2.5% 1/2/2032	7,767,724	0.07
USD 3,603,928	Fannie Mae Pool 'BM1896' 2.5% 1/11/2031	3,506,691	0.03
USD 5,312,160	Fannie Mae Pool 'BM1907' 4% 1/11/2046	5,459,612	0.05
USD 3,214,737	Fannie Mae Pool 'BM1918' 4.5% 1/10/2047	3,361,564	0.03
USD 4,307,511	Fannie Mae Pool 'BM1923' 3.5% 1/12/2046	4,316,025	0.04
USD 2,844,013	Fannie Mae Pool 'BM1953' 3.5% 1/8/2045	2,853,210	0.02
USD 3,230,154	Fannie Mae Pool 'BM3036' 3.5% 1/4/2046	3,237,079	0.03
USD 5,665,029	Fannie Mae Pool 'BM3047' 4% 1/10/2047	5,824,340	0.05
USD 3,266,205	Fannie Mae Pool 'BM3096' 3.5% 1/12/2045	3,274,258	0.03
USD 6,163,996	Fannie Mae Pool 'BM3110' 4.5% 1/11/2047	6,488,020	0.06
USD 15,061,297	Fannie Mae Pool 'BM3210' 4.5% 1/12/2047	15,803,607	0.13

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 677,827	Fannie Mae Pool 'BM3310' 4.5% 1/12/2047	715,379	0.01
USD 4,726,446	Fannie Mae Pool 'BM3360' 4% 1/11/2047	4,853,995	0.04
USD 2,257,528	Fannie Mae Pool 'BM3402' 2.5% 1/6/2030	2,209,117	0.02
USD 2,859,619	Fannie Mae Pool 'BM3449' 4% 1/2/2048	2,937,099	0.03
USD 6,194,263	Fannie Mae Pool 'BM3486' 3.5% 1/2/2045	6,206,412	0.05
USD 5,751,793	Fannie Mae Pool 'BM3582' 3% 1/2/2033	5,721,263	0.05
USD 5,468,038	Fannie Mae Pool 'BM3675' 4% 1/3/2048	5,622,557	0.05
USD 2,001,884	Fannie Mae Pool 'BM4173' 4.5% 1/7/2048	2,116,290	0.02
USD 21,939,849	Fannie Mae Pool 'CA0195' 3% 1/8/2032	21,828,312	0.18
USD 4,272,286	Fannie Mae Pool 'CA0307' 4.5% 1/9/2047	4,482,840	0.04
USD 8,752,840	Fannie Mae Pool 'CA0343' 4.5% 1/9/2047	9,213,395	0.08
USD 146,389	Fannie Mae Pool 'CA0428' 3% 1/9/2032	145,599	0.00
USD 324,305	Fannie Mae Pool 'CA0577' 3% 1/10/2032	322,635	0.00
USD 2,302,174	Fannie Mae Pool 'CA0592' 3% 1/10/2032	2,289,947	0.02
USD 6,967,733	Fannie Mae Pool 'CA0704' 4% 1/11/2047	7,164,545	0.06
USD 8,836,910	Fannie Mae Pool 'CA0710' 4.5% 1/11/2047	9,301,892	0.08
USD 10,313,656	Fannie Mae Pool 'CA0715' 4.5% 1/11/2047	10,885,007	0.09
USD 21,213,328	Fannie Mae Pool 'CA0902' 3% 1/12/2032	21,103,969	0.18
USD 6,405,157	Fannie Mae Pool 'CA1004' 4% 1/1/2048	6,578,879	0.06
USD 5,512,722	Fannie Mae Pool 'CA1007' 4% 1/1/2048	5,652,259	0.05
USD 3,482,154	Fannie Mae Pool 'CA1013' 4% 1/1/2048	3,580,656	0.03
USD 1,978,921	Fannie Mae Pool 'CA1094' 3% 1/1/2033	1,968,239	0.02
USD 1,853,681	Fannie Mae Pool 'CA1096' 3% 1/1/2033	1,843,676	0.02
USD 3,863,463	Fannie Mae Pool 'CA1121' 4% 1/2/2048	3,968,140	0.03
USD 3,884,807	Fannie Mae Pool 'CA1122' 4% 1/2/2048	3,983,038	0.03
USD 3,892,232	Fannie Mae Pool 'CA1123' 4% 1/2/2048	4,002,382	0.03
USD 2,673,100	Fannie Mae Pool 'CA1128' 4.5% 1/2/2048	2,821,964	0.02
USD 999,603	Fannie Mae Pool 'CA1432' 3% 1/3/2033	994,290	0.01
USD 399,588	Fannie Mae Pool 'CA1648' 3% 1/12/2032	397,432	0.00
USD 630,148	Fannie Mae Pool 'CA2130' 3% 1/7/2033	626,799	0.01
USD 3,930,771	Fannie Mae Pool 'CA2133' 3% 1/7/2033	3,909,879	0.03
USD 20,154,284	Fannie Mae Pool 'MA2617' 3% 1/5/2031	20,045,495	0.17
USD 389,040	Fannie Mae Pool 'MA2684' 3% 1/7/2031	386,940	0.00
USD 54,699,548	Fannie Mae Pool 'MA2871' 3% 1/1/2032	54,404,291	0.46
USD 2,059,856	Fannie Mae Pool 'MA3029' 3% 1/6/2032	2,048,737	0.02
USD 1,895,646	Fannie Mae Pool 'MA3060' 3% 1/7/2032	1,885,413	0.02
USD 237,576	Fannie Mae Pool 'MA3090' 3% 1/8/2032	236,293	0.00
USD 10,962,214	Fannie Mae Pool 'MA3155' 3% 1/10/2032	10,903,043	0.09
USD 84,694,224	Fannie Mae Pool 'MA3188' 3% 1/11/2032	84,245,211	0.71
USD 48,230,977	Fannie Mae Pool 'MA3247' 3% 1/1/2033	47,975,091	0.41
USD 26,382,437	Fannie Mae Pool 'MA3283' 3% 1/2/2033	26,240,030	0.22
USD 126,624,049	Fannie Mae Pool 'MA3339' 3% 1/4/2033	125,951,305	1.06
USD 26,626,310	Fannie Mae Pool 'MA3363' 3% 1/5/2033	26,484,796	0.22
USD 54,479,930	Fannie Mae Pool 'MA3391' 3% 1/6/2033	54,190,206	0.46
USD 90,477,995	Fannie Mae Pool 'MA3409' 3% 1/7/2033	89,997,065	0.76

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 38,254,285	Fannie Mae Pool 'MA3437' 3% 1/8/2033	38,047,796	0.32
USD 60,189,292	Fannie Mae Pool 'MA3461' 3% 1/9/2033	59,864,402	0.51
USD 940,000	Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M8 A2' FRN 25/5/2027	914,098	0.01
USD 14,526,959	Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M12 X' FRN 25/6/2027	190,085	0.00
USD 2,700,000	Fannie Mae-Aces 'Series 2017-M14 A2' FRN 25/11/2027	2,587,502	0.02
USD 1,453,000	Fannie Mae-Aces 'Series 2018-M1 A2' FRN 25/12/2027	1,402,529	0.01
USD 3,910,000	Fannie Mae-Aces 'Series 2018-M10 A2' FRN 25/7/2028	3,900,776	0.03
USD 6,398,214	Fannie Mae-Aces 'Series 2016-M4 X2' FRN 25/1/2039	545,544	0.00
EUR 1,660,000	Federal-Mogul LLC / Federal-Mogul Financing Corp 5% 15/7/2024	2,051,942	0.02
USD 10,799,000	First Data Corp '144A' 5% 15/1/2024	10,859,744	0.09
USD 640,000	First Data Corp '144A' 5.375% 15/8/2023	652,896	0.01
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 'Series 2004-FFH3 M3' FRN 25/10/2034	717,142	0.01
USD 988,400	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF5 'Series 2006-FF5 2A3' FRN 25/4/2036	965,789	0.01
USD 2,709,871	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FFH1 'Series 2006-FFH1 M2' FRN 25/1/2036	1,627,695	0.01
USD 4,394,000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp ' 144A' 7.875% 15/11/2025	4,459,910	0.04
USD 1,400,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 15/4/2027	1,396,498	0.01
EUR 1,400,000	Ford Motor Credit Co LLC FRN 14/5/2021	1,617,894	0.01
EUR 200,000	Ford Motor Credit Co LLC FRN 7/12/2022	226,851	0.00
USD 9,330,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.375% 12/3/2019	9,301,264	0.08
USD 1,335,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 4/5/2023	1,258,236	0.01
USD 1,675,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 4/8/2025	1,601,476	0.01
USD 6,050,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.25% 20/9/2022	6,016,386	0.05
USD 3,003,265	Freddie Mac Gold Pool 'C04180' 3.5% 1/8/2042	3,008,805	0.03
USD 913,056	Freddie Mac Gold Pool 'C04276' 3.5% 1/10/2042	914,748	0.01
USD 2,487,008	Freddie Mac Gold Pool 'C09007' 3.5% 1/8/2042	2,491,615	0.02
USD 754,482	Freddie Mac Gold Pool 'C09032' 3.5% 1/2/2043	755,878	0.01
USD 17,503	Freddie Mac Gold Pool 'E09015' 2.5% 1/12/2027	17,111	0.00
USD 777,017	Freddie Mac Gold Pool 'G06922' 3.5% 1/2/2042	778,454	0.01
USD 7,146,671	Freddie Mac Gold Pool 'G07818' 4.5% 1/9/2044	7,552,694	0.06
USD 220,560	Freddie Mac Gold Pool 'G14606' 2.5% 1/11/2027	215,619	0.00
USD 29,911,689	Freddie Mac Gold Pool 'G15601' 2.5% 1/1/2029	29,242,400	0.25
USD 6,925,869	Freddie Mac Gold Pool 'G15887' 2.5% 1/1/2031	6,728,246	0.06
USD 1,504,130	Freddie Mac Gold Pool 'G16164' 2.5% 1/1/2030	1,467,921	0.01
USD 5,215,046	Freddie Mac Gold Pool 'G16178' 2.5% 1/11/2028	5,098,196	0.04
USD 1,962,739	Freddie Mac Gold Pool 'G18449' 2.5% 1/11/2027	1,918,771	0.02
USD 495,701	Freddie Mac Gold Pool 'G18461' 2.5% 1/4/2028	484,591	0.00
USD 786,158	Freddie Mac Gold Pool 'G60262' 3.5% 1/1/2044	787,613	0.01
USD 2,990,638	Freddie Mac Gold Pool 'G60691' 4% 1/6/2046	3,059,718	0.03
USD 1,094,363	Freddie Mac Gold Pool 'G60871' 4.5% 1/7/2046	1,151,681	0.01
USD 4,501,153	Freddie Mac Gold Pool 'G60884' 4% 1/2/2047	4,614,636	0.04
USD 385,266	Freddie Mac Gold Pool 'G60963' 3.5% 1/12/2044	385,980	0.00
USD 8,194,261	Freddie Mac Gold Pool 'G60971' 4.5% 1/1/2047	8,597,191	0.07
USD 7,294,404	Freddie Mac Gold Pool 'G61007' 4.5% 1/8/2046	7,676,147	0.07

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

保有高		銘柄		時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)					
USD	8,366,430	Freddie Mac Gold Pool	' G61119 ' 4.5% 1/8/2047	8,780,649	0.07
USD	1,870,581	Freddie Mac Gold Pool	' G61303 ' 3.5% 1/8/2044	1,876,889	0.02
USD	49,659,591	Freddie Mac Gold Pool	' G67702 ' 4% 1/1/2047	50,898,308	0.43
USD	22,327,768	Freddie Mac Gold Pool	' G67711 ' 4% 1/3/2048	22,897,699	0.19
USD	19,206,526	Freddie Mac Gold Pool	' G67715 ' 4.5% 1/8/2048	20,181,335	0.17
USD	1,953,053	Freddie Mac Gold Pool	' J20465 ' 2.5% 1/9/2027	1,909,304	0.02
USD	3,242,903	Freddie Mac Gold Pool	' J23930 ' 2.5% 1/5/2028	3,170,324	0.03
USD	595,300	Freddie Mac Gold Pool	' J34888 ' 2.5% 1/7/2031	578,306	0.01
USD	3,291,432	Freddie Mac Gold Pool	' J35138 ' 2.5% 1/8/2031	3,197,462	0.03
USD	2,250,815	Freddie Mac Gold Pool	' J35215 ' 2.5% 1/9/2031	2,186,582	0.02
USD	2,190,164	Freddie Mac Gold Pool	' Q04688 ' 4% 1/11/2041	2,249,543	0.02
USD	1,211,142	Freddie Mac Gold Pool	' Q09307 ' 3.5% 1/7/2042	1,213,387	0.01
USD	3,184,214	Freddie Mac Gold Pool	' Q09342 ' 3.5% 1/6/2042	3,190,115	0.03
USD	731,148	Freddie Mac Gold Pool	' Q10053 ' 3.5% 1/8/2042	732,503	0.01
USD	597,048	Freddie Mac Gold Pool	' Q11908 ' 3.5% 1/10/2042	595,178	0.01
USD	967,217	Freddie Mac Gold Pool	' Q12052 ' 3.5% 1/10/2042	969,006	0.01
USD	1,466,229	Freddie Mac Gold Pool	' Q13670 ' 3.5% 1/11/2042	1,468,947	0.01
USD	59,764	Freddie Mac Gold Pool	' Q23935 ' 3.5% 1/12/2043	59,747	0.00
USD	808,039	Freddie Mac Gold Pool	' Q29918 ' 4.5% 1/11/2044	853,790	0.01
USD	923,505	Freddie Mac Gold Pool	' Q38476 ' 4.5% 1/1/2046	974,326	0.01
USD	1,379,169	Freddie Mac Gold Pool	' Q39445 ' 4.5% 1/3/2046	1,455,058	0.01
USD	3,840,148	Freddie Mac Gold Pool	' Q42608 ' 4.5% 1/8/2046	4,051,391	0.03
USD	698,077	Freddie Mac Gold Pool	' Q44616 ' 4.5% 1/11/2046	732,362	0.01
USD	129,967	Freddie Mac Gold Pool	' Q44955 ' 4.5% 1/11/2046	137,117	0.00
USD	1,186,572	Freddie Mac Gold Pool	' Q45398 ' 4.5% 1/4/2046	1,251,868	0.01
USD	1,524,643	Freddie Mac Gold Pool	' Q45754 ' 4.5% 1/1/2047	1,599,895	0.01
USD	1,192,739	Freddie Mac Gold Pool	' Q45755 ' 4.5% 1/1/2047	1,258,441	0.01
USD	3,433,805	Freddie Mac Gold Pool	' Q47409 ' 4% 1/4/2047	3,520,422	0.03
USD	9,159,062	Freddie Mac Gold Pool	' Q47934 ' 4.5% 1/5/2047	9,612,487	0.08
USD	1,476,209	Freddie Mac Gold Pool	' Q47958 ' 4.5% 1/5/2047	1,549,292	0.01
USD	2,047,737	Freddie Mac Gold Pool	' Q48235 ' 4.5% 1/5/2047	2,155,261	0.02
USD	3,378,346	Freddie Mac Gold Pool	' Q49708 ' 4.5% 1/8/2047	3,535,419	0.03
USD	708,819	Freddie Mac Gold Pool	' Q49807 ' 4.5% 1/8/2047	748,149	0.01
USD	804,968	Freddie Mac Gold Pool	' Q49868 ' 4.5% 1/8/2047	844,825	0.01
USD	298,275	Freddie Mac Gold Pool	' Q50525 ' 4.5% 1/9/2047	313,043	0.00
USD	4,912,791	Freddie Mac Gold Pool	' Q50686 ' 4.5% 1/8/2047	5,156,023	0.04
USD	1,944,349	Freddie Mac Gold Pool	' Q50871 ' 4% 1/9/2047	1,999,112	0.02
USD	1,979,443	Freddie Mac Gold Pool	' Q52318 ' 4.5% 1/11/2047	2,083,899	0.02
USD	584,627	Freddie Mac Gold Pool	' Q53752 ' 4.5% 1/1/2048	617,239	0.01
USD	618,822	Freddie Mac Gold Pool	' Q53762 ' 4.5% 1/1/2048	652,371	0.01
USD	975,634	Freddie Mac Gold Pool	' Q57394 ' 4% 1/7/2048	996,937	0.01
USD	1,569,858	Freddie Mac Gold Pool	' Q57403 ' 4% 1/7/2048	1,603,553	0.01
USD	4,838,299	Freddie Mac Gold Pool	' V61221 ' 2.5% 1/6/2031	4,700,132	0.04
USD	209,531	Freddie Mac Gold Pool	' V61746 ' 2.5% 1/10/2031	203,573	0.00
USD	7,236,449	Freddie Mac Gold Pool	' V83460 ' 4.5% 1/9/2047	7,594,724	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 920,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K040 A2 ' 3.241% 25/9/2024	927,050	0.01
USD 9,705,657	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K044 X1 ' FRN 25/1/2025	380,039	0.00
USD 8,117,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K057 A2 ' 2.57% 25/7/2026	7,738,260	0.07
USD 1,779,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K058 A2 ' 2.653% 25/8/2026	1,701,418	0.01
USD 1,400,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K059 A2 ' FRN 25/9/2026	1,383,192	0.01
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K061 A2 ' FRN 25/11/2026	631,913	0.01
USD 187,246	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K062 A2 ' 3.413% 25/12/2026	188,562	0.00
USD 9,870,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K063 A2 ' FRN 25/1/2027	9,951,361	0.08
USD 17,357,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K064 A2 ' 3.224% 25/3/2027	17,228,476	0.15
USD 21,035,533	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K064 X1 ' FRN 25/3/2027	932,545	0.01
USD 20,130,245	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K065 X1 ' FRN 25/4/2027	998,963	0.01
USD 630,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K072 A2 ' 3.444% 25/12/2027	632,017	0.01
USD 1,310,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K079 A2 ' 3.926% 25/6/2028	1,363,801	0.01
USD 6,842,672	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K718 X1 ' FRN 25/1/2022	123,916	0.00
USD 824,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series K730 A2 ' 3.59% 25/1/2025	844,478	0.01
USD 29,132	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KC01 X1 ' FRN 25/12/2022	530	0.00
USD 24,063,760	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KIR1 X ' FRN 25/3/2026	1,549,888	0.01
USD 930,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KJ20 A2 ' 3.799% 25/12/2025	958,584	0.01
USD 29,664,773	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW01 X1 ' FRN 25/1/2026	1,628,130	0.01
USD 6,245,419	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW03 X1 ' FRN 25/6/2027	346,780	0.00
USD 930,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates ' Series KW06 A2 ' FRN 25/6/2028	955,339	0.01
USD 393,465	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-DN1 B ' FRN 25/1/2025	566,152	0.00
USD 415,106	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2015-HQ2 B ' FRN 25/5/2025	509,179	0.00
USD 2,600,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2016-DNA4 M3 ' FRN 25/3/2029	2,931,214	0.02
USD 2,710,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA1 M2 ' FRN 25/7/2029	2,952,627	0.03
USD 1,800,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 B1 ' FRN 25/10/2029	2,099,282	0.02
USD 3,271,259	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA2 M2 ' FRN 25/10/2029	3,619,575	0.03
USD 3,210,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA3 B1 ' FRN 25/3/2030	3,603,356	0.03
USD 6,340,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-DNA3 M2 ' FRN 25/3/2030	6,626,938	0.06
USD 7,000,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2018-DNA1 B1 ' FRN 25/7/2030	6,869,794	0.06
USD 17,000,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2018-DNA1 M2 ' FRN 25/7/2030	16,949,108	0.14
USD 750,000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ' Series 2017-HRP1 M2 ' FRN 25/12/2042	774,578	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	107,070,144	FREMF 2015-K718 Mortgage Trust 'Series 2015-K718 X2A' '144A' FRN 25/2/2022	289,164	0.00
USD	1,150,000	FREMF 2016-K54 Mortgage Trust 'Series 2016-K54 B' '144A' FRN 25/4/2048	1,148,985	0.01
USD	1,840,000	FREMF 2018-K73 Mortgage Trust 'Series 2018-K73 B' '144A' FRN 25/1/2028	1,779,815	0.02
USD	1,700,000	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust FRN 25/5/2025	1,669,952	0.01
USD	730,000	FREMF 2018-K74 Mortgage Trust 'Series 2018-K74 B' '144A' FRN 25/2/2051	717,846	0.01
USD	700,000	FREMF 2018-K77 Mortgage Trust 'Series 2018-K77 B' '144A' 4.159% 25/5/2028	690,792	0.01
USD	598,333	FREMF Mortgage Trust 'Series 2017-K64 B' '144A' FRN 25/3/2027	590,401	0.01
USD	10,604,966	Fremont Home Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	8,525,644	0.07
USD	2,220,000	FRESB 2018-SB52 Mortgage Trust 'Series 2018-SB52 A10F' FRN 25/6/2028	2,212,872	0.02
USD	2,065,000	Frontier Communications Corp 7.125% 15/3/2019	2,080,487	0.02
USD	1,632,000	Frontier Communications Corp 8.125% 1/10/2018	1,629,960	0.01
USD	3,377,000	Frontier Communications Corp '144A' 8.5% 1/4/2026	3,195,486	0.03
USD	223,634	GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF 'Series 2015-NRF AFL1' '144A' FRN 15/12/2034	223,782	0.00
USD	5,458,000	GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF 'Series 2015-NRF EFX' '144A' FRN 15/12/2034	5,409,177	0.05
USD	550,000	GAHR Commercial Mortgage Trust 2015-NRF 'Series 2015-NRF FFX' '144A' FRN 15/12/2034	542,262	0.00
USD	1,330,000	Galaxy XV CLO Ltd 'Series 2013-15A AR' '144A' FRN 15/10/2030	1,329,788	0.01
USD	250,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018-29A B' '144A' FRN 15/11/2026	248,441	0.00
USD	850,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018-29A C' '144A' FRN 15/11/2026	847,956	0.01
USD	1,180,000	Galaxy XXIX CLO Ltd 'Series 2018-29A D' '144A' FRN 15/11/2026	1,180,350	0.01
USD	282,000	Gates Global LLC / Gates Global Co '144A' 6% 15/7/2022	285,525	0.00
EUR	360,000	General Electric Co FRN 28/5/2020	419,698	0.00
EUR	360,000	General Motors Financial Co Inc FRN 10/5/2021	421,264	0.00
USD	4,130,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 30/6/2022	4,029,209	0.03
USD	1,277,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	1,262,095	0.01
USD	1,277,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 5/1/2023	1,238,788	0.01
USD	1,973,000	General Motors Financial Co Inc 3.55% 9/4/2021	1,973,774	0.02
USD	591,000	General Motors Financial Co Inc 3.85% 5/1/2028	550,931	0.00
USD	2,559,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 1/3/2021	2,596,802	0.02
USD	15,000	General Motors Financial Co Inc 4.35% 17/1/2027	14,656	0.00
USD	4,230,000	George Washington University/The 4.126% 15/9/2048	4,279,038	0.04
USD	407,153	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 A2C' FRN 25/12/2035	406,275	0.00
USD	4,150,409	GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-2 'Series 2005-2 M1' FRN 25/12/2035	2,486,050	0.02
USD	302,702	GE-WMC Mortgage Securities Trust 2006-1 'Series 2006-1 A2A' FRN 25/8/2036	191,493	0.00
USD	11,112,482	GE-WMC Mortgage Securities Trust 2006-1 'Series 2006-1 A2B' FRN 25/8/2036	7,210,310	0.06
USD	1,174,038	GE-WMC Mortgage Securities Trust 2006-1 'Series 2006-1 A2C' FRN 25/8/2036	777,367	0.01
USD	1,500,000	Gilbert Park CLO Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/10/2030	1,537,495	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 482,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.375% 15/4/2021	492,242	0.00
USD 6,969,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.875% 1/11/2020	7,173,714	0.06
USD 3,739,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.25% 1/6/2025	3,912,863	0.03
USD 6,530,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 1/11/2023	6,905,475	0.06
USD 91,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15/4/2026	95,095	0.00
USD 280,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.75% 1/6/2028	298,900	0.00
USD 703,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd 'Series 2014-9A D ' '144A' FRN 29/10/2026	704,988	0.01
USD 859,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd 'Series 2015-11A AR2' '144A' FRN 18/1/2031	858,308	0.01
USD 47,000,000	Goldman Sachs Group Inc/The 12/10/2018 (Zero Coupon)	47,000,000	0.40
EUR 360,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 31/12/2018	419,396	0.00
USD 17,350,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	17,230,172	0.15
EUR 4,914,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.5% 18/10/2021	6,121,320	0.05
USD 5,180,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2.75% 15/9/2020	5,134,794	0.04
USD 7,660,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 16/11/2026	7,320,103	0.06
USD 10,125,000	Goldman Sachs Group Inc/The 4.25% 21/10/2025	10,077,357	0.09
USD 2,570,000	Goldman Sachs Group Inc/The 5.25% 27/7/2021	2,700,160	0.02
USD 8,135,000	Goldman Sachs Group Inc/The 7.5% 15/2/2019	8,311,135	0.07
USD 64,000,000	Goldman Sachs Secured Notes 13/11/2018 (Zero Coupon)	64,000,000	0.54
USD 148,000,000	Goldman Sachs Secured Notes 8/2/2019 (Zero Coupon)	148,000,000	1.25
USD 2,594,992	Government National Mortgage Association 'Series 2013- 145 SI' FRN 16/4/2040	171,983	0.00
USD 5,210,398	Government National Mortgage Association 'Series 2015- 48 IO' FRN 16/2/2050	236,595	0.00
USD 19,778,005	Government National Mortgage Association 'Series 2013- 63 IO' FRN 16/9/2051	1,028,650	0.01
USD 2,835,592	Government National Mortgage Association 'Series 2012- 23 IO' FRN 16/6/2053	70,563	0.00
USD 12,084,729	Government National Mortgage Association 'Series 2013- 30 IO' FRN 16/9/2053	513,349	0.00
USD 2,337,959	Government National Mortgage Association 'Series 2013- 191 IO' FRN 16/11/2053	83,675	0.00
USD 14,977,888	Government National Mortgage Association 'Series 2013- 78 IO' FRN 16/10/2054	714,826	0.01
USD 17,644,663	Government National Mortgage Association 'Series 2015- 22 IO' FRN 16/3/2055	939,126	0.01
USD 6,092,649	Government National Mortgage Association 'Series 2015- 173 IO' FRN 16/9/2055	403,798	0.00
USD 10,429,803	Government National Mortgage Association 'Series 2015- 171 IO' FRN 16/11/2055	650,477	0.01
USD 9,427,068	Government National Mortgage Association 'Series 2016- 97 IO' FRN 16/7/2056	784,131	0.01
USD 12,770,052	Government National Mortgage Association 'Series 2016- 128 IO' FRN 16/9/2056	1,016,344	0.01
USD 2,584,229	Government National Mortgage Association 'Series 2015- 37 IO' FRN 16/10/2056	160,764	0.00
USD 10,879,978	Government National Mortgage Association 'Series 2016- 67 IO' FRN 16/7/2057	891,684	0.01
USD 10,721,142	Government National Mortgage Association 'Series 2016- 36 IO' FRN 16/8/2057	794,087	0.01
USD 29,565,627	Government National Mortgage Association 'Series 2017- 151 IO' FRN 16/9/2057	1,931,079	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,552,495	Government National Mortgage Association 'Series 2016-125 IO' FRN 16/12/2057	596,607	0.01
USD 6,503,053	Government National Mortgage Association 'Series 2016-165 IO' FRN 16/12/2057	525,141	0.00
USD 16,124,053	Government National Mortgage Association 'Series 2016-96 IO' FRN 16/12/2057	1,199,279	0.01
USD 8,887,609	Government National Mortgage Association 'Series 2016-34 IO' FRN 16/1/2058	697,381	0.01
USD 8,263,779	Government National Mortgage Association 'Series 2016-113 IO' FRN 16/2/2058	754,239	0.01
USD 16,372,012	Government National Mortgage Association 'Series 2016-26 IO' FRN 16/2/2058	1,161,273	0.01
USD 32,435,431	Government National Mortgage Association 'Series 2016-119 IO' FRN 16/4/2058	2,674,245	0.02
USD 5,185,277	Government National Mortgage Association 'Series 2016-110 IO' FRN 16/5/2058	413,123	0.00
USD 5,563,264	Government National Mortgage Association 'Series 2016-158 IO' FRN 16/6/2058	415,932	0.00
USD 13,986,995	Government National Mortgage Association 'Series 2016-152 IO' FRN 15/8/2058	1,066,389	0.01
USD 17,400,549	Government National Mortgage Association 'Series 2016-87 IO' FRN 16/8/2058	1,342,532	0.01
USD 24,523,719	Government National Mortgage Association 'Series 2016-162 IO' FRN 16/9/2058	1,993,490	0.02
USD 8,182,903	Government National Mortgage Association 'Series 2017-100 IO' FRN 16/5/2059	518,100	0.00
USD 4,822,074	Government National Mortgage Association 'Series 2017-86 IO' FRN 16/5/2059	311,771	0.00
USD 635,596	Government National Mortgage Association 'Series 2016-158 VA' 2% 16/3/2035	560,399	0.00
USD 9,893,248	Government National Mortgage Association 'Series 2018-106 IO' FRN 16/4/2060	545,674	0.00
USD 10,986,217	Government National Mortgage Association 'Series 2018-85 IO' FRN 16/6/2060	680,540	0.01
USD 4,249,000	GPMT 2018-FL1 Ltd 'Series 2018-FL1 A' '144A' FRN 21/11/2035	4,245,634	0.04
USD 9,330,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE E' '144A' FRN 10/6/2028	9,253,587	0.08
USD 15,210,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE F' '144A' FRN 10/6/2028	14,984,503	0.13
USD 4,640,000	Grand Parkway Transportation Corp 5% 1/10/2043	5,303,450	0.05
USD 730,000	Grant County Public Utility District No 2 4.584% 1/1/2040	764,357	0.01
USD 95,000	Graphic Packaging International LLC 4.75% 15/4/2021	96,483	0.00
USD 1,879,000	Great Lakes Dredge & Dock Corp 8% 15/5/2022	1,935,370	0.02
USD 500,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	581,330	0.01
USD 1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing 'Series 1999-5 M1B' FRN 15/12/2029	1,097,350	0.01
USD 1,207,038	Greenpoint Manufactured Housing 'Series 1999-5 M2' FRN 15/12/2029	999,637	0.01
USD 1,791,026	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 'Series 2006-AR2 4A1' FRN 25/3/2036	1,692,010	0.01
USD 820,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	817,985	0.01
USD 630,000	Greywolf CLO IV Ltd 'Series 2014-2A BR' '144A' FRN 17/1/2027	629,930	0.01
USD 5,000,000	GS Mortgage Securities Corp II 'Series 2013-KING E' '144A' FRN 10/12/2027	4,921,771	0.04
USD 2,570,000	GS Mortgage Securities Corp II 'Series 2005-ROCK A' '144A' 5.366% 3/5/2032	2,842,915	0.02
USD 1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT 'Series 2016-RENT C' '144A' FRN 10/2/2029	1,060,027	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K D ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,453,037	0.01
USD	2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K E ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	2,004,911	0.02
USD	1,119,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K F ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,122,143	0.01
USD	1,595,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ' Series 2017-500K G ' ' 144A ' FRN 15/7/2032	1,601,003	0.01
USD	2,170,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-GPTX ' Series 2017-GPTX A ' ' 144A ' 2.856% 10/5/2034	2,129,616	0.02
USD	680,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-CHILL ' Series 2018-CHILL E ' ' 144A ' FRN 15/2/2037	686,307	0.01
USD	1,100,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-HULA ' Series 2018-HULA D ' ' 144A ' FRN 15/7/2025	1,102,062	0.01
USD	110,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014-GC20 B ' FRN 10/4/2047	109,555	0.00
USD	1,238,695	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ' Series 2014-GC20 XA ' FRN 10/4/2047	51,509	0.00
USD	930,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC22 ' Series 2014-GC22 D ' ' 144A ' FRN 10/6/2047	823,808	0.01
USD	210,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32 ' Series 2015-GC32 D ' 3.345% 10/7/2048	181,591	0.00
USD	1,129,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 D ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	936,835	0.01
USD	780,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ' Series 2017-GS7 E ' ' 144A ' 3% 10/8/2050	622,241	0.01
USD	497,183	GSAA Home Equity Trust 2007-2 ' Series 2007-2 AF3 ' FRN 25/3/2037	197,155	0.00
USD	1,289,836	GSAMP Trust 2007-H1 ' Series 2007-H1 A1B ' FRN 25/1/2047	862,537	0.01
USD	2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 ' Series 2007-HS1 M6 ' FRN 25/2/2047	2,060,982	0.02
USD	1,395,500	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 ' Series 2005-RP1 1AF ' ' 144A ' FRN 25/1/2035	1,315,381	0.01
USD	1,689,642	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 ' Series 2005-RP2 1AF ' ' 144A ' FRN 25/3/2035	1,592,660	0.01
USD	1,281,264	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1 ' Series 2006-RP1 1AF1 ' ' 144A ' FRN 25/1/2036	1,150,477	0.01
USD	637,553	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-3 ' Series 2007-3 2A1B ' FRN 19/5/2047	516,662	0.00
USD	859,274	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 ' Series 2007-4 2A2 ' FRN 19/7/2047	749,789	0.01
USD	685,000	HCA Healthcare Inc 6.25% 15/2/2021	718,394	0.01
USD	143,000	HCA Inc 3.75% 15/3/2019	143,715	0.00
USD	280,000	HCA Inc 4.25% 15/10/2019	283,500	0.00
USD	3,960,000	HCA Inc 4.75% 1/5/2023	4,034,250	0.03
USD	5,111,000	HCA Inc 5% 15/3/2024	5,224,873	0.04
USD	170,000	HCA Inc 5.25% 15/4/2025	175,525	0.00
USD	2,799,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	2,878,995	0.02
USD	1,980,000	HCA Inc 5.875% 15/3/2022	2,105,374	0.02
USD	12,097,000	HCA Inc 6.5% 15/2/2020	12,596,001	0.11
USD	3,760,000	HD Supply Inc (Step-up coupon) ' 144A ' 5.75% 15/4/2024	3,962,100	0.03
USD	4,295,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.086% 15/9/2051	3,643,212	0.03
USD	1,065,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.651% 15/1/2046	1,025,696	0.01
USD	3,885,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 3.652% 15/8/2057	3,664,643	0.03
USD	785,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 5% 15/11/2029	895,638	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	3,624,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.5% 1/6/2022	3,850,500	0.03
USD	4,099,000	Herc Rentals Inc '144A' 7.75% 1/6/2024	4,437,167	0.04
USD	327,000	Hertz Corp/The 5.875% 15/10/2020	327,000	0.00
USD	1,035,000	Hertz Corp/The 7.375% 15/1/2021	1,035,000	0.01
USD	320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 A1B' '144A' FRN 18/7/2031	320,212	0.00
USD	650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd 'Series 12A-18 D' '144A' FRN 18/7/2031	609,016	0.01
USD	250,000	Highbridge Loan Management 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A DR' '144A' FRN 20/10/2029	254,276	0.00
USD	750,000	Highbridge Loan Management 4-2014 Ltd 'Series 4A-2014 BR' '144A' FRN 28/1/2030	742,474	0.01
USD	920,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5A-2015 C1R' '144A' FRN 29/1/2026	921,348	0.01
USD	250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5A-2015 C2R' '144A' FRN 29/1/2026	250,610	0.00
USD	1,030,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5A-2015 D1R' '144A' FRN 29/1/2026	1,032,180	0.01
USD	250,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5A-2015 D2R' '144A' FRN 29/1/2026	250,529	0.00
USD	1,750,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5A-2015 E' '144A' FRN 29/1/2026	1,755,299	0.02
USD	670,000	Highbridge Loan Management 5-2015 Ltd 'Series 5X-2015 E' FRN 29/1/2026	672,029	0.01
USD	360,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd '144A' FRN 5/2/2031	358,553	0.00
USD	2,470,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd 'Series 6A-2015 A1R' '144A' FRN 5/2/2031	2,460,075	0.02
USD	380,000	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd 'Series 6A-2015 DR' '144A' FRN 5/2/2031	355,512	0.00
USD	330,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 CR' '144A' FRN 15/3/2027	327,821	0.00
USD	340,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 DR' '144A' FRN 15/3/2027	340,216	0.00
USD	760,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd 'Series 7A-2015 ER' '144A' FRN 15/3/2027	755,827	0.01
USD	250,000	Highbridge Loan Management 8-2016 Ltd 'Series 8A-2016 ER' '144A' FRN 20/7/2030	246,532	0.00
USD	2,350,000	Hilton Orlando Trust 2018-ORL 'Series 2018-ORL E' '144A' FRN 15/12/2034	2,363,266	0.02
USD	1,980,000	Home Equity Asset Trust 2007-1 'Series 2007-1 2A3' FRN 25/5/2037	1,644,161	0.01
USD	10,074,926	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 'Series 2006-E 2A3' FRN 25/4/2037	7,846,168	0.07
USD	2,056,921	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 'Series 2007-A 2A2' FRN 25/4/2037	1,549,611	0.01
USD	4,053,204	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-B 'Series 2007-B 2A3' FRN 25/7/2037	2,687,953	0.02
USD	607,587	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 'Series 2004-A M2' FRN 25/7/2034	610,731	0.01
USD	3,273,489	Home Equity Mortgage Trust 2006-2 (Step-up coupon) 'Series 2006-2 1A1' 5.867% 25/7/2036	1,190,614	0.01
USD	1,369,837	Home Loan Mortgage Loan Trust 2005-1 'Series 2005-1 A3' FRN 15/4/2036	1,273,120	0.01
USD	4,944,000	Howard Hughes Medical Institute 3.5% 1/9/2023	5,029,806	0.04
USD	1,338,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd 'Series 10A-16 C' '144A' FRN 20/1/2028	1,346,264	0.01
USD	1,000,000	HPS Loan Management 10-2016 Ltd 'Series 10A-16 D' '144A' FRN 20/1/2028	1,010,135	0.01
USD	250,000	HPS Loan Management 11-2017 Ltd 'Series 11A-17 E' '144A' FRN 6/5/2030	251,552	0.00
USD	765,000	Humana Inc 2.5% 15/12/2020	751,415	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,555,000	Humana Inc 3.15% 1/12/2022	2,514,603	0.02
USD 3,000,000	Huntington National Bank/The 2.4% 1/4/2020	2,963,535	0.03
USD 1,595,000	Huntsman International LLC 5.125% 15/11/2022	1,648,831	0.01
USD 4,780,373	Impac CMB Trust Series 2005-7 'Series 2005-7 A1' FRN 25/11/2035	3,999,916	0.03
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS 'Series 2017-APTS AFX' '144A' FRN 15/6/2034	1,204,597	0.01
USD 2,798,000	IMT Trust 2017-APTS 'Series 2017-APTS BFX' '144A' FRN 15/6/2034	2,766,984	0.02
USD 5,890,000	IMT Trust 2017-APTS 'Series 2017-APTS DFX' '144A' FRN 15/6/2034	5,692,008	0.05
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS 'Series 2017-APTS EFX' '144A' FRN 15/6/2034	1,869,468	0.02
USD 820,000	Indiana Housing & Community Development Authority 3.8% 1/7/2038	830,914	0.01
USD 2,075,676	IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust 2007-A2 'Series 2007-A2 3A1' 7% 25/10/2037	1,392,351	0.01
USD 6,022,153	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 'Series 2007-HOA1 AXPP' FRN 25/7/2047	234,510	0.00
USD 8,416,185	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 'Series 2007-AR19 3A1' FRN 25/9/2037	6,012,252	0.05
USD 1,138,806	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 'Series 2007-FLX5 2A2' FRN 25/8/2037	1,002,595	0.01
USD 1,515,000	Intercontinental Exchange Inc 3.75% 21/9/2028	1,521,574	0.01
USD 2,050,000	Intercontinental Exchange Inc 4.25% 21/9/2048	2,062,666	0.02
USD 2,580,000	International Business Machines Corp 2.25% 19/2/2021	2,531,797	0.02
USD 1,165,000	International Business Machines Corp 2.9% 1/11/2021	1,158,174	0.01
USD 560,000	InTown Hotel Portfolio Trust 2018-STAY 'Series 2018-STAY A' '144A' FRN 15/1/2033	560,208	0.00
USD 8,000,000	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 E' '144A' FRN 17/3/2037	8,045,226	0.07
USD 3,200,000	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 F' '144A' FRN 17/3/2037	3,226,412	0.03
USD 3,628,464	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust 'Series 2018-SFR3 A' '144A' FRN 17/7/2037	3,653,676	0.03
USD 2,660,000	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust 'Series 2018-SFR3 E' '144A' FRN 17/7/2037	2,670,034	0.02
EUR 1,500,000	IQVIA Inc 3.25% 15/3/2025	1,766,955	0.02
EUR 410,000	Iron Mountain Inc 3% 15/1/2025	473,948	0.00
USD 277,000	Iron Mountain Inc '144A' 4.375% 1/6/2021	279,077	0.00
USD 638,000	Iron Mountain Inc 6% 15/8/2023	657,140	0.01
USD 1,135,000	Iron Mountain US Holdings Inc '144A' 5.375% 1/6/2026	1,081,087	0.01
USD 1,597,099	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 (Step-up coupon) 'Series 2006-3 2A3' '144A' 6.53% 25/9/2037	1,560,506	0.01
USD 450,641	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 'Series 2006-P1 1A' '144A' FRN 25/12/2036	433,246	0.00
USD 11,655,004	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	4,281,495	0.04
USD 3,710,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE 'Series 2016-NINE A' '144A' FRN 6/10/2038	3,498,243	0.03
USD 1,770,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI 'Series 2017-MAUI D' '144A' FRN 15/7/2034	1,775,260	0.02
USD 10,000,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI 'Series 2017-MAUI E' '144A' FRN 15/7/2034	10,032,191	0.09

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,900,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-MAUI 'Series 2017-MAUI F' '144A' FRN 15/7/2034	2,909,302	0.02
USD 1,440,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-ASH8 'Series 2018-ASH8 E' '144A' FRN 15/2/2035	1,449,022	0.01
USD 2,260,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT 'Series 2018-WPT FFX' '144A' 5.542% 5/7/2033	2,223,381	0.02
USD 2,553,000	Jagged Peak Energy LLC '144A' 5.875% 1/5/2026	2,517,922	0.02
USD 770,000	Jay Park CLO Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 20/10/2027	779,752	0.01
USD 2,605,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,654,495	0.02
USD 458,453	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 'Series 2007-A2 2A1' FRN 25/5/2037	414,977	0.00
USD 673,214	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2003-PM1 'Series 2003-PM1A G' '144A' FRN 12/8/2040	685,881	0.01
USD 400,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-CIBX 'Series 2012-CBX A4FL' '144A' FRN 15/6/2045	410,451	0.00
USD 1,910,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C20 'Series 2014-C20 A5' 3.805% 15/7/2047	1,949,523	0.02
USD 919,714	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-FL4 'Series 2014-FL4 C' '144A' FRN 15/12/2030	920,651	0.01
USD 2,230,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 'Series 2015-JP1 D' FRN 15/1/2049	2,123,968	0.02
USD 3,100,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES 'Series 2015-UES D' '144A' FRN 5/9/2032	3,090,481	0.03
USD 4,957,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES 'Series 2015-UES E' '144A' FRN 5/9/2032	4,896,071	0.04
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP3 'Series 2016-JP3 XC' '144A' FRN 15/8/2049	520,858	0.00
USD 2,961,912	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP4 'Series 2016-JP4 XA' FRN 15/12/2049	123,082	0.00
USD 1,036,573	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014-1 'Series 2014-CH1 M2' '144A' FRN 25/11/2024	1,128,103	0.01
USD 960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 'Series 2006-CW1 M1' FRN 25/5/2036	919,409	0.01
USD 6,584,524	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 'Series 2017-2 A6' '144A' FRN 25/5/2047	6,495,000	0.06
USD 17,745,832	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 'Series 2017-3 1A6' '144A' FRN 25/8/2047	17,246,933	0.15
USD 2,612,367	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 'Series 2014-C22 XA' FRN 15/9/2047	106,473	0.00
USD 450,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 'Series 2014-C22 A4' 3.801% 15/9/2047	458,362	0.00
USD 1,439,344	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 'Series 2014-C23 XA' FRN 15/9/2047	36,902	0.00
USD 2,228,606	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 'Series 2014-C26 XA' FRN 15/1/2048	93,442	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 XD' '144A' FRN 15/2/2048	188,356	0.00
USD 2,435,099	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C29 'Series 2015-C29 XA' FRN 15/5/2048	75,599	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 'Series 2015-C33 D1' '144A' FRN 15/12/2048	1,387,182	0.01
USD 1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 'Series 2017-JP5 D' '144A' FRN 15/3/2050	1,283,043	0.01
USD 2,410,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP7 'Series 2017-JP7 B' 4.05% 15/9/2050	2,415,483	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 XC' '144A' FRN 15/12/2049	211,214	0.00
USD 6,755,000	JPMorgan Chase & Co FRN 18/6/2022	6,767,504	0.06
USD 12,225,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	12,176,687	0.10
USD 13,760,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2029	13,664,464	0.12
USD 15,036,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2029	15,144,507	0.13
USD 5,095,000	JPMorgan Chase & Co 1.85% 22/3/2019	5,077,226	0.04
USD 2,555,000	JPMorgan Chase & Co 2.4% 7/6/2021	2,503,057	0.02
EUR 3,622,000	JPMorgan Chase & Co 2.625% 23/4/2021	4,503,219	0.04
USD 5,885,000	JPMorgan Chase & Co 4.125% 15/12/2026	5,886,874	0.05
USD 6,008,000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10% 15/7/2022	6,038,040	0.05
USD 3,502,000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 10.5% 15/7/2024	3,484,490	0.03
USD 4,884,000	Kaiser Aluminum Corp 5.875% 15/5/2024	5,042,779	0.04
USD 3,976,000	Kaiser Foundation Hospitals 3.5% 1/4/2022	4,003,375	0.03
USD 1,541,000	Kaiser Foundation Hospitals 4.15% 1/5/2047	1,588,401	0.01
USD 660,000	KB Home 4.75% 15/5/2019	665,775	0.01
USD 150,000	KB Home 8% 15/3/2020	159,000	0.00
USD 690,000	Kentucky Economic Development Finance Authority 5.25% 1/6/2050	735,447	0.01
USD 2,730,000	Keurig Dr Pepper Inc '144A' 4.057% 25/5/2023	2,747,218	0.02
USD 4,406,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A' 5% 1/6/2024	4,406,000	0.04
USD 2,300,000	KKR CLO 12 Ltd '144A' FRN 15/7/2027	2,300,241	0.02
USD 520,000	KKR CLO 12 Ltd '144A' FRN 15/7/2027	520,042	0.00
USD 634,000	KKR CLO Ltd 22 '144A' FRN 20/7/2031	631,683	0.01
USD 2,555,000	Kraft Heinz Foods Co 3.5% 6/6/2022	2,547,274	0.02
EUR 232,000	Kronos International Inc 3.75% 15/9/2025	265,879	0.00
USD 280,000	Lamar Media Corp 5.375% 15/1/2024	287,000	0.00
USD 950,000	Las Vegas Valley Water District 5% 1/6/2046	1,068,474	0.01
USD 325,629	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2006-C4 'Series 2006-C4 F' FRN 15/6/2038	334,350	0.00
USD 71,279	LB-UBS Commercial Mortgage Trust 2007-C6 'Series 2007-C6 AMFL' '144A' 6.114% 15/7/2040	71,265	0.00
USD 4,030,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust 'Series 2014-909 E' '144A' FRN 15/5/2031	3,867,490	0.03
USD 4,770,000	LCM 26 Ltd '144A' FRN 20/1/2031	4,774,695	0.04
USD 660,000	LCM XIV LP '144A' FRN 20/7/2031	659,161	0.01
USD 670,000	LCM XVI LP '144A' FRN 15/7/2026	670,019	0.01
USD 440,000	LCM XVII LP '144A' FRN 15/10/2026	440,030	0.00
USD 500,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2031	506,815	0.00
USD 730,000	LCM XVIII LP '144A' FRN 20/4/2031	468,753	0.00
USD 1,330,000	LCM XXI LP '144A' FRN 20/4/2028	1,330,125	0.01
USD 530,000	LCM XXI LP '144A' FRN 20/4/2028	529,971	0.00
USD 400,000	LCM Xxiv Ltd '144A' FRN 20/3/2030	401,350	0.00
USD 17,500,000	Legacy Mortgage Asset Trust 2018-SL1 'Series 2018-SL1 A' '144A' FRN 25/2/2058	17,412,158	0.15
USD 5,630,000	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2001-B 'Series 2001-B M1' FRN 15/4/2040	5,984,170	0.05
USD 408,943	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 'Series 2002-A C' 15/6/2033 (Zero Coupon)	329,338	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 440,649	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 'Series 2007-1 2A1' '144A' FRN 25/6/2037	311,210	0.00
USD 530,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 'Series 2006-2A M2' '144A' FRN 25/9/2036	509,500	0.00
USD 1,294,360	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 'Series 2007-1A 1A' '144A' FRN 25/3/2037	1,208,809	0.01
USD 14	Lehman XS Trust Series 2006-12N FRN 25/8/2046	14	0.00
USD 1	Lehman XS Trust Series 2006-12N 'Series 2006-12N A2A2' FRN 25/8/2046	1	0.00
USD 1,198,746	Lehman XS Trust Series 2007-20N 'Series 2007-20N A1' FRN 25/12/2037	1,196,800	0.01
USD 14,918,000	Lendmark Funding Trust 2017-1 'Series 2017-1A A' '144A' 2.83% 22/12/2025	14,862,677	0.13
USD 2,200,000	Lendmark Funding Trust 2017-1 'Series 2017-1A B' '144A' 3.77% 22/12/2025	2,197,731	0.02
USD 17,890,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A A' '144A' 2.8% 20/5/2026	17,655,448	0.15
USD 620,000	Lendmark Funding Trust 2017-2 'Series 2017-2A B' '144A' 3.38% 20/5/2026	611,924	0.01
USD 1,267,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	1,272,421	0.01
USD 18,000	Lennar Corp 2.95% 29/11/2020	17,561	0.00
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.125% 1/12/2018	1,403,500	0.01
USD 1,400,000	Lennar Corp 4.5% 15/6/2019	1,408,750	0.01
USD 393,000	Lennar Corp 4.5% 15/11/2019	396,930	0.00
USD 8,953,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	8,997,765	0.08
USD 1,030,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,035,150	0.01
USD 60,000	Lennar Corp 5.25% 1/6/2026	59,799	0.00
USD 3,962,000	Lennar Corp 5.875% 15/11/2024	4,130,781	0.04
USD 162,000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 7.375% 15/7/2039	189,540	0.00
USD 840,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	908,132	0.01
USD 4,698,316	LFRF '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	4,676,704	0.04
USD 2,165,000	Limerock CLO III LLC 'Series 2014-3A C' '144A' FRN 20/10/2026	2,172,232	0.02
USD 7,140,000	LoanCore 2018-CRE1 Issuer Ltd 'Series 2018-CRE1 A' '144A' FRN 15/5/2028	7,161,984	0.06
USD 116,736	Lone Star Portfolio Trust 2015-LSP 'Series 2015-LSP A1A2' '144A' FRN 15/9/2028	116,874	0.00
USD 3,524,746	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-1 'Series 2006-1 1A' FRN 25/2/2036	3,521,637	0.03
USD 375,791	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A2' FRN 25/11/2036	171,279	0.00
USD 3,865,051	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A3' FRN 25/11/2036	1,774,504	0.02
USD 1,374,945	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-10 'Series 2006-10 2A4' FRN 25/11/2036	636,685	0.01
USD 16,632,003	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-2 'Series 2006-2 2A3' FRN 25/3/2046	8,265,012	0.07
USD 7,074,135	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-2 'Series 2006-2 2A4' FRN 25/3/2046	3,549,246	0.03
USD 5,282,950	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 2A3' FRN 25/5/2046	2,292,719	0.02
USD 11,474,014	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-4 'Series 2006-4 2A3' FRN 25/5/2036	5,572,184	0.05
USD 3,696,703	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 'Series 2006-5 2A3' FRN 25/6/2036	2,182,522	0.02
USD 5,910,594	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 'Series 2006-7 2A3' FRN 25/8/2036	3,299,778	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,581,496	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-8 ' Series 2006-8 2A3 ' FRN 25/9/2036	1,092,812	0.01
USD 1,368,947	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A2 ' FRN 25/10/2036	602,064	0.01
USD 5,257,754	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A3 ' FRN 25/10/2036	2,325,746	0.02
USD 1,666,011	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ' Series 2006-9 2A4 ' FRN 25/10/2036	742,681	0.01
USD 2,400,000	Los Angeles Community College District/CA 6.6% 1/8/2042	3,359,220	0.03
USD 2,330,000	Los Angeles County Metropolitan Transportation Authority 5% 1/7/2042	2,694,738	0.02
USD 5,000,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,506,875	0.05
USD 1,240,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.574% 1/7/2045	1,767,577	0.02
USD 1,285,000	Los Angeles Department of Water & Power Power System Revenue 6.603% 1/7/2050	1,858,463	0.02
USD 2,675,235	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 ' Series 2017-5 X ' ' 144A ' FRN 10/3/2050	131,153	0.00
USD 2,525,368	LSTAR Securities Investment Ltd 2017-8 LLC ' Series 2017-8 A ' ' 144A ' FRN 1/11/2022	2,523,528	0.02
USD 9,995,182	LSTAR Securities Investment Ltd 2018-1 ' Series 2018-1 A ' ' 144A ' FRN 1/2/2023	10,041,735	0.09
USD 4,200,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M D ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	4,146,388	0.04
USD 6,600,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M ' Series 2017-330M E ' ' 144A ' FRN 15/8/2034	6,294,057	0.05
USD 1,430,000	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A ' Series 2002-A B2 ' FRN 25/3/2032	1,465,114	0.01
USD 6,600,000	Madison Avenue Trust 2013-650M ' Series 2013-650M D ' ' 144A ' FRN 12/10/2032	6,616,761	0.06
USD 520,000	Madison Park Funding X Ltd ' Series 2012-10A ER ' ' 144A ' FRN 20/1/2029	528,334	0.00
USD 380,000	Madison Park Funding XI Ltd ' Series 2013-11A ER ' ' 144A ' FRN 23/7/2029	382,147	0.00
USD 360,000	Madison Park Funding XII Ltd ' Series 2014-12A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	361,921	0.00
USD 2,430,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A AR2 ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	2,427,161	0.02
USD 1,500,000	Madison Park Funding XIII Ltd ' Series 2014-13A ER ' ' 144A ' FRN 19/4/2030	1,512,481	0.01
USD 4,301,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' Series 2014-14A A2R ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	4,301,747	0.04
USD 854,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' Series 2014-14A DR ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	857,592	0.01
USD 500,000	Madison Park Funding XIV Ltd ' Series 2014-14A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2026	502,340	0.00
USD 340,000	Madison Park Funding XV Ltd ' Series 2014-15A CR ' ' 144A ' FRN 27/1/2026	340,984	0.00
USD 300,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A C ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	301,748	0.00
USD 1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd ' Series 2015-16A D ' ' 144A ' FRN 20/4/2026	1,225,039	0.01
USD 7,820,000	Madison Park Funding XVIII Ltd ' Series 2015-18A A1R ' ' 144A ' FRN 21/10/2030	7,830,584	0.07
USD 510,000	Madison Park Funding XX Ltd ' Series 2016-20A ER ' ' 144A ' FRN 27/7/2030	504,292	0.00
USD 2,350,000	Madison Park Funding XXVI Ltd ' Series 2017-26A AR ' ' 144A ' FRN 29/7/2030	2,352,957	0.02
USD 700,000	Madison Park Funding XXX Ltd ' Series 2018-30A E ' ' 144A ' FRN 15/4/2029	688,272	0.01
USD 1,620,000	Marathon CRE 2018 FL1 Ltd FRN 15/6/2028	1,623,794	0.01
USD 4,500,000	Marble Point CLO XI Ltd ' Series 2017-2A A ' ' 144A ' FRN 18/12/2030	4,503,614	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,780,000	Marriott International Inc/MD 2.3% 15/1/2022	1,717,282	0.01
USD 835,000	Maryland Health & Higher Educational Facilities Authority 5.25% 1/7/2027	934,215	0.01
USD 1,500,000	Maryland Stadium Authority 5% 1/5/2041	1,683,127	0.01
USD 790,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2039	904,424	0.01
USD 835,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2040	955,248	0.01
USD 880,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2041	1,006,003	0.01
USD 920,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2042	1,050,967	0.01
USD 740,000	Massachusetts Bay Transportation Authority 5% 1/7/2043	844,729	0.01
USD 810,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2043	890,433	0.01
USD 930,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/9/2045	1,045,980	0.01
USD 1,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,152,684	0.01
USD 4,040,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	4,409,963	0.04
USD 2,280,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2053	2,479,067	0.02
USD 500,000	Massachusetts Educational Financing Authority 5% 1/1/2022	542,460	0.00
USD 875,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	905,923	0.01
USD 1,080,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	1,118,561	0.01
USD 920,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	953,304	0.01
USD 211,000	Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 4.9% 1/4/2077	214,354	0.00
USD 1,500,000	Massachusetts Port Authority 5% 1/7/2043	1,665,788	0.01
USD 2,510,000	Massachusetts School Building Authority 5.25% 15/2/2048	2,926,622	0.02
USD 870,000	Massachusetts Water Resources Authority 5% 1/8/2040	988,394	0.01
USD 5,005,651	Mastr Asset Backed Securities Trust 2006-HE2 'Series 2006-HE2 A3' FRN 25/6/2036	3,000,744	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE1 'Series 2007-HE1 A4' FRN 25/5/2037	1,268,764	0.01
USD 717,501	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 'Series 2008-3 A1' '144A' FRN 25/8/2037	546,958	0.00
USD 616,449	Mastr Specialized Loan Trust 'Series 2006-3 A' '144A' FRN 25/6/2046	584,049	0.01
USD 878,000	Matador Resources Co 6.875% 15/4/2023	922,174	0.01
EUR 400,000	McDonald's Corp 0.5% 15/1/2021	470,138	0.00
USD 16,100,000	MCM_18-NPL1 4% 1/6/2057	16,151,749	0.14
USD 1,270,000	Medtronic Inc 2.5% 15/3/2020	1,263,242	0.01
USD 3,074,000	Meritor Inc 6.25% 15/2/2024	3,131,637	0.03
USD 2,202,998	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 'Series 2007-OAR2 A2' FRN 25/4/2037	1,858,111	0.02
USD 6,465,270	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 'Series 2007-2 A2C' FRN 25/5/2037	4,533,789	0.04
USD 932,927	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 'Series 2006-RM3 A2B' FRN 25/6/2037	304,953	0.00
USD 952,570	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005-CIP1 'Series 2005-CIP1 D' FRN 12/7/2038	969,512	0.01
USD 1,070,000	Merrill Lynch Mortgage Trust 2005-MKB2 'Series 2005-MKB2 F' '144A' FRN 12/9/2042	1,104,087	0.01
USD 1,400,000	Mesquite Independent School District 5% 15/8/2042	1,583,967	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,650,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2041	1,848,990	0.02
USD 1,650,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2042	1,847,909	0.02
USD 1,290,000	Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 5% 1/7/2045	1,460,054	0.01
USD 1,400,000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 5% 1/7/2046	1,536,563	0.01
USD 400,000	Metropolitan Life Global Funding I '144A' 1.95% 15/9/2021	383,382	0.00
USD 2,100,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2042	2,416,355	0.02
USD 2,100,000	Metropolitan St Louis Sewer District 5% 1/5/2047	2,404,300	0.02
USD 1,400,000	Metropolitan Transportation Authority 5% 15/11/2042	1,593,354	0.01
USD 1,720,000	Metropolitan Transportation Authority 5.25% 15/11/2057	1,948,063	0.02
USD 1,360,000	Metropolitan Transportation Authority 6.687% 15/11/2040	1,816,409	0.02
USD 2,350,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2032	2,666,757	0.02
USD 2,530,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2043	2,868,198	0.02
USD 2,950,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2048	3,330,919	0.03
USD 1,000,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 5% 1/10/2053	1,056,860	0.01
USD 1,280,000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 7.462% 1/10/2046	1,879,283	0.02
USD 3,071,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	3,170,808	0.03
USD 143,000	MGM Resorts International 5.25% 31/3/2020	146,217	0.00
USD 1,640,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5% 1/4/2048	1,831,568	0.02
USD 3,450,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5% 1/4/2053	3,826,378	0.03
USD 1,680,000	Miami-Dade County Educational Facilities Authority 5.073% 1/4/2050	1,884,910	0.02
USD 880,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	964,374	0.01
USD 700,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	772,131	0.01
USD 1,370,000	MidOcean Credit CLO III 'Series 2014-3A A3A2' '144A' ' FRN 21/4/2031	1,358,261	0.01
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd 'Series 2016-1A C' '144A' FRN 20/4/2028	499,934	0.00
USD 500,000	Mill Creek II CLO Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/4/2028	502,278	0.00
USD 1,330,000	Mississippi Hospital Equipment & Facilities Authority 5% 1/9/2046	1,419,270	0.01
EUR 360,000	Molson Coors Brewing Co FRN 15/3/2019	419,103	0.00
USD 2,035,000	Molson Coors Brewing Co 2.1% 15/7/2021	1,962,418	0.02
EUR 200,000	Mondelez International Inc 2.375% 26/1/2021	245,581	0.00
USD 3,440,000	Montefiore Obligated Group 5.246% 1/11/2048	3,499,464	0.03
USD 8,355,000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	8,345,442	0.07
USD 21,270,000	Morgan Stanley FRN 24/1/2029*	20,538,408	0.17
EUR 1,715,000	Morgan Stanley 2.375% 31/3/2021	2,112,802	0.02
USD 2,560,000	Morgan Stanley 2.8% 16/6/2020	2,545,108	0.02
USD 7,260,000	Morgan Stanley 3.95% 23/4/2027	7,008,917	0.06
USD 12,090,000	Morgan Stanley 4.35% 8/9/2026	12,055,840	0.10
EUR 2,400,000	Morgan Stanley 5.375% 10/8/2020	3,082,964	0.03

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	3,445,508	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE5 'Series 2005-HE5 M4' FRN 25/9/2035	1,568,384	0.01
USD	11,382,674	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-NC1 'Series 2007-NC1 A1' FRN 25/11/2036	7,160,539	0.06
USD	11,026,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XD' '144A' FRN 15/12/2047	705,865	0.01
USD	3,830,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 'Series 2014-C19 XF' '144A' FRN 15/12/2047	214,078	0.00
USD	1,300,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C16 'Series 2014-C16 A5' 3.892% 15/6/2047	1,330,335	0.01
USD	3,263,109	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 'Series 2015-C20 XA' FRN 15/2/2048	197,149	0.00
USD	3,510,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 'Series 2015-C21 XB' '144A' FRN 15/3/2048	67,994	0.00
USD	25,392,972	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C22 'Series 2015-C22 XA' FRN 15/4/2048	1,316,480	0.01
USD	480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 'Series 2015-C23 D' '144A' FRN 15/7/2050	429,665	0.00
USD	973,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 'Series 2015-C23 A4' 3.719% 15/7/2050	983,062	0.01
USD	220,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 C' FRN 15/10/2048	221,440	0.00
USD	106,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 'Series 2015-C25 D' 3.068% 15/10/2048	91,696	0.00
USD	5,350,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 XD' '144A' FRN 15/10/2048	438,085	0.00
USD	2,330,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 'Series 2015-C26 D' '144A' 3.06% 15/10/2048	2,008,991	0.02
USD	8,700,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C29 'Series 2016-C29 XB' FRN 15/5/2049	560,823	0.00
USD	2,197,732	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 'Series 2016-C31 XA' FRN 15/11/2049	183,851	0.00
USD	660,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 'Series 2017-C33 C' FRN 15/5/2050	661,248	0.01
USD	780,000	Morgan Stanley Capital Barclays Bank Trust 2016-MART 'Series 2016-MART A' '144A' 2.2% 13/9/2031	756,464	0.01
USD	13,880,763	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 'Series 2017-HR2 XA' FRN 15/12/2050	820,561	0.01
USD	380,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 'Series 2017-HR2 D' 2.73% 15/12/2050	299,951	0.00
USD	3,410	Morgan Stanley Capital I Trust 2005-IQ9 'Series 2005-IQ9 AJ' 4.77% 15/7/2056	3,402	0.00
USD	1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ11 'Series 2006-IQ11 C' FRN 15/10/2042	1,508,386	0.01
USD	479,013	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 'Series 2007-T27 AJ' FRN 11/6/2042	506,542	0.00
USD	1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 'Series 2014-150E F' '144A' FRN 9/9/2032	1,346,416	0.01
USD	200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT E' '144A' FRN 13/7/2029	196,285	0.00
USD	4,363,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT F' '144A' FRN 13/7/2029	4,263,727	0.04
USD	1,750,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT 'Series 2014-CPT G' '144A' FRN 13/7/2029	1,691,172	0.01
USD	360,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 'Series 2015-MS1 C' FRN 15/5/2048	347,273	0.00
USD	250,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 'Series 2015-MS1 D' '144A' FRN 15/5/2048	224,076	0.00
USD	5,480,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 'Series 2017-CLS F' '144A' FRN 15/11/2034	5,505,126	0.05
USD	510,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 C' FRN 15/6/2050	501,223	0.00
USD	2,640,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 XD' '144A' FRN 15/6/2050	414,995	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,180,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 'Series 2017-H1 D' '144A' 2.546% 15/6/2050	1,708,063	0.01
USD 920,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR 'Series 2017-JWDR D' '144A' FRN 15/11/2034	924,764	0.01
USD 1,710,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-JWDR 'Series 2017-JWDR E' '144A' FRN 15/11/2034	1,721,656	0.01
USD 1,280,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 C' FRN 15/7/2051	1,300,365	0.01
USD 880,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 D' '144A' 3% 15/7/2051	718,841	0.01
USD 1,510,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 'Series 2018-H3 A5' 4.177% 15/7/2051	1,568,703	0.01
USD 1,470,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 'Series 2018-MP E' '144A' FRN 11/7/2040	1,353,411	0.01
USD 2,010,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 'Series 2018-SUN F' '144A' FRN 15/7/2035	2,013,769	0.02
USD 1,057,838	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust 2006-2 'Series 2006-2 A2' FRN 25/11/2036	535,460	0.00
USD 2,099,489	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-15XS (Step-up coupon) 'Series 2006-15XS A2B' 5.507% 25/11/2036	1,136,765	0.01
USD 1,208,023	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-9SL 'Series 2007-9SL A' FRN 25/7/2037	1,150,700	0.01
USD 8,398,549	Mortgage Loan Resecuritization Trust 'Series 2009-RS1 A85' '144A' FRN 16/4/2036	7,231,401	0.06
USD 3,920,000	Mountain Hawk II CLO Ltd 'Series 2013-2A BR' '144A' FRN 20/7/2024	3,921,880	0.03
USD 2,470,000	MP CLO III Ltd 'Series 2013-1A AR' '144A' FRN 20/10/2030	2,474,750	0.02
USD 400,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 18/4/2027	400,328	0.00
USD 1,000,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' FRN 18/4/2027	1,002,818	0.01
USD 5,490,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A ARR' '144A' FRN 18/10/2028	5,490,000	0.05
USD 3,550,000	MP CLO VIII Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 28/10/2027	3,543,945	0.03
USD 260,000	MP CLO VIII Ltd 'Series 2015-2A ER' '144A' FRN 28/10/2027	260,641	0.00
USD 267,064	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-C 'Series 2007-C 2AV3' FRN 25/6/2037	266,109	0.00
USD 740,000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 'Series 2018-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2035	740,551	0.01
USD 3,020,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA B' '144A' 3.5% 15/8/2044	2,935,116	0.03
USD 4,895,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA B' '144A' FRN 17/10/2044	4,968,663	0.04
USD 2,278,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 'Series 2015-AA B' '144A' 3.5% 15/12/2044	2,160,669	0.02
USD 1,760,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-CA B' '144A' 3.25% 15/5/2040	1,760,970	0.02
USD 2,150,000	Navient Private Education Loan Trust 2016-A 'Series 2016-AA B' '144A' FRN 16/12/2058	2,098,448	0.02
USD 1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc '144A' 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,446,375	0.01
USD 2,555,000	NBCUniversal Media LLC 5.15% 30/4/2020	2,643,070	0.02
USD 1,119,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,096,620	0.01
USD 1,375,000	Neuberger Berman CLO XIV Ltd 'Series 2013-14A ER' '144A' FRN 28/1/2030	1,399,257	0.01
USD 400,000	Neuberger Berman CLO XV 'Series 2013-15A DR' '144A' FRN 15/10/2029	401,526	0.00
USD 599,000	Neuberger Berman CLO XVII Ltd 'Series 2014-17A DR' '144A' FRN 22/4/2029	603,756	0.01
USD 640,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd 'Series 2014-18A CR' '144A' FRN 14/11/2027	645,113	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 250,000	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd 'Series 2014-18A DR' '144A' FRN 14/11/2027	254,386	0.00
USD 780,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA A' '144A' FRN 15/1/2028	777,733	0.01
USD 350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd 'Series 2017-16SA D' '144A' FRN 15/1/2028	349,284	0.00
USD 439,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A AR' '144A' FRN 15/1/2028	436,474	0.00
USD 260,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd 'Series 2015-20A ER' '144A' FRN 15/1/2028	260,674	0.00
USD 390,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd 'Series 2016-23A E' '144A' FRN 17/10/2027	393,744	0.00
USD 7,100,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	7,112,421	0.06
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 Ltd 'Series 2018-28A E' '144A' FRN 20/4/2030	295,013	0.00
USD 7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 'Series 2005-B M1' FRN 25/10/2035	7,055,096	0.06
USD 780,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5% 15/6/2029	870,866	0.01
USD 3,615,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6.104% 15/12/2028	3,787,309	0.03
USD 1,360,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,475,586	0.01
USD 770,000	New York City Transitional Finance Authority Building Aid Revenue 5% 15/7/2040	861,823	0.01
USD 3,695,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	3,578,903	0.03
USD 4,740,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.55% 1/5/2025	4,788,893	0.04
USD 400,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/8/2031	462,030	0.00
USD 860,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/2/2035	973,477	0.01
USD 820,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5% 1/5/2036	929,044	0.01
USD 3,410,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2039	3,943,546	0.03
USD 2,440,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2040	2,819,542	0.02
USD 4,245,000	New York City Water & Sewer System 5% 15/6/2047	4,809,988	0.04
USD 1,590,000	New York City Water & Sewer System 5.44% 15/6/2043	1,955,962	0.02
USD 1,570,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	2,001,067	0.02
USD 780,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2040	879,200	0.01
USD 1,950,000	New York Convention Center Development Corp 5% 15/11/2046	2,193,750	0.02
USD 2,000,000	New York Liberty Development Corp '144A' 5% 15/11/2044	2,105,340	0.02
USD 650,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2031	751,748	0.01
USD 1,225,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2032	1,411,084	0.01
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2036	1,834,576	0.02
USD 760,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2037	870,147	0.01
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2038	846,627	0.01
USD 3,320,000	New York State Dormitory Authority 5% 1/10/2038	3,908,304	0.03
USD 740,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2039	846,009	0.01
USD 2,590,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2039	2,986,425	0.03
USD 700,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2040	798,518	0.01
USD 1,600,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2041	1,821,176	0.02
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2041	1,886,648	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,160,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2042	2,456,795	0.02
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2042	1,885,188	0.02
USD 2,980,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/2/2043	3,386,979	0.03
USD 1,660,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2043	1,885,494	0.02
USD 1,640,000	New York State Dormitory Authority 5% 15/3/2043	1,883,737	0.02
USD 4,505,000	New York State Urban Development Corp 2.86% 15/3/2024	4,425,847	0.04
USD 2,400,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	2,362,116	0.02
USD 3,655,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	3,532,356	0.03
USD 1,800,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/8/2020	1,886,058	0.02
USD 620,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	661,521	0.01
USD 4,940,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	5,329,618	0.05
USD 364,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	383,110	0.00
USD 2,805,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.342% 1/9/2020	2,817,425	0.02
USD 1,181,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 4.375% 15/8/2022	1,189,857	0.01
USD 6,570,000	NGPL PipeCo LLC '144A' 7.768% 15/12/2037	8,130,375	0.07
USD 6,245,000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5% 15/4/2022	6,065,519	0.05
USD 1,270,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' FRN 8/3/2019	1,275,763	0.01
USD 1,135,000	Nissan Motor Acceptance Corp '144A' 2.35% 4/3/2019	1,132,980	0.01
USD 390,001	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 'Series 2001-R1A A' '144A' FRN 19/2/2030	392,901	0.00
USD 546,793	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 (Step-up coupon) 'Series 2006-AF1 1A4' 6.634% 25/5/2036	216,935	0.00
USD 380,520	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-S5 'Series 2006-S5 A1' '144A' FRN 25/10/2036	342,077	0.00
USD 2,633,292	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2007-2 'Series 2007-2 A4' FRN 25/4/2047	2,273,147	0.02
USD 1,090,000	North Texas Tollway Authority 5% 1/1/2043	1,234,845	0.01
USD 70,768	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	73,090	0.00
USD 2,238,000	Northwestern University 3.662% 1/12/2057	2,157,861	0.02
USD 5,370,000	Northwoods Capital XVII Ltd FRN 22/4/2031	5,338,777	0.05
USD 2,734,000	NRG Energy Inc '144A' 2.75% 1/6/2048	2,791,644	0.02
USD 133,000	NRG Energy Inc 6.25% 15/7/2022	137,655	0.00
USD 142,000	NRG Energy Inc 6.25% 1/5/2024	147,680	0.00
USD 350,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd 'Series 2014-10A CR' '144A' FRN 20/7/2026	350,209	0.00
USD 250,000	Oak Hill Credit Partners X Ltd 'Series 2014-10A DR' '144A' FRN 20/7/2026	250,475	0.00
USD 1,870,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 20/10/2027	1,870,683	0.02
USD 2,000,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' FRN 20/10/2027	1,999,412	0.02
USD 766,868	Oakwood Mortgage Investors Inc 'Series 2001-D A2' FRN 15/1/2019	593,539	0.01
USD 637,711	Oakwood Mortgage Investors Inc 'Series 2001-D A4' FRN 15/9/2031	558,917	0.00
USD 7,841,000	Oasis Petroleum Inc 6.875% 15/3/2022	7,988,019	0.07

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

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)				
USD	6,180,000	OBX 2018-EXP1 Trust 'Series 2018-EXP1 1A3' '144A' FRN 25/4/2048	6,180,542	0.05
USD	1,580,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,938,398	0.02
USD	440,000	OCP CLO 2012-2 Ltd 'Series 2012-2A DR' '144A' FRN 22/11/2025	442,796	0.00
USD	460,000	OCP CLO 2014-5 Ltd 'Series 2014-5A A1R' '144A' FRN 26/4/2031	457,827	0.00
USD	1,540,000	OCP CLO 2014-7 Ltd 'Series 2014-7A A1AR' '144A' FRN 20/10/2026	1,539,825	0.01
USD	2,100,000	OCP CLO 2015-10 Ltd 'Series 2015-10A A1R' '144A' FRN 26/10/2027	2,101,234	0.02
USD	1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd 'Series 2015-10A BR' '144A' FRN 26/10/2027	1,751,811	0.02
USD	2,184,000	OCP CLO 2015-8 Ltd 'Series 2015-8A A1R' '144A' FRN 17/4/2027	2,176,681	0.02
USD	440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd 'Series 2016-12A C' '144A' FRN 18/10/2028	443,447	0.00
USD	330,000	OCP CLO 2016-12 Ltd 'Series 2016-12A D' '144A' FRN 18/10/2028	332,395	0.00
USD	5,210,000	OCP CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A A1A' '144A' FRN 15/7/2030	5,220,044	0.04
USD	920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd 'Series 2017-13A D' '144A' FRN 15/7/2030	937,973	0.01
USD	750,000	OCP CLO 2017-14 Ltd 'Series 2017-14A B' '144A' FRN 20/11/2030	747,656	0.01
USD	5,200,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd 'Series 2018-18A A1A' '144A' FRN 16/4/2031	5,171,938	0.04
USD	7,960,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 21/5/2027	7,962,514	0.07
USD	2,220,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A A2AR' '144A' FRN 21/5/2027	2,208,790	0.02
USD	940,000	Octagon Investment Partners 24 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 21/5/2027	945,026	0.01
USD	2,250,000	Octagon Investment Partners 27 Ltd 'Series 2016-1A ER' '144A' FRN 15/7/2030	2,279,469	0.02
USD	250,000	Octagon Investment Partners 30 Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 17/3/2030	252,903	0.00
USD	1,000,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/7/2030	1,015,764	0.01
USD	448,000	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 31 LLC 'Series 2017-1A F' '144A' FRN 20/7/2030	456,782	0.00
USD	1,625,000	Octagon Investment Partners 33 Ltd 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 20/1/2031	1,625,858	0.01
USD	4,335,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd 'Series 2013-1A A1R2' '144A' FRN 25/1/2031	4,332,299	0.04
USD	1,775,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd 'Series 2014-1A C' '144A' FRN 14/11/2026	1,781,742	0.02
USD	3,100,000	Octagon Investment Partners XXI Ltd 'Series 2014-1A D' '144A' FRN 14/11/2026	3,115,002	0.03
USD	460,000	Octagon Investment Partners XXII Ltd 'Series 2014-1A DRR' '144A' FRN 22/1/2030	455,966	0.00
USD	530,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd FRN 15/7/2027	530,444	0.00
USD	1,120,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd FRN 15/7/2027	1,125,852	0.01
USD	7,105,000	OFSI Fund VI Ltd '144A' FRN 20/3/2025	7,089,842	0.06
USD	367,096	OHA Credit Partners IX Ltd 'Series 2013-9A A1R' '144A' FRN 20/10/2025	367,076	0.00
USD	280,000	OHA Credit Partners XI Ltd 'Series 2015-11A E' '144A' FRN 20/10/2028	282,843	0.00
USD	260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd 'Series 2016-13A E' '144A' FRN 21/1/2030	263,476	0.00
USD	1,360,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A AR' '144A' FRN 23/5/2031	1,357,054	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 7,920,000	OHA Loan Funding 2016-1 Ltd 'Series 2016-1A D' '144A' FRN 20/1/2028	7,975,081	0.07
USD 1,780,000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission 5% 15/2/2048	1,937,984	0.02
USD 1,000,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2043	1,123,570	0.01
USD 500,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.25% 15/8/2048	559,580	0.00
USD 4,480,000	Oklahoma Development Finance Authority 5.5% 15/8/2057	5,093,939	0.04
USD 3,000,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT E' '144A' FRN 10/5/2039	2,791,959	0.02
USD 29,500,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 'Series 2017-OT XA' '144A' FRN 10/5/2039	919,662	0.01
USD 1,900,000	Omaha Public Power District 5% 1/2/2042	2,191,384	0.02
USD 43,880,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 'Series 2017-1MKT XCP' '144A' FRN 10/2/2032	205,797	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 'Series 2017-1MKT XNCP' '144A' FRN 10/2/2032	7,021	0.00
USD 137,489	OneMain Financial Issuance Trust 2014-2 'Series 2014-2A C' '144A' 4.33% 18/9/2024	137,626	0.00
USD 11,050,000	OneMain Financial Issuance Trust 2014-2 'Series 2014-2A D' '144A' 5.31% 18/9/2024	11,122,218	0.09
USD 2,298,878	OneMain Financial Issuance Trust 2015-1 'Series 2015-1A A' '144A' 3.19% 18/3/2026	2,306,131	0.02
USD 2,733,000	OneMain Financial Issuance Trust 2015-1 'Series 2015-1A C' '144A' 5.12% 18/3/2026	2,774,875	0.02
USD 414,317	OneMain Financial Issuance Trust 2015-2 'Series 2015-2A A' '144A' 2.57% 18/7/2025	414,796	0.00
USD 16,601,000	OneMain Financial Issuance Trust 2015-2 'Series 2015-2A B' '144A' 3.1% 18/7/2025	16,626,488	0.14
USD 8,170,000	OneMain Financial Issuance Trust 2015-2 'Series 2015-2A C' '144A' 4.32% 18/7/2025	8,213,117	0.07
USD 1,985,000	OneMain Financial Issuance Trust 2016-1 'Series 2016-1A A' '144A' 3.66% 20/2/2029	1,993,796	0.02
USD 810,000	OneMain Financial Issuance Trust 2016-1 'Series 2016-1A B' '144A' 4.57% 20/2/2029	820,089	0.01
USD 831,735	OneMain Financial Issuance Trust 2016-2 'Series 2016-2A A' '144A' 4.1% 20/3/2028	837,843	0.01
USD 1,422,702	Option One Mortgage Loan Trust 2006-3 'Series 2006-3 1A1' FRN 25/2/2037	1,046,261	0.01
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 'Series 2007-CP1 2A3' FRN 25/3/2037	1,346,234	0.01
USD 8,137,079	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD1 2A1' 5.866% 25/1/2037	7,715,198	0.07
USD 11,039,648	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 (Step-up coupon) 'Series 2007-FXD2 1A1' 5.82% 25/3/2037	10,887,145	0.09
EUR 300,000	Oracle Corp 2.25% 10/1/2021	368,354	0.00
USD 3,255,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,399,051	0.04
USD 3,695,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	3,950,029	0.03
USD 4,255,000	Oregon School Boards Association 5.48% 30/6/2022	4,601,527	0.04
USD 5,965,000	Oregon School Boards Association 5.49% 30/6/2023	6,559,770	0.06
USD 689,941	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 'Series 2001-A M1' FRN 15/3/2032	681,793	0.01
USD 2,220,700	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 'Series 2007-B A1' '144A' FRN 15/10/2037	2,219,977	0.02
USD 277,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp 5.25% 15/2/2022	279,421	0.00
USD 1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 (Step-up coupon) 'Series 2006-2 A2C' 6% 25/1/2037	1,477,990	0.01
USD 600,000	OZLM Funding II Ltd FRN 15/7/2031	588,000	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,060,000	OZLM Funding III Ltd 'Series 2013-3A BR' '144A' FRN 22/1/2029	2,074,023	0.02
USD 2,850,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013-4A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,855,508	0.02
USD 290,000	OZLM Funding IV Ltd 'Series 2013-4A A2R' '144A' FRN 22/10/2030	289,998	0.00
USD 3,610,000	OZLM Funding Ltd 'Series 2012-1X SUB' FRN 22/7/2029	1,586,978	0.01
USD 720,000	OZLM IX Ltd 'Series 2014-9A BR' '144A' FRN 20/1/2027	721,474	0.01
USD 2,380,000	OZLM IX Ltd 'Series 2014-9A CR' '144A' FRN 20/1/2027	2,385,733	0.02
USD 3,200,000	OZLM VI Ltd 'Series 2014-6A SUB' '144A' FRN 17/4/2031	1,645,811	0.01
USD 5,345,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A A1AR' '144A' FRN 17/10/2026	5,345,839	0.05
USD 1,250,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A BR' '144A' FRN 17/10/2026	1,252,150	0.01
USD 1,315,000	OZLM VIII Ltd 'Series 2014-8A CR' '144A' FRN 17/10/2026	1,318,030	0.01
USD 531,000	OZLM XI Ltd 'Series 2015-11A BR' '144A' FRN 30/10/2030	532,929	0.00
USD 874,000	OZLM XI Ltd 'Series 2015-11A CR' '144A' FRN 30/10/2030	882,430	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd 'Series 2015-12A A1' '144A' FRN 30/4/2027	620,480	0.01
USD 620,000	OZLM XII Ltd 'Series 2015-12A A2' '144A' FRN 30/4/2027	620,444	0.01
USD 290,000	OZLM XII Ltd 'Series 2015-12A B' '144A' FRN 30/4/2027	290,465	0.00
USD 875,000	OZLM XII Ltd 'Series 2015-12A C' '144A' FRN 30/4/2027	876,663	0.01
USD 335,000	OZLM XIII Ltd 'Series 2015-13A C' '144A' FRN 30/7/2027	335,681	0.00
USD 3,310,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A A2AR' '144A' FRN 15/1/2029	3,314,011	0.03
USD 1,630,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A B1R' '144A' FRN 15/1/2029	1,632,297	0.01
USD 2,190,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A CR' '144A' FRN 15/1/2029	2,192,095	0.02
USD 660,000	OZLM XIV Ltd 'Series 2015-14A DR' '144A' FRN 15/1/2029	660,813	0.01
USD 2,250,000	OZLM XIX Ltd 'Series 2017-19A A1' '144A' FRN 22/11/2030	2,254,271	0.02
USD 2,000,000	OZLM XIX Ltd 'Series 2017-19A D' '144A' FRN 22/11/2030	2,051,269	0.02
USD 2,120,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A1' '144A' FRN 20/1/2029	2,124,318	0.02
USD 830,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A A2A' '144A' FRN 20/1/2029	833,767	0.01
USD 440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A C' '144A' FRN 20/1/2029	444,820	0.00
USD 440,000	OZLM XV Ltd 'Series 2016-15A D' '144A' FRN 20/1/2029	445,849	0.00
USD 250,000	OZLM XVIII Ltd 'Series 2018-18A SUB' '144A' FRN 15/4/2031	233,943	0.00
USD 260,000	OZLM XX Ltd 'Series 2018-20A D' '144A' FRN 20/4/2031	260,797	0.00
USD 570,000	OZLM XXI 'Series 2017-21A B' '144A' FRN 20/1/2031	569,997	0.01
USD 6,750,000	OZLM XXI 'Series 2017-21A C' '144A' FRN 20/1/2031	6,638,847	0.06
USD 1,170,000	OZLM XXI 'Series 2017-21A D' '144A' FRN 20/1/2031	1,164,629	0.01
USD 3,720,000	Pacific Gas & Electric Co '144A' 4.25% 1/8/2023	3,746,819	0.03
USD 2,085,000	Pacific Gas & Electric Co 4.25% 15/3/2046	1,929,711	0.02
USD 3,085,000	Pacific Gas & Electric Co '144A' 4.65% 1/8/2028	3,127,292	0.03
USD 4,010,000	Pacific Gas & Electric Co 6.05% 1/3/2034	4,514,945	0.04
USD 250,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1AR' '144A' FRN 17/10/2027	250,081	0.00
USD 640,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A CR' '144A' FRN 17/10/2027	642,232	0.01
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R2' '144A' FRN 17/1/2031	580,305	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 530,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A CR2' '144A' FRN 17/1/2031	516,847	0.00
USD 690,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A DR2' '144A' FRN 17/1/2031	691,728	0.01
USD 250,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A CR' '144A' FRN 20/7/2030	252,663	0.00
USD 630,000	Palmer Square CLO 2015-2 Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2030	645,159	0.01
USD 2,090,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 18/4/2031	2,078,976	0.02
USD 640,000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A D' '144A' FRN 16/7/2031	633,581	0.01
USD 3,502,000	Palmer Square CLO 2018-3 Ltd 'Series 2018-3A A2' '144A' FRN 15/8/2026	3,502,173	0.03
USD 1,280,000	Palmer Square Loan Funding 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 15/10/2025	1,281,188	0.01
USD 103,580	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	98,986	0.00
USD 1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 23/8/2031	1,336,635	0.01
USD 7,125,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A1' '144A' FRN 14/11/2029	7,136,998	0.06
USD 1,500,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A A2' '144A' FRN 14/11/2029	1,503,932	0.01
USD 2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 14/11/2029	2,862,889	0.02
USD 5,597,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5.375% 15/1/2025	5,666,403	0.05
USD 2,150,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 6.25% 1/6/2024	2,246,750	0.02
USD 1,000,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2022	1,099,690	0.01
USD 400,000	Pennsylvania Economic Development Financing Authority 5% 31/12/2038	432,480	0.00
USD 1,130,000	Pennsylvania State University 5% 1/9/2043	1,308,009	0.01
USD 1,320,000	Pennsylvania State University 5% 1/9/2048	1,520,600	0.01
USD 2,470,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2048	2,750,444	0.02
USD 3,750,000	Pepperdine University 3.948% 1/12/2057	3,704,252	0.03
USD 1,270,000	PepsiCo Inc 3% 25/8/2021	1,271,685	0.01
USD 3,450,000	Permanent University Fund - University of Texas System 3.376% 1/7/2047	3,213,640	0.03
USD 2,555,000	Philip Morris International Inc 1.875% 1/11/2019	2,524,064	0.02
USD 1,955,000	Pinnacle Entertainment Inc 5.625% 1/5/2024	2,062,525	0.02
USD 1,514,000	Pioneer Energy Services Corp 6.125% 15/3/2022	1,332,320	0.01
USD 2,875,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	3,076,811	0.03
USD 1,425,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.81% 15/10/2065	1,618,080	0.01
USD 260,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	300,158	0.00
USD 710,000	Port Authority of New York & New Jersey 5% 15/11/2047	793,691	0.01
USD 830,000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	923,578	0.01
USD 5,548,000	Post Holdings Inc '144A' 5.5% 1/3/2025	5,561,870	0.05
USD 6,424,353	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL2 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-NPL2 A1' '144A' 3.25% 28/3/2057	6,412,860	0.05
USD 6,566,721	Pretium Mortgage Credit Partners I 2017-NPL3 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-NPL3 A1' '144A' 3.25% 29/6/2032	6,539,665	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 850,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV Ltd 'Series 2015-4A C' '144A' 4% 24/8/2049	836,995	0.01
USD 340,118	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 'Series 2006-DR1 2A1' '144A' 5.5% 25/5/2035	255,863	0.00
USD 2,486,859	Progress Residential 2015-SFR2 Trust 'Series 2015-SFR2 A' '144A' 2.74% 12/6/2032	2,456,245	0.02
USD 590,000	Progress Residential 2015-SFR3 Trust 'Series 2015-SFR3 F' '144A' 6.643% 12/11/2032	612,814	0.01
USD 1,284,643	Progress Residential 2016-SFR1 Trust 'Series 2016-SFR1 A' '144A' FRN 17/9/2033	1,286,759	0.01
USD 2,450,000	Progress Residential 2016-SFR1 Trust 'Series 2016-SFR1 E' '144A' FRN 17/9/2033	2,469,285	0.02
USD 1,350,000	Progress Residential 2016-SFR2 Trust 'Series 2016-SFR2 E' '144A' FRN 17/1/2034	1,365,392	0.01
USD 2,083,307	Progress Residential 2017-SFR1 Trust 'Series 2017-SFR1 A' '144A' 2.768% 17/8/2034	2,019,673	0.02
USD 250,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust 'Series 2017-SFR1 D' '144A' 3.565% 17/8/2034	244,244	0.00
USD 380,000	Progress Residential 2017-SFR1 Trust 'Series 2017-SFR1 E' '144A' 4.261% 17/8/2034	377,638	0.00
USD 750,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 E' '144A' 4.38% 17/3/2035	744,679	0.01
USD 1,480,000	Progress Residential 2018-SFR1 Trust 'Series 2018-SFR1 F' '144A' 4.778% 17/3/2035	1,469,677	0.01
USD 780,000	Progress Residential 2018-SFR2 Trust 'Series 2018-SFR2 E' '144A' 4.656% 17/8/2035	785,125	0.01
USD 920,000	Progress Residential 2018-SFR2 Trust 'Series 2018-SFR2 F' '144A' 4.953% 17/8/2035	923,642	0.01
USD 2,653,000	Providence St Joseph Health Obligated Group 3.93% 1/10/2048	2,560,601	0.02
USD 257,107	PRPM 2017-1 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-1A A1' '144A' 4.25% 25/1/2022	257,399	0.00
EUR 838,000	PSPC Escrow Corp 6% 1/2/2023	1,027,634	0.01
USD 880,000	Public Power Generation Agency 5% 1/1/2035	985,613	0.01
USD 192,000	PulteGroup Inc 5% 15/1/2027	183,600	0.00
USD 2,765,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	2,754,631	0.02
USD 3,255,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	3,653,737	0.03
EUR 868,000	PVH Corp 3.125% 15/12/2027	1,009,018	0.01
USD 2,235,000	QUALCOMM Inc 4.3% 20/5/2047*	2,108,096	0.02
USD 11,390,000	Quicken Loans Inc '144A' 5.75% 1/5/2025	11,361,525	0.10
USD 630,000	Race Point IX CLO Ltd 'Series 2015-9A A1AR' '144A' FRN 15/10/2030	630,912	0.01
USD 2,957,740	RAIT 2017-FL7 Trust 'Series 2017-FL7 A' '144A' FRN 15/6/2037	2,960,047	0.03
USD 430,000	RAIT 2017-FL7 Trust 'Series 2017-FL7 C' '144A' FRN 15/6/2037	430,309	0.00
USD 1,278,340	RALI Series 2007-QH9 Trust 'Series 2007-QH9 A1' FRN 25/11/2037	1,118,860	0.01
USD 5,571,150	RAMP Series 2006-RS6 Trust 'Series 2006-RS6 A4' FRN 25/11/2036	4,721,701	0.04
USD 1,917,681	RAMP Series 2007-RS1 Trust 'Series 2007-RS1 A3' FRN 25/2/2037	1,055,445	0.01
USD 895,875	RBSSP Resecuritization Trust 2013-2 'Series 2013-2 1A2' '144A' FRN 26/12/2036	869,462	0.01
USD 310,000	Regatta IV Funding Ltd 'Series 2014-1A DR' '144A' FRN 25/7/2026	310,901	0.00
USD 585,000	Regatta V Funding Ltd 'Series 2014-1A BR' '144A' FRN 25/10/2026	586,440	0.01
USD 1,025,000	Regatta V Funding Ltd 'Series 2014-1A C' '144A' FRN 25/10/2026	1,027,677	0.01
USD 640,000	Regatta XI Funding Ltd 'Series 2018-1A SUB' '144A' FRN 17/7/2031	550,271	0.00

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国（続き）		
USD	1,530,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 5% 15/5/2047	1,716,507	0.01
USD	3,420,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,585,468	0.04
USD	176,856	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 'Series 2005-R3 AF' '144A' FRN 25/9/2035	165,028	0.00
USD	1,658,197	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 'Series 2005-A5 A5' FRN 25/5/2035	1,413,333	0.01
USD	11,654,000	Resolute Energy Corp 8.5% 1/5/2020	11,661,284	0.10
USD	2,976,645	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd 'Series 2017-CRE5 A' '144A' FRN 15/7/2034	2,979,704	0.03
USD	1,109,532	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd 'Series 2017-CRE5 B' '144A' FRN 15/7/2034	1,108,087	0.01
USD	10,980,000	Reynolds American Inc 4.45% 12/6/2025	11,161,565	0.09
USD	7,094,838	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 5.75% 15/10/2020	7,121,443	0.06
USD	145,199	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu 6.875% 15/2/2021	147,196	0.00
USD	141,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 7% 15/7/2024	144,084	0.00
USD	1,881,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	1,885,783	0.02
USD	1,250,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A C' '144A' FRN 15/10/2029	1,262,162	0.01
USD	4,390,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	4,420,652	0.04
USD	2,860,000	Rockford Tower CLO 2017-2 Ltd 'Series 2017-2A E' '144A' FRN 15/10/2029	2,901,027	0.02
USD	9,005,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A A' '144A' FRN 20/10/2030	9,002,983	0.08
USD	3,015,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A E' '144A' FRN 20/10/2030	3,046,750	0.03
USD	260,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A E' '144A' FRN 20/5/2031	256,402	0.00
USD	560,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A E' '144A' FRN 20/10/2031	560,000	0.00
USD	1,320,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A B' '144A' FRN 15/4/2029	1,323,459	0.01
USD	2,140,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 15/4/2029	2,146,474	0.02
USD	2,450,000	Rockford Tower CLO Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 15/4/2029	2,462,030	0.02
USD	2,384,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 5.625% 15/4/2020	2,458,500	0.02
USD	3,295,000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6% 15/1/2019	3,332,892	0.03
USD	5,440,000	Romark WM-R Ltd 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 20/4/2031	5,425,566	0.05
USD	2,201,000	Rosslyn Portfolio Trust 2017-ROSS 'Series 2017-ROSS E' '144A' FRN 15/6/2033	2,242,231	0.02
USD	960,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,048,411	0.01
USD	250,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 15/10/2029	250,074	0.00
USD	410,000	RR 2 Ltd 'Series 2017-2A D' '144A' FRN 15/10/2029	414,384	0.00
USD	6,645,000	RR 3 Ltd 'Series 2018-3A A1R2' '144A' FRN 15/1/2030	6,639,152	0.06
USD	2,225,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	2,394,373	0.02
USD	7,115,000	Sable Permian Resources Land LLC / AEPB Finance Corp '144A' 13% 30/11/2020	7,897,650	0.07
USD	1,975,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.25% 15/11/2023	1,989,082	0.02
USD	2,500,000	Sabre GBLB Inc '144A' 5.375% 15/4/2023	2,528,125	0.02
USD	548,052	SACO I Trust 2006-9 'Series 2006-9 A1' FRN 25/8/2036	535,961	0.00
USD	1,760,000	Sacramento County Sanitation Districts Financing Authority FRN 1/12/2035	1,719,045	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 900,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	1,021,437	0.01
USD 2,405,000	Salt Lake City Corp Airport Revenue 5% 1/7/2047	2,680,613	0.02
USD 1,620,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/1/2036	1,896,161	0.02
USD 6,010,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/12/2045	6,797,190	0.06
USD 4,210,000	San Antonio Water System 5% 15/5/2039	4,714,547	0.04
USD 1,500,000	San Diego County Regional Airport Authority 5% 1/7/2047	1,704,863	0.01
USD 1,000,000	San Diego Public Facilities Financing Authority Sewer Revenue 5% 15/5/2039	1,155,840	0.01
USD 3,150,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2046	3,487,176	0.03
USD 1,660,000	San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5% 1/5/2047	1,852,419	0.02
USD 3,425,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 2.958% 1/8/2024	3,376,742	0.03
USD 1,506,535	Saxon Asset Securities Trust 2007-1 'Series 2007-1 M1' FRN 25/1/2047	872,841	0.01
USD 6,991,000	Scientific Games International Inc 10% 1/12/2022	7,419,898	0.06
USD 5,248,000	SEACOR Holdings Inc 3.25% 15/5/2030	5,117,383	0.04
EUR 218,000	Sealed Air Corp 4.5% 15/9/2023*	287,754	0.00
USD 3,875,010	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B' '144A' 25/7/2056 (Zero Coupon)	337,852	0.00
USD 5,248,077	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 B10' '144A' FRN 25/7/2056	617,898	0.01
USD 2,550,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 'Series 2017-3 M2' '144A' FRN 25/7/2056	2,498,350	0.02
USD 520,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 BX' FRN 25/5/2057	277,966	0.00
USD 470,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 'Series 2018-1 M' FRN 25/5/2057	466,209	0.00
USD 2,390,000	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 'Series 2018-3 M' '144A' FRN 25/8/2057	2,320,857	0.02
USD 5,552,319	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A1' '144A' FRN 25/11/2036	3,458,324	0.03
USD 1,356,131	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2A' FRN 25/11/2036	568,656	0.01
USD 4,061,190	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2006-WM4 'Series 2006-WM4 A2C' FRN 25/11/2036	1,719,255	0.01
USD 801,325	Security National Mortgage Loan Trust 2007-1 'Series 2007-1A 2A' '144A' FRN 25/4/2037	795,626	0.01
USD 1,750,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A CR' '144A' FRN 17/7/2026	1,750,936	0.01
USD 1,590,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A D' '144A' FRN 17/7/2026	1,592,893	0.01
USD 250,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 'Series 2014-1A SUB' '144A' FRN 17/7/2026	84,662	0.00
USD 1,428,549	SG Mortgage Securities Trust 2006-FRE2 'Series 2006-FRE2 A2C' FRN 25/7/2036	498,668	0.00
USD 1,310,000	SG Mortgage Securities Trust 2006-OPT2 'Series 2006-OPT2 A3D' FRN 25/10/2036	1,125,972	0.01
USD 3,120,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd 'Series 2013-3A AR' '144A' FRN 15/7/2030	3,121,208	0.03
USD 1,000,000	Shackleton 2013-III CLO Ltd 'Series 2013-3A DR' '144A' FRN 15/7/2030	1,000,738	0.01
USD 2,550,000	Sherwin-Williams Co/The 2.25% 15/5/2020	2,515,682	0.02
EUR 540,000	Silgan Holdings Inc 3.25% 15/3/2025	647,997	0.01
USD 3,750,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A AR' '144A' FRN 20/7/2030	3,756,019	0.03
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A DR' '144A' FRN 20/7/2030	502,581	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 500,000	Silver Creek CLO Ltd 'Series 2014-1A E1R' '144A' FRN 20/7/2030	496,742	0.00
USD 2,555,000	Simon Property Group LP 2.5% 1/9/2020	2,526,743	0.02
USD 3,820,430	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 'Series 2004-A A3' FRN 15/6/2033	3,784,399	0.03
USD 6,500,967	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B A3' FRN 15/3/2024	6,496,918	0.06
USD 1,254,280	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B 'Series 2004-B B' FRN 15/9/2033	1,246,616	0.01
USD 5,336,216	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 'Series 2005-B B' FRN 15/6/2039	5,269,396	0.04
USD 5,145,596	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 'Series 2006-B A5' FRN 15/12/2039	5,040,617	0.04
USD 1,050,966	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 'Series 2006-BW A5' FRN 15/12/2039	1,030,424	0.01
USD 308,813	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 4.54% 17/10/2044	312,493	0.00
USD 295,667	SLM Private Education Loan Trust 2012-E 'Series 2012-E A2B' '144A' FRN 15/6/2045	295,715	0.00
USD 1,887,230	SLM Private Education Loan Trust 2013-A 'Series 2013-A A2B' '144A' FRN 17/5/2027	1,891,596	0.02
USD 4,235,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-A 'Series 2013-A B' '144A' 2.5% 15/3/2047	4,206,860	0.04
USD 2,690,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-B 'Series 2013-B B' '144A' 3% 16/5/2044	2,678,833	0.02
USD 2,475,000	SLM Private Education Loan Trust 2013-C 'Series 2013-C B' '144A' FRN 15/6/2044	2,471,816	0.02
USD 4,740,000	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A B' '144A' 3.5% 15/11/2044	4,719,078	0.04
USD 1,135,573	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A A2B' '144A' FRN 15/5/2026	1,145,184	0.01
USD 2,960,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 'Series 2015-B B' '144A' 3.5% 17/12/2040	2,931,501	0.02
USD 2,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-C B' '144A' 3.5% 15/9/2043	2,885,324	0.02
USD 6,100,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 'Series 2017-B A2B' '144A' FRN 15/10/2035	6,126,425	0.05
USD 10,170,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 'Series 2017-B A2A' '144A' 2.82% 15/10/2035	9,901,139	0.08
USD 9,000,000	SMB Private Education Loan Trust 2018-A 'Series 2018-A A2B' '144A' FRN 15/2/2036	9,044,619	0.08
USD 500,000	Sound Point CLO II Ltd 'Series 2013-1A A1R' '144A' FRN 26/1/2031	498,557	0.00
USD 250,000	Sound Point CLO II Ltd 'Series 2013-1A A3R' '144A' FRN 26/1/2031	249,158	0.00
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd 'Series 2015-2A DR' '144A' FRN 20/7/2027	699,988	0.01
USD 700,000	Sound Point CLO IX Ltd 'Series 2015-2A E' '144A' FRN 20/7/2027	705,910	0.01
USD 2,025,000	Sound Point CLO VII Ltd 'Series 2014-3A AR' '144A' FRN 23/1/2027	2,025,913	0.02
USD 590,000	Sound Point CLO VII Ltd 'Series 2014-3A D' '144A' FRN 23/1/2027	592,024	0.01
USD 1,380,000	Sound Point CLO X Ltd 'Series 2015-3A ER' '144A' FRN 20/1/2028	1,380,080	0.01
USD 1,000,000	Sound Point CLO XI Ltd 'Series 2016-1A E' '144A' FRN 20/7/2028	1,012,300	0.01
USD 1,300,000	Sound Point Clo XII Ltd 'Series 2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	1,301,425	0.01
USD 650,000	Sound Point Clo XII Ltd 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 20/10/2028	656,565	0.01
USD 440,000	Sound Point Clo XIV Ltd 'Series 2016-3A C' '144A' FRN 23/1/2029	442,889	0.00
USD 1,440,000	Sound Point Clo XIV Ltd 'Series 2016-3A E' '144A' FRN 23/1/2029	1,456,485	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 340,000	Sound Point CLO XVIII Ltd 'Series 2017-4A B' '144A' FRN 21/1/2031	335,239	0.00
USD 49,551	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 'Series 2004-WMC1 M2' FRN 25/1/2035	47,094	0.00
USD 2,225,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,084,959	0.02
USD 2,090,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,091,076	0.02
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2049	1,505,633	0.01
USD 1,430,000	South Carolina Public Service Authority 5% 1/12/2050	1,515,421	0.01
USD 3,567,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	4,751,333	0.04
USD 1,500,000	Southern Baptist Hospital of Florida Inc 4.857% 15/7/2045	1,670,459	0.01
USD 900,000	Southern California Edison Co 4.125% 1/3/2048	881,475	0.01
USD 2,580,000	Southern Power Co '144A' FRN 20/12/2020	2,581,561	0.02
USD 570,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	660,277	0.01
USD 10,082,224	SpringCastle America Funding LLC 'Series 2016-AA A' '144A' 3.05% 25/4/2029	10,052,627	0.09
USD 6,467,799	Springleaf Funding Trust 2015-A 'Series 2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	6,470,984	0.05
USD 11,187,000	Springleaf Funding Trust 2015-A 'Series 2015-AA B' '144A' 3.62% 15/11/2024	11,174,269	0.09
USD 5,363,000	Springleaf Funding Trust 2016-A 'Series 2016-AA A' '144A' 2.9% 15/11/2029	5,364,555	0.05
USD 480,000	Springleaf Funding Trust 2016-A 'Series 2016-AA B' '144A' 3.8% 15/11/2029	479,523	0.00
USD 607,000	Sprint Capital Corp 6.9% 1/5/2019	619,140	0.01
USD 2,410,000	Sprint Communications Inc '144A' 7% 1/3/2020	2,510,136	0.02
USD 1,005,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	1,016,306	0.01
USD 142,000	Sprint Corp 7.125% 15/6/2024	147,857	0.00
USD 3,448,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	3,706,600	0.03
USD 18,416,938	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	18,371,987	0.16
USD 3,460,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20/3/2025	3,468,650	0.03
USD 4,631,000	SSM Health Care Corp 3.688% 1/6/2023	4,655,519	0.04
USD 1,462,000	SSM Health Care Corp 3.823% 1/6/2027	1,465,159	0.01
USD 3,010,000	STACR Trust 2018-DNA2 'Series 2018-DNA2 M2' '144A' FRN 25/12/2030	3,032,075	0.03
USD 4,205,000	STACR Trust 2018-HRP1 'Series 2018-HRP1 M2' '144A' FRN 25/4/2043	4,251,660	0.04
USD 9,838,000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6% 15/10/2025	10,157,735	0.09
USD 1,240,176	Stanwich Mortgage Loan Co 2016-NPL2 LLC (Step-up coupon) 'Series 2016-NPL2 NOTE' '144A' 3.721% 16/8/2046	1,247,343	0.01
USD 9,535,460	Stanwich Mortgage Loan Co 2017-NPL-B-1 LLC (Step-up coupon) 'Series 2017-NPB1 A1' '144A' 3.598% 17/5/2022	9,491,692	0.08
USD 1,815,000	Starbucks Corp 2.2% 22/11/2020	1,781,236	0.02
USD 3,845,000	State Board of Administration Finance Corp 2.638% 1/7/2021	3,800,706	0.03
USD 6,350,000	State of California 2.25% 1/10/2023	6,102,509	0.05
USD 2,395,000	State of California 7.3% 1/10/2039	3,399,738	0.03
USD 1,210,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,721,800	0.01
USD 2,575,000	State of California 7.5% 1/4/2034	3,629,257	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,360,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,022,551	0.02
USD 4,315,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	4,209,110	0.04
USD 1,300,000	State of Illinois 5% 1/5/2020	1,349,198	0.01
USD 1,580,000	State of Illinois 5% 1/11/2022	1,672,154	0.01
USD 4,060,000	State of Illinois 5% 1/11/2024	4,315,902	0.04
USD 820,000	State of Illinois 5% 1/12/2024	871,832	0.01
USD 11,030,000	State of Illinois 5% 1/11/2025	11,759,635	0.10
USD 1,230,000	State of Minnesota 5% 1/8/2030	1,487,568	0.01
USD 1,230,000	State of Minnesota 5% 1/8/2031	1,480,410	0.01
USD 1,520,000	State of Minnesota 5% 1/8/2032	1,823,582	0.02
USD 1,530,000	State of Minnesota 5% 1/8/2034	1,819,453	0.02
USD 1,560,000	State of Minnesota 5% 1/8/2035	1,847,719	0.02
USD 980,000	State of Ohio 5% 1/5/2030	1,129,386	0.01
USD 1,960,000	State of Ohio 5% 15/3/2032	2,213,781	0.02
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2034	1,025,937	0.01
USD 900,000	State of Ohio 5% 1/5/2035	1,023,583	0.01
USD 2,150,000	State of Ohio 5% 1/5/2036	2,439,626	0.02
USD 1,630,000	State of Ohio 5% 1/5/2037	1,846,399	0.02
USD 5,035,000	State of South Carolina 5% 1/10/2022	5,644,210	0.05
USD 1,230,000	State of Texas 5% 1/4/2040	1,391,997	0.01
USD 1,970,000	State of Texas 5% 1/4/2043	2,225,194	0.02
USD 3,950,000	State of Washington 5% 1/7/2030	4,506,891	0.04
USD 930,000	State of Washington 5% 1/8/2040	1,064,269	0.01
USD 2,400,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,694,252	0.02
USD 1,670,000	State of Washington 5% 1/2/2041	1,897,938	0.02
USD 980,000	State of Washington 5% 1/8/2041	1,120,669	0.01
USD 1,030,000	State of Washington 5% 1/8/2042	1,175,266	0.01
USD 2,240,000	State of West Virginia 5% 1/6/2040	2,583,179	0.02
USD 2,320,000	State of West Virginia 5% 1/12/2040	2,675,436	0.02
USD 2,210,000	State of West Virginia 5% 1/12/2041	2,546,583	0.02
USD 2,655,000	State of Wisconsin 3.154% 1/5/2027	2,586,262	0.02
USD 920,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2032	1,054,168	0.01
USD 830,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2033	948,317	0.01
USD 1,210,000	State of Wisconsin 5% 1/11/2033	1,415,404	0.01
USD 1,080,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2034	1,229,710	0.01
USD 1,340,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2036	1,518,769	0.01
USD 1,350,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2038	1,528,349	0.01
USD 1,859,000	Steel Dynamics Inc 5% 15/12/2026	1,854,353	0.02
USD 4,492,000	Steel Dynamics Inc 5.125% 1/10/2021	4,542,535	0.04
USD 283,000	Steel Dynamics Inc 5.25% 15/4/2023	287,599	0.00
USD 4,464,000	Steel Dynamics Inc 5.5% 1/10/2024	4,586,760	0.04
USD 4,730,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' ' FRN 15/1/2030	4,736,326	0.04
USD 1,845,000	Stewart Park CLO Ltd 'Series 2015-1A CR' '144A' FRN 15/1/2030	1,839,790	0.02
USD 1,806,080	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 'Series 2006-3 4A' FRN 25/4/2036	1,610,792	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,137,076	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 'Series 2006-AR2 A1' FRN 25/2/2036	2,043,466	0.02
USD 6,009,540	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR4 'Series 2006-AR4 3A1' FRN 25/6/2036	5,670,202	0.05
USD 575,067	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 'Series 2006-AR5 2A1' FRN 25/5/2046	487,214	0.00
USD 1,235,106	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 'Series 2006-RF4 2A1' '144A' 6% 25/10/2036	1,046,635	0.01
USD 1,359,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6.125% 15/7/2023	1,386,180	0.01
USD 795,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	806,070	0.01
USD 5,429,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.875% 15/1/2023	5,361,138	0.05
USD 2,855,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 5.875% 15/3/2028	2,740,800	0.02
USD 3,225,000	SunTrust Bank/Atlanta GA FRN 2/8/2024	3,224,034	0.03
USD 8,746,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	8,709,866	0.07
USD 250,000	Symphony CLO VIII LP 'Series 2012-8A CR' '144A' FRN 9/1/2023	250,063	0.00
USD 1,383,818	Symphony CLO VIII LP 'Series 2012-8A ER' '144A' FRN 9/1/2023	1,386,050	0.01
USD 4,394,740	Symphony CLO XII Ltd 'Series 2013-12A AR' '144A' FRN 15/10/2025	4,394,859	0.04
USD 1,650,000	Symphony CLO XIX Ltd 'Series 2018-19A A' '144A' FRN 16/4/2031	1,639,345	0.01
USD 1,275,000	Symphony CLO XV Ltd 'Series 2014-15A DR' '144A' FRN 17/10/2026	1,277,331	0.01
USD 425,000	Symphony CLO XV Ltd 'Series 2014-15A E' '144A' FRN 17/10/2026	426,024	0.00
USD 330,000	Symphony CLO XVI Ltd 'Series 2015-16A E' '144A' FRN 15/7/2028	331,019	0.00
USD 1,830,000	Symphony CLO XVII Ltd 'Series 2016-17A AR' '144A' FRN 15/4/2028	1,824,358	0.02
USD 250,000	Symphony CLO XVIII Ltd 'Series 2016-18A D' '144A' FRN 23/1/2028	253,483	0.00
USD 5,088,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	3,816,000	0.03
USD 2,613,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 9.5% 15/7/2022	2,521,545	0.02
USD 3,523,000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10.5% 15/1/2026	3,104,644	0.03
USD 1,820,000	Talos Production LLC / Talos Production Finance Inc ' 144A' 11% 3/4/2022	1,920,100	0.02
USD 286,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.125% 15/11/2019	286,000	0.00
USD 2,113,000	Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.25% 15/4/2021	2,118,283	0.02
USD 1,810,000	TCI-Flatiron Clo 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A A' '144A' ' FRN 17/11/2030	1,812,308	0.02
USD 579,000	TCI-Symphony CLO 2017-1 Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' ' FRN 15/7/2030	587,453	0.01
USD 1,720,000	Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 1/2/2025	1,496,400	0.01
USD 180,000	Tenet Healthcare Corp 4.75% 1/6/2020	183,150	0.00
USD 282,000	Tenet Healthcare Corp 5.5% 1/3/2019	285,172	0.00
USD 10,261,000	Tenet Healthcare Corp 6% 1/10/2020	10,700,684	0.09
USD 180,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 7.5% 1/1/2022	189,169	0.00
USD 870,000	Tennessee Housing Development Agency 3.75% 1/7/2038	871,266	0.01
USD 420,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	420,607	0.00
USD 325,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	325,468	0.00
USD 4,000,000	Texas A&M University 2.756% 15/5/2026	3,845,220	0.03

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	1,780,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,707,073	0.01
USD	720,000	Texas Municipal Gas Acquisition & Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	834,412	0.01
USD	570,000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp 5% 31/12/2055	611,841	0.01
USD	2,450,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2043	2,825,560	0.02
USD	950,000	Texas Water Development Board 5% 15/10/2047	1,085,841	0.01
USD	1,410,000	Thacher Park CLO Ltd 'Series 2014-1A D1R' '144A' FRN 20/10/2026	1,413,414	0.01
USD	260,000	Thayer Park CLO Ltd 'Series 2017-1A D' '144A' FRN 20/4/2029	262,845	0.00
USD	2,500,000	THL Credit Wind River 2012-1 CLO Ltd 'Series 2012-1A DR' '144A' FRN 15/1/2026	2,516,906	0.02
USD	1,520,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd 'Series 2014-3A AR' '144A' FRN 22/1/2027	1,520,128	0.01
USD	250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd 'Series 2014-3A DR' '144A' FRN 22/1/2027	250,560	0.00
USD	250,000	THL Credit Wind River 2014-3 CLO Ltd 'Series 2014-3A E ' '144A' FRN 22/1/2027	250,765	0.00
USD	670,000	THL Credit Wind River 2015-1 CLO Ltd 'Series 2015-1A E1' '144A' FRN 20/7/2027	673,290	0.01
USD	4,260,000	THL Credit Wind River 2016-1 CLO Ltd 'Series 2016-1A AR' FRN 15/7/2028	4,260,676	0.04
USD	905,824	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-3 'Series 2007-3 4A1' FRN 25/6/2047	818,019	0.01
USD	250,000	TIAA CLO II Ltd 'Series 2017-1A E' '144A' FRN 20/4/2029	252,189	0.00
USD	2,483,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A A' '144A' FRN 16/1/2031	2,479,125	0.02
USD	750,000	Tiaa Clo III Ltd 'Series 2017-2A B' '144A' FRN 16/1/2031	748,599	0.01
USD	520,000	TICP CLO VI 2016-2 Ltd 'Series 2016-6A E' '144A' FRN 15/1/2029	525,088	0.00
USD	3,220,000	TICP CLO VII Ltd 'Series 2017-7A E' '144A' FRN 15/7/2029	3,294,710	0.03
USD	6,040,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	6,084,696	0.05
USD	3,765,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	3,750,768	0.03
USD	1,298,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,265,550	0.01
USD	2,800,000	Total System Services Inc 3.8% 1/4/2021	2,819,715	0.02
USD	1,510,000	Total System Services Inc 4% 1/6/2023	1,520,395	0.01
USD	1,810,000	TransDigm Inc 5.5% 15/10/2020	1,816,787	0.02
USD	3,690,000	TransDigm Inc 6% 15/7/2022	3,745,350	0.03
USD	2,150,000	TransDigm Inc 6.5% 15/7/2024	2,198,375	0.02
USD	790,000	Treman Park CLO Ltd 'Series 2015-1A AR' '144A' FRN 20/4/2027	791,020	0.01
USD	1,750,000	Treman Park CLO Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 20/4/2027	1,757,830	0.02
USD	640,000	TRESTLES CLO II Ltd 'Series 2018-2A D' '144A' FRN 25/7/2031	625,407	0.01
USD	320,000	TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc 4.375% 15/6/2019	323,200	0.00
USD	11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd 'Series 2006-1A A2' ' 144A' FRN 3/3/2039	774,710	0.01
USD	730,000	Tricon American Homes 2017-SFR2 Trust 'Series 2017- SFR2 F' '144A' 5.104% 17/1/2036	742,470	0.01
USD	850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018- SFR1 E' '144A' 4.564% 17/5/2037	847,946	0.01
USD	580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 'Series 2018- SFR1 F' '144A' 4.96% 17/5/2037	584,179	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,302,980	0.02
USD 3,013,000	Trinity Health Corp 4.125% 1/12/2045	2,962,133	0.03
USD 1,400,000	TSASC Inc/NY 5% 1/6/2041	1,511,993	0.01
USD 165,029	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	174,312	0.00
USD 5,498,226	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 'Series 2017-C1 XA' FRN 15/6/2050	559,749	0.00
USD 2,279,061	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	2,351,802	0.02
USD 180,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/7/2023	182,925	0.00
USD 2,150,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/7/2025	2,201,063	0.02
USD 3,482,000	United Rentals North America Inc 5.75% 15/11/2024	3,599,517	0.03
USD 524,473,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2020* †	557,098,104	4.71
USD 60,549,300	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2021*	63,168,488	0.53
USD 45,811,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2022*	46,335,635	0.39
USD 12,040,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.375% 15/1/2027*	12,168,079	0.10
USD 49,615,000	United States Treasury Note/Bond 2.625% 30/6/2023*	49,355,296	0.42
USD 130,803,900	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/5/2023*	130,890,762	1.11
USD 25,380,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/7/2023*	25,389,914	0.21
USD 35,251,500	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2028*	35,325,859	0.30
USD 170,209,500	United States Treasury Note/Bond 3% 15/2/2048* †	170,635,024	1.44
USD 8,009,900	United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/5/2048* †	8,194,613	0.07
EUR 400,000	United Technologies Corp FRN 18/5/2020	466,561	0.00
USD 4,000,000	United Technologies Corp 2.8% 4/5/2024	3,819,058	0.03
USD 12,725,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	12,800,396	0.11
USD 2,480,000	United Technologies Corp 3.95% 16/8/2025	2,500,244	0.02
USD 2,255,000	United Technologies Corp 4.125% 16/11/2028	2,259,233	0.02
USD 425,000	United Technologies Corp 4.625% 16/11/2048	432,413	0.00
USD 975,000	UnitedHealth Group Inc 2.7% 15/7/2020	972,236	0.01
USD 800,000	UnitedHealth Group Inc 3.375% 15/11/2021	806,054	0.01
USD 3,570,000	UnitedHealth Group Inc 4.25% 15/6/2048	3,600,397	0.03
USD 1,480,000	University of California 3.063% 1/7/2025	1,453,345	0.01
USD 1,665,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,781,359	0.02
USD 790,000	University of Houston 5% 15/2/2033	898,123	0.01
USD 720,000	University of Houston 5% 15/2/2034	815,969	0.01
USD 1,630,000	University of Houston 5% 15/2/2035	1,842,617	0.02
USD 2,110,000	University of Houston 5% 15/2/2036	2,379,236	0.02
USD 2,500,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	2,867,387	0.02
USD 2,555,000	University of Notre Dame du Lac 3.394% 15/2/2048	2,401,848	0.02
USD 1,220,000	University of Oregon 5% 1/4/2046	1,370,145	0.01
USD 6,002,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	5,459,272	0.05
USD 2,075,000	University of Vermont & State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,346,171	0.02
USD 2,150,000	Upper Arlington City School District 5% 1/12/2048	2,470,393	0.02
USD 1,300,000	US 2018-USDC 'Series 2018-USDC F' '144A' FRN 9/5/2038	1,213,269	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,427,354	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	2,424,927	0.02
USD	744,341	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	764,736	0.01
USD	2,957,000	Valvoline Inc 5.5% 15/7/2024	3,038,317	0.03
GBP	700,000	Vantiv LLC / Vantiv Issuer Corp 3.875% 15/11/2025	889,766	0.01
USD	478,012	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2014-1 'Series 2014-1 M1' '144A' FRN 25/9/2044	477,094	0.00
USD	505,934	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2015-1 'Series 2015-1 AFL' '144A' FRN 25/6/2045	511,638	0.00
USD	755,375	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 AFL' FRN 25/10/2046	770,977	0.01
USD	310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M1' FRN 25/10/2046	309,098	0.00
USD	170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M2' FRN 25/10/2046	168,435	0.00
USD	710,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M3' FRN 25/10/2046	705,021	0.01
USD	310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 'Series 2016-2 M4' FRN 25/10/2046	322,577	0.00
USD	2,435,977	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 'Series 2017-1 AFL' '144A' FRN 25/5/2047	2,452,896	0.02
USD	332,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 'Series 2017-1 M1' '144A' FRN 25/5/2047	324,959	0.00
USD	330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 'Series 2017-1 M2' '144A' FRN 25/5/2047	328,730	0.00
USD	330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 'Series 2017-1 M3' '144A' FRN 25/5/2047	339,259	0.00
USD	2,369,449	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 'Series 2017-2 M3' '144A' FRN 25/11/2047	2,322,577	0.02
USD	393,469	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 'Series 2017-2 M4' '144A' FRN 25/11/2047	384,999	0.00
USD	349,652	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 'Series 2018-1 M2' '144A' 4.26% 25/4/2048	348,167	0.00
USD	5,765,000	Ventas Realty LP 4.4% 15/1/2029	5,818,871	0.05
USD	2,420,000	Venture 32 CLO Ltd 'Series 2018-32A A2A' '144A' FRN 15/7/2031	2,416,645	0.02
USD	1,200,000	Venture XIX CLO Ltd 'Series 2014-19A AR' '144A' FRN 15/1/2027	1,200,694	0.01
USD	650,000	Venture XIX CLO Ltd 'Series 2014-19A BR' '144A' FRN 15/1/2027	649,677	0.01
USD	804,000	Venture XXIV CLO Ltd 'Series 2016-24A E' '144A' FRN 20/10/2028	812,273	0.01
USD	750,000	Venture XXVI CLO Ltd 'Series 2017-26A D' '144A' FRN 20/1/2029	762,539	0.01
USD	2,450,000	Venture XXVI CLO Ltd 'Series 2017-26A E' '144A' FRN 20/1/2029	2,502,048	0.02
USD	16,296,000	VeriSign Inc 4.625% 1/5/2023	16,608,883	0.14
EUR	700,000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd 7.5% 1/2/2023	819,524	0.01
EUR	165,000	Verizon Communications Inc 2.875% 15/1/2038	191,408	0.00
USD	7,830,000	Verizon Communications Inc 4.672% 15/3/2055	7,267,794	0.06
USD	4,164,000	Viacom Inc FRN 28/2/2057	4,095,615	0.03
USD	4,850,000	Viacom Inc 4.375% 15/3/2043	4,252,179	0.04
USD	645,000	Vibrant Clo III Ltd 'Series 2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2026	645,514	0.01
USD	250,000	Vibrant Clo III Ltd 'Series 2015-3A A2R' '144A' FRN 20/4/2026	250,147	0.00
USD	440,000	Vibrant Clo III Ltd 'Series 2015-3A BR' '144A' FRN 20/4/2026	439,951	0.00
USD	1,310,000	Vibrant Clo IV Ltd 'Series 2016-4A C' '144A' FRN 20/7/2028	1,320,970	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 470,000	Vibrant Clo IV Ltd 'Series 2016-4A D' '144A' FRN 20/7/2028	474,901	0.00
USD 830,000	Vibrant Clo V Ltd 'Series 2016-5A A' '144A' FRN 20/1/2029	833,356	0.01
USD 1,254,000	Vibrant Clo VII Ltd 'Series 2017-7A A1' '144A' FRN 15/9/2030	1,256,991	0.01
USD 2,270,000	Virginia Small Business Financing Authority 5% 31/12/2052	2,470,679	0.02
USD 10,101,000	Vistra Energy Corp 7.375% 1/11/2022	10,542,919	0.09
USD 283,000	Vistra Energy Corp 7.625% 1/11/2024	305,640	0.00
USD 450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust 'Series 2013-PENN D' '144A' FRN 13/12/2029	449,524	0.00
USD 885,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust 'Series 2013-PENN E' '144A' FRN 13/12/2029	866,771	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 25/4/2031	1,846,684	0.02
USD 2,034,502	Voya CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A A1R' '144A' FRN 18/1/2026	2,034,479	0.02
USD 1,275,000	Voya CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A A2R' '144A' FRN 18/1/2026	1,274,994	0.01
USD 685,000	Voya CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A BR' '144A' FRN 18/1/2026	685,016	0.01
USD 275,000	Voya CLO 2016-2 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 19/7/2028	276,457	0.00
USD 330,000	Voya CLO 2016-3 Ltd 'Series 2016-3A D' '144A' FRN 18/10/2027	333,946	0.00
USD 250,000	Voya CLO 2016-4 Ltd 'Series 2016-4A E2' '144A' FRN 20/7/2029	252,808	0.00
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd 'Series 2017-4A A1' '144A' FRN 15/10/2030	3,503,097	0.03
EUR 422,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	487,448	0.00
USD 2,450,910	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2A A' '144A' FRN 25/7/2037	2,361,235	0.02
USD 35,211	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series 2007-C31 'Series 2007-C31 C' FRN 15/4/2047	35,255	0.00
USD 10,000	Wachovia Corp 6.55% 15/10/2035	12,009	0.00
USD 3,050,000	Walmart Inc 3.55% 26/6/2025	3,087,405	0.03
USD 5,005,000	Walmart Inc 3.7% 26/6/2028	5,058,711	0.04
USD 1,405,000	Walt Disney Co/The 1.95% 4/3/2020	1,386,883	0.01
USD 8,850,435	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A3' FRN 25/4/2037	4,826,386	0.04
USD 948,261	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A4' FRN 25/4/2037	522,584	0.00
USD 602,042	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust 'Series 2005-AR2 B1' FRN 25/1/2045	401,151	0.00
USD 765,492	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 'Series 2007-OA5 1A' FRN 25/6/2047	731,407	0.01
USD 6,440,424	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 'Series 2006-4 1A1' 6% 25/4/2036	5,957,341	0.05
USD 428,735	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A5' 6.35% 25/5/2036	376,887	0.00
USD 1,875,543	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) 'Series 2006-4 3A1' 6.5% 25/5/2036	1,648,501	0.01
USD 1,742,790	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA1 Trust 'Series 2007-OA1 2A' FRN 25/12/2046	1,500,451	0.01
USD 4,821,603	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 'Series 2006-HE4 2A2' FRN 25/9/2036	2,443,380	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 4,178,216	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006-HE5 1A' FRN 25/10/2036	3,632,647	0.03
USD 3,647,963	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 'Series 2006-HE5 2A2' FRN 25/10/2036	2,125,440	0.02
USD 4,695,919	Washington Mutural Asset-Backed Certificates WMABS Series 2007-HE2 Trust 'Series 2007-HE2 2A2' FRN 25/2/2037	2,175,729	0.02
USD 6,300,000	Washington State Convention Center Public Facilities District 5% 1/7/2058	7,046,298	0.06
USD 1,820,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 1/2/2023	1,774,500	0.02
USD 1,821,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6.625% 15/8/2025	1,729,950	0.01
USD 1,240,000	Weld County School District No RE-4 5.25% 1/12/2041	1,438,400	0.01
USD 5,500,000	Wellfleet CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A DR' '144A' FRN 20/10/2027	5,483,840	0.05
USD 1,625,000	Wellfleet CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A ER' '144A' FRN 20/10/2027	1,630,292	0.01
USD 2,132,000	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A A1' '144A' FRN 17/1/2031	2,132,830	0.02
USD 510,000	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd 'Series 2017-3A B' '144A' FRN 17/1/2031	504,782	0.00
USD 1,190,000	Wells Fargo & Co 2.125% 22/4/2019	1,186,285	0.01
USD 12,115,000	Wells Fargo Bank NA FRN 23/7/2021	12,134,027	0.10
USD 5,820,000	Wells Fargo Bank NA 1.75% 24/5/2019	5,785,418	0.05
USD 1,620,000	Wells Fargo Bank NA 2.6% 15/1/2021	1,598,662	0.01
USD 10,200,000	Wells Fargo Bank NA 3.55% 14/8/2023	10,236,771	0.09
USD 530,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC18 'Series 2014-LC18 A5' 3.405% 15/12/2047	527,267	0.00
USD 15,524,906	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 XA' FRN 15/2/2048	707,308	0.01
USD 2,200,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 D' '144A' 3.768% 15/2/2048	1,803,690	0.02
USD 1,329,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 'Series 2015-C27 C' 3.894% 15/2/2048	1,246,231	0.01
USD 2,500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C31 'Series 2015-C31 A4' 3.695% 15/11/2048	2,521,837	0.02
USD 3,400,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 'Series 2015-NXS1 XB' FRN 15/5/2048	103,198	0.00
USD 720,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 'Series 2015-NXS4 D' FRN 15/12/2048	669,258	0.01
USD 570,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 'Series 2015-NXS4 A4' 3.718% 15/12/2048	576,154	0.01
USD 480,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 'Series 2015-P2 D' '144A' 3.241% 15/12/2048	381,013	0.00
USD 5,483,598	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 'Series 2016-BNK1 XB' FRN 15/8/2049	501,996	0.00
USD 2,760,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 'Series 2016-BNK1 XD' '144A' FRN 15/8/2049	216,232	0.00
USD 730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C34 'Series 2016-C34 C' FRN 15/6/2049	745,325	0.01
USD 18,729,594	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC25 'Series 2016-LC25 XA' FRN 15/12/2059	1,079,293	0.01
USD 800,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 'Series 2016-NXS5 C' FRN 15/1/2059	820,683	0.01
USD 1,730,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 'Series 2017-C39 D' '144A' FRN 15/9/2050	1,626,541	0.01
USD 1,940,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 'Series 2017-C39 C' 4.118% 15/9/2050	1,859,197	0.02
USD 29,297,560	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 'Series 2017-C41 XA' FRN 15/11/2050	2,526,475	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB ' Series 2017-HSDB A ' ' 144A ' FRN 13/12/2031	1,359,451	0.01
USD 9,878,339	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RC1 ' Series 2017-RC1 XA ' FRN 15/1/2060	915,184	0.01
USD 850,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 ' Series 2018-1745 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2036	854,360	0.01
USD 810,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-BXI ' Series 2018-BXI E ' ' 144A ' FRN 15/12/2036	809,131	0.01
USD 29,727,577	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 ' Series 2018-C44 XA ' FRN 15/5/2051	1,684,634	0.01
USD 1,050,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 ' Series 2018-C44 D ' ' 144A ' 3% 15/5/2051	861,854	0.01
USD 490,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 ' Series 2018-C45 C ' 4.727% 15/6/2051	492,931	0.00
USD 430,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	436,321	0.00
USD 2,380,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	2,423,965	0.02
USD 3,158,995	West CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A A1AR ' ' 144A ' FRN 7/11/2025	3,160,040	0.03
USD 830,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2019	850,015	0.01
USD 895,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2020	940,390	0.01
USD 890,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2021	956,167	0.01
USD 975,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2022	1,068,829	0.01
USD 810,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2023	903,442	0.01
USD 860,000	West Virginia Hospital Finance Authority 5% 1/6/2024	972,333	0.01
USD 330,000	Westcott Park CLO Ltd ' Series 2016-1A D ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	334,316	0.00
USD 4,330,000	Westcott Park CLO Ltd ' Series 2016-1A E ' ' 144A ' FRN 20/7/2028	4,405,616	0.04
USD 112,046	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2011-C3 ' Series 2011-C3 A3FL ' ' 144A ' FRN 15/3/2044	112,480	0.00
USD 360,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 ' Series 2012-C8 C ' FRN 15/8/2045	363,681	0.00
EUR 400,000	Whirlpool Corp 0.625% 12/3/2020	469,606	0.00
USD 937,000	Whiting Petroleum Corp 1.25% 1/4/2020	899,933	0.01
USD 650,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/12/2044	696,183	0.01
EUR 1,000,000	WMG Acquisition Corp 4.125% 1/11/2024	1,208,849	0.01
USD 670,000	World Financial Network Credit Card Master Trust ' Series 2012-D B ' 3.34% 17/4/2023	671,027	0.01
USD 1,520,000	World Financial Network Credit Card Master Trust ' Series 2012-C C ' 4.55% 15/8/2022	1,522,559	0.01
USD 2,126,270	Yale Mortgage Loan Trust 2007-1 ' Series 2007-1 A ' ' 144A ' FRN 25/6/2037	946,538	0.01
USD 340,000	York CLO 1 Ltd ' Series 2014-1A CR ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	339,966	0.00
USD 600,000	York CLO 1 Ltd ' Series 2014-1A DR ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	601,231	0.01
USD 1,120,000	York CLO 1 Ltd ' Series 2014-1A E ' ' 144A ' FRN 22/1/2027	1,122,374	0.01
USD 4,990,000	York CLO-2 Ltd ' Series 2015-1A AR ' ' 144A ' FRN 22/1/2031	4,991,969	0.04
USD 250,000	York CLO-2 Ltd ' Series 2015-1A ER ' ' 144A ' FRN 22/1/2031	242,537	0.00
USD 960,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A AR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	961,848	0.01
USD 1,170,000	York Clo-3 Ltd ' Series 2016-1A BR ' ' 144A ' FRN 20/10/2029	1,173,481	0.01

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,990,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A DR' '144A' FRN 20/10/2029	3,020,652	0.03
USD	1,520,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A ER' '144A' FRN 20/10/2029	1,541,835	0.01
USD	730,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A FR' '144A' FRN 20/10/2029	720,012	0.01
USD	3,290,000	York Clo-3 Ltd 'Series 2016-1A SUB' '144A' FRN 20/10/2029	2,691,987	0.02
USD	610,000	York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A D' '144A' FRN 20/1/2030	619,283	0.01
USD	1,820,000	York Clo-4 Ltd 'Series 2016-2A E' '144A' FRN 20/1/2030	1,847,029	0.02
USD	3,115,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6% 1/4/2023	3,226,112	0.03
USD	1,085,000	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc 6.375% 15/5/2025	1,137,894	0.01
USD	2,409,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	2,455,736	0.02
USD	4,364,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.75% 29/4/2025	4,424,060	0.04
			7,656,451,558	64.72
		ベトナム		
USD	2,500,000	No Va Land Investment Group Corp 5.5% 27/4/2023	2,490,625	0.02
USD	3,000,000	Vinpearl JSC 3.5% 14/6/2023	3,060,000	0.03
			5,550,625	0.05
	債券合計		10,135,156,597	85.67
	公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		10,536,721,540	89.07

その他の譲渡可能な有価証券

保有高		銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
香港				
CNH	917,253	China City Construction International Co Ltd (Defaulted) 5.35% 3/7/2017**	93,637	0.00
米国				
USD	2,391	Lehman Brothers Holdings Inc (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	96	0.00
USD	2,391	Lehman Brothers Special Finance (Defaulted) 31/12/2049 (Zero Coupon)**	-	0.00
USD	3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) FRN 1/5/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	630,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
USD	10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow 6/11/2018 (Zero Coupon)	-	0.00
債券合計			96	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計			93,733	0.00
投資有価証券合計			10,536,815,273	89.07
その他の純資産			1,293,058,494	10.93
純資産合計(米ドル)			11,829,873,767	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記2(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約 2018年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 53,686,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 10/18 ' 2.5% TBA	52,089,320	0.44
USD 114,102,000	Fannie Mae Pool ' 2.5 9/18 ' 2.5% TBA	110,897,334	0.94
USD 642,545,000	Fannie Mae Pool ' 3 9/18 ' 3% TBA	638,516,513	5.40
USD (620,762,000)	Fannie Mae Pool ' 3 9/18 ' 3% TBA	(600,244,463)	(5.08)
USD (574,143,000)	Fannie Mae Pool ' 3.5 9/18 ' 3.5% TBA	(570,610,654)	(4.82)
USD (1,071,300,000)	Fannie Mae Pool ' 3.5 10/18 ' 3.5% TBA	(1,063,704,612)	(8.99)
USD 82,600,000	Fannie Mae Pool ' 4 10/18 ' 4% TBA	83,977,045	0.71
USD 61,776,000	Fannie Mae Pool ' 4 9/18 ' 4% TBA	62,880,005	0.53
USD (207,931,000)	Fannie Mae Pool ' 4.5 9/18 ' 4.5% TBA	(215,913,086)	(1.83)
USD (18,764,000)	Freddie Mac Gold Pool ' 4 9/18 ' 4% TBA	(19,100,799)	(0.16)
USD (2,503,000)	Freddie Mac Gold Pool ' 4.5 9/18 ' 4.5% TBA	(2,600,214)	(0.02)
USD 409,500,000	Ginnie Mae II Pool ' 3.5 9/18 ' 3.5% TBA	410,747,706	3.47
USD 234,000,000	Ginnie Mae II Pool ' 4 9/18 ' 4% TBA	239,466,076	2.02
USD 237,550,000	Ginnie Mae II Pool ' 4.5 9/18 ' 4.5% TBA	246,826,862	2.09
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 4,317,574,689米ドル)		(626,772,967)	(5.30)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
BRL	18,488,622	USD	4,589,000	Deutsche Bank	4/9/2018	(120,145)
USD	2,645,000	BRL	10,658,292	UBS	4/9/2018	68,802
BRL	68,712,546	USD	17,214,400	BNP Paribas	5/9/2018	(607,837)
BRL	26,512,750	USD	6,820,000	UBS	5/9/2018	(412,354)
BRL	39,392,061	USD	9,502,000	Barclays	5/9/2018	18,339
BRL	110,177,257	USD	27,971,320	Goldman Sachs	5/9/2018	(1,343,495)
CLP	1,815,520,000	USD	2,800,000	JP Morgan	5/9/2018	(134,262)
CLP	1,729,266,000	USD	2,660,000	UBS	5/9/2018	(120,910)
HKD	15,000,000	USD	1,911,205	UBS	5/9/2018	(143)
USD	11,822,200	BRL	46,407,989	Morgan Stanley	5/9/2018	606,240
USD	10,466,000	BRL	40,393,527	BNP Paribas	5/9/2018	703,625
USD	16,218,200	BRL	61,735,523	Barclays	5/9/2018	1,297,855
USD	299,700	BRL	1,236,442	Citibank	5/9/2018	875
USD	22,701,620	BRL	88,838,797	Goldman Sachs	5/9/2018	1,230,911
USD	2,184,000	CLP	1,442,313,600	RBS Plc	5/9/2018	66,243
USD	3,276,000	CLP	2,155,853,209	BNP Paribas	5/9/2018	110,549
AUD	4,270,500	USD	3,111,358	Citibank	6/9/2018	(30,220)
JPY	7,445,410,500	USD	66,858,931	Barclays	6/9/2018	344,330
USD	1,868,493	AUD	2,562,500	Commonwealth Bank of Australia	6/9/2018	19,666
USD	1,246,886	AUD	1,708,000	Goldman Sachs	6/9/2018	14,575
USD	619,076,959	EUR	527,268,000	UBS	6/9/2018	5,394,263
USD	7,553,348	EUR	6,514,000	Toronto Dominion	6/9/2018	(28,241)
USD	10,278,185	EUR	8,837,000	State Street	6/9/2018	(7,124)
USD	239,354,390	GBP	182,150,000	Toronto Dominion	6/9/2018	3,113,915
USD	18,267,026	GBP	14,032,000	State Street	6/9/2018	68,144
USD	114,158,383	JPY	12,702,917,000	Barclays	6/9/2018	(499,826)
USD	7,462,779	JPY	829,988,000	State Street	6/9/2018	(28,803)
USD	12,484,151	JPY	1,383,003,000	Toronto Dominion	6/9/2018	983
USD	539,193	ZAR	7,206,000	Bank of America	6/9/2018	48,667
AUD	19,664,114	USD	14,355,000	Morgan Stanley	7/9/2018	(167,475)
AUD	19,674,814	USD	14,355,000	Deutsche Bank	7/9/2018	(159,755)
CAD	37,142,285	USD	28,710,000	Goldman Sachs	7/9/2018	(243,620)
EUR	24,566,181	USD	28,710,000	Goldman Sachs	7/9/2018	(115,533)
GBP	11,133,972	USD	14,355,000	Goldman Sachs	7/9/2018	85,856
GBP	11,074,330	USD	14,355,000	UBS	7/9/2018	8,500
TWD	157,452,350	USD	5,170,000	Goldman Sachs	7/9/2018	(42,257)
ZAR	84,351,296	USD	5,937,304	Bank of America	7/9/2018	(196,140)
ZAR	52,487,696	USD	3,686,814	Morgan Stanley	7/9/2018	(114,367)
ZAR	20,966,985	USD	1,474,726	Standard Chartered Bank	7/9/2018	(47,659)
ZAR	503,262	USD	35,393	Goldman Sachs	7/9/2018	(1,140)
ZAR	10,482,792	USD	737,363	RBS Plc	7/9/2018	(23,877)
EUR	6,620,600	USD	7,549,236	Goldman Sachs	10/9/2018	158,688
RUB	424,442,900	USD	6,251,000	Deutsche Bank	10/9/2018	7,179

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	7,684,450	EUR	6,620,600	Morgan Stanley	10/9/2018	(23,475)
USD	6,251,000	RUB	405,564,880	JP Morgan	10/9/2018	271,168
JPY	13,480,830,000	USD	121,928,394	Goldman Sachs	11/9/2018	(205,917)
JPY	406,600,000	USD	3,659,338	Citibank	11/9/2018	11,976
USD	123,341,827	JPY	13,480,830,000	Barclays	11/9/2018	1,619,349
RUB	61,032,768	USD	964,000	Barclays	12/9/2018	(64,300)
USD	61,000	RUB	3,819,966	Barclays	12/9/2018	4,689
USD	903,000	RUB	60,988,620	JP Morgan	12/9/2018	3,951
CNH	69,649,200	USD	10,239,188	HSBC Bank Plc	13/9/2018	(65,991)
CNH	5,000,000	USD	742,559	RBS Plc	13/9/2018	(12,242)
CNH	61,602,848	USD	8,954,000	Barclays	13/9/2018	43,920
CNH	125,536,174	USD	18,346,000	ANZ	13/9/2018	(9,763)
JPY	78,645,000	USD	715,545	BNP Paribas	13/9/2018	(5,335)
JPY	352,524,500	USD	3,228,345	ANZ	13/9/2018	(44,848)
JPY	32,334,000	USD	290,318	Morgan Stanley	13/9/2018	1,677
JPY	19,850,000	USD	179,449	HSBC Bank Plc	13/9/2018	(192)
USD	1,280,000	CNH	8,822,108	Morgan Stanley	13/9/2018	(8,587)
USD	366,000	CNH	2,502,582	Goldman Sachs	13/9/2018	464
USD	18,697,954	CNH	125,103,793	HSBC Bank Plc	13/9/2018	424,872
USD	19,744,963	EUR	16,760,006	HSBC Bank Plc	13/9/2018	228,100
USD	25,195,277	HKD	197,272,344	HSBC Bank Plc	13/9/2018	58,500
USD	498,093	HKD	3,906,000	BNP Paribas	13/9/2018	384
USD	675,958	JPY	73,850,000	ANZ	13/9/2018	9,050
USD	22,799,262	JPY	2,471,175,532	Citibank	13/9/2018	483,136
USD	22,840,152	JPY	2,475,595,000	Bank of America	13/9/2018	484,116
USD	61,209	JPY	6,732,850	BNP Paribas	13/9/2018	408
ARS	97,764,825	USD	3,587,700	BNP Paribas	14/9/2018	(1,059,735)
ARS	105,281,850	USD	3,895,000	Citibank	14/9/2018	(1,172,662)
ARS	120,994,389	USD	4,476,300	JP Morgan	14/9/2018	(1,347,674)
EUR	5,232,415	USD	6,000,000	Goldman Sachs	14/9/2018	93,544
EUR	15,681,603	USD	18,000,000	RBS Plc	14/9/2018	262,415
IDR	99,143,643,710	USD	6,880,000	BNP Paribas	14/9/2018	(202,341)
IDR	55,096,153,354	USD	3,812,619	Citibank	14/9/2018	(101,707)
USD	11,959,000	ARS	267,907,910	BNP Paribas	14/9/2018	5,031,541
USD	14,972,457	ARS	430,178,334	Citibank	14/9/2018	3,849,072
USD	24,000,000	EUR	20,896,822	BNP Paribas	14/9/2018	(335,933)
USD	3,249,770	IDR	45,727,515,289	Bank of America	14/9/2018	169,868
USD	640,503	IDR	9,368,638,065	RBS Plc	14/9/2018	9,494
USD	32,861,213	INR	2,261,951,928	Deutsche Bank	14/9/2018	1,008,919
USD	1,653,713	KRW	1,771,457,538	JP Morgan	14/9/2018	63,317
USD	2,681,782	THB	85,438,878	BNY Mellon	14/9/2018	70,661
USD	4,515,692	TWD	133,574,168	RBS Plc	14/9/2018	162,605
ARS	47,289,300	USD	1,698,000	BNP Paribas	17/9/2018	(479,274)
COP	16,509,675,000	USD	5,460,000	JP Morgan	17/9/2018	(40,044)

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
INR	201,649,500	USD	2,925,000	JP Morgan	17/9/2018	(86,469)
MXN	41,745,323	USD	1,990,000	HSBC Bank Plc	17/9/2018	189,471
USD	1,698,000	ARS	51,364,500	Citibank	17/9/2018	374,249
USD	5,460,000	COP	16,330,860,000	RBS Plc	17/9/2018	98,747
USD	2,925,000	INR	200,257,200	JP Morgan	17/9/2018	106,068
USD	1,990,000	MXN	40,771,120	Goldman Sachs	17/9/2018	(138,609)
JPY	325,815,022	USD	2,980,000	UBS	18/9/2018	(36,671)
USD	2,980,000	JPY	325,630,560	RBS Plc	18/9/2018	38,338
ARS	34,891,390	USD	1,217,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(319,788)
AUD	4,972,000	JPY	404,492,585	RBS Plc	19/9/2018	(67,097)
AUD	2,358,388	JPY	190,244,556	Citibank	19/9/2018	(17,191)
AUD	23,169,000	NOK	137,918,106	Morgan Stanley	19/9/2018	178,186
AUD	24,388,000	USD	17,855,842	JP Morgan	19/9/2018	(260,176)
AUD	125,719,000	USD	92,599,150	Morgan Stanley	19/9/2018	(1,894,312)
AUD	25,840,000	USD	18,656,480	RBS Plc	19/9/2018	(13,212)
AUD	9,944,000	USD	7,411,812	Standard Chartered Bank	19/9/2018	(237,328)
AUD	1,718,000	USD	1,258,481	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(18,964)
AUD	17,053,000	USD	12,512,245	Deutsche Bank	19/9/2018	(208,698)
AUD	29,747,000	USD	21,792,587	Citibank	19/9/2018	(330,464)
AUD	1,436,000	USD	1,052,801	Barclays	19/9/2018	(16,743)
AUD	52,587,000	USD	38,448,166	BNP Paribas	19/9/2018	(507,242)
AUD	25,779,000	USD	18,818,101	Goldman Sachs	19/9/2018	(218,843)
BRL	32,267,185	EUR	7,457,000	JP Morgan	19/9/2018	(901,111)
BRL	224,061,789	USD	58,739,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(4,671,154)
BRL	33,395,557	USD	8,701,000	Barclays	19/9/2018	(642,393)
BRL	11,503,940	USD	2,983,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(207,010)
BRL	19,357,212	USD	4,740,000	UBS	19/9/2018	(68,955)
BRL	167,854,416	USD	42,963,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(2,458,428)
BRL	9,874,605	USD	2,370,000	RBS Plc	19/9/2018	12,819
BRL	108,503,971	USD	26,926,000	BNP Paribas	19/9/2018	(743,152)
CAD	11,534,503	EUR	7,457,000	JP Morgan	19/9/2018	154,859
CAD	4,972,000	MXN	79,798,114	Bank of America	19/9/2018	(353,312)
CAD	7,457,000	MXN	107,679,080	BNP Paribas	19/9/2018	96,513
CAD	8,106,908	USD	6,215,000	Toronto Dominion	19/9/2018	(285)
CAD	13,913,900	USD	10,623,000	BNP Paribas	19/9/2018	43,326
CAD	16,709,445	USD	12,670,000	Barclays	19/9/2018	139,376
CAD	3,565,946	USD	2,702,000	UBS	19/9/2018	31,636
CAD	20,381,994	USD	15,445,000	RBS Plc	19/9/2018	179,734
CAD	3,141,108	USD	2,371,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	36,958
CAD	69,932,250	USD	53,361,000	Bank of America	19/9/2018	248,712
CAD	19,542,559	USD	14,852,000	Morgan Stanley	19/9/2018	129,228
CAD	64,943,281	USD	49,543,000	Deutsche Bank	19/9/2018	242,193
CAD	52,952,438	USD	40,517,000	JP Morgan	19/9/2018	76,073
CAD	17,527,486	USD	13,382,000	Goldman Sachs	19/9/2018	54,483

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CAD	34,693,588	USD	26,442,000	Citibank	19/9/2018	153,930
CHF	8,674,467	EUR	7,457,000	Deutsche Bank	19/9/2018	277,401
CHF	2,734,000	JPY	303,890,661	RBS Plc	19/9/2018	80,054
CHF	3,481,000	JPY	385,484,199	Morgan Stanley	19/9/2018	114,913
CHF	6,215,000	SEK	55,415,488	Morgan Stanley	19/9/2018	336,404
CHF	38,613,171	USD	38,853,414	Barclays	19/9/2018	1,052,286
CHF	14,232,795	USD	14,417,000	JP Morgan	19/9/2018	292,220
CHF	9,952,026	USD	10,074,000	Deutsche Bank	19/9/2018	211,159
CHF	11,261,913	USD	11,400,333	Citibank	19/9/2018	238,559
CHF	6,367,924	USD	6,489,000	Morgan Stanley	19/9/2018	92,083
CHF	12,329,817	USD	12,429,000	UBS	19/9/2018	313,542
CNH	45,042,954	USD	6,537,325	JP Morgan	19/9/2018	40,846
CNH	68,367,325	USD	9,942,675	Citibank	19/9/2018	41,839
COP	7,044,783,000	USD	2,397,000	RBS Plc	19/9/2018	(84,439)
EUR	7,457,000	BRL	32,956,212	Barclays	19/9/2018	734,844
EUR	7,457,000	CAD	11,461,931	Bank of America	19/9/2018	(99,226)
EUR	7,457,000	CHF	8,643,856	Morgan Stanley	19/9/2018	(245,766)
EUR	2,486,000	JPY	319,785,018	Deutsche Bank	19/9/2018	7,141
EUR	2,486,000	JPY	319,690,899	Citibank	19/9/2018	7,991
EUR	6,215,000	NOK	59,311,610	Citibank	19/9/2018	128,346
EUR	1,575,000	PLN	6,907,626	Barclays	19/9/2018	(39,589)
EUR	1,995,000	PLN	8,503,765	HSBC Bank Plc	19/9/2018	16,580
EUR	6,215,000	SEK	64,039,982	Citibank	19/9/2018	206,580
EUR	99,344,198	USD	117,705,438	RBS Plc	19/9/2018	(1,969,076)
EUR	6,213,000	USD	7,118,675	Toronto Dominion	19/9/2018	119,493
EUR	57,162,000	USD	66,360,870	Deutsche Bank	19/9/2018	233,074
EUR	34,428,000	USD	40,037,688	Morgan Stanley	19/9/2018	71,061
EUR	1,242,000	USD	1,455,746	Nomura	19/9/2018	(8,811)
EUR	30,317,000	USD	35,688,777	JP Morgan	19/9/2018	(369,358)
EUR	7,044,500	USD	8,114,757	Credit Suisse	19/9/2018	92,112
EUR	71,260,000	USD	82,604,411	Goldman Sachs	19/9/2018	413,758
EUR	5,213,000	USD	6,095,186	UBS	19/9/2018	(22,021)
EUR	44,957,000	USD	51,480,670	BNP Paribas	19/9/2018	894,403
EUR	104,525,000	USD	121,805,857	Citibank	19/9/2018	(33,840)
EUR	25,831,000	USD	30,156,603	State Street	19/9/2018	(63,391)
EUR	25,137,000	USD	29,164,061	Barclays	19/9/2018	120,638
GBP	308,000	USD	407,200	Goldman Sachs	19/9/2018	(7,526)
GBP	4,852,000	USD	6,407,592	JP Morgan	19/9/2018	(111,431)
GBP	838,000	USD	1,080,755	State Street	19/9/2018	6,669
GBP	9,927,000	USD	13,243,710	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(362,013)
GBP	12,429,334	USD	16,368,724	Citibank	19/9/2018	(239,892)
GBP	19,254,000	USD	25,232,464	Deutsche Bank	19/9/2018	(247,657)
GBP	61,699,000	USD	78,953,109	RBS Plc	19/9/2018	1,110,135
GBP	1,474,000	USD	1,928,903	Nomura	19/9/2018	(16,178)

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
GBP	7,846,000	USD	10,147,500	BNP Paribas	19/9/2018	33,804
IDR	17,602,931,400	USD	1,217,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(36,121)
INR	897,018,200	USD	13,000,000	Nomura	19/9/2018	(376,194)
JPY	91,372,665	AUD	1,115,388	Nomura	19/9/2018	20,755
JPY	508,920,868	AUD	6,215,000	Toronto Dominion	19/9/2018	113,731
JPY	687,323,065	CHF	6,215,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(213,504)
JPY	640,519,888	EUR	4,972,000	JP Morgan	19/9/2018	(5,701)
JPY	6,531,715,117	USD	58,615,000	Bank of America	19/9/2018	394,977
JPY	1,372,209,850	USD	12,430,000	RBS Plc	19/9/2018	(32,938)
JPY	833,359,510	USD	7,557,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(28,116)
JPY	11,796,846,536	USD	106,493,750	Goldman Sachs	19/9/2018	83,410
JPY	4,847,197,034	USD	44,029,000	Citibank	19/9/2018	(237,594)
JPY	2,475,650,975	USD	22,373,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(7,035)
JPY	965,563,021	USD	8,701,000	JP Morgan	19/9/2018	22,260
JPY	1,263,530,334	USD	11,435,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(19,791)
KRW	8,060,495,010	USD	7,457,000	Barclays	19/9/2018	(222,645)
KRW	17,084,735,194	USD	15,251,338	BNP Paribas	19/9/2018	82,342
KRW	1,331,851,342	USD	1,198,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(2,653)
MXN	80,715,448	CAD	4,972,000	BNP Paribas	19/9/2018	401,189
MXN	107,247,320	CAD	7,457,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(119,048)
MXN	282,004,453	USD	14,915,000	State Street	19/9/2018	(196,627)
MXN	229,823,961	USD	12,232,600	Barclays	19/9/2018	(237,631)
MXN	46,335,808	USD	2,486,000	BNP Paribas	19/9/2018	(67,642)
MXN	403,484,165	USD	19,889,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	1,169,641
MXN	246,673,290	USD	12,503,000	RBS Plc	19/9/2018	371,370
MXN	838,471,428	USD	43,222,000	Citibank	19/9/2018	539,491
MXN	1,050,340,426	USD	54,297,050	UBS	19/9/2018	522,305
MXN	522,114,714	USD	26,817,092	JP Morgan	19/9/2018	433,114
MXN	2,120,702,112	USD	109,503,000	Goldman Sachs	19/9/2018	1,180,661
MXN	1,557,163,973	USD	80,616,000	Deutsche Bank	19/9/2018	655,485
MXN	617,164,685	USD	31,290,000	Morgan Stanley	19/9/2018	921,053
NOK	95,499,867	AUD	15,852,500	RBS Plc	19/9/2018	14,145
NOK	44,103,433	AUD	7,316,500	Goldman Sachs	19/9/2018	9,743
NOK	59,526,245	EUR	6,215,000	Citibank	19/9/2018	(102,609)
NOK	27,695,689	EUR	2,905,000	Bank of America	19/9/2018	(63,300)
NOK	59,796,305	EUR	6,215,000	JP Morgan	19/9/2018	(70,226)
NOK	21,103,032	USD	2,560,000	Nomura	19/9/2018	(29,501)
NOK	50,967,351	USD	6,215,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(103,422)
NOK	93,496,538	USD	11,503,000	Bank of America	19/9/2018	(291,677)
NOK	20,321,807	USD	2,486,000	BNP Paribas	19/9/2018	(49,179)
NOK	20,132,125	USD	2,486,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(71,924)
NOK	73,111,233	USD	8,700,000	Toronto Dominion	19/9/2018	66,887
NOK	111,708,558	USD	13,495,429	JP Morgan	19/9/2018	(100,275)
NOK	20,998,420	USD	2,485,000	Barclays	19/9/2018	32,956

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
NOK	97,866,526	USD	11,953,000	Citibank	19/9/2018	(217,665)
NOK	57,126,104	USD	6,987,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(136,916)
NZD	9,189,000	USD	6,313,459	JP Morgan	19/9/2018	(217,535)
NZD	9,944,000	USD	6,716,555	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(119,770)
NZD	413,000	USD	281,605	RBS Plc	19/9/2018	(7,623)
NZD	7,457,000	USD	4,909,781	State Street	19/9/2018	37,144
NZD	40,292,000	USD	26,997,472	Citibank	19/9/2018	(268,020)
NZD	325,000	USD	216,847	Barclays	19/9/2018	(1,244)
NZD	3,090,000	USD	2,083,264	Goldman Sachs	19/9/2018	(33,378)
PLN	859,549	EUR	198,333	State Street	19/9/2018	2,190
PLN	859,577	EUR	198,333	Citibank	19/9/2018	2,198
PLN	4,297,834	EUR	991,667	JP Morgan	19/9/2018	10,975
PLN	859,632	EUR	198,333	HSBC Bank Plc	19/9/2018	2,213
PLN	3,438,188	EUR	793,333	Deutsche Bank	19/9/2018	8,759
PLN	4,298,181	EUR	991,667	Bank of America	19/9/2018	11,069
PLN	859,577	EUR	198,333	Goldman Sachs	19/9/2018	2,198
PLN	4,390,181	USD	1,198,000	UBS	19/9/2018	(6,670)
RUB	317,561,640	USD	4,972,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(294,285)
RUB	317,303,096	USD	4,972,000	BNP Paribas	19/9/2018	(298,094)
RUB	317,710,800	USD	4,972,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(292,088)
SEK	55,976,752	CHF	6,215,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(274,757)
SEK	64,227,861	EUR	6,215,000	Bank of America	19/9/2018	(185,944)
SEK	12,812,145	USD	1,434,000	Bank of America	19/9/2018	(26,761)
SEK	1,053,296	USD	119,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(3,310)
SEK	42,949,628	USD	4,972,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(254,569)
SEK	14,501,816	USD	1,616,000	Citibank	19/9/2018	(23,173)
SEK	4,561,106	USD	520,000	Barclays	19/9/2018	(19,025)
SEK	38,030,548	USD	4,325,000	JP Morgan	19/9/2018	(147,863)
SEK	188,008,843	USD	21,501,000	BNP Paribas	19/9/2018	(850,793)
TRY	25,595,494	USD	5,319,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(1,468,657)
TRY	9,588,183	USD	1,914,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(471,645)
TRY	3,555,612	USD	721,000	JP Morgan	19/9/2018	(186,128)
TRY	31,013,652	USD	6,215,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(1,549,601)
TRY	7,793,421	USD	1,568,000	Nomura	19/9/2018	(395,632)
TRY	15,009,538	USD	2,425,000	Bank of America	19/9/2018	(167,108)
TRY	67,754,585	USD	9,943,000	Citibank	19/9/2018	249,357
TRY	313,431,196	USD	57,712,000	BNP Paribas	19/9/2018	(10,562,386)
TRY	8,812,037	USD	1,242,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	83,599
TRY	62,950,963	USD	10,639,000	RBS Plc	19/9/2018	(1,169,255)
TRY	14,915,000	ZAR	38,197,762	BNP Paribas	19/9/2018	(351,852)
TWD	150,253,840	USD	4,972,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(72,936)
TWD	107,998,425	USD	3,545,000	Citibank	19/9/2018	(23,684)
TWD	100,726,419	USD	3,298,231	Goldman Sachs	19/9/2018	(14,020)
TWD	382,688,910	USD	12,429,000	Standard Chartered Bank	19/9/2018	48,669

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
TWD	164,430,000	USD	5,400,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(38,718)
USD	1,217,000	ARS	41,986,500	JP Morgan	19/9/2018	137,341
USD	5,422,954	AUD	7,457,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	42,813
USD	10,733,953	AUD	14,615,000	Citibank	19/9/2018	189,396
USD	1,814,432	AUD	2,486,000	RBS Plc	19/9/2018	20,811
USD	10,036,697	AUD	13,672,000	Deutsche Bank	19/9/2018	172,504
USD	23,415,701	AUD	31,747,000	BNP Paribas	19/9/2018	510,599
USD	8,233,815	AUD	11,235,000	Barclays	19/9/2018	127,889
USD	32,346,684	AUD	43,741,000	JP Morgan	19/9/2018	788,046
USD	4,015,347	AUD	5,505,000	UBS	19/9/2018	43,552
USD	112,246,140	AUD	153,193,000	Morgan Stanley	19/9/2018	1,719,124
USD	13,825,920	AUD	18,938,000	Goldman Sachs	19/9/2018	162,367
USD	4,972,000	BRL	19,766,683	JP Morgan	19/9/2018	202,146
USD	3,355,000	BRL	13,564,902	Citibank	19/9/2018	81,684
USD	4,972,000	BRL	18,888,628	Deutsche Bank	19/9/2018	414,028
USD	38,010,000	BRL	147,018,978	Barclays	19/9/2018	2,533,181
USD	36,418,000	BRL	143,483,716	Morgan Stanley	19/9/2018	1,794,268
USD	49,318,700	BRL	189,846,426	BNP Paribas	19/9/2018	3,507,284
USD	12,306,000	BRL	48,917,332	UBS	19/9/2018	501,868
USD	37,643,000	BRL	149,773,596	Goldman Sachs	19/9/2018	1,501,470
USD	5,065,000	CAD	6,605,267	HSBC Bank Plc	19/9/2018	1,436
USD	14,904,000	CAD	19,448,734	RBS Plc	19/9/2018	(5,302)
USD	30,093,462	CAD	39,613,377	Bank of America	19/9/2018	(273,955)
USD	4,972,000	CAD	6,606,679	Barclays	19/9/2018	(92,647)
USD	24,362,000	CAD	32,305,905	JP Morgan	19/9/2018	(403,544)
USD	22,468,753	CAD	29,413,878	UBS	19/9/2018	(79,777)
USD	57,368,000	CAD	75,602,548	Goldman Sachs	19/9/2018	(588,533)
USD	20,584,667	CAD	26,969,218	Morgan Stanley	19/9/2018	(89,800)
USD	7,457,000	CAD	9,795,217	Citibank	19/9/2018	(51,964)
USD	28,356,000	CAD	37,059,597	BNP Paribas	19/9/2018	(53,699)
USD	6,285,000	CHF	6,234,438	BNP Paribas	19/9/2018	(158,128)
USD	14,656,000	CHF	14,510,941	Barclays	19/9/2018	(340,678)
USD	1,554,000	CHF	1,534,130	Morgan Stanley	19/9/2018	(31,484)
USD	4,723,000	CHF	4,648,377	Deutsche Bank	19/9/2018	(80,975)
USD	13,796,000	CHF	13,695,869	RBS Plc	19/9/2018	(358,321)
USD	4,690,000	CHF	4,591,314	Citibank	19/9/2018	(55,002)
USD	25,123,000	CHF	24,851,610	UBS	19/9/2018	(560,487)
USD	2,967,000	CHF	2,926,989	Goldman Sachs	19/9/2018	(57,966)
USD	21,080,000	CHF	20,846,211	JP Morgan	19/9/2018	(464,013)
USD	13,995,000	CNH	96,402,272	JP Morgan	19/9/2018	(83,798)
USD	2,486,000	CNH	17,281,180	BNP Paribas	19/9/2018	(37,781)
USD	2,394,000	COP	7,220,304,000	UBS	19/9/2018	23,821
USD	2,393,000	COP	7,204,222,220	RBS Plc	19/9/2018	28,100
USD	27,281,895	EUR	23,342,000	Barclays	19/9/2018	88,377

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	76,198,437	EUR	65,180,000	Citibank	19/9/2018	263,494
USD	7,064,653	EUR	6,215,000	UBS	19/9/2018	(175,846)
USD	2,196,640	EUR	1,917,000	RBS Plc	19/9/2018	(36,672)
USD	18,574,165	EUR	16,158,000	JP Morgan	19/9/2018	(249,967)
USD	81,075,097	EUR	69,545,000	Morgan Stanley	19/9/2018	54,912
USD	13,795,769	EUR	11,839,000	BNP Paribas	19/9/2018	3,290
USD	78,459,495	EUR	67,139,000	Deutsche Bank	19/9/2018	242,309
USD	151,074,554	EUR	129,215,000	Goldman Sachs	19/9/2018	538,597
USD	91,828,952	EUR	80,204,000	Bank of America	19/9/2018	(1,609,008)
USD	13,997,070	GBP	10,800,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(17,469)
USD	26,904,334	GBP	20,948,500	Goldman Sachs	19/9/2018	(279,331)
USD	8,594,821	GBP	6,463,000	Barclays	19/9/2018	208,157
USD	4,081,444	GBP	3,112,000	UBS	19/9/2018	43,181
USD	41,899,813	GBP	32,827,000	Bank of America	19/9/2018	(697,897)
USD	13,059,859	GBP	10,092,500	Morgan Stanley	19/9/2018	(36,597)
USD	27,422,809	GBP	20,800,000	Deutsche Bank	19/9/2018	431,845
USD	16,139,093	GBP	12,430,000	Citibank	19/9/2018	9,397
USD	39,103,324	GBP	29,701,334	JP Morgan	19/9/2018	561,609
USD	1,217,000	IDR	18,128,748,420	RBS Plc	19/9/2018	847
USD	13,000,000	INR	905,690,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	254,155
USD	12,179,000	JPY	1,340,472,379	Deutsche Bank	19/9/2018	68,667
USD	13,744,000	JPY	1,507,774,513	Barclays	19/9/2018	122,197
USD	16,052,000	JPY	1,772,888,520	BNP Paribas	19/9/2018	35,057
USD	6,215,000	JPY	678,313,179	JP Morgan	19/9/2018	86,863
USD	6,215,000	JPY	679,003,293	Standard Chartered Bank	19/9/2018	80,628
USD	38,783,000	JPY	4,294,555,928	Goldman Sachs	19/9/2018	(15,639)
USD	43,502,000	JPY	4,808,316,851	State Street	19/9/2018	61,853
USD	34,801,000	JPY	3,853,733,459	Bank of America	19/9/2018	(15,081)
USD	67,397,750	JPY	7,398,097,178	Morgan Stanley	19/9/2018	560,551
USD	12,043,000	JPY	1,341,544,515	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(77,019)
USD	19,986,000	JPY	2,213,014,262	Citibank	19/9/2018	(7,205)
USD	2,487,000	KRW	2,787,678,300	JP Morgan	19/9/2018	(14,963)
USD	12,764,338	KRW	14,194,401,873	HSBC Bank Plc	19/9/2018	24,754
USD	4,723,000	KRW	5,293,538,400	Nomura	19/9/2018	(27,991)
USD	3,742,000	KRW	4,190,718,940	Barclays	19/9/2018	(19,203)
USD	3,933,000	KRW	4,393,947,315	Morgan Stanley	19/9/2018	(10,601)
USD	2,474,477	MXN	47,479,566	RBS Plc	19/9/2018	(3,576)
USD	19,538,523	MXN	395,951,675	Deutsche Bank	19/9/2018	(1,126,982)
USD	56,552,000	MXN	1,059,686,941	Barclays	19/9/2018	1,244,831
USD	23,121,000	MXN	482,394,833	Standard Chartered Bank	19/9/2018	(2,056,146)
USD	10,192,000	MXN	213,135,104	Morgan Stanley	19/9/2018	(931,945)
USD	17,155,000	MXN	330,949,630	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(117,920)
USD	117,352,100	MXN	2,373,886,194	UBS	19/9/2018	(6,545,741)
USD	109,056,482	MXN	2,077,800,313	Goldman Sachs	19/9/2018	611,951

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	43,659,400	MXN	844,103,896	JP Morgan	19/9/2018	(396,061)
USD	3,231,800	MXN	61,959,275	BNP Paribas	19/9/2018	(1,978)
USD	1,910,000	MXN	35,963,390	Citibank	19/9/2018	32,999
USD	1,930,000	MXN	36,580,332	Toronto Dominion	19/9/2018	20,800
USD	11,536,000	NOK	94,119,982	Barclays	19/9/2018	249,920
USD	1,199,000	NOK	10,040,196	Deutsche Bank	19/9/2018	(4,936)
USD	1,559,000	NOK	12,624,857	BNP Paribas	19/9/2018	45,133
USD	2,486,000	NOK	20,056,208	Bank of America	19/9/2018	81,027
USD	6,215,000	NOK	52,135,584	UBS	19/9/2018	(36,663)
USD	20,840,000	NOK	170,953,088	Morgan Stanley	19/9/2018	340,736
USD	11,130,000	NOK	92,091,266	Citibank	19/9/2018	87,185
USD	8,224,429	NOK	68,531,364	Goldman Sachs	19/9/2018	6,721
USD	9,944,000	NOK	82,733,780	JP Morgan	19/9/2018	23,258
USD	12,024,866	NZD	17,898,000	Citibank	19/9/2018	151,449
USD	412,783	NZD	626,000	BNP Paribas	19/9/2018	(2,501)
USD	284,815	NZD	413,000	Barclays	19/9/2018	10,833
USD	574,961	NZD	845,000	Nomura	19/9/2018	14,393
USD	4,032,513	NZD	5,992,000	Goldman Sachs	19/9/2018	57,458
USD	5,941,869	NZD	8,863,000	Morgan Stanley	19/9/2018	62,212
USD	7,083,549	NZD	10,397,000	Bank of America	19/9/2018	186,247
USD	4,913,126	NZD	7,457,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(33,799)
USD	15,011,296	NZD	22,373,000	JP Morgan	19/9/2018	169,193
USD	2,387,000	PLN	9,142,556	Deutsche Bank	19/9/2018	(93,946)
USD	14,916,000	RUB	949,552,560	BNP Paribas	19/9/2018	928,995
USD	14,044,000	SEK	122,591,014	Barclays	19/9/2018	579,050
USD	252,642	SEK	2,234,776	Morgan Stanley	19/9/2018	7,183
USD	6,587,000	SEK	58,433,112	BNP Paribas	19/9/2018	168,920
USD	1,295,000	SEK	11,425,785	HSBC Bank Plc	19/9/2018	40,033
USD	5,214,000	SEK	47,622,112	Bank of America	19/9/2018	(16,640)
USD	3,153,000	SEK	28,335,955	Goldman Sachs	19/9/2018	40,682
USD	10,487,000	SEK	91,237,832	Deutsche Bank	19/9/2018	465,768
USD	4,972,000	TRY	23,742,294	Morgan Stanley	19/9/2018	1,400,435
USD	2,486,000	TRY	12,381,523	Citibank	19/9/2018	623,441
USD	1,568,000	TRY	7,568,214	RBS Plc	19/9/2018	429,510
USD	38,196,890	TRY	187,480,535	HSBC Bank Plc	19/9/2018	9,994,099
USD	28,713,000	TRY	178,669,175	BNP Paribas	19/9/2018	1,835,705
USD	234,110	TRY	1,449,071	Bank of America	19/9/2018	16,126
USD	4,126,000	TRY	21,308,727	JP Morgan	19/9/2018	920,517
USD	17,402,000	TRY	99,078,225	Barclays	19/9/2018	2,497,613
USD	2,545,000	TWD	77,466,749	BNP Paribas	19/9/2018	19,177
USD	6,679,000	TWD	204,624,523	Barclays	19/9/2018	7,165
USD	4,972,000	TWD	149,418,544	JP Morgan	19/9/2018	100,170
USD	3,545,000	TWD	108,069,325	Bank of America	19/9/2018	21,372
USD	1,199,000	TWD	36,809,300	Goldman Sachs	19/9/2018	(1,177)

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	11,848,000	TWD	363,378,160	Nomura	19/9/2018	(38)
USD	3,759,198	TWD	114,578,843	HSBC Bank Plc	19/9/2018	23,326
USD	10,689,033	TWD	327,405,081	Standard Chartered Bank	19/9/2018	13,907
USD	6,214,500	ZAR	90,520,407	Deutsche Bank	19/9/2018	63,673
USD	24,759,000	ZAR	347,966,626	JP Morgan	19/9/2018	1,114,801
USD	9,570,000	ZAR	132,147,686	Morgan Stanley	19/9/2018	590,615
USD	2,148,500	ZAR	29,266,768	HSBC Bank Plc	19/9/2018	159,834
USD	2,734,000	ZAR	37,644,446	Bank of America	19/9/2018	176,074
USD	19,484,500	ZAR	268,772,402	Barclays	19/9/2018	1,221,518
USD	67,824,625	ZAR	945,196,829	BNP Paribas	19/9/2018	3,598,860
USD	13,110,235	ZAR	185,962,207	Citibank	19/9/2018	474,174
USD	16,655,000	ZAR	229,328,410	Goldman Sachs	19/9/2018	1,072,222
USD	4,972,000	ZAR	73,162,219	UBS	19/9/2018	655
ZAR	38,935,608	TRY	14,915,000	BNP Paribas	19/9/2018	401,989
ZAR	241,798,934	USD	17,401,000	Morgan Stanley	19/9/2018	(970,855)
ZAR	302,853,623	USD	21,029,000	Goldman Sachs	19/9/2018	(450,211)
ZAR	51,703,704	USD	3,729,000	JP Morgan	19/9/2018	(215,753)
ZAR	51,354,767	USD	3,770,000	HSBC Bank Plc	19/9/2018	(280,463)
ZAR	37,934,496	USD	2,734,000	Bank of America	19/9/2018	(156,365)
ZAR	289,228,037	USD	21,504,000	Citibank	19/9/2018	(1,851,064)
ZAR	639,040,102	USD	45,514,500	BNP Paribas	19/9/2018	(2,091,968)
ZAR	83,691,051	USD	6,163,000	UBS	19/9/2018	(476,225)
ZAR	216,480,310	USD	15,064,000	RBS Plc	19/9/2018	(354,245)
ZAR	88,133,869	USD	6,339,000	Deutsche Bank	19/9/2018	(350,337)
NZD	1,185,000	USD	787,857	Standard Chartered Bank	20/9/2018	(1,736)
TWD	105,762,800	USD	3,440,000	Citibank	20/9/2018	8,761
AUD	9,458,000	USD	6,921,554	Goldman Sachs	24/9/2018	(97,731)
AUD	9,300,200	USD	6,821,492	Standard Chartered Bank	24/9/2018	(111,520)
CLP	7,008,179,200	USD	10,496,000	Credit Suisse	24/9/2018	(200,857)
MXN	43,000,025	USD	2,253,500	Goldman Sachs	24/9/2018	(11,046)
USD	1,200,000	ARS	36,864,000	RBS Plc	24/9/2018	257,343
USD	1,157,814	AUD	1,577,017	BNP Paribas	24/9/2018	20,017
USD	1,156,175	AUD	1,574,967	RBS Plc	24/9/2018	19,857
USD	7,991,271	AUD	10,956,117	Goldman Sachs	24/9/2018	86,577
USD	2,253,500	MXN	42,589,347	Goldman Sachs	24/9/2018	32,463
ZAR	85,498,076	USD	5,935,800	BNP Paribas	25/9/2018	(131,070)
USD	2,730,000	COP	8,136,219,000	Barclays	27/9/2018	59,903
USD	2,730,000	COP	8,157,240,000	JP Morgan	27/9/2018	53,005
USD	3,938,130	ZAR	56,764,060	Standard Chartered Bank	27/9/2018	85,311
CLP	4,068,240,000	USD	6,164,000	UBS	28/9/2018	(187,066)
CLP	2,155,296,780	USD	3,276,000	BNP Paribas	28/9/2018	(109,504)
CNH	199,005,108	USD	31,458,000	Bank of America	28/9/2018	(2,401,187)
JPY	12,884,172,180	USD	116,021,361	UBS	28/9/2018	452,702

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	26,158,773,820	USD	235,644,780	HSBC Bank Plc	28/9/2018	832,863
RUB	399,835,488	USD	5,935,800	BNP Paribas	28/9/2018	(51,926)
USD	31,458,000	CNH	200,428,355	Nomura	28/9/2018	2,193,378
USD	125,489,840	EUR	101,327,760	Toronto Dominion	28/9/2018	7,364,521
USD	20,658,400	IDR	303,533,871,200	JP Morgan	28/9/2018	442,278
USD	61,510,035	JPY	6,497,366,500	Nomura	28/9/2018	2,773,264
USD	61,558,988	JPY	6,497,366,500	UBS	28/9/2018	2,822,217
USD	61,471,336	JPY	6,497,366,500	HSBC Bank Plc	28/9/2018	2,734,564
USD	61,778,461	JPY	6,526,740,000	JP Morgan	28/9/2018	2,776,151
USD	123,217,905	JPY	13,024,106,500	Bank of America	28/9/2018	5,478,823
USD	5,904,000	TRY	37,338,254	BNP Paribas	28/9/2018	317,201
USD	4,475,000	TWD	136,393,078	Morgan Stanley	28/9/2018	23,947
USD	4,475,000	TWD	136,393,525	Barclays	28/9/2018	23,933
USD	8,955,000	TWD	272,858,850	JP Morgan	28/9/2018	50,523
USD	2,816,626	TWD	85,935,267	Goldman Sachs	28/9/2018	12,214
USD	4,477,374	TWD	136,627,059	UBS	28/9/2018	18,685
USD	4,480,000	TWD	136,519,667	BNP Paribas	28/9/2018	24,816
ZAR	84,746,901	USD	5,935,800	JP Morgan	28/9/2018	(184,465)
MXN	308,217,482	USD	16,380,000	BNP Paribas	1/10/2018	(324,537)
USD	4,439,129	MXN	83,486,093	BNP Paribas	1/10/2018	90,226
USD	13,370,871	MXN	251,440,564	RBS Plc	1/10/2018	272,994
USD	4,567,000	MXN	85,764,949	UBS	1/10/2018	99,388
USD	5,277,000	MXN	100,864,388	State Street	1/10/2018	22,838
USD	10,004,400	BRL	41,016,539	BNP Paribas	2/10/2018	121,048
USD	9,502,000	BRL	39,491,167	Barclays	2/10/2018	(13,798)
USD	6,196,000	BRL	25,855,598	UBS	2/10/2018	(34,169)
USD	10,466,000	KRW	11,674,613,680	Barclays	2/10/2018	(3,507)
EUR	13,120,000	USD	15,329,466	Goldman Sachs	3/10/2018	(28,883)
USD	15,401,778	EUR	13,120,000	Morgan Stanley	3/10/2018	101,195
USD	7,341,337	ZAR	97,665,809	Goldman Sachs	3/10/2018	717,864
USD	66,991,277	JPY	7,445,410,500	Barclays	4/10/2018	(344,265)
BRL	23,629,000	USD	5,814,938	Goldman Sachs	5/10/2018	(122,984)
RUB	1,934,740,948	USD	30,154,000	BNP Paribas	5/10/2018	(1,704,660)
USD	6,084,106	BRL	23,497,000	Barclays	5/10/2018	423,949
USD	7,174,824	KRW	8,000,000,000	State Street	5/10/2018	1,582
USD	24,784,000	RUB	1,573,907,920	Deutsche Bank	5/10/2018	1,640,518
USD	5,370,000	RUB	344,318,472	Barclays	5/10/2018	306,979
SEK	35,994,312	USD	4,063,000	Toronto Dominion	10/10/2018	(102,887)
USD	4,063,000	SEK	35,874,283	Goldman Sachs	10/10/2018	116,092
USD	1,348,955	CHF	1,343,333	BNP Paribas	12/10/2018	(42,168)
USD	3,642,605	EUR	3,135,785	Standard Chartered Bank	16/10/2018	(18,262)
USD	63,034,312	ZAR	867,648,394	Bank of America	16/10/2018	4,302,600
USD	12,686,153	IDR	188,199,083,100	JP Morgan	17/10/2018	255,154
USD	2,804,847	IDR	41,382,431,382	Barclays	19/10/2018	72,905

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	10,304,013	IDR	152,736,384,213	Morgan Stanley	19/10/2018	220,821
IDR	246,914,395,000	USD	16,757,000	Barclays	31/10/2018	(508,340)
CNY	132,880,000	USD	19,404,206	Morgan Stanley	14/11/2018	(19,796)
CNY	69,960,000	USD	10,216,122	HSBC Bank Plc	14/11/2018	(10,423)
EUR	853,000	JPY	110,000,000	Bank of America	14/11/2018	320
EUR	24,865,000	USD	28,935,898	HSBC Bank Plc	14/11/2018	160,182
EUR	94,295,584	USD	110,015,561	Barclays	14/11/2018	325,555
GBP	1,660,000	EUR	1,849,755	Goldman Sachs	14/11/2018	(5,097)
GBP	21,365,000	EUR	23,819,502	Citibank	14/11/2018	(79,950)
GBP	17,525,613	USD	22,677,355	HSBC Bank Plc	14/11/2018	120,895
GBP	5,054,387	USD	6,541,160	Bank of America	14/11/2018	33,855
GBP	18,976,155	USD	24,294,222	RBS Plc	14/11/2018	390,969
GBP	66,660,000	USD	85,080,680	Barclays	14/11/2018	1,634,193
GBP	3,783,845	USD	4,845,059	BNP Paribas	14/11/2018	77,168
IDR	22,920,000,000	USD	1,567,715	Morgan Stanley	14/11/2018	(64,744)
IDR	11,960,000,000	USD	817,498	Bank of America	14/11/2018	(33,225)
SEK	87,472,973	EUR	8,467,940	Barclays	14/11/2018	(257,275)
SEK	9,400,000	EUR	898,448	Citibank	14/11/2018	(14,153)
SEK	27,900,000	EUR	2,679,960	Deutsche Bank	14/11/2018	(57,559)
USD	23,267,951	EUR	20,250,000	Barclays	14/11/2018	(427,831)
USD	27,370,444	EUR	23,710,000	Citibank	14/11/2018	(374,098)
USD	30,946,851	GBP	23,826,836	Citibank	14/11/2018	(48,364)
USD	30,232,929	GBP	23,682,568	RBS Plc	14/11/2018	(574,614)
USD	53,924,939	GBP	42,030,000	Barclays	14/11/2018	(749,919)
USD	4,786,611	GBP	3,691,635	Goldman Sachs	14/11/2018	(15,664)
USD	24,720,133	GBP	19,068,365	Standard Chartered Bank	14/11/2018	(85,010)
USD	10,082,255	IDR	147,402,570,967	Morgan Stanley	14/11/2018	416,378
USD	2,346,129	INR	163,062,996	Morgan Stanley	14/11/2018	69,320
MXN	117,349,441	USD	6,139,000	Barclays	26/11/2018	(78,962)
MXN	531,249,492	USD	27,284,000	HSBC Bank Plc	26/11/2018	150,235
USD	23,454,000	MXN	452,235,126	RBS Plc	26/11/2018	100,143
USD	8,337,000	MXN	160,741,596	State Street	26/11/2018	36,149
USD	5,651,000	ARS	195,468,090	JP Morgan	30/11/2018	999,950
USD	1,914,588	HKD	15,000,000	UBS	13/12/2018	154
USD	3,683,678	JPY	406,600,000	Citibank	13/12/2018	(12,648)
USD	4,883,714	IDR	71,438,969,627	Citibank	14/12/2018	229,537
USD	2,826,000	ARS	102,159,900	Citibank	28/12/2018	453,726
MXN	85,946,400	USD	4,320,000	Barclays	14/6/2019	(15,331)
USD	4,320,000	MXN	85,060,800	Barclays	14/6/2019	59,687
USD	41,192,720	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	13/12/2019	2,704,656
USD	41,459,504	EUR	31,760,000	Deutsche Bank	25/2/2020	2,713,791
USD	42,233,480	JPY	4,230,950,000	HSBC Bank Plc	16/3/2020	2,154,921
未実現純評価益						60,127,207

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	162,988,842	USD	120,833,064	BNY Mellon	14/9/2018	(3,238,168)
USD	173,134	AUD	236,846	BNY Mellon	14/9/2018	2,252
未実現純評価損 Net unrealised appreciation						183,538
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,172,074,759	USD	895,707,305	BNY Mellon	14/9/2018	2,710,549
USD	29,967	CAD	39,100	BNY Mellon	14/9/2018	(4)
未実現純評価益						2,710,545
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	280,040,385	USD	281,993,302	BNY Mellon	14/9/2018	7,291,640
USD	5,377,940	CHF	5,313,289	BNY Mellon	14/9/2018	(110,772)
未実現純評価益						7,180,868
ヘッジを使用した中国人民元建投資証券クラス						
CNY	4,551,639	USD	665,276	BNY Mellon	14/9/2018	(465)
未実現純評価損						(465)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	2,698,701,085	USD	3,137,093,595	BNY Mellon	14/9/2018	5,744,109
USD	42,461,313	EUR	36,776,790	BNY Mellon	14/9/2018	(367,775)
未実現純評価益						5,376,334
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,558,917,366	USD	2,007,677,187	BNY Mellon	14/9/2018	14,821,721
USD	3,274,919	GBP	2,557,692	BNY Mellon	14/9/2018	(43,356)
未実現純評価益						14,778,365
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	5,890,890	USD	751,201	BNY Mellon	14/9/2018	(561)
未実現純評価損						(561)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	57,462,967,626	USD	518,719,227	BNY Mellon	14/9/2018	240,445
USD	635,933	JPY	70,276,766	BNY Mellon	14/9/2018	1,249
未実現純評価益						241,694
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	230,603,772	USD	62,731,868	BNY Mellon	14/9/2018	(159,955)
USD	1,869,272	PLN	6,947,946	BNY Mellon	14/9/2018	(15,977)
未実現純評価損						(175,932)

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,135,810,876	USD	127,308,786	BNY Mellon	14/9/2018	(2,601,961)
USD	641,294	SEK	5,812,295	BNY Mellon	14/9/2018	3,138
未実現純評価損						(2,598,823)
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	87,309,973	USD	64,042,593	BNY Mellon	14/9/2018	(373,660)
USD	86,115	SGD	118,039	BNY Mellon	14/9/2018	37
未実現純評価損						(373,623)
未実現純評価益合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 17,139,094,355米ドル)						84,029,693

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引 2018年8月31日現在

契約数	通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエク スポージャー (米ドル)	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(519)	AUD	Australian 10 Year Bond	2018年9月	49,036,420	(622,980)
33	EUR	Euro-BTP	2018年9月	4,713,172	(79,273)
23	EUR	EURO STOXX 600 Bank Index	2018年9月	139,449	(8,699)
9	EUR	EURO STOXX 50 Index	2018年9月	355,889	3,185
1	EUR	Euro Schatz	2018年9月	130,331	47
(167)	EUR	Euro BUXL	2018年9月	34,705,470	(899,527)
(518)	EUR	Euro BOBL	2018年9月	79,715,219	(97,811)
(1,195)	EUR	Euro Bund	2018年9月	226,939,499	(847,443)
(1,212)	EUR	Euro-OAT	2018年9月	218,010,028	(1,931,616)
(54)	JPY	TOPIX Index	2018年9月	8,423,718	216,624
(313)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2018年9月	424,621,314	540,228
149	KRW	Korean 10 Year Bond	2018年9月	16,577,863	594,314
296	USD	MSCI Emerging Markets Index	2018年9月	15,562,200	(225,272)
73	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2018年9月	11,190,170	298,447
(353)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2018年9月	51,198,238	224,105
(1,626)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2018年9月	195,805,969	(361,953)
(2,452)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年9月	518,827,875	(157,095)
(346)	USD	CBOE Volatility Index	2018年11月	5,473,720	23,100
(230)	CAD	Canadian 10 Year Bond	2018年12月	23,751,698	(58,167)
(18)	EUR	Euro BOBL	2018年12月	2,756,411	(6,074)
(27)	EUR	Euro Schatz	2018年12月	3,517,520	(1,571)
(31)	EUR	Euro Bund	2018年12月	5,796,945	(9,019)
(696)	GBP	Long Gilt	2018年12月	110,452,092	(238,309)
138	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2018年12月	187,076,234	(199,269)
22,593	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年12月	4,774,183,313	787,569
3,797	USD	US Ultra Bond (CBT)	2018年12月	607,401,344	(402,282)
3,707	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2018年12月	420,339,047	556,301
3,514	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2018年12月	422,833,031	1,030,591
838	USD	90 Day Euro \$	2018年12月	204,011,100	(53,625)
692	USD	CBOE Volatility Index	2018年12月	11,044,320	28,581
(2,254)	USD	US Long Bond (CBT)	2018年12月	325,914,312	(380,709)
(5,246)	USD	US Ultra 10 Year Note	2018年12月	672,389,656	720,847
(346)	USD	CBOE Volatility Index	2019年1月	5,664,020	19,270
323	USD	90 Day Euro \$	2019年3月	78,513,225	(28,263)
323	USD	90 Day Euro \$	2019年6月	78,432,475	57
(1,179)	USD	90 Day Euro \$	2019年12月	286,025,400	(39,987)
(167)	USD	90 Day Euro \$	2020年3月	40,512,113	(29,225)
995	USD	90 Day Euro \$	2020年9月	241,436,750	199,000
(1,849)	USD	90 Day Euro \$	2020年12月	448,659,850	(104,587)
(360)	USD	90 Day Euro \$	2021年9月	87,381,000	(17,309)
合計				10,899,518,400	(1,557,799)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2018年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	322,253	112,273
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(212,627)	(110,855)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(24,801)	(34,518)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(40,562)	(55,229)
CDS	EUR (9,250)	ファンドはEnel Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(678)	(2,137)
CDS	EUR 350,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	999	(1,053)
CDS	USD 1,495,570	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	232,690	175,661
CDS	EUR (107,914)	ファンドはEnel Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(7,914)	(24,925)
CDS	EUR 350,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	1,219	(1,053)
CDS	EUR (95,581)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(7,009)	(22,077)
CDS	EUR (760,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(94,156)	(175,540)
CDS	USD 899,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	72,095	105,591
CDS	USD 777,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	62,902	91,262
CDS	USD 2,711,429	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	230,245	318,468

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 1,797,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	140,155	211,065
CDS	USD 3,615,238	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2023	306,993	424,624
CDS	USD 1,980,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2020	1,553	(147,010)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	68,892	44,401
CDS	JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(16,079)	(26,073)
CDS	JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(15,002)	(13,398)
CDS	JPY 115,384,616	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(14,700)	(20,711)
CDS	EUR (620,000)	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2022	(11,854)	(11,355)
CDS	EUR 1,450,000	ファンドはBayerische Motoren Werke AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(2,025)	(35,155)
CDS	EUR 775,000	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	26,167	106,698
CDS	USD 6,676,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	8,101	59,835
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	1,708	(22,325)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(29,733)	(69,292)
CDS	EUR 110,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	1,035	(5,625)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,980,000)	ファンドはBeazer Homes USA Incに 係るデフォルト・プロテクション を提供し、5%の固定金利を受け 取る	Barclays	20/6/2023	(87,347)	78,173
CDS	EUR 1,810,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、1%の固定金利を支 払う	Barclays	20/6/2023	35,705	77,515
CDS	EUR (710,000)	ファンドはAltice France SA (France)に係るデフォルト・プロ テクションを提供し、5%の固定 金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(616)	60,069
CDS	USD 3,177,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	3,202	28,475
CDS	EUR 930,000	ファンドはCentrica Plcに係るデ フォルト・プロテクションを受け 取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	114	(9,677)
CDS	EUR 560,000	ファンドはITV Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(7,927)	(124,108)
CDS	USD 1,923,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支 払う	Barclays	20/6/2023	274,972	225,864
CDS	EUR (160,000)	ファンドはThomas Cook Group Plc に係るデフォルト・プロテクショ ンを提供し、5%の固定金利を受け 取る	Barclays	20/6/2023	(651)	21,621
CDS	USD 1,890,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支 払う	Barclays	20/6/2023	272,541	221,988
CDS	USD 2,820,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支 払う	Barclays	20/6/2023	403,235	331,220
CDS	USD 3,674,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(36,670)	32,929
CDS	EUR 290,000	ファンドはAltice Luxembourg SA に係るデフォルト・プロテクショ ンを受け取り、5%の固定金利を 支払う	Barclays	20/6/2023	12,080	11,495
CDS	EUR 1,100,000	ファンドはAnglo American Plcに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、5%の固定金利を支 払う	Barclays	20/6/2023	10,094	(215,240)
CDS	EUR 180,000	ファンドはUnitymedia GMBHに係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	306	(41,679)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 717,000	ファンドはSolvay SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(2,037)	(18,050)
CDS	EUR 447,000	ファンドはLanxessに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(574)	(8,840)
CDS	EUR 350,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(231)	(3,648)
CDS	EUR (3,633)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(375)	(839)
CDS	EUR (36,946)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(3,714)	(8,534)
CDS	EUR (36,367)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(3,655)	(8,400)
CDS	EUR 350,000	ファンドはVolkswagen AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	1,447	(1,989)
CDS	EUR 200,000	ファンドはCDX.NA.HY.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	7,957	7,928
CDS	USD 4,593,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(44,861)	41,166
CDS	EUR (197,984)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(19,900)	(45,729)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	5,738	(4,045)
CDS	USD 4,593,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(38,971)	41,166
CDS	EUR (412,016)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(42,582)	(95,165)
CDS	USD 4,592,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(42,890)	41,157
CDS	EUR 300,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	237	(16,393)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (230,000)	ファンドはBoparan Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	17,260	(4,311)
CDS	USD 1,323,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	107,103	155,392
CDS	EUR (300,000)	ファンドはFiat Chrysler Automobiles NVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	521	51,007
CDS	USD 4,593,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(45,842)	41,166
CDS	EUR 400,000	ファンドはArcelormittalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(2,144)	(77,823)
CDS	EUR 1,100,000	ファンドはTelefonica SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2023	(1,168)	(6,999)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはWind Acquisition Finance SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(315)	22,155
CDS	EUR 2,300,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2023	155	22,169
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(75,405)	(46,837)
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(43,159)	(26,465)
CDS	USD 9,700,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(106,641)	(688,712)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(33,010)	(60,053)
CDS	EUR 700,000	ファンドはBayerische Motoren Werke AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	(3,021)	(16,971)
CDS	EUR (270,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(34,279)	(62,363)
CDS	EUR (416,667)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(312)	31,308

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (500,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(375)	37,570
CDS	JPY 34,840,000	ファンドはSoftbank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	(8,436)	13,928
CDS	EUR (20,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(59)	1,503
CDS	USD 4,678,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	95,944	404,296
CDS	USD 4,677,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	79,183	404,210
CDS	EUR (10,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(1,270)	(2,310)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはEnel Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(23,257)	(66,982)
CDS	EUR 210,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	500	(632)
CDS	EUR 902,000	ファンドはBarclays Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	3,737	8,640
CDS	EUR 2,890,000	ファンドはBarclays Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	16,767	27,682
CDS	USD (71,160,000)	ファンドはMonitchem Holdco 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(27,158)	1,238,745
CDS	EUR 2,510,000	ファンドはTelefonica SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	(6,972)	(15,969)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(1,008)	25,548
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,887)	(16,168)
CDS	USD 4,843,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	230,970	418,556

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,887)	(16,168)
CDS	EUR (590,000)	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	3,512	(25,267)
CDS	USD 4,843,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	230,970	418,556
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	835	(44,650)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(24,186)	(71,602)
CDS	EUR 1,450,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	7,358	(15,115)
CDS	JPY 77,300,000	ファンドはSoftbank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2023	(7,922)	30,903
CDS	EUR 500,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2023	(1,781)	15,661
CDS	EUR (636,702)	ファンドはGrohe Holding GMBHに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2018	(8,399)	11,379
CDS	EUR (100,000)	ファンドはRallye SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2020	(10,483)	(28,535)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはRallye SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2020	(28,906)	(57,070)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはRallye SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2020	(22,595)	(57,070)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2020	(44,160)	(48,551)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはRallye SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2021	(14,955)	(37,470)
CDS	EUR 600,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2021	(11,573)	(84,696)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (20,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	(546)	(949)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはTelecom Italia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	(5,607)	(13,760)
CDS	EUR (150,000)	ファンドはFiat Chrysler Automobiles NVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2022	(7,277)	24,401
CDS	USD 4,579,661	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	139,108	395,797
CDS	EUR (247,704)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(21,706)	(57,213)
CDS	USD 4,398,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	206,130	380,097
CDS	EUR (200,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(17,014)	(46,195)
CDS	USD 3,582,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	56,387	309,574
CDS	EUR (400,000)	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(39,557)	(92,390)
CDS	USD 4,662,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	49,744	402,913
CDS	USD 6,480,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(13,560)	(58,483)
CDS	USD 8,349,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	30,601	74,830
CDS	USD 4,228,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(885)	37,895
CDS	EUR (760,000)	ファンドはCommerzbank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(4,740)	(37,349)
CDS	EUR 350,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	814	(1,053)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (220,518)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	1,857	12,841
CDS	USD 4,658,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	139,613	402,568
CDS	USD 4,639,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	6,039	41,578
CDS	EUR (20,750)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(1,708)	(4,793)
CDS	EUR (105,195)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	108	14,215
CDS	USD 1,615,754	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	95,443	139,642
CDS	EUR (700,000)	ファンドはZiggo Bond Finance BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(1,644)	111,771
CDS	EUR 100,000	ファンドはNovafives SASに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(357)	(6,887)
CDS	USD 5,103,339	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	144,760	441,056
CDS	USD 7,716,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	7,300	69,157
CDS	EUR 200,000	ファンドはNovafives SASに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(662)	(13,774)
CDS	USD 6,166,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	6,100	55,264
CDS	EUR (1,300,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	1,880	1,715
CDS	EUR 100,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	5,778	6,084
CDS	EUR 960,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	1,508	(204,147)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (242,086)	ファンドはEnel Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(19,927)	(55,916)
CDS	USD 4,726,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(46,160)	42,358
CDS	EUR (600,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(53,837)	(138,584)
CDS	EUR 700,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	2,748	34,847
CDS	USD 4,662,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	47,027	402,913
CDS	EUR 700,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	19,759	60,805
CDS	EUR 128,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(4,978)	1,713
CDS	EUR (13,782)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	116	803
CDS	EUR 100,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	104	(19,333)
CDS	EUR (214,419)	ファンドはEnel Spaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(17,649)	(49,525)
CDS	USD 4,662,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	50,651	402,913
CDS	EUR (253,054)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(26,153)	(58,449)
CDS	EUR 230,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(2,867)	(43,979)
CDS	EUR (700,000)	ファンドはTesco Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	4,013	389
CDS	USD 7,329,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	79,627	633,409
CDS	EUR (208,291)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	1,851	12,129

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (7,854)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(688)	(1,814)
CDS	EUR (78,540)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(6,883)	(18,141)
CDS	USD 4,663,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	48,849	403,000
CDS	EUR 250,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(3,856)	15,210
CDS	EUR (1,400,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	(16,009)	1,847
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	20,052	(6,560)
CDS	EUR 700,000	ファンドはBayerische Motoren Werke AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(2,625)	(16,971)
CDS	EUR (227,409)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	1,915	13,243
CDS	USD 4,658,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	139,613	402,568
CDS	EUR (560,000)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	2,757	75,675
CDS	EUR (570,000)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2023	584	77,026
CDS	EUR 700,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	456	163
CDS	EUR 700,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2023	(3,275)	(125)
CDS	EUR 700,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2023	(2,290)	21,314
CDS	EUR 850,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2023	(1,237)	8,193

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 850,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、1%の固定金利を 支払う	Citibank	20/12/2023	(4,548)	26,624
CDS	EUR (600,000)	ファンドはConstellium NVに係る デフォルト・プロテクションを提 供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2024	14,698	91,234
CDS	USD 1,650,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデ フォルト・プロテクションを受け 取り、2%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	(13,966)	19,229
CDS	EUR (1,263,298)	ファンドはGrohe Holding GMBH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	20/12/2018	(16,665)	22,578
CDS	EUR (200,000)	ファンドはSaipem Finance International BVに係るデフォル ト・プロテクションを提供し、 5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2022	18,776	33,113
CDS	EUR 100,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデ フォルト・プロテクションを受け 取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	9,158	3,808
CDS	EUR (250,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、 5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(25,561)	16,630
CDS	EUR 200,000	ファンドはUnitymedia GMBHに係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(4,856)	(42,543)
CDS	EUR (360,000)	ファンドはWind Acquisition Finance SAに係るデフォルト・プ ロテクションを提供し、5%の固 定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	528	73,661
CDS	EUR (260,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォ ルト・プロテクションを提供し、 5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(31,827)	17,295
CDS	USD 3,400,000	ファンドはCDX.NA.HY.30.V1に係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(14,524)	(230,127)
CDS	USD 12,641,820	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(39,062)	(220,067)
CDS	EUR 720,000	ファンドはUnitymedia GMBHに係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	9,222	(166,717)
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテク ションを提供し、5%の固定金利 を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	2,872	2,161
CDS	EUR 580,000	ファンドはUnitymedia GMBHに係る デフォルト・プロテクションを受 け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(647)	(134,300)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはAdler Real Est AG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	20/6/2023	(28,853)	113,904

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 100,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(3,925)	(19,333)
CDS	EUR (70,857)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(4,564)	4,126
CDS	EUR (300,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(526)	3,241
CDS	EUR (4,571)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(294)	266
CDS	EUR 260,000	ファンドはMatterhorn Telecom Holding SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(10,203)	(50,266)
CDS	EUR 200,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(315)	(38,243)
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	26	(44,650)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(15,507)	17,470
CDS	USD 105,930,000	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(18,232)	(1,844,018)
CDS	EUR (10,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(473)	582
CDS	USD 106,001,000	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(67,621)	(1,845,253)
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(10,785)	(223,250)
CDS	EUR (180,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(8,505)	10,482
CDS	EUR 400,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(6,356)	(76,485)
CDS	EUR 400,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(8,617)	24,336
CDS	USD 3,300,000	ファンドはCDX.NA.HY.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(11,014)	(223,358)
CDS	EUR 1,111,000	ファンドはMarks and Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2023	(5,612)	24,310

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 840,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2023	(1,900)	25,577
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	59,209	4,715
CDS	USD (4,030,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	38,108	(323,806)
CDS	USD 1,650,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(11,914)	19,229
CDS	USD (335,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	10,669	(26,917)
CDS	USD 4,906,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(26,112)	57,173
CDS	USD 940,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(6,281)	10,955
CDS	USD (343,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/9/2058	9,027	(27,560)
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(55,284)	(12,646)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(23,295)	(80,239)
CDS	USD 2,930,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2022	(31,569)	(208,034)
CDS	USD 1,785,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2023	187,602	313,146
CDS	USD 5,291,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2023	21,515	47,422
CDS	USD 1,845,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2023	161,459	216,703
CDS	USD 1,846,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2023	167,046	216,820
CDS	USD (1,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	36,987	(100,436)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(44,907)	(10,160)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (284,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	12,129	(22,819)
CDS	USD 4,702,016	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(36,134)	(37,783)
CDS	USD 5,390,596	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(45,040)	(43,316)
CDS	USD 3,344,530	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(27,521)	(26,875)
CDS	EUR (410,000)	ファンドはScandinavian Airlines Systemに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2019	51,805	13,865
CDS	EUR 70,000	ファンドはAtlantia SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2019	(288)	997
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	70,313	44,401
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(13,497)	(15,507)
CDS	EUR 330,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(5,105)	(37,006)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(44,051)	(34,651)
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(13,801)	(16,933)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(14,247)	(15,783)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(12,734)	(15,507)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(10,614)	(16,072)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはItochu Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(12,893)	(15,507)
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(27,278)	(31,566)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.EUR.27.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	246,021	78,696

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 220,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(3,676)	(13,491)
CDS	EUR 440,000	ファンドはConstellium NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2021	(5,633)	(62,110)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはWind Acquisition Finance SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2022	1,218	61,384
CDS	EUR (600,000)	ファンドはCommerzbank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2022	156	(22,158)
CDS	EUR (240,000)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	752	32,432
CDS	EUR 672,000	ファンドはBarclays Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	2,784	6,437
CDS	EUR 736,000	ファンドはBarclays Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	3,244	7,050
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(10,058)	(18,478)
CDS	EUR 700,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(7,603)	(148,857)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	1,234	22,973
CDS	EUR 970,000	ファンドはTelefonica SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(1,552)	(6,171)
CDS	JPY 51,630,000	ファンドはSoftbank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(9,531)	20,641
CDS	EUR 200,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	1,982	(10,929)
CDS	USD 1,731,857	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	147,063	203,413
CDS	EUR (700,000)	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(10,845)	(16,967)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (140,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	779	22,516
CDS	EUR (660,000)	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(10,427)	(15,998)
CDS	EUR (194,805)	ファンドはThomas Cook Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	695	26,325
CDS	EUR (190,000)	ファンドはTDC A/Sに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	10,482	(7,686)
CDS	EUR (270,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(33,944)	(62,363)
CDS	EUR 150,000	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(2,232)	(28,682)
CDS	EUR 102,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(1,883)	1,365
CDS	EUR 250,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	1,882	9,909
CDS	EUR 68,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(964)	910
CDS	EUR (100,000)	ファンドはArdagh Packaging Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	80	14,052
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(1,699)	(44,650)
CDS	EUR 150,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	4,134	5,946
CDS	EUR 200,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(2,265)	(44,650)
CDS	EUR 230,000	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(1,933)	(43,051)
CDS	USD 1,890,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	205,234	331,566

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (938,301)	ファンドはBeazer Homes USA Inc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	(4,772)	37,046
CDS	EUR 700,000	ファンドはDaimler AGに係るデ フォルト・プロテクションを受け 取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	949	(7,297)
CDS	USD (562,981)	ファンドはBeazer Homes USA Inc 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	(3,462)	22,227
CDS	EUR 447,000	ファンドはLanxessに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	3	(8,840)
CDS	EUR 710,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	3,706	(127)
CDS	USD 1,670,000	ファンドはChina Government Bond に係るデフォルト・プロテクショ ンを受け取り、1%の固定金利を 支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(4,724)	(29,937)
CDS	EUR (40,000)	ファンドはThomas Cook Group Plc に係るデフォルト・プロテクショ ンを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	204	5,405
CDS	JPY 64,440,000	ファンドはSoftbank Group Corpに 係るデフォルト・プロテクション を受け取り、1%の固定金利を支 払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(15,029)	25,762
CDS	EUR (610,000)	ファンドはThomas Cook Group Plc に係るデフォルト・プロテクショ ンを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	3,106	82,432
CDS	EUR 100,000	ファンドはUPC Holding BVに係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(569)	(19,121)
CDS	EUR 5,410,000	ファンドはITRAXX.X0.29.V1に係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	273	(545,461)
CDS	USD 33,350,000	ファンドはCDX.NA.HY.30.V1に係る デフォルト・プロテクションを受け 取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(34,724)	(2,257,273)
CDS	EUR 500,000	ファンドはNext Plcに係るデフォ ルト・プロテクションを受け取 り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(262)	4,819
CDS	EUR (330,000)	ファンドはConstellium NVに係る デフォルト・プロテクションを提 供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	10,658	50,178
CDS	EUR (440,000)	ファンドはConstellium NVに係る デフォルト・プロテクションを提 供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(5,700)	66,905
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデ フォルト・プロテクションを受け 取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(47,353)	(4,715)
CDS	USD (1,400,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデ フォルト・プロテクションを提供 し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	58,417	(22,084)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (430,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/10/2057	38,487	(6,783)
CDS	USD (2,280,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	93,089	(183,195)
CDS	USD 850,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/9/2058	(7,171)	9,906
CDS	USD (1,058,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	33,261	(85,009)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	26,812	(90,714)
CDS	USD 2,070,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	228,853	363,144
CDS	USD 3,750,000	ファンドはColombia (Republic of)に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	(28,007)	22,123
CDS	USD 2,014,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	322,346	236,552
CDS	USD 2,970,000	ファンドはBahrain Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	117,098	312,153
CDS	USD 2,015,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	326,673	236,670
CDS	USD 2,756,000	ファンドはArgentine Republic Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	441,105	323,703
CDS	USD 3,710,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2023	402,866	650,853
CDS	USD 810,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(662)	(68,255)
CDS	USD 2,700,000	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(3,235)	(227,516)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(179,718)	(112,273)
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	342,453	110,855
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(49,282)	(55,105)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(44,183)	(47,917)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(16,317)	(13,601)
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(33,032)	(38,680)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(50,833)	(58,601)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Limitedに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(46,876)	(48,762)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(48,142)	(48,641)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(11,018)	(17,259)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(12,122)	(17,259)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(24,244)	(34,518)
CDS	EUR (250,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2022	(41,645)	(52,259)
CDS	EUR 300,000	ファンドはStena ABに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(7,037)	(2,354)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2022	(7,404)	23,524
CDS	EUR 1,357,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	1,231	315
CDS	EUR 1,762,100	ファンドはBayer AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(3,728)	(39,797)
CDS	EUR (320,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	2,776	18,635
CDS	USD 88,482,500	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(83,661)	(1,540,293)
CDS	EUR 400,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	13,775	56,702
CDS	EUR (360,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(13,782)	(83,151)
CDS	EUR 500,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	17,462	70,878
CDS	EUR (10,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(1,280)	(2,310)
CDS	USD 28,950,000	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	66,198	(261,280)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはRio Tinto Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	2,823	(51,205)
CDS	EUR (3,144)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(304)	(726)
CDS	EUR (7,862)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(689)	(1,816)
CDS	EUR (99,178)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(9,600)	(22,908)
CDS	USD (105,890,000)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	488	1,843,321

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (78,616)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(6,889)	(18,158)
CDS	USD 7,700,000	ファンドはKroger Colに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	850	(100,000)
CDS	EUR (148,766)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(14,400)	(34,361)
CDS	USD (12,641,820)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	23,862	220,067
CDS	EUR 2,895,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	2,607	672
CDS	EUR (4,717)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(457)	(1,089)
CDS	EUR 360,000	ファンドはRallye SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	6,602	162,140
CDS	EUR (760,000)	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(39,796)	(66,017)
CDS	EUR 683,000	ファンドはSolvay SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(2,132)	(17,194)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	474	48,249
CDS	USD (35,570,000)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(19,520)	619,199
CDS	USD 7,700,000	ファンドはNordstrom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(113,846)	60,865
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(19,640)	(48,505)
CDS	EUR (47,170)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(4,566)	(10,895)
CDS	USD 7,700,000	ファンドはKohls Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(50,032)	23,866
CDS	EUR 700,000	ファンドはCDX.NA.IG.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	23,221	99,229

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 7,700,000	ファンドはMacys Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(29,090)	168,045
CDS	EUR 1,700,000	ファンドはDeutsche Lufthansa AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	6,453	(19,817)
CDS	EUR 350,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	1	(3,648)
CDS	EUR (247,944)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(21,727)	(57,269)
CDS	EUR 500,000	ファンドはUnitymedia GMBHに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(194)	(115,776)
CDS	EUR (31,447)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(3,044)	(7,263)
CDS	EUR 520,000	ファンドはIntesa Sanpaolo SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	18,413	73,713
CDS	EUR (280,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(35,831)	(64,673)
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(10,237)	(18,478)
CDS	USD 88,482,500	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(111,947)	(1,540,293)
CDS	EUR 100,000	ファンドはSmurfit Kappa Acquisitionsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	515	(22,325)
CDS	USD 100,193,000	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2023	(123,558)	(1,744,148)
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	54,760	(92,401)
CDS	USD 590,000	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、2%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/9/2058	(72,158)	6,876
CDS	USD (507,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	14,845	(40,737)
CDS	USD (857,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	8,445	(68,859)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	728	(2,435)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	14,624	80,239
CDS	EUR (64,571,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/12/2022	(286,129)	852,806
CDS	EUR (10,220,000)	ファンドはITRAXX.EUR.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/12/2022	(80,395)	209,973
CDS	EUR (7,970,000)	ファンドはITRAXX.X0.28.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/12/2022	(224,056)	871,313
CDS	EUR 16,500,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/6/2023	387,325	680,239
CDS	EUR (350,000)	ファンドはBoparan Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/6/2023	23,766	(6,560)
CDS	EUR (1,817,100)	ファンドはITRAXX.EUR.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/6/2023	3,509	31,322
CDS	USD (358,872,000)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/6/2023	(103,398)	6,247,203
CDS	EUR (81,910,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	20/6/2023	(991,845)	676,571
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(22,529)	(13,708)
CDS	EUR 180,000	ファンドはCMA CGM SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2022	16,883	6,855
CDS	EUR (710,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2022	(87,922)	47,229
CDS	EUR (254,572)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(16,381)	14,825
CDS	EUR (300,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(18,519)	17,470
CDS	EUR (760,000)	ファンドはFiat Chrysler Automobiles NVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(22,279)	129,217

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (71,160,000)	ファンドはCDX.NA.IG.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(24,914)	1,238,745
CDS	USD 1,682,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	173,499	295,077
CDS	USD 8,419,484	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	243,837	453,825
CDS	USD 1,337,516	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	25,648	72,095
CDS	EUR 590,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	2,099	(106)
CDS	EUR 1,380,000	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	(4,147)	(247)
CDS	EUR (630,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(52,668)	(145,514)
CDS	EUR 948,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	1,113	220
CDS	EUR (200,000)	ファンドはIntrum ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	2,813	11,647
CDS	EUR (760,000)	ファンドはUnicredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(44,218)	(104,632)
CDS	USD 8,349,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	26,481	74,830
CDS	EUR 1,090,000	ファンドはTelefonica SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2023	(1,158)	(6,935)
CDS	USD (270,000)	ファンドはCMBX.NA.8.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/10/2057	19,633	(4,259)
CDS	USD (1,120,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	26,951	(89,991)
CDS	USD 4,020,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(67,638)	(14,281)
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(56,373)	(12,895)
CDS	USD (830,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	13,402	(66,689)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (910,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	45,007	(73,117)
CDS	USD (860,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	38,291	(69,100)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(31,059)	(7,105)
CDS	USD (1,290,000)	ファンドはCMBX.NA.6.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	11/5/2063	31,178	(19,198)
IFS	GBP 7,220,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.32%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/12/2022	(4,985)	(4,985)
IFS	GBP 9,680,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.296%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/5/2023	(42,142)	(42,142)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/3/2048	8,021	8,021
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	208,584	208,584
IRS	MXN 48,534,715	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.8499992%の固定金利を支払う	Bank of America	1/11/2018	14,263	14,263
IRS	MXN 37,929,872	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.7000016%の固定金利を支払う	Bank of America	6/12/2018	18,305	18,305
IRS	MXN 224,740,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1100008%の固定金利を支払う	Bank of America	18/6/2021	24,124	24,124
IRS	MXN 173,030,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1100008%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2021	398	398
IRS	NOK 83,601,000	ファンドは1.56%の固定金利を受け取り、6ヶ月NOK NIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2021	(14,288)	(14,288)
IRS	DKK 49,805,000	ファンドは6ヶ月DKK CIBORの変動金利を受け取り、0.1175%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2021	(1,037)	(1,037)
IRS	BRL 3,229,099	ファンドは10.82%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2023	(17,532)	(17,532)
IRS	DKK 34,720,000	ファンドは0.3875%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2023	(5,133)	(5,133)
IRS	TWD 213,503,400	ファンドは3ヶ月TWD TAIBORの変動金利を受け取り、1.055%の固定金利を支払う	Bank of America	19/9/2023	(38,299)	(38,299)
IRS	INR 484,574,400	ファンドは7.122%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	(96,583)	(96,583)
IRS	INR 524,955,600	ファンドは7.163%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	(92,386)	(92,386)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	INR 980,000,000	ファンドは7.227%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	(136,784)	(136,784)
IRS	CNY 59,640,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.118%の固定金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	55,730	55,730
IRS	CNY 88,770,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.19%の固定金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	40,112	40,112
IRS	CNY 44,726,250	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.23%の固定金利を支払う	Bank of America	19/12/2023	8,219	8,219
IRS	BRL 6,376,750	ファンドは10.04%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	(157,408)	(157,408)
IRS	BRL 26,162	ファンドは10.7%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	(457)	(457)
IRS	BRL 3,683,939	ファンドは10.8%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	(60,207)	(60,207)
IRS	BRL 2,485,130	ファンドは10.9%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	(37,030)	(37,030)
IRS	BRL 1,842,119	ファンドは10.95%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	(26,491)	(26,491)
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	447,153	447,153
IRS	MXN 90,735,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3100008%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	447,153	447,153
IRS	MXN 10,285,479	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1064008%の固定金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	(54,158)	(54,158)
IRS	MXN 85,520,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1950004%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2028	2,476	2,476
IRS	MXN 65,635,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1500004%の固定金利を支払う	Bank of America	12/6/2028	12,482	12,482
IRS	USD 53,790,000	ファンドは3.022%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/6/2028	617,044	617,044
IRS	ZAR 165,145,885	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.935%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	420,992	420,992
IRS	DKK 16,954,000	ファンドは0.99%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2028	(4,245)	(4,245)
IRS	DKK 6,390,000	ファンドは1.54%の固定金利を受け取り、6ヶ月DKK CIBORの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2048	(11,390)	(11,390)
IRS	EUR 82,605,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.143%の固定金利を支払う	Barclays	18/6/2021	(184,167)	(184,167)
IRS	USD 134,480,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.831%の固定金利を支払う	Barclays	7/2/2022	208,210	208,210
IRS	USD 26,155,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9105%の固定金利を支払う	Barclays	28/8/2022	(6,776)	(6,776)
IRS	EUR 137,810,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.54%の固定金利を支払う	Barclays	28/6/2024	(355,903)	(355,903)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	PLN 82,280,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、3.01%の固定金利を支払う	Barclays	19/9/2028	(216,244)	(216,244)
IRS	EUR 27,200,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.37%の固定金利を支払う	Barclays	20/2/2029	(1,219,934)	(1,219,934)
IRS	EUR 1,470,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、1.38%の固定金利を支払う	Barclays	22/2/2029	(67,402)	(67,402)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.7100012%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	380,424	380,424
IRS	JPY 891,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.393%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/12/2028	3,797	3,797
IRS	JPY 2,780,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6979%の固定金利を支払う	BNP Paribas	18/6/2038	481,115	481,115
IRS	JPY 1,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.913%の固定金利を支払う	BNP Paribas	12/7/2047	270	270
IRS	MXN 393,052,250	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1042984%の固定金利を支払う	Citibank	21/11/2018	(50,256)	(50,256)
IRS	MXN 670,800,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1074988%の固定金利を支払う	Citibank	28/11/2018	(101,149)	(101,149)
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.77%の固定金利を支払う	Citibank	5/12/2018	17,743	17,743
IRS	MXN 37,929,873	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、4.7599992%の固定金利を支払う	Citibank	6/12/2018	17,989	17,989
IRS	BRL 65,085,195	ファンドは9.48%の固定金利を受け取り、1日BRL BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2020	509,077	509,077
IRS	BRL 106,518,910	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.34%の固定金利を支払う	Citibank	4/1/2021	214,342	214,342
IRS	BRL 93,054,090	ファンドは1日BRL BROISの変動金利を受け取り、9.37%の固定金利を支払う	Citibank	4/1/2021	171,862	171,862
IRS	INR 169,325,000	ファンドは7.1975%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Citibank	19/12/2023	(26,475)	(26,475)
IRS	CNY 60,360,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.25%の固定金利を支払う	Citibank	19/12/2023	3,000	3,000
IRS	MXN 86,921,000	ファンドは6.325%の固定金利を受け取り、1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	17/7/2025	(421,299)	(421,299)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1064008%の固定金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,709,430)	(1,709,430)
IRS	PLN 151,920,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、3.103%の固定金利を支払う	Citibank	19/9/2028	(732,425)	(732,425)
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Citigroup	1/11/2021	(3,657,740)	(3,657,740)
IRS	USD 220,844,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6365%の固定金利を支払う	Citigroup	5/3/2023	1,994,532	1,994,532
IRS	USD 112,867,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Citigroup	31/12/2023	(236,929)	(236,929)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 51,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8795%の固定金利を支払う	Citigroup	28/2/2048	394,440	394,440
IRS	USD 177,220,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.915%の固定金利を支払う	Citigroup	27/4/2048	93,092	93,092
IRS	USD 125,626,000	ファンドは2.96625%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Citigroup	13/7/2048	1,288,637	1,288,637
IRS	MXN 1,235,687,404	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.3613988%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2019	226,022	226,022
IRS	GBP 1,850,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.21516%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/6/2023	6,031	12,454
IRS	EUR 2,950,000	ファンドは1.51575%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/7/2044	37,413	42,154
IRS	EUR 1,760,000	ファンドは1.571%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/7/2044	50,642	50,642
IRS	INR 1,250,000,000	ファンドは6.965%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	19/9/2020	(77,787)	(77,787)
IRS	USD 173,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.6502%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	31/1/2021	804,608	804,608
IRS	USD 88,400,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8006%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/2/2021	184,685	184,685
IRS	MXN 253,592,767	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.1049996%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	427,645	427,645
IRS	MXN 193,289,233	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.11%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	14/10/2022	324,163	324,163
IRS	CNY 29,590,000	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動金利を受け取り、3.1825%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	19/12/2023	14,858	14,858
IRS	USD 33,540,000	ファンドは2.7297%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	31/1/2024	(232,783)	(232,783)
IRS	MXN 336,807,890	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、6.3072%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/8/2025	1,662,477	1,662,477
IRS	ZAR 194,300,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.66%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	6/3/2028	710,482	710,482
IRS	ZAR 165,155,886	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.925%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	428,538	428,538
IRS	USD 223,460,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.626%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	14/7/2019	1,979,380	1,979,380
IRS	USD 305,570,000	ファンドは2.765%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2021	(839,491)	(839,491)
IRS	USD 41,300,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.852%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	2/6/2022	45,155	45,155
IRS	JPY 2,528,000,000	ファンドは0.135%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2023	10,946	10,946
IRS	JPY 5,900,500,000	ファンドは0.1432%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	19/9/2023	(19,286)	(19,286)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	PLN 30,460,000	ファンドは2.496%の固定金利を受け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	19/9/2023	21,288	21,288
IRS	MXN 261,414,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、8.1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	6/8/2025	(1,278,100)	(1,278,100)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは3ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、8.1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(919,017)	(919,017)
IRS	EUR 73,090,000	ファンドは0.82426%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	15/8/2027	394,528	394,528
IRS	USD 59,084,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.248%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	8/12/2027	3,077,276	3,077,276
IRS	JPY 1,269,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	22/1/2028	(13,346)	(13,346)
IRS	ZAR 137,210,937	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.895%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	374,772	374,772
IRS	USD 198,130,900	ファンドは2.968%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/7/2028	1,338,396	1,338,396
IRS	JPY 1,000,000,000	ファンドは0.363%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	31/7/2028	(3,660)	(3,660)
IRS	JPY 2,967,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.34%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	19/9/2028	97,238	97,238
IRS	ZAR 56,050,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、8.28%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	19/9/2028	62,169	62,169
IRS	USD 67,625,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	16/2/2029	(496,807)	(496,807)
IRS	JPY 2,739,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6945%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	18/6/2038	490,034	490,034
IRS	EUR 1,590,000	ファンドは1.5826%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/7/2042	53,312	53,312
IRS	JPY 480,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.92%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	12/7/2047	78,198	78,198
IRS	USD 3,430,000	ファンドは3.0335%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/2/2053	76,570	76,570
IRS	USD 611,500,000	ファンドは2.645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	26/1/2021	(1,661,557)	(1,661,557)
IRS	USD 625,900,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.68625%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	26/1/2022	1,220,818	1,220,818
IRS	INR 378,000,000	ファンドは7.2025%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	19/12/2023	(58,029)	(58,029)
IRS	INR 222,000,000	ファンドは7.21%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	HSBC Bank Plc	19/12/2023	(33,133)	(33,133)
IRS	ZAR 191,400,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	6/3/2028	716,982	716,982
IRS	ZAR 163,857,434	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.918%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2028	430,392	430,392

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 471,662,700	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの 変動金利を受け取り、8.1042984% の固定金利を支払う	JP Morgan	21/11/2018	(60,862)	(60,862)
IRS	MXN 380,532,808	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの 変動金利を受け取り、8.1074988% の固定金利を支払う	JP Morgan	28/11/2018	(57,380)	(57,380)
IRS	USD 190,020,000	ファンドは2.59%の固定金利を受 け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	17/9/2019	(190,192)	(190,192)
IRS	USD 194,660,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、2.86%の固定金 利を支払う	JP Morgan	16/9/2020	176,968	176,968
IRS	INR 1,250,000,000	ファンドは6.9775%の固定金利を 受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動 金利を支払う	JP Morgan	19/9/2020	(73,749)	(73,749)
IRS	BRL 16,868,978	ファンドは12.17%の固定金利を受 け取り、1日BRL BROISの変動金利 を支払う	JP Morgan	4/1/2021	477,190	477,190
IRS	USD 89,520,000	ファンドは2.8425%の固定金利を 受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動 金利を支払う	JP Morgan	6/4/2021	(61,468)	(61,468)
IRS	USD 71,400,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、2.6015%の固定 金利を支払う	JP Morgan	22/1/2022	420,854	420,854
IRS	USD 89,520,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、2.845%の固定金 利を支払う	JP Morgan	6/4/2022	39,756	39,756
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受 け取り、1日BRL BROISの変動金利 を支払う	JP Morgan	2/1/2023	225,940	225,940
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受 け取り、1日BRL BROISの変動金利 を支払う	JP Morgan	2/1/2023	(436,599)	(436,599)
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受 け取り、1日BRL BROISの変動金利 を支払う	JP Morgan	2/1/2023	(92,532)	(92,532)
IRS	USD 83,210,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動 金利を受け取り、2.2055%の固定 金利を支払う	JP Morgan	22/1/2023	2,232,519	2,232,519
IRS	USD 96,410,000	ファンドは2.5563%の固定金利を 受け取り、1日USD LIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	28/2/2023	(78,215)	(78,215)
IRS	USD 148,370,000	ファンドは2.5563%の固定金利を 受け取り、1日USD LIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	28/2/2023	(120,370)	(120,370)
IRS	JPY 5,900,500,000	ファンドは0.1425%の固定金利を 受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動 金利を支払う	JP Morgan	19/9/2023	(21,151)	(21,151)
IRS	PLN 32,340,000	ファンドは2.427%の固定金利を受 け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	19/9/2023	(5,720)	(5,720)
IRS	PLN 30,950,000	ファンドは2.52%の固定金利を受 け取り、6ヶ月PLN WIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	19/9/2023	31,058	31,058
IRS	TWD 307,236,600	ファンドは3ヶ月TWD TAIBORの変 動金利を受け取り、1.055%の固定 金利を支払う	JP Morgan	19/9/2023	(55,112)	(55,112)
IRS	CNY 74,543,750	ファンドは3ヶ月CNY CNRRの変動 金利を受け取り、3.185%の固定金 利を支払う	JP Morgan	19/12/2023	36,181	36,181
IRS	USD 373,357,000	ファンドは2.922%の固定金利を受 け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金 利を支払う	JP Morgan	25/2/2024	585,212	585,212
IRS	USD 155,070,000	ファンドは2.9185%の固定金利を 受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動 金利を支払う	JP Morgan	23/8/2024	190,463	190,463

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	ZAR 181,523,858	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、7.94%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	458,611	458,611
IRS	USD 64,611,000	ファンドは3.066%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	JP Morgan	6/9/2028	986,446	986,446
IRS	JPY 2,967,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.34075%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/9/2028	95,238	95,238
IRS	PLN 89,000,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、2.9775%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/9/2028	(165,698)	(165,698)
IRS	PLN 100,130,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、3.02%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/9/2028	(286,767)	(286,767)
IRS	ZAR 104,450,000	ファンドは3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を受け取り、8.34%の固定金利を支払う	JP Morgan	19/9/2028	87,085	87,085
IRS	USD 145,815,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.127%の固定金利を支払う	JP Morgan	18/5/2048	(6,329,486)	(6,329,486)
IRS	GBP 13,050,000	ファンドは1.1425%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	19/4/2020	21,020	21,020
IRS	GBP 13,360,000	ファンドは1.0215%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	10/5/2020	(11,614)	(11,614)
IRS	MXN 651,116,400	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.1034992%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/2/2021	(314,848)	(314,848)
IRS	USD 79,558,000	ファンドは2.6975%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	15/3/2021	(254,397)	(254,397)
IRS	USD 239,600,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.868%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	18/3/2021	242,487	242,487
IRS	USD 1,120,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.014%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/5/2021	(1,893)	(1,893)
IRS	USD 79,610,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0595%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	18/6/2021	(189,040)	(189,040)
IRS	EUR 60,391,000	ファンドは0.306%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	10/8/2021	44,194	44,194
IRS	SEK 545,472,000	ファンドは0.4125%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	10/8/2021	(30,078)	(30,078)
IRS	EUR 65,570,000	ファンドは0.235%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	20/8/2021	(13,964)	(13,964)
IRS	CAD 11,954,000	ファンドは2.4825%の固定金利を受け取り、6ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2021	3,765	3,765
IRS	GBP 6,145,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.1735%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2021	9,176	9,176
IRS	AUD 9,058,000	ファンドは3ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.1005%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2021	(13,774)	(13,774)
IRS	SEK 80,183,000	ファンドは0.072%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2021	(2,140)	(2,140)
IRS	USD 18,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9995%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	3/9/2021	(23,692)	(23,692)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 57,770,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9495%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	2/3/2022	(45,867)	(45,867)
IRS	USD 9,595,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.884%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	7/4/2022	3,684	3,684
IRS	USD 4,140,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.027%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	11/5/2022	(9,091)	(9,091)
IRS	USD 41,500,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0625%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	12/5/2022	(118,370)	(118,370)
IRS	USD 41,020,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.182%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/5/2022	(207,222)	(207,222)
IRS	USD 20,470,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0615%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/6/2022	(57,946)	(57,946)
IRS	USD 20,470,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0645%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/6/2022	(59,082)	(59,082)
IRS	USD 20,330,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.025%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/6/2022	(44,085)	(44,085)
IRS	USD 20,320,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.033%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/6/2022	(47,070)	(47,070)
IRS	USD 100,970,000	ファンドは2.955%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	19/7/2022	93,021	93,021
IRS	USD 70,170,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.066%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	28/7/2022	(209,706)	(209,706)
IRS	USD 61,120,000	ファンドは2.689%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	3/4/2023	(429,411)	(429,411)
IRS	GBP 1,770,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.412%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/4/2023	(8,571)	(8,571)
IRS	USD 149,901,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	4/5/2023	(503,765)	(503,765)
IRS	GBP 5,430,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.332%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	10/5/2023	(1,288)	(1,288)
IRS	USD 80,820,000	ファンドは2.891%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	16/7/2023	142,353	142,353
IRS	GBP 3,460,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.316%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2023	7,311	7,311
IRS	AUD 5,550,000	ファンドは6ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.4125%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2023	(13,676)	(13,676)
IRS	EUR 4,672,000	ファンドは0.265%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2023	(2,542)	(2,542)
IRS	SEK 46,751,000	ファンドは0.423%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2023	(4,500)	(4,500)
IRS	USD 4,408,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8415%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2023	2,368	2,368
IRS	USD 117,554,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	4/9/2023	(266,743)	(266,743)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	JPY 1,320,000,000	ファンドは0.158%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	19/9/2023	4,505	4,505
IRS	USD 126,327,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.985%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	25/10/2023	(687,366)	(687,366)
IRS	USD 212,270,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.896%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/7/2024	(146,894)	(146,894)
IRS	USD 154,280,000	ファンドは2.928%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	21/8/2024	257,572	257,572
IRS	USD 111,870,000	ファンドは2.927%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	19/7/2026	28,844	28,844
IRS	USD 6,493,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2026	(9,511)	(9,511)
IRS	USD 7,550,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.245%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/1/2027	355,357	355,478
IRS	USD 65,700,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.825%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	6/2/2028	338,437	338,437
IRS	USD 1,880,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	14/3/2028	(2,730)	(2,730)
IRS	USD 860,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.854%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/3/2028	2,277	2,277
IRS	USD 141,480,000	ファンドは3.005%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	26/4/2028	1,410,340	1,410,340
IRS	USD 365,720,000	ファンドは2.965%の固定金利を受け取り、6ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/4/2028	2,398,613	2,398,613
IRS	USD 45,185,000	ファンドは3.045%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/4/2028	603,890	603,890
IRS	USD 22,590,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0535%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	27/4/2028	(318,248)	(318,248)
IRS	USD 93,415,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.015%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	30/4/2028	(1,024,501)	(1,024,501)
IRS	USD 93,020,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.91335161%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/5/2028	(63,225)	(83,813)
IRS	GBP 6,610,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.6556%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	17/5/2028	(126,168)	(97,979)
IRS	USD 101,705,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0325%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	14/6/2028	(1,258,846)	(1,258,846)
IRS	USD 55,010,000	ファンドは3.001%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	18/6/2028	531,465	531,465
IRS	USD 67,050,000	ファンドは3.0075%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	18/6/2028	685,353	685,353
IRS	USD 41,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9185%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/7/2028	(102,831)	(102,831)
IRS	USD 188,206,800	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.91%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	17/7/2028	(323,344)	(323,344)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 740,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.954%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/7/2028	(4,076)	(4,076)
IRS	USD 12,930,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9395%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/8/2028	(54,045)	(54,045)
IRS	CAD 2,920,000	ファンドは6ヶ月CAD CDORの変動金利を受け取り、2.624%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2028	(1,214)	(1,214)
IRS	GBP 1,698,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.527%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2028	3,298	3,298
IRS	EUR 2,285,000	ファンドは0.866%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2028	(1,597)	(1,597)
IRS	SEK 23,698,000	ファンドは1.108%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2028	(3,948)	(3,948)
IRS	USD 7,190,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.894%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2028	(1,325)	(1,325)
IRS	USD 2,285,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.896%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2028	(821)	(821)
IRS	USD 4,345,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.967%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	31/8/2028	(30,148)	(30,148)
IRS	JPY 666,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.357%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	19/9/2028	11,653	11,653
IRS	USD 95,070,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.94718079%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	15/2/2044	(91,114)	(190,367)
IRS	USD 36,395,000	ファンドは3.075%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	27/4/2048	1,185,242	1,185,242
IRS	GBP 2,460,000	ファンドは1.75522%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	17/5/2048	115,567	92,163
IRS	USD 36,450,000	ファンドは3.132%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	18/5/2048	1,619,952	1,619,952
IRS	USD 55,674,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.916%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	13/7/2048	10,285	10,285
IRS	GBP 621,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.614%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	22/8/2048	4,722	4,722
IRS	AUD 1,232,000	ファンドは6ヶ月AUD BBSWの変動金利を受け取り、2.919%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	23/8/2048	(7,303)	(7,303)
IRS	EUR 863,000	ファンドは1.456%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2048	(3,979)	(3,979)
IRS	SEK 9,339,000	ファンドは1.695%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2048	(10,118)	(7,792)
IRS	USD 944,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9255%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	24/8/2048	(1,725)	(1,725)
IRS	GBP 8,800,000	ファンドは0.8%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2019	(27,901)	(27,901)
IRS	USD 324,000,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.19%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	3/12/2020	4,337,586	4,337,586

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 583,560,000	ファンドは2.305%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	17/12/2020	(3,561,147)	(3,561,147)
IRS	USD 583,560,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.343%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/12/2021	2,995,303	2,995,303
IRS	JPY 1,475,000,000	ファンドは0.1055%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	6/10/2022	(5,374)	(5,374)
IRS	JPY 907,000,000	ファンドは0.146%の固定金利を受け取り、6ヶ月JPY LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	9/8/2023	1,341	1,341
IRS	INR 338,650,000	ファンドは7.15%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	19/12/2023	(62,103)	(62,103)
IRS	INR 600,000,000	ファンドは7.15%の固定金利を受け取り、6ヶ月INR MIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	19/12/2023	(110,031)	(110,031)
IRS	MXN 174,450,000	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、8.1100008%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/7/2025	(847,976)	(847,976)
IRS	JPY 605,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.286%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	6/10/2027	21,361	21,361
IRS	JPY 451,000,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3835%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	9/8/2028	(6,230)	(6,230)
IRS	USD 63,220,000	ファンドは3.046%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	4/9/2028	850,532	850,532
IRS	USD 61,341,000	ファンドは3.026%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	5/9/2028	717,069	717,069
IRS	USD 64,596,000	ファンドは3.06%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Morgan Stanley	6/9/2028	952,221	952,221
IRS	JPY 2,780,500,000	ファンドは6ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.702%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	18/6/2038	461,406	461,406
IRS	USD 3,280,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.00531%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	15/11/2043	(44,839)	(44,839)
IRS	GBP 4,140,000	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、1.108%の固定金利を支払う	UBS	3/10/2022	39,901	39,901
IRS	MXN 144,525,723	ファンドは1ヶ月MXN MXIBTIIIEの変動金利を受け取り、7.6399992%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	228,338	228,338
IRS	EUR 2,090,000	ファンドは1.92%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	UBS	20/1/2048	24,184	24,184
TRS	USD (61,905)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを受け取り、Superior Energy Services Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	7/2/2019	30,333	30,333
TRS	USD (2,566)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを受け取り、Charter Communications Inc Class A + 0bpsを支払う	BNP Paribas	27/8/2019	(20,138)	(20,138)
TRS	USD (129,513)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 7.5bpsを受け取り、Weatherford International Plc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	30/8/2019	660	660
TRS	USD (1,294)	ファンドは1ヶ月USD BBA LIBOR + 10bpsを受け取り、Charter Communications Inc Class A + 0bpsを支払う	Citibank	6/8/2019	(12,835)	(12,835)

スワップ 2018年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	EUR 1,250,000	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx EUR Contingent Conver + Obpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2018	(3,740)	(3,540)
TRS	EUR 4,831,948	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2018	(75,311)	(76,274)
TRS	EUR 5,568,052	ファンドは3ヶ月EUR BBA EURIBOR + Obpsを受け取り、Markit iBoxx EUR Liquid High Yield + Obpsを支払う	JP Morgan	20/9/2018	(92,063)	(93,085)
TRS	USD (11,000)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、American Express + Obpsを支払う	Merrill Lynch	14/12/2018	(69,190)	(69,190)
TRS	USD (3,567)	ファンドは3ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、O'Reilly Automotive Inc + Obpsを支払う	Merrill Lynch	28/2/2019	(220,155)	(220,155)
VAR	EUR 61,964,000	1mn EURvegaインデックス 行使価格EUR/USD 7.75	Deutsche Bank	4/12/2018	(127,421)	(127,421)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 14,415,642,006米ドル)					18,005,372	24,892,786

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

VAR: バリエーション・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション 2018年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
10,420,000	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 21.169	5/9/2018	(360,428)	-
37,287,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.145	6/9/2018	143,585	712,445
35,535,000	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.285	7/9/2018	(149,064)	13,686
13,880,000	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 18.5	14/9/2018	(8,361)	18,790
3,945,000	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 21	14/9/2018	(2,250)	244
9,458,000	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.735	25/9/2018	(14,227)	18,258
37,040,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.32	15/11/2018	(112,863)	116
25,765,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.26	15/11/2018	(287,007)	6,613
18,644,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.2	20/11/2018	(3,045)	100,453
19,200,000	コール	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.95	4/12/2018	(30,872)	34,792
19,615,000	プット	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.26	7/9/2018	(14,857)	50
24,858,000	コール	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.315	12/9/2018	(53,957)	62,208
22,372,000	コール	OTC USD/BRL	Barclays	USD 3.9	28/9/2018	1,123,778	1,419,536
49,716,000	コール	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.7525	24/10/2018	(298,330)	61,980
42,259,000	プット	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.285	15/11/2018	10,672	304,372
7,755,000	コール	OTC USD/TWD	BNP Paribas	USD 31.1	6/9/2018	(14,956)	1,485
71,654,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.1275	13/9/2018	(447,874)	13,379
38,760,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.1345	13/9/2018	(397,214)	16,805
8,751,400	プット	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.295	17/9/2018	(15,078)	27,760
8,751,400	コール	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 69	21/9/2018	(31,071)	83,835
18,644,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4	28/9/2018	547,381	826,724
36,875,000	プット	OTC EUR/CNH	BNP Paribas	EUR 7.45	8/10/2018	(169,166)	10,800
16,390,000	プット	OTC EUR/CNH	BNP Paribas	EUR 7.5	8/10/2018	(106,434)	5,203
37,000,000	プット	OTC EUR/CNY	BNP Paribas	EUR 7.6	8/10/2018	(127,770)	41,863
49,716,000	プット	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.6	10/10/2018	(373,666)	19,090
24,858,000	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4	10/10/2018	855,194	1,222,098
34,801,000	コール	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.75	10/10/2018	951,170	5,127,290
24,858,000	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 15.2	10/10/2018	7,189	406,160
23,615,000	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.2	7/11/2018	(404,079)	33,979
22,372,200	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 13.9	13/11/2018	(265,017)	218,894
25,765,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.3	15/11/2018	(7,387)	407
17,772,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.15	20/11/2018	32,668	154,254
17,772,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.25	20/2/2019	3,569	76,749
17,083,000	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.7277	5/9/2018	74,634	119,256
17,083,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.7424	5/9/2018	(912)	67
15,630,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20.5	5/9/2018	(405,660)	52
144,205,000	プット	OTC NOK/SEK	Citibank	NOK 1.06	6/9/2018	(118,229)	62
56,535,569	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.7245	7/9/2018	18,723	302,700
18,900,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.135	12/9/2018	(126,596)	6,977
71,654,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.11	13/9/2018	(35,056)	861
50,242,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.155	13/9/2018	(166,374)	139,986
54,132,000	コール	OTC USD/KRW	Citibank	USD 1,160	13/9/2018	(351,528)	6,825
2,406,000	コール	OTC USD/KRW	Citibank	USD 1,193	13/9/2018	(226,638)	4,338
12,429,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.2	13/9/2018	(17,590)	121
4,975,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20.5	14/9/2018	(3,093)	1,883

買建オプション 2018年8月31日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
9,458,000	コール	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.74	19/9/2018	(27,957)	7,292
71,540,000	プット	OTC NOK/SEK	Citibank	NOK 1.04	19/9/2018	(5,062)	139
71,540,000	プット	OTC NOK/SEK	Citibank	NOK 1.04	19/9/2018	(3,746)	138
49,716,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1	20/9/2018	(48,427)	1,607
37,287,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1	20/9/2018	(1,410)	1,205
16,698,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 114	20/9/2018	(74,600)	4,715
9,903,750	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.75	21/9/2018	(71,997)	45,149
47,392,000	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 1	26/9/2018	7,813	18,002
18,644,000	プット	OTC NZD/USD	Citibank	NZD 0.66	27/9/2018	(60,908)	90,551
22,372,000	コール	OTC NZD/USD	Citibank	NZD 0.6725	11/10/2018	(29,211)	86,274
861,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.14	16/10/2018	195,380	347,733
37,287,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.15	18/10/2018	464,881	865,353
7,220,400	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 14.5	18/10/2018	(24,786)	137,674
16,674,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19	19/10/2018	(95,641)	225,333
4,972,000	コール	OTC USD/NOK	Citibank	USD 8.6	22/10/2018	(3,637)	20,693
21,326,000	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19.25	25/10/2018	45,537	454,357
24,858,000	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 18.25	31/10/2018	(194,104)	110,568
20,293,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	6/11/2018	(274,328)	79,112
49,716,000	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.33	15/11/2018	(21,075)	306,553
503,737,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 107	15/11/2018	(1,522,963)	2,358,330
23,696,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.5	26/11/2018	(175,019)	148,668
29,620,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 113	28/11/2018	(60,628)	140,224
9,790,000	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 4.1897	3/1/2019	(547,346)	253
328,243,000	プット	OTC GBP/USD	Citibank	GBP 1.275	15/1/2019	1,313,043	5,265,835
328,243,000	コール	OTC GBP/USD	Citibank	GBP 1.375	15/1/2019	(2,780,970)	2,053,822
23,615,000	プット	OTC USD/NOK	Citibank	USD 8	22/1/2019	(24,165)	214,139
12,429,000	プット	OTC USD/CHF	Citibank	USD 0.95	11/2/2019	89,328	201,997
41,468,000	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 1	14/2/2019	24,438	190,311
143,080,000	プット	OTC NOK/SEK	Credit Suisse	NOK 1.06	19/9/2018	(82,904)	5,439
10,920,000	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 12.55	4/9/2018	(252,143)	-
9,943,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 21.5	5/9/2018	(161,375)	-
6,214,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19	5/9/2018	(12,946)	22,225
3,141,500	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.5	5/9/2018	(22,765)	10
21,117,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.145	11/9/2018	(76,439)	19,028
37,287,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.5	13/9/2018	(324,947)	45,313
8,337,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	13/9/2018	131,337	190,613
6,214,500	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	13/9/2018	97,900	142,086
12,429,000	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14	13/9/2018	(88,885)	15,643
10,250,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20	14/9/2018	(89,552)	15,613
9,943,000	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.75	18/9/2018	(65,260)	35,959
10,223,200	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 31	20/9/2018	(22,333)	12,017
3,932,000	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 31	20/9/2018	(8,353)	4,622
14,262,800	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	21/9/2018	210,200	345,699
12,429,000	コール	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 111	26/9/2018	(62,691)	72,661
12,429,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 110.5	26/9/2018	(58,539)	84,767
10,663,000	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 14.75	26/9/2018	58,483	223,440

買建オプション 2018年8月31日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
49,716,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 108	28/9/2018	(139,031)	90,657
10,471,000	コール	OTC USD/KRW	Deutsche Bank	USD 1,175	1/10/2018	(90,715)	3,943
87,003,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18	4/10/2018	(112,899)	95,039
20,830,000	プット	OTC EUR/CNH	Deutsche Bank	EUR 7.35	8/10/2018	(118,956)	5,512
16,045,000	プット	OTC EUR/CNH	Deutsche Bank	EUR 7.35	8/10/2018	(101,292)	4,245
37,500,000	プット	OTC EUR/PLN	Deutsche Bank	EUR 4.05	8/10/2018	(42,149)	632
20,840,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 103	9/10/2018	(137,810)	3,068
22,372,000	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.5	10/10/2018	3,216,127	4,058,880
16,100,000	コール	OTC USD/CNH	Deutsche Bank	USD 7	11/10/2018	(48,642)	41,196
5,924,000	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 15.25	25/10/2018	20,243	118,463
24,858,000	プット	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.25	31/10/2018	(5,694)	88,614
20,293,000	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 99	6/11/2018	(17,530)	2,358
37,040,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.28	15/11/2018	(620,692)	2,565
35,770,000	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 31	15/11/2018	(54,653)	156,748
14,785,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.29	16/11/2018	(14,271)	546
18,957,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.25	26/11/2018	(57,079)	119,789
19,000,000	プット	OTC USD/INR	Deutsche Bank	USD 68	19/12/2018	(2,499)	25,811
24,858,000	プット	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.2	31/1/2019	18,487	127,479
25,047,000	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 31	19/7/2019	(48,491)	275,868
22,372,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20.75	5/9/2018	(94,403)	8
20,670,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19.25	5/9/2018	(825,673)	78,412
18,644,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.5	5/9/2018	(52,875)	3,056
25,122,000	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.25	7/9/2018	(129,202)	-
9,458,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 109.5	12/9/2018	(53,072)	15,025
7,276,000	プット	OTC USD/TRY	Goldman Sachs	USD 4.48	12/9/2018	(137,604)	-
6,215,000	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4	13/9/2018	153,746	235,107
9,458,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 110	13/9/2018	(25,464)	25,287
22,372,000	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 13.75	13/9/2018	(196,070)	8,122
5,125,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 21	14/9/2018	(2,656)	316
5,125,000	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 21	14/9/2018	(2,246)	316
49,716,000	コール	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 113	17/9/2018	(194,303)	31,408
11,466,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20.5	18/9/2018	580,079	810,400
746,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.11	20/9/2018	(73,656)	15,356
38,693,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.5	25/9/2018	(420,743)	107,301
18,644,000	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 12.5	26/9/2018	(75,982)	141
18,644,000	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 12.5	26/9/2018	(70,463)	141
7,115,000	プット	OTC AUD/NOK	Goldman Sachs	AUD 5.7	3/10/2018	2,140	5,189
13,765,000	コール	OTC AUD/USD	Goldman Sachs	AUD 0.75	12/10/2018	(8,440)	13,536
25,123,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 19	31/10/2018	138,957	376,520
25,123,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18	31/10/2018	5,068	72,297
19,980,000	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.25	16/11/2018	(116,938)	9,737
20,941,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 94	15/2/2019	(212,596)	18,090
74,574,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.05	20/3/2019	(108,915)	172,212
16,550,000	プット	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.2814	6/9/2018	(83,505)	8,647
10,340,000	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30.6	6/9/2018	(41,691)	39,064
24,858,000	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.6	20/9/2018	(41,012)	3,036

買建オプション 2018年8月31日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
12,429,000	コール	OTC USD/KRW	HSBC Bank Plc	USD 1,175	1/10/2018	(56,147)	4,681
20,610,000	プット	OTC EUR/CNH	HSBC Bank Plc	EUR 7.5	8/10/2018	(122,697)	6,542
35,500,000	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 30	17/10/2018	576,911	736,305
37,287,000	コール	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.45	1/11/2018	(108,570)	474
37,690,379	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.715	7/9/2018	39,297	55,110
18,845,190	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.715	7/9/2018	14,582	27,555
28,587,000	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.98	12/9/2018	(226,312)	68,666
23,696,000	コール	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.74	13/9/2018	(29,049)	9,389
9,683,000	プット	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 13,800	13/9/2018	(104,164)	316
11,466,000	コール	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19.55	13/9/2018	(120,037)	43,469
106,877,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.165	19/9/2018	(74,551)	822,020
24,858,000	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.5	19/9/2018	1,498,926	2,064,570
19,660,000	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 30	20/9/2018	342,025	418,896
5,504,800	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 31	20/9/2018	(6,575)	6,471
9,903,750	プット	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 18.75	21/9/2018	(42,401)	45,149
5,700,000	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 4.075	28/9/2018	(104,349)	-
12,429,000	プット	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 14,300	1/10/2018	(107,427)	7,388
14,230,000	プット	OTC AUD/NOK	JP Morgan	AUD 5.9	3/10/2018	(77,218)	31,482
31,225,000	プット	OTC EUR/PLN	JP Morgan	EUR 4.15	8/10/2018	(241,666)	13,607
8,751,400	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.35	11/10/2018	(155,992)	13,260
10,390,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.29	16/11/2018	(6,808)	384
24,494,000	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 4.195	2/1/2019	(1,388,937)	657
19,886,000	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13	4/9/2018	(162,449)	-
12,562,000	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 21.169	5/9/2018	(141,787)	-
9,458,000	プット	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.15	6/9/2018	(57,650)	5,129
24,858,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14.25	19/9/2018	304,300	926,346
24,858,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4	20/9/2018	(173,130)	148,583
11,850,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.08	20/9/2018	55,024	329,174
12,429,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.5	26/9/2018	(117,781)	133
33,123,000	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 12.9035	26/9/2018	(290,082)	2,229
24,858,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.9	28/9/2018	1,205,898	1,577,276
32,760,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18	4/10/2018	(18,137)	35,786
19,500,000	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4	10/10/2018	464,356	958,681
24,858,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14	10/10/2018	1,157,611	1,441,613
50,247,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 17.75	24/10/2018	(333,866)	70,220
16,641,000	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 114	26/10/2018	(36,177)	27,558
30,990,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 104	6/11/2018	(288,624)	45,821
12,429,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.5	13/11/2018	(15,227)	13,658
37,287,000	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.5	14/2/2019	(131,686)	157,660
9,950,000	プット	OTC USD/CAD	RBS Plc	USD 1.26	7/9/2018	(4,253)	26
55,204,000	プット	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.722	13/9/2018	(126,904)	287,523
36,176,000	プット	OTC GBP/USD	RBS Plc	GBP 1.2695	13/9/2018	(387,118)	27,722
24,858,000	プット	OTC EUR/USD	RBS Plc	EUR 1.13	20/9/2018	(155,793)	19,072
17,772,000	コール	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.74	3/10/2018	(32,100)	29,532
10,004,400	コール	OTC USD/BRL	RBS Plc	USD 3.8	5/10/2018	670,159	865,945

買建オプション 2018年8月31日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
19,500,000	コール	OTC USD/BRL	RBS Plc	USD 3.85	10/10/2018	842,259	1,502,139
17,305,000	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.295	7/9/2018	(54,170)	23,510
35,544,000	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.33	12/9/2018	15,102	25,765
55,931,000	コール	OTC USD/JPY	Royal Bank of Canada	USD 113	28/9/2018	(154,741)	73,083
37,287,000	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.37	15/11/2018	23,803	66,560
21,317,000	コール	OTC USD/MXN	UBS	USD 21.5	5/9/2018	(165,207)	-
12,429,000	プット	OTC USD/JPY	UBS	USD 108	29/10/2018	(45,697)	56,532
1,075	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	14/12/2018	(52,014)	16,797
363	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.25	14/12/2018	(7,362)	56,719
875	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 98	16/12/2019	(154,446)	98,437
714	コール	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.25	12/10/2018	(63,567)	62,475
70	プット	3 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 2,675	16/11/2018	(77,189)	61,250
8,742	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 18	19/9/2018	(138,268)	480,810
6,658	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 16	19/9/2018	(540,630)	532,640
50	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,350	21/9/2018	(16,667)	15,128
49	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,300	19/10/2018	(10,020)	21,840
146	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,500	16/11/2018	(19,152)	55,728
106	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,550	16/11/2018	(7,870)	23,376
80	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,400	16/11/2018	8,515	85,371
515	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 110	19/10/2018	(27,069)	33,712
936	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 112.5	16/11/2018	(39,078)	62,631
1,149	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.375	18/3/2019	(121,287)	186,713
3,421	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.75	17/6/2019	(5,234)	256,575
693	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.5	17/6/2019	(1,060)	95,287
686	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.5	16/3/2020	(69,650)	240,100
321	プット	iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	Exchange Traded	USD 102.5	19/10/2018	(8,121)	17,655
66	プット	Mylan NV	Exchange Traded	USD 37.5	19/10/2018	(6,848)	5,808
36	コール	NASDAQ 100 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 7,575	21/9/2018	267,446	554,760
131	コール	PG&E Corp	Exchange Traded	USD 49	18/1/2019	2,247	38,972
60	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,850	21/9/2018	(34,204)	72,000
11	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,720	21/9/2018	(60,704)	3,630
13	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,800	19/10/2018	(20,673)	23,855
7	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,825	19/10/2018	(182)	15,365
23	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,850	16/11/2018	(16,300)	99,705
1,217	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	3/9/2018	21,663	48,680
3,257	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 287	7/9/2018	56,137	177,506

買建オプション 2018年8月31日(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
10,097	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 273	21/9/2018	(2,069,981)	413,977
8,908	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 291	21/9/2018	1,070,093	1,933,036
7,344	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	21/9/2018	(295,229)	514,080
6,841	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 290	21/9/2018	662,209	1,867,593
1,629	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 285	21/9/2018	64,020	230,503
4,896	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 292	28/9/2018	(111,139)	937,584
29,109	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	19/10/2018	(2,402,515)	5,690,809
20,828	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	19/10/2018	(1,856,208)	3,540,760
1,294	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 281	19/10/2018	(508,154)	272,387
666	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 270	19/10/2018	(111,709)	69,264
808	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 280	16/11/2018	(72,882)	271,488
1,365	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 285	21/12/2018	944,989	1,560,877
3,235	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	20/12/2019	772,850	4,868,675
1,005	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119.5	21/9/2018	(127,512)	102,070
167	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119	21/9/2018	(95,484)	6,523
685	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 113.5	21/9/2018	52,694	139,140
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 2,394,569,064米ドル)						(10,442,694)	72,460,703

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション 2018年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(10,420,000)	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 22	5/9/2018	264,876	-
(17,305,000)	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.295	7/9/2018	92,485	(23,510)
(29,565,000)	プット	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.26	7/9/2018	42,498	(77)
(10,250,000)	コール	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 20.5	14/9/2018	46,346	(3,879)
(35,500,000)	コール	OTC USD/TWD	Bank of America	USD 30	17/10/2018	(478,931)	(736,305)
(37,287,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.15	18/10/2018	(107,875)	(865,353)
(25,765,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.3	15/11/2018	121,496	(407)
(37,040,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.28	15/11/2018	268,317	(2,565)
(31,073,000)	プット	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.285	12/9/2018	35,685	(28,325)
(37,287,000)	プット	OTC USD/CAD	Barclays	USD 1.3	12/9/2018	18,411	(133,720)
(37,287,000)	コール	OTC USD/BRL	Barclays	USD 4	28/9/2018	(1,369,650)	(1,653,404)
(12,429,000)	コール	OTC AUD/USD	Barclays	AUD 0.7725	24/10/2018	25,749	(2,770)
(24,858,000)	プット	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.2	7/9/2018	350,471	(27)
(18,900,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.135	12/9/2018	155,917	(6,977)
(71,654,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.11	13/9/2018	190,282	(861)
(12,429,000)	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 14	13/9/2018	137,880	(15,643)
(24,858,000)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 15	13/9/2018	59,782	(211,667)
(8,751,400)	コール	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 71	21/9/2018	15,801	(40,821)
(18,644,000)	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4.1	28/9/2018	(373,174)	(544,264)
(16,390,000)	プット	OTC EUR/CNH	BNP Paribas	EUR 7.6	8/10/2018	180,383	(6,972)
(36,875,000)	プット	OTC EUR/CNH	BNP Paribas	EUR 7.35	8/10/2018	84,157	(9,757)
(24,858,000)	プット	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 3.7	10/10/2018	371,952	(28,262)
(31,073,000)	コール	OTC USD/BRL	BNP Paribas	USD 4.1	10/10/2018	(771,135)	(1,081,865)
(22,372,000)	コール	OTC USD/TRY	BNP Paribas	USD 5.5	10/10/2018	(823,911)	(4,058,880)
(23,696,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.15	18/10/2018	(33,803)	(136,278)
(6,214,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19	5/9/2018	147,773	(22,225)
(31,260,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 21.5	5/9/2018	567,204	-
(37,287,000)	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.145	6/9/2018	(530,490)	(712,445)
(56,535,569)	プット	OTC AUD/USD	Citibank	AUD 0.715	7/9/2018	27,683	(82,664)
(51,850,000)	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.7558	11/9/2018	140,014	(45,275)
(21,117,000)	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.145	12/9/2018	205,428	(22,196)
(62,145,000)	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.33	12/9/2018	85,146	(45,048)
(2,122,500)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19.5	13/9/2018	17,609	(48,528)
(7,131,400)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19.5	21/9/2018	43,719	(172,850)
(29,620,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 112.5	26/9/2018	42,757	(53,120)
(23,696,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.75	26/9/2018	153,459	(45,588)
(24,858,000)	コール	OTC NZD/USD	Citibank	NZD 0.69	11/10/2018	12,696	(19,871)
(24,858,000)	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.17	18/10/2018	(157,891)	(264,174)
(10,830,600)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 13.8	18/10/2018	20,087	(58,110)
(29,620,000)	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 20	25/10/2018	(13,736)	(273,651)
(25,123,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 19	31/10/2018	394,605	(376,520)
(37,287,000)	プット	OTC USD/MXN	Citibank	USD 17.8	31/10/2018	154,202	(73,079)
(20,293,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 99	6/11/2018	69,009	(2,358)
(37,287,000)	コール	OTC USD/CAD	Citibank	USD 1.37	15/11/2018	10,998	(66,560)
(629,671,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 104	15/11/2018	1,021,477	(1,239,041)

売建オプション 2018年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(31,073,000)	プット	OTC USD/NOK	Citibank	USD 7.9	20/11/2018	18,324	(74,032)
(41,468,000)	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 1	28/11/2018	(22,948)	(104,640)
(9,790,000)	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 3.7588	3/1/2019	126,122	(17)
(143,080,000)	プット	OTC NOK/SEK	Credit Suisse	NOK 1.04	19/9/2018	31,739	(277)
(20,670,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.25	5/9/2018	1,433,599	(78,412)
(37,287,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.5	5/9/2018	176,221	(6,113)
(12,429,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	13/9/2018	207,893	(284,171)
(62,145,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.1	13/9/2018	265,760	(12,028)
(14,195,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 21	14/9/2018	46,393	(876)
(19,886,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 20.5	18/9/2018	69,180	(15,137)
(3,932,000)	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 30	20/9/2018	(35,494)	(83,779)
(10,223,200)	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 30	20/9/2018	(90,547)	(217,826)
(19,807,500)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.75	21/9/2018	(27,694)	(90,297)
(23,696,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.4	26/9/2018	69,689	(52,819)
(23,696,000)	コール	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 15.25	26/9/2018	(56,883)	(249,058)
(62,145,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 106	28/9/2018	94,017	(34,623)
(16,045,000)	プット	OTC EUR/CNH	Deutsche Bank	EUR 7.45	8/10/2018	170,330	(4,699)
(20,640,000)	プット	OTC EUR/CNH	Deutsche Bank	EUR 7.5	8/10/2018	91,073	(6,552)
(20,830,000)	プット	OTC EUR/CNH	Deutsche Bank	EUR 7.45	8/10/2018	200,381	(6,101)
(34,801,000)	コール	OTC USD/TRY	Deutsche Bank	USD 5.75	10/10/2018	(4,339,047)	(5,127,290)
(24,858,000)	プット	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.22	31/10/2018	13,039	(29,383)
(20,293,000)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 107	6/11/2018	52,387	(79,112)
(37,040,000)	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.32	15/11/2018	280,808	(115)
(35,770,000)	コール	OTC USD/TWD	Deutsche Bank	USD 32	15/11/2018	52,789	(34,132)
(24,858,000)	プット	OTC GBP/USD	Deutsche Bank	GBP 1.17	31/1/2019	(4,668)	(71,564)
(18,771,500)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20.5	5/9/2018	518,771	(63)
(22,982,000)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 21.169	5/9/2018	133,916	-
(24,858,000)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 21.5	5/9/2018	36,359	(9)
(37,685,000)	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.27	7/9/2018	98,345	-
(34,801,000)	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 13.2	13/9/2018	70,863	(339)
(11,466,000)	コール	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 22	18/9/2018	154,763	(51)
(87,003,000)	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.1	20/9/2018	202,292	(2,812)
(38,693,000)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18	25/9/2018	195,616	(23,425)
(25,175,000)	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.29	16/11/2018	56,204	(929)
(15,510,000)	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 31.1	6/9/2018	49,764	(2,970)
(37,751,000)	プット	OTC USD/CNH	HSBC Bank Plc	USD 6.7853	20/9/2018	43,314	(101,579)
(16,360,000)	プット	OTC EUR/CNH	HSBC Bank Plc	EUR 7.5	8/10/2018	70,321	(5,193)
(20,610,000)	プット	OTC EUR/CNH	HSBC Bank Plc	EUR 7.6	8/10/2018	218,010	(8,767)
(25,047,000)	コール	OTC USD/TWD	HSBC Bank Plc	USD 31	19/7/2019	(29,405)	(275,868)
(35,499,000)	プット	OTC USD/BRL	JP Morgan	USD 3.9	12/9/2018	138,465	(24,976)
(106,877,000)	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.14	19/9/2018	137,327	(156,756)
(37,287,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 14	19/9/2018	(1,118,237)	(1,617,137)
(5,504,800)	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 30	20/9/2018	(64,059)	(117,291)
(19,660,000)	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 31	20/9/2018	5,003	(23,110)
(7,131,400)	プット	OTC USD/MXN	JP Morgan	USD 19.5	21/9/2018	(4,334)	(172,850)
(12,429,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 110.5	26/9/2018	56,541	(84,767)

売建オプション 2018年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(12,429,000)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 111	26/9/2018	2,420	(72,661)
(18,644,000)	プット	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 14,000	1/10/2018	57,867	(6,330)
(7,115,000)	プット	OTC AUD/NOK	JP Morgan	AUD 5.7	3/10/2018	9,423	(5,189)
(37,500,000)	プット	OTC EUR/PLN	JP Morgan	EUR 4.05	8/10/2018	104,936	(632)
(6,563,550)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 13.75	11/10/2018	(351,730)	(475,584)
(24,494,000)	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 3.765	2/1/2019	319,945	(44)
(6,215,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4	13/9/2018	(142,043)	(235,107)
(24,858,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 13.5	19/9/2018	(811,230)	(2,064,570)
(11,850,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.08	20/9/2018	(33,097)	(252,441)
(37,287,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.95	20/9/2018	(1,611,391)	(1,887,874)
(37,287,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.93	20/9/2018	168,514	(109,199)
(10,004,400)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.065	25/9/2018	(72,907)	(325,518)
(6,215,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4	28/9/2018	(222,016)	(275,589)
(35,765,000)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 18	4/10/2018	91,653	(39,068)
(19,500,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 4.25	10/10/2018	(183,653)	(386,453)
(49,716,000)	プット	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 3.6	10/10/2018	125,086	(19,090)
(31,073,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 14.5	10/10/2018	(965,966)	(1,121,331)
(17,083,000)	コール	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.7424	4/9/2018	32,473	(67)
(17,083,000)	プット	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.7277	4/9/2018	(87,093)	(119,256)
(23,696,000)	コール	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.74	13/9/2018	25,191	(9,389)
(15,006,600)	コール	OTC USD/BRL	RBS Plc	USD 3.96	5/10/2018	(680,801)	(812,559)
(19,500,000)	コール	OTC USD/BRL	RBS Plc	USD 4	10/10/2018	(582,526)	(958,681)
(35,535,000)	プット	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.285	7/9/2018	49,685	(13,686)
(7,109,000)	コール	OTC USD/CAD	Royal Bank of Canada	USD 1.3	12/9/2018	(22,573)	(52,196)
(363)	コール	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.5	14/12/2018	1,713	(24,956)
(670)	プット	1 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 96.875	14/12/2018	49,225	(100,500)
(714)	コール	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.75	12/10/2018	21,220	(4,462)
(3,690)	プット	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 96.875	14/12/2018	15,646	(622,688)
(766)	コール	2 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 97.25	15/3/2019	27,328	(268,100)
(70)	プット	3 Year Eurodollar MIDCV	Exchange Traded	USD 2,535	16/11/2018	45,311	(33,250)
(3,203)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 28	19/9/2018	34,592	(48,045)
(6,333)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 13	19/9/2018	54,520	(269,153)
(6,658)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	19/9/2018	408,135	(249,675)
(6,658)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 12.5	19/9/2018	175,105	(149,805)
(80)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,300	16/11/2018	(6,536)	(53,205)
(3,421)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 97.875	17/6/2019	(5,234)	(171,050)
(131)	コール	PG&E Corp	Exchange Traded	USD 60	18/1/2019	(1,162)	(5,895)
(16)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,775	16/11/2018	13,268	(45,920)
(3,257)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 283	7/9/2018	(21,689)	(70,025)
(1,629)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 278	21/9/2018	(28,834)	(101,812)

売建オプション 2018年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(10,097)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 263	21/9/2018	1,047,090	(227,182)
(1,969)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 260	19/10/2018	119,640	(125,032)
(20,828)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 269	19/10/2018	903,345	(2,041,144)
(29,109)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 272	19/10/2018	1,242,888	(3,376,644)
(808)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 260	16/11/2018	28,925	(103,424)
(685)	プット	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 112.75	21/9/2018	31,117	(26,757)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,370,381,174米ドル)						83,840	(39,859,075)

シンセティック・キャップ・オプション 2018年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
521,000,000	コール	USD - 2 Year Constant Maturity Swap	Citibank	USD 0.24	7/9/2018	(573,084)	15
521,000,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Citibank	USD 0.17	7/9/2018	(539,235)	-
1,079,632,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.21	29/5/2020	(233,093)	1,440,337
(1,079,632,000)	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Goldman Sachs	USD 0.71	29/5/2020	144,800	(341,034)
341,000,000	コール	USD - 5 Year Constant Maturity Swap	Morgan Stanley	USD 0.07	22/6/2020	38,772	601,422
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,542,264,000米ドル)						(1,161,840)	1,700,740

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引 2018年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価 益/(損) (米ドル)
	ベルギー		
3,363	KBC Groupe SA	Merrill Lynch	(4,696)
43,399	Nyrstar NV	Merrill Lynch	(31,092)
			<u>(35,788)</u>
	フランス		
27,344	BNP Paribas	Merrill Lynch	(28,002)
(7,661)	Casino Guichard-Perrachon SA	Merrill Lynch	29,509
16,423	Credit Agricole SA	Merrill Lynch	1,185
38,902	Europcar Mobility Group SA	Merrill Lynch	7,470
			<u>10,162</u>
	ドイツ		
5,674	Tele Columbus AG	Merrill Lynch	3,653
			<u>3,653</u>
	ギリシャ		
413,788	National Bank Of Greece SA	Merrill Lynch	2,600
			<u>2,600</u>
	アイルランド		
(26,593)	SPDR S&P U.S Energy Select UCITS ETF	Merrill Lynch	(15,490)
			<u>(15,490)</u>
	ルクセンブルグ		
19,197	Aroundtown SA	Merrill Lynch	12,622
			<u>12,622</u>
	オランダ		
173,725	Altice Europe NV	Merrill Lynch	52,563
			<u>52,563</u>
	スペイン		
59,305	CaixaBank SA	Merrill Lynch	10,559
			<u>10,559</u>
	英国		
209,556	Vodafone Group Plc	Merrill Lynch	(27,883)
			<u>(27,883)</u>
	合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 7,422,475米ドル）		<u>12,998</u>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2018年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 102,600,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.69%の固定金利を8/10/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	6/4/2020	(29,391)	247,629
USD 296,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.7%の固定金利を28/11/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/8/2020より四半期毎に支払う。	Bank of America	26/5/2020	140,989	763,639
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(52,973)	291,485
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(160,297)	184,161
USD 39,820,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは9/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.8%の固定金利を9/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	(711,793)	841,655
USD 613,193,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.87%の固定金利を25/4/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/1/2019より四半期毎に支払う。	Citibank	23/10/2018	697,501	2,521,750
USD 20,387,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2028より四半期毎に支払う。	Citibank	27/6/2028	34,699	1,186,682
USD 162,951,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.65%の固定金利を13/2/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/11/2019より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	9/8/2019	56,895	190,534
USD 163,810,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.17%の固定金利を18/3/2019より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	14/9/2018	(2,482,397)	4,968
USD 418,222,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.83%の固定金利を3/4/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/1/2019より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	1/10/2018	465,389	998,622
USD 18,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、4%の固定金利を5/8/2020より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/2/2020	(295,893)	65,621

買建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 22,967,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/12/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.04%の固定金利を2/3/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	31/8/2021	(93,232)	818,558
USD 22,967,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.04%の固定金利を2/3/2022より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/12/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	31/8/2021	75,274	987,064
USD 34,930,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(360,015)	1,489,803
USD 10,840,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/5/2023より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.4%の固定金利を16/8/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	14/2/2023	(260,846)	625,640
USD 5,880,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1125%の固定金利を28/10/2023より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/7/2023より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	26/4/2023	101,447	700,325
USD 5,880,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/7/2023より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.1125%の固定金利を28/10/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	26/4/2023	(115,692)	483,186
USD 239,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.2%の固定金利を6/3/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	4/9/2018	(586,285)	-
USD 213,960,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.48%の固定金利を19/4/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	17/10/2018	2,287,649	3,878,947
USD 42,670,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.2%の固定金利を11/6/2019より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/3/2019より四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	(1,274,646)	10,250
USD 763,153,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.14%の固定金利を25/8/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	21/2/2019	(1,021,244)	2,334,500
USD 384,818,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.2%の固定金利を18/9/2019より半年毎に支払う。	JP Morgan	14/3/2019	(1,512,229)	1,081,970

買建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 217,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.2%の固定金利を21/2/2020より半年毎に支払う。	JP Morgan	19/8/2019	(324,874)	1,251,976
USD 219,480,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.2%の固定金利を23/2/2020より半年毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2019	(312,205)	1,272,416
JPY 1,184,200,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	(142,210)	227,922
JPY 1,184,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/10/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	101,113	471,400
USD 162,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/11/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3%の固定金利を18/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/8/2022	(374,531)	6,974,241
USD 28,838,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	227,575	1,806,456
USD 28,838,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4/8/2028より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	(118,118)	1,460,762
USD 10,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	22,337	504,322
USD 10,255,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/7/2038より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(29,743)	452,242
USD 239,246,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3.195%の固定金利を6/3/2019より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	4/9/2018	(569,405)	-
USD 692,910,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を14/7/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/4/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	10/1/2020	224,088	2,046,614

買建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 692,910,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を23/7/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/4/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	21/1/2020	300,166	2,100,564
USD 337,560,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を3/8/2020より半年毎に受け取り、3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/5/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	30/1/2020	285,299	1,034,574
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/3/2021より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(57,595)	283,494
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/9/2020	(156,929)	184,161
EUR 25,190,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/7/2028より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(337,939)	1,332,796
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 2,389,668,467米ドル)				(6,360,061)	41,110,929

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建スワップション 2018年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (102,600,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/10/2020より3%の固定金利を半年毎に受け取り、8/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	6/4/2020	(13,545)	(290,565)
USD (182,960,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	(34,642)	(1,306,214)
USD (182,960,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/10/2020より2.944%の固定金利を半年毎に受け取り、21/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	17/4/2020	93,690	(1,177,882)
USD (296,500,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/11/2020より3%の固定金利を半年毎に受け取り、28/8/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Bank of America	26/5/2020	37,707	(920,976)
USD (23,100,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/3/2019より2.45%の固定金利を半年毎に受け取り、10/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	6/9/2018	(541,228)	(882,530)
USD (17,100,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、15/4/2019より2.8%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	11/10/2018	25,101	(54,842)
USD (17,100,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/4/2019より3.1%の固定金利を半年毎に受け取り、15/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	11/10/2018	84,476	(18,124)
EUR (183,570,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/6/2020より0.143%の固定金利を毎年受け取り、18/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	14/6/2019	217,877	(231,355)
EUR (44,631,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/6/2020より0.6%の固定金利を毎年受け取り、27/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	25/6/2019	79,176	(254,496)
EUR (500,468,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは28/6/2020より0.78%の固定金利を毎年受け取り、28/12/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	26/6/2019	641,318	(1,563,174)
USD (105,490,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	(491,045)	(860,260)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (105,490,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、6/5/2020より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	Barclays	4/11/2019	259,837	(69,820)
USD (366,760,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/8/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、5/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	3/2/2020	112,977	(1,530,108)
USD (167,860,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは26/2/2021より3.5%の固定金利を半年毎に受け取り、26/11/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	24/8/2020	51,528	(515,000)
EUR (28,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは6/5/2022より2%の固定金利を毎年受け取り、6/11/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	Barclays	4/5/2021	234,976	(468,133)
USD (84,340,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは9/12/2021より3.87%の固定金利を半年毎に受け取り、9/9/2021より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	751,131	(901,154)
USD (100,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/11/2019より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、10/8/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	BNP Paribas	8/5/2019	970,507	(1,064,141)
USD (613,193,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/4/2019より2.62%の固定金利を半年毎に支払う。	Citibank	23/10/2018	9,707	(480,848)
USD (403,263,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/6/2019より3.18%の固定金利を半年毎に受け取り、31/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Citibank	27/12/2018	924,722	(555,253)
USD (34,520,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/4/2019より3.12%の固定金利を半年毎に受け取り、11/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	9/10/2018	157,085	(25,871)
USD (34,520,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/1/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/4/2019より2.82%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	9/10/2018	50,264	(124,062)
USD (588,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは31/7/2019より2.95%の固定金利を半年毎に受け取り、30/4/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	29/1/2019	(163,698)	(1,272,919)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (162,951,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは13/2/2020より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、13/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	9/8/2019	37,405	(134,935)
USD (111,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/8/2020より3.2%の固定金利を半年毎に受け取り、11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	1,666	(423,177)
USD (111,070,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/8/2020より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/2/2020	39,312	(252,247)
USD (112,110,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、19/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	45,810	(325,288)
USD (112,110,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは19/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、19/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/2/2020	133,586	(320,826)
USD (186,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に受け取り、16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	21,355	(1,330,610)
USD (186,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは16/7/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、16/10/2020より2.8775%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/4/2020	118,795	(1,233,170)
USD (97,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/12/2020より2.9%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	29/5/2020	12,226	(701,826)
USD (97,150,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、2/12/2020より2.9%の固定金利を半年毎に支払う。	Deutsche Bank	29/5/2020	32,067	(681,985)
USD (171,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/3/2019より3.32%の固定金利を半年毎に受け取り、18/12/2018より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	14/9/2018	1,222,145	(9)
USD (214,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/9/2019より2.6%の固定金利を半年毎に受け取り、25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	21/3/2019	(297,953)	(1,586,753)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (1,015,670,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/12/2019より3.3%の固定金利を半年毎に受け取り、27/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	25/6/2019	892,448	(1,491,014)
USD (677,115,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは27/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、27/12/2019より2.7%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/6/2019	(54,853)	(1,810,599)
USD (61,267,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは15/1/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、15/10/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	11/7/2019	335,837	(710,296)
USD (177,210,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは30/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、29/2/2020より3.0025%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	28/8/2019	(105,902)	(966,700)
USD (177,210,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは29/2/2020より3.0025%の固定金利を半年毎に受け取り、30/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	28/8/2019	127,861	(732,937)
USD (98,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは7/11/2020より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、7/8/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	5/5/2020	72,989	(473,433)
USD (136,590,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、2/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	29/5/2020	14,242	(482,604)
USD (373,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、10/12/2020より3.05%の固定金利を半年毎に支払う。	Goldman Sachs	8/6/2020	(360,813)	(1,502,031)
USD (373,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/12/2020より3.05%の固定金利を半年毎に受け取り、10/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	8/6/2020	9,368	(1,090,836)
USD (135,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/12/2020より3.45%の固定金利を半年毎に受け取り、10/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	8/6/2020	158,354	(404,438)
USD (86,390,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは17/12/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、17/9/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	15/6/2020	111,431	(312,744)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (87,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5/11/2022より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、5/8/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	351,854	(1,474,782)
USD (64,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、11/6/2019より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	982,537	(515)
USD (42,670,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは11/6/2019より3.4%の固定金利を半年毎に受け取り、11/3/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	7/12/2018	765,425	(15,312)
USD (381,576,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/8/2019より2.74%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/2/2019	(185,186)	(1,953,650)
USD (214,800,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/9/2019より2.2%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/3/2019	214,083	(73,908)
USD (109,650,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/9/2019より3.15%の固定金利を半年毎に受け取り、25/6/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/3/2019	149,089	(156,835)
USD (141,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/10/2019より2.75%の固定金利を半年毎に受け取り、1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	(104,524)	(753,797)
USD (141,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、1/10/2019より1.75%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	28/3/2019	596,484	(11,106)
USD (26,930,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/10/2019より2.35%の固定金利を半年毎に受け取り、10/7/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	8/4/2019	(141,204)	(310,863)
USD (298,730,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3/12/2019より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	30/5/2019	161,936	(384,740)
USD (298,730,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3/12/2019より3.25%の固定金利を半年毎に受け取り、3/9/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	30/5/2019	72,669	(474,007)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (10,775,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは10/7/2020より0.4%の固定金利を毎年受け取り、10/1/2020より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	8/7/2019	36,479	(5,353)
USD (217,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、21/2/2020より2.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	19/8/2019	(245,069)	(1,861,398)
USD (219,480,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/11/2019より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/2/2020より2.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2019	(190,886)	(1,887,704)
USD (348,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは8/5/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、8/2/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	6/11/2019	(1,716,360)	(2,838,660)
USD (74,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、18/6/2020より1.7%の固定金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	88,828	(61,646)
USD (74,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは18/6/2020より2.7%の固定金利を半年毎に受け取り、18/3/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/12/2019	(393,246)	(626,889)
USD (186,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/7/2020より2.85%の固定金利を半年毎に受け取り、23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/1/2020	(506,637)	(1,286,527)
EUR (46,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは21/4/2022より2.15%の固定金利を半年毎に受け取り、21/10/2021より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に支払う。	JP Morgan	19/4/2021	401,923	(600,772)
USD (1,039,365,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは14/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、14/7/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	10/1/2020	(118,325)	(1,406,552)
USD (1,039,365,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは23/4/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、23/7/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	21/1/2020	(250,259)	(1,464,736)
USD (506,340,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、3/8/2020より2.45%の固定金利を半年毎に支払う。	Morgan Stanley	30/1/2020	(240,307)	(729,661)

売建スワップション 2018年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (18,890,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは22/7/2019より6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を半年毎に受け取り、22/1/2020より0.65%の固定金利を毎年支払う。	UBS	18/1/2019	13,926	(20,330)
USD (113,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/8/2020より3.35%の固定金利を半年毎に受け取り、25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に支払う。	UBS	21/2/2020	113,859	(328,011)
USD (113,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/5/2020より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、25/8/2020より2.35%の固定金利を半年毎に支払う。	UBS	21/2/2020	1,323	(332,912)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 5,074,285,476米ドル)				5,883,709	(50,596,851)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2018年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
スイス			
USD 10,500,000	UBS AG (London Branch) 4/9/2018 (Zero Coupon)	10,497,093	0.53
USD 10,500,000	UBS AG (London Branch) 2.667% 4/4/2019	10,513,595	0.54
		21,010,688	1.07
米国			
USD 10,000,000	Barclays Bank Plc (New York Branch) 28/9/2018 (Zero Coupon)	9,983,559	0.51
USD 4,500,000	BNZ International Funding Ltd 2.553% 16/4/2019	4,502,036	0.23
USD 5,000,000	Enbridge Energy Partners LP 4/9/2018 (Zero Coupon)	4,998,483	0.25
USD 5,000,000	HP Inc 23/10/2018 (Zero Coupon)	4,984,527	0.25
USD 10,500,000	Suncorp Group Ltd 10/10/2018 (Zero Coupon)	10,474,433	0.53
		34,943,038	1.77
コマーシャル・ペーパー合計		55,953,726	2.84
預託証書			
カナダ			
USD 10,500,000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.66% 16/4/2019	10,505,757	0.53
USD 10,500,000	Royal Bank of Canada (New York Branch) FRN 22/3/2019	10,513,982	0.54
		21,019,739	1.07
フランス			
USD 5,000,000	BNP Paribas SA (New York Branch) FRN 28/12/2018	5,003,835	0.25
USD 11,000,000	BNP Paribas SA (New York Branch) FRN 8/4/2019	11,010,623	0.56
		16,014,458	0.81
オランダ			
USD 11,000,000	Rabobank Nederland FRN 5/4/2019	11,009,207	0.56
スウェーデン			
USD 10,500,000	Norden Bank (New York Branch) FRN 5/4/2019	10,511,839	0.53
米国			
USD 10,500,000	Bank of America NA 10/10/2018 (Zero Coupon)	10,500,064	0.53
USD 10,500,000	Wells Fargo Bank FRN 5/4/2019	10,511,839	0.54
		21,011,903	1.07
預託証書合計		79,567,146	4.04
債券			
アルゼンチン			
USD 150,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 27/7/2023	126,000	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オーストラリア			
AUD 133,464	Apollo Series 2009-1 Trust 'Series 2009-1 A3' FRN 3/10/2040	96,594	0.00
USD 2,640,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd/New York NY 2.25% 9/11/2020	2,587,156	0.13
USD 1,705,000	Commonwealth Bank of Australia/New York NY 2.3% 6/9/2019	1,697,884	0.09
USD 9,000,000	National Australia Bank Ltd '144A' 2.4% 7/12/2021	8,780,234	0.44
AUD 212,139	National Rmbs Trust 2012-2 'Series 2012-2 A1' FRN 20/6/2044	153,927	0.01
AUD 1,328,190	TORRENS Series 2013-1 Trust 'Series 2013-1 A' FRN 12/4/2044	956,510	0.05
USD 1,282,600	Virgin Australia 2013-1A Pass Through Trust '144A' 5% 23/10/2023	1,305,686	0.07
USD 942,719	Virgin Australia 2013-1B Pass Through Trust '144A' 6% 23/10/2020	959,217	0.05
		16,537,208	0.84
ブラジル			
USD 1,600,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA '144A' 5.75% 27/10/2021	1,588,000	0.08
カナダ			
USD 1,635,714	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust '144A' 5.375% 15/5/2021	1,672,518	0.08
USD 2,565,000	Bank of Montreal 1.75% 11/9/2019	2,541,782	0.13
USD 10,000,000	Bank of Montreal '144A' 1.75% 15/6/2021*	9,630,755	0.49
USD 1,865,000	Canadian Natural Resources Ltd 2.95% 15/1/2023	1,807,147	0.09
USD 6,000,000	CPPIB Capital Inc '144A' 1.25% 20/9/2019	5,909,292	0.30
USD 175,000	Enbridge Inc 2.9% 15/7/2022	170,706	0.01
USD 17,520,000	Province of Alberta Canada 1.9% 6/12/2019	17,333,596	0.88
USD 5,595,000	Royal Bank of Canada 2.1% 14/10/2020	5,486,007	0.28
USD 4,000,000	Toronto-Dominion Bank/The '144A' 2.25% 15/3/2021	3,918,648	0.20
USD 2,545,000	TransCanada PipeLines Ltd 3.75% 16/10/2023	2,564,750	0.13
		51,035,201	2.59
ケイマン諸島			
USD 27,100	Ambac LSNI LLC '144A' FRN 12/2/2023	27,405	0.00
USD 2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,674,146	0.14
USD 1,005,000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.25% 15/8/2022	1,025,040	0.05
USD 2,487,224	Resource Capital Corp 2017-CRE5 Ltd FRN 15/7/2034	2,489,780	0.13
USD 891,000	Vale Overseas Ltd 4.375% 11/1/2022	897,524	0.04
		7,113,895	0.36
チリ			
USD 2,000,000	Empresa Nacional del Petroleo '144A' 5.25% 10/8/2020	2,060,900	0.11
コロンビア			
USD 2,800,000	Ecopetrol SA 7.625% 23/7/2019	2,919,000	0.15

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
キプロス			
EUR 1,996,000	Cyprus Government International Bond '144A' 4.625% 3/2/2020	2,469,029	0.12
EUR 3,230,000	Cyprus Government International Bond 4.75% 25/6/2019	3,897,592	0.20
		6,366,621	0.32
フランス			
USD 825,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA '144A' 2.7% 20/7/2022	797,896	0.04
ドイツ			
EUR 1,020,154	Compartement VCL 24 FRN 21/8/2022	1,190,768	0.06
USD 4,800,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/6/2020*	4,725,240	0.24
USD 5,830,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/11/2020	5,715,461	0.29
		11,631,469	0.59
国際機関			
USD 7,080,000	European Investment Bank 2.5% 15/3/2023	6,948,344	0.35
USD 12,120,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.875% 15/8/2019	11,927,195	0.61
		18,875,539	0.96
アイルランド			
USD 1,160,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	1,124,096	0.06
USD 1,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	984,995	0.05
USD 3,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.95% 1/2/2022	2,999,247	0.15
USD 1,010,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.25% 1/7/2020	1,023,000	0.05
USD 1,189,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	1,209,851	0.06
USD 4,155,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	4,070,560	0.21
USD 16,935,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 1.9% 23/9/2019	16,740,603	0.85
USD 3,845,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/9/2023	3,672,256	0.19
USD 754,000	Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	790,269	0.04
		32,614,877	1.66
イタリア			
USD 1,530,000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 3.375% 12/1/2023	1,414,513	0.07
日本			
USD 1,001,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	990,658	0.05
USD 705,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 3.535% 26/7/2021	707,691	0.04
USD 3,400,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp '144A' 2.45% 16/10/2019	3,378,828	0.17
USD 2,595,000	Mizuho Bank Ltd '144A' 2.65% 25/9/2019	2,587,530	0.13
USD 3,455,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp 2.45% 16/1/2020	3,427,618	0.17
USD 5,395,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.846% 11/1/2022	5,287,545	0.27
		16,379,870	0.83

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ			
USD 395,000	Allergan Funding SCS 2.45% 15/6/2019	393,773	0.02
USD 7,185,000	Allergan Funding SCS 3% 12/3/2020	7,168,661	0.36
USD 2,509,000	Allergan Funding SCS 3.45% 15/3/2022	2,490,967	0.13
		10,053,401	0.51
オランダ			
USD 1,340,000	ING Groep NV 3.15% 29/3/2022	1,321,127	0.07
USD 1,214,000	Mylan NV 2.5% 7/6/2019	1,208,435	0.06
USD 703,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 3.875% 1/9/2022	698,606	0.04
USD 5,840,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 15/6/2020	5,905,700	0.30
USD 7,477,000	NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 4.125% 1/6/2021	7,505,039	0.38
		16,638,907	0.85
ノルウェー			
USD 3,000,000	DNB Boligkreditt AS '144A' 2% 28/5/2020	2,948,667	0.15
パナマ			
USD 1,380,000	Carnival Corp 3.95% 15/10/2020	1,401,331	0.07
スウェーデン			
USD 1,915,000	Nordea Bank AB '144A' 1.625% 30/9/2019	1,887,328	0.10
USD 2,190,000	Svenska Handelsbanken AB 3.35% 24/5/2021	2,196,142	0.11
		4,083,470	0.21
スイス			
USD 3,340,000	Credit Suisse AG/New York NY 2.3% 28/5/2019	3,331,814	0.17
USD 5,745,000	Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 9/1/2023	5,673,682	0.29
USD 675,000	UBS AG/Stamford CT 2.375% 14/8/2019	672,694	0.03
USD 2,215,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' FRN 15/8/2023	2,138,737	0.11
USD 1,395,000	UBS Group Funding Switzerland AG '144A' 2.65% 1/2/2022	1,354,266	0.07
		13,171,193	0.67
英国			
USD 677,000	Anglo American Capital Plc '144A' 4.125% 15/4/2021	682,683	0.04
USD 1,665,000	Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,638,691	0.08
USD 3,219,000	AXIS Specialty Finance Plc 2.65% 1/4/2019	3,214,972	0.16
USD 2,200,000	Barclays Plc 2.875% 8/6/2020	2,179,454	0.11
USD 2,550,000	Barclays Plc 3.25% 12/1/2021	2,522,353	0.13
GBP 2,858,910	Compartment Driver UK Four 'A' FRN 25/3/2025	3,709,391	0.19
GBP 150,694	First Flexible No 7 Plc FRN 15/9/2033	194,952	0.01
USD 5,820,000	HSBC Holdings Plc FRN 13/3/2023	5,737,522	0.29
USD 3,310,000	Lloyds Banking Group Plc 3% 11/1/2022	3,239,980	0.16
USD 995,000	Lloyds Banking Group Plc 4.5% 4/11/2024	989,031	0.05
GBP 5,710,397	Oat Hill No 1 Plc FRN 25/2/2046	7,381,964	0.38
USD 2,235,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,162,120	0.11
USD 475,000	Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	465,317	0.02
USD 7,370,000	Sky Plc '144A' 2.625% 16/9/2019	7,326,797	0.37
EUR 2,617,277	Turbo Finance 7 Plc FRN 20/6/2023	3,047,980	0.16

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 423,200	Unique Pub Finance Co Plc/The 6.542% 30/3/2021	577,982	0.03
GBP 1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,560,137	0.08
		46,631,326	2.37
米国			
USD 3,560,000	AbbVie Inc 2.5% 14/5/2020	3,527,716	0.18
USD 4,655,000	Adams Mill CLO Ltd 'Series 2014-1A A2R' '144A' FRN 15/7/2026	4,655,648	0.24
USD 550,000	Aetna Inc 2.2% 15/3/2019	548,898	0.03
USD 950,000	AIG Global Funding '144A' 1.95% 18/10/2019	938,537	0.05
USD 680,000	Air Lease Corp 2.625% 4/9/2018	680,000	0.03
USD 855,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	822,665	0.04
USD 565,000	Air Lease Corp 3.375% 15/1/2019	565,972	0.03
USD 1,565,000	Allergan Finance LLC 3.25% 1/10/2022	1,537,224	0.08
USD 2,815,000	Alliant Energy Finance LLC '144A' 3.75% 15/6/2023	2,822,702	0.14
USD 6,770,000	Ally Auto Receivables Trust 2018-3 'Series 2018-3 A2' 2.72% 17/5/2021	6,772,101	0.34
USD 4,500,000	ALM V Ltd 'Series 2012-5A A1R3' '144A' FRN 18/10/2027	4,488,908	0.23
USD 2,525,000	ALM XII Ltd 'Series 2015-12A A1R2' '144A' FRN 16/4/2027	2,519,975	0.13
USD 5,950	Ambac Assurance Corp '144A' 5.1% 7/6/2020	8,092	0.00
USD 1,199,952	American Airlines 2013-2 Class B Pass Through Trust '144A' 5.6% 15/7/2020	1,225,463	0.06
USD 1,556,000	American Electric Power Co Inc 2.95% 15/12/2022	1,519,092	0.08
USD 3,315,000	American Express Co 2.5% 1/8/2022	3,192,962	0.16
USD 8,380,000	American Express Credit Account Master Trust 'Series 2017-4 A' 1.64% 15/12/2021	8,328,083	0.42
USD 3,459,000	American International Group Inc 2.3% 16/7/2019	3,448,258	0.18
USD 4,215,000	American Tower Corp 3.4% 15/2/2019	4,224,083	0.21
USD 370,000	American Tower Corp 3.5% 31/1/2023	365,040	0.02
USD 3,149,240	Americold 2010 LLC 'Series 2010-ARTA A1' '144A' 3.847% 14/1/2029	3,175,031	0.16
USD 3,226,289	Americredit Automobile Receivables Trust 2014-4 'Series 2014-4 C' 2.47% 9/11/2020	3,224,923	0.16
USD 4,787,502	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2016-3 'Series 2016-3 A3' 1.46% 10/5/2021	4,764,920	0.24
USD 1,030,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017-1 'Series 2017-1 A3' 1.87% 18/8/2021	1,023,578	0.05
USD 1,740,000	AmeriCredit Automobile Receivables Trust 2017-2 'Series 2017-2 A3' 1.98% 20/12/2021	1,726,428	0.09
USD 4,600,000	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-1 'Series 2018-1 A3' 3.07% 19/12/2022	4,599,646	0.23
USD 3,400,000	AMMC CLO XIII Ltd 'Series 2013-13AA1LR' '144A' FRN 24/7/2029	3,405,821	0.17
USD 1,855,000	Amphenol Corp 2.2% 1/4/2020	1,828,394	0.09
USD 1,150,000	Analog Devices Inc 2.5% 5/12/2021	1,118,204	0.06
USD 335,000	Analog Devices Inc 2.85% 12/3/2020	333,877	0.02
USD 1,995,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 3.5% 1/12/2022	1,964,382	0.10
USD 1,435,000	Andeavor Logistics LP / Tesoro Logistics Finance Corp 6.25% 15/10/2022	1,487,019	0.08

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,990,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.3% 1/2/2023	2,968,554	0.15
USD	1,110,000	Anthem Inc 3.125% 15/5/2022	1,095,423	0.06
USD	1,729,000	Apache Corp 3.25% 15/4/2022	1,711,222	0.09
USD	460,000	Apache Corp 3.625% 1/2/2021	461,578	0.02
USD	368,400	Apidos CLO XVI 'Series 2013-16A A1R' '144A' FRN 19/1/2025	368,468	0.02
USD	2,580,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2016-FL1 Ltd 'Series 2016-FL1A A' '144A' FRN 15/9/2026	2,591,586	0.13
USD	7,690,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1 A' '144A' FRN 15/4/2027	7,730,362	0.39
USD	4,612,235	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A2' '144A' '1.91% 15/4/2026	4,587,806	0.23
USD	5,245,000	ARI Fleet Lease Trust 2017-A 'Series 2017-A A3' '144A' '2.28% 15/4/2026	5,171,233	0.26
USD	7,985,000	AT&T Inc 3.6% 17/2/2023	7,961,452	0.40
USD	15,000,000	Aventura Mall Trust 2013-AVM 'Series 2013-AVM A' ' 144A' FRN 5/12/2032	15,246,455	0.77
USD	3,405,000	Aviation Capital Group LLC '144A' 2.875% 20/1/2022	3,308,809	0.17
USD	480,000	AXA Equitable Holdings Inc '144A' 3.9% 20/4/2023	478,751	0.02
USD	2,508,440	B2R Mortgage Trust 2015-1 'Series 2015-1 A1' '144A' 2.524% 15/5/2048	2,477,602	0.13
USD	4,011,767	B2R Mortgage Trust 2015-2 'Series 2015-2 A' '144A' 3.336% 15/11/2048	4,001,078	0.20
USD	15,660,000	BA Credit Card Trust 'Series 2018-A2 A2' 3% 15/9/2023	15,663,487	0.80
USD	2,685,000	Baker Hughes a GE Co LLC / Baker Hughes Co-Obligor Inc 2.773% 15/12/2022	2,615,583	0.13
USD	7,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 ' Series 2016-UB10 A2' 2.723% 15/7/2049	7,332,870	0.37
USD	41,090	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 'Series 2003-J 2A1' FRN 25/11/2033	41,481	0.00
USD	3,555,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2021	3,492,743	0.18
USD	975,000	Bank of America Corp FRN 23/1/2022	960,005	0.05
USD	3,410,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2023	3,323,452	0.17
USD	5,365,000	Bank of America Corp 2.503% 21/10/2022	5,161,594	0.26
USD	2,870,000	Bank of America Corp 3.3% 11/1/2023	2,846,909	0.14
USD	1,800,000	Bank of America Corp 5.49% 15/3/2019	1,824,367	0.09
USD	6,595,000	BAT Capital Corp '144A' 2.764% 15/8/2022	6,392,069	0.32
USD	2,020,000	Bayer US Finance LLC '144A' 2.375% 8/10/2019	2,004,231	0.10
USD	2,025,000	BB&T Corp 3.2% 3/9/2021	2,024,811	0.10
USD	9,731	Bear Stearns ALT-A Trust 2004-13 'Series 2004-13 A1' FRN 25/11/2034	9,754	0.00
USD	9,575,000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020*	9,594,332	0.49
USD	2,040,000	Becton Dickinson and Co 2.404% 5/6/2020	2,008,071	0.10
USD	940,000	Berkshire Hathaway Energy Co 2.375% 15/1/2021	923,499	0.05
USD	2,629,418	BlueMountain CLO 2013-3 Ltd 'Series 2013-3A AR' '144A' 'FRN 29/10/2025	2,626,322	0.13
USD	5,743,627	BlueMountain CLO 2013-4 Ltd 'Series 2013-4A AR' '144A' 'FRN 15/4/2025	5,743,599	0.29
USD	2,410,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.375% 15/1/2020	2,382,677	0.12
USD	535,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2.65% 15/1/2023	507,062	0.03

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	2,989,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3% 15/1/2022	2,918,518	0.15
USD	2,586,373	BSPRT 2017-FL1 Issuer Ltd 'Series 2017-FL1 A' '144A' FRN 15/6/2027	2,595,897	0.13
USD	6,820,000	BSPRT 2018-FL3 Issuer Ltd 'Series 2018-FL3 A' '144A' FRN 15/3/2028	6,804,328	0.35
USD	1,060,000	CA Inc 3.6% 15/8/2022	1,051,429	0.05
USD	3,659,000	Caesars Palace Las Vegas Trust 2017-VICI 'Series 2017-VICI A' '144A' 3.531% 15/10/2034	3,679,216	0.19
USD	4,035,000	Capital One Bank USA NA 2.3% 5/6/2019	4,021,929	0.20
USD	1,485,000	Capital One Financial Corp 2.4% 30/10/2020	1,457,680	0.07
USD	955,000	Capital One Financial Corp 3.05% 9/3/2022	937,231	0.05
USD	5,500,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust 'Series 2015-A2 A2' 2.08% 15/3/2023	5,425,440	0.28
USD	5,380,000	Capital One Multi-Asset Execution Trust 'Series 2018-A1 A1' 3.01% 15/2/2024	5,383,915	0.27
USD	1,410,000	Capital One NA 1.85% 13/9/2019	1,395,320	0.07
USD	8,500,000	CarMax Auto Owner Trust 2018-2 'Series 2018-2 A3' 2.98% 17/1/2023	8,493,741	0.43
USD	1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,089,993	0.06
USD	1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,751,490	0.09
USD	3,150,000	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	3,152,842	0.16
USD	2,630,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.464% 23/7/2022	2,685,831	0.14
USD	6,539,489	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-2A A2' '144A' FRN 15/5/2029	6,553,023	0.33
USD	2,575,568	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-3A A2' '144A' FRN 15/8/2029	2,577,854	0.13
USD	283,774	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 'Series 2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	249,761	0.01
USD	7,350,000	CIFC Funding 2015-II Ltd 'Series 2015-2A AR' '144A' FRN 15/4/2027	7,307,196	0.37
USD	3,750,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 'Series 2013-375P A' '144A' 3.251% 10/5/2035	3,733,431	0.19
USD	7,045,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 'Series 2014-GC19 AAB' 3.552% 10/3/2047	7,129,679	0.36
USD	5,790,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-SSHP 'Series 2015-SSHP A' '144A' FRN 15/9/2027	5,792,862	0.29
USD	115,000	Citigroup Inc FRN 24/1/2023	113,401	0.01
USD	3,365,000	Citigroup Inc FRN 24/7/2023	3,271,450	0.17
USD	2,000,000	Citigroup Inc 2.65% 26/10/2020	1,976,847	0.10
USD	850,000	Citigroup Inc 2.75% 25/4/2022	828,777	0.04
USD	1,615,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.25% 2/3/2020	1,591,858	0.08
USD	2,005,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.3% 3/12/2018	2,004,344	0.10
USD	5,806,000	Citizens Bank NA/Providence RI 2.5% 14/3/2019	5,802,522	0.30
USD	6,510,000	CLNS Trust 2017-IKPR 'Series 2017-IKPR A' '144A' FRN 11/6/2032	6,517,719	0.33
USD	4,326,881	CNH Equipment Trust 2016-B 'Series 2016-B A3' 1.63% 15/8/2021	4,292,589	0.22
USD	6,140,000	CNH Equipment Trust 2017-B 'Series 2017-B A3' 1.86% 15/9/2022	6,046,138	0.31

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	5,390,000	CNH Equipment Trust 2017-C 'Series 2017-C A3' 2.08% 15/2/2023	5,304,772	0.27
USD	2,789,669	Colony American Homes 2015-1 'Series 2015-1A A' '144A' ' FRN 17/7/2032	2,794,427	0.14
USD	3,013,000	COMM 2005-C6 Mortgage Trust 'Series 2005-C6 F' '144A' ' FRN 10/6/2044	3,066,842	0.16
USD	5,518,685	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust 'Series 2013-CR7 ASB' 2.739% 10/3/2046	5,477,694	0.28
USD	989,855	COMM 2013-GAM 'Series 2013-GAM A1' '144A' 1.705% 10/2/2028	972,708	0.05
USD	1,443,530	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust 'Series 2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	1,425,688	0.07
USD	842,202	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 'Series 2013-SFS A1' ' 144A' 1.873% 12/4/2035	816,600	0.04
USD	5,238,000	COMM 2014-TWC Mortgage Trust 'Series 2014-TWC A' ' 144A' FRN 13/2/2032	5,242,240	0.27
USD	6,265,000	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS3 ASB' 3.367% 10/6/2047	6,291,488	0.32
USD	2,770,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS5 ASB' 3.548% 10/9/2047	2,791,899	0.14
USD	5,500,000	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust 'Series 2015-CR22 A2' 2.856% 10/3/2048	5,490,230	0.28
USD	10,790,541	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 'Series 2015-CR23 XA' FRN 10/5/2048	459,324	0.02
USD	2,655,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 'Series 2015-CR24 ASB' 3.445% 10/8/2048	2,662,127	0.14
USD	10,700,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 A2' 2.976% 10/7/2048	10,690,881	0.54
USD	4,100,000	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 'Series 2015-LC21 ASB' 3.421% 10/7/2048	4,119,772	0.21
USD	258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	279	0.00
USD	141,922	Continental Airlines 2010-1 Class B Pass Through Trust 6% 12/1/2019	142,011	0.01
USD	3,085,000	Continental Resources Inc/OK 4.5% 15/4/2023	3,156,783	0.16
USD	8,149,087	Core Industrial Trust 2015-CALW 'Series 2015-CALW A' ' 144A' 3.04% 10/2/2034	8,107,666	0.41
USD	6,401,604	Core Industrial Trust 2015-TEXW 'Series 2015-TEXW A' ' 144A' 3.077% 10/2/2034	6,376,725	0.32
USD	3,585,000	Cox Communications Inc '144A' 3.15% 15/8/2024	3,420,472	0.17
USD	7,318,772	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2016-2 'Series 2016- 2A A' '144A' 2.42% 15/11/2023	7,311,374	0.37
USD	8,500,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2016-3 'Series 2016- 3A A' '144A' 2.15% 15/4/2024	8,456,799	0.43
USD	5,150,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2017-1 'Series 2017- 1A A' '144A' 2.56% 15/10/2025	5,125,975	0.26
USD	8,160,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-1 'Series 2018- 1A A' '144A' 3.01% 16/2/2027	8,088,828	0.41
USD	9,890,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2 'Series 2018- 2A A' '144A' 3.47% 17/5/2027	9,913,166	0.50
USD	4,760,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-3 'Series 2018- 3A A' '144A' 3.55% 15/8/2027	4,759,127	0.24
USD	3,315,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	3,167,464	0.16
USD	870,000	Crown Castle International Corp 4.875% 15/4/2022	898,403	0.05
USD	2,215,000	CSX Corp 3.7% 30/10/2020	2,236,131	0.11

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 9,175,000	CVS Health Corp 3.7% 9/3/2023	9,178,331	0.47
USD 5,155,000	Daimler Finance North America LLC '144A' 1.5% 5/7/2019	5,100,909	0.26
USD 528,751	Delta Air Lines 2012-1 Class B Pass Through Trust '144A' ' 6.875% 7/5/2019	540,280	0.03
USD 1,575,000	Delta Air Lines Inc 2.6% 4/12/2020	1,543,649	0.08
USD 2,115,000	Delta Air Lines Inc 2.875% 13/3/2020	2,099,344	0.11
USD 3,255,000	Devon Energy Corp 3.25% 15/5/2022	3,206,772	0.16
USD 1,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	977,679	0.05
USD 5,000,000	Discover Card Execution Note Trust 'Series 2014-A4 A4' 2.12% 15/12/2021	4,981,015	0.25
USD 1,265,000	Discovery Communications LLC 4.375% 15/6/2021	1,289,172	0.07
USD 830,000	Dominion Energy Inc 2.579% 1/7/2020	819,126	0.04
USD 1,315,000	Dow Chemical Co/The 4.25% 15/11/2020	1,343,497	0.07
USD 1,985,706	Drive Auto Receivables Trust 2017-2 'Series 2017-2 B' 2.25% 15/6/2021	1,983,679	0.10
USD 1,560,000	DTE Energy Co 3.7% 1/8/2023	1,570,761	0.08
USD 2,835,000	Duke Energy Corp 3.95% 15/10/2023	2,874,547	0.15
USD 1,435,000	Emera US Finance LP 2.15% 15/6/2019	1,425,584	0.07
USD 2,005,000	Enbridge Energy Partners LP 5.2% 15/3/2020	2,059,063	0.10
USD 1,250,000	Energy Transfer Partners LP 3.6% 1/2/2023	1,233,147	0.06
USD 7,620,000	Energy Transfer Partners LP 4.15% 1/10/2020	7,722,497	0.39
USD 5,745,943	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A2' ' 144A' 1.74% 22/2/2022	5,722,930	0.29
USD 3,840,000	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2016-2 A3' ' 144A' 2.04% 22/2/2022	3,792,672	0.19
USD 1,294,961	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2017-1 A2' ' 144A' 2.13% 20/7/2022	1,288,395	0.07
USD 9,230,000	Enterprise Fleet Financing LLC 'Series 2018-1 A2' ' 144A' 2.87% 20/10/2023	9,211,110	0.47
USD 2,090,000	EOG Resources Inc 2.45% 1/4/2020	2,070,325	0.11
USD 2,910,000	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd 'Series 2018-RS06 A' ' '144A' FRN 15/6/2035	2,910,590	0.15
USD 2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,067,608	0.11
USD 1,800,000	Exelon Generation Co LLC 5.2% 1/10/2019	1,838,422	0.09
USD 197,856	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2014- C02 1M1' FRN 25/5/2024	198,320	0.01
USD 3,173,914	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017- C02 2M1' FRN 25/9/2029	3,194,151	0.16
USD 4,542,042	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017- C04 2M1' FRN 25/11/2029	4,558,770	0.23
USD 2,378,702	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017- C07 1M1' FRN 25/5/2030	2,384,013	0.12
USD 2,359,730	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities 'Series 2017- C07 2M1' FRN 25/5/2030	2,361,075	0.12
USD 4,070	Fannie Mae Pool '255316' 5% 1/7/2019	4,172	0.00
USD 82,363	Fannie Mae Pool 'AB4997' 3% 1/4/2027	82,358	0.00
USD 12,175	Fannie Mae Pool 'AD0454' 5% 1/11/2021	12,480	0.00
USD 55,803	Fannie Mae Pool 'AE0812' 5% 1/7/2025	57,200	0.00
USD 2,020,388	Fannie Mae Pool 'AL4364' FRN 1/9/2042	2,042,602	0.10
USD 93,576	Fannie Mae Pool 'AL7139' 3% 1/7/2030	93,340	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 64,626	Fannie Mae Pool 'AL7227' 3% 1/8/2030	64,463	0.00
USD 811,563	Fannie Mae Pool 'AL9376' 3% 1/8/2031	807,462	0.04
USD 76,104	Fannie Mae Pool 'AL9378' 3% 1/9/2031	75,748	0.00
USD 446,020	Fannie Mae Pool 'AL9899' 3% 1/3/2032	443,651	0.02
USD 36,013	Fannie Mae Pool 'AS5622' 3% 1/8/2030	35,922	0.00
USD 123,314	Fannie Mae Pool 'AS5728' 3% 1/9/2030	123,003	0.01
USD 113,996	Fannie Mae Pool 'AS8604' 3% 1/1/2032	113,408	0.01
USD 90,347	Fannie Mae Pool 'AU0967' 3% 1/8/2028	90,119	0.00
USD 3,708,530	Fannie Mae Pool 'AX0000' FRN 1/9/2044	3,718,106	0.19
USD 166,111	Fannie Mae Pool 'AZ4080' 3% 1/12/2031	165,379	0.01
USD 749,230	Fannie Mae Pool 'AZ5005' 3% 1/12/2030	745,186	0.04
USD 118,037	Fannie Mae Pool 'AZ5798' 3% 1/9/2030	117,730	0.01
USD 41,915	Fannie Mae Pool 'BA0776' 3% 1/9/2030	41,689	0.00
USD 36,771	Fannie Mae Pool 'BA2882' 3% 1/11/2030	36,678	0.00
USD 790,069	Fannie Mae Pool 'BA5803' 3% 1/12/2030	786,296	0.04
USD 733,911	Fannie Mae Pool 'BC0853' 3% 1/4/2031	729,950	0.04
USD 126,343	Fannie Mae Pool 'BC1707' 3% 1/1/2031	125,661	0.01
USD 48,363	Fannie Mae Pool 'BC1774' 3% 1/1/2031	48,102	0.00
USD 116,548	Fannie Mae Pool 'BC4017' 3% 1/3/2031	115,919	0.01
USD 114,851	Fannie Mae Pool 'BC4263' 3% 1/5/2031	114,231	0.01
USD 85,276	Fannie Mae Pool 'BC7657' 3% 1/4/2031	84,816	0.00
USD 35,401	Fannie Mae Pool 'BD1996' 3% 1/8/2031	35,210	0.00
USD 120,426	Fannie Mae Pool 'BD4404' 3% 1/7/2031	119,776	0.01
USD 762,558	Fannie Mae Pool 'BD6154' 3% 1/11/2031	758,442	0.04
USD 46,351	Fannie Mae Pool 'BE2583' 3% 1/6/2032	46,101	0.00
USD 820,345	Fannie Mae Pool 'BE3155' 3% 1/1/2032	816,448	0.04
USD 893,123	Fannie Mae Pool 'BE6942' 3% 1/2/2032	888,302	0.05
USD 43,756	Fannie Mae Pool 'BH0040' 3% 1/6/2032	43,520	0.00
USD 62,061	Fannie Mae Pool 'BH2512' 3% 1/7/2032	61,731	0.00
USD 87,085	Fannie Mae Pool 'BH3215' 3% 1/7/2032	86,622	0.00
USD 838,234	Fannie Mae Pool 'BH4308' 3% 1/6/2032	834,271	0.04
USD 857,957	Fannie Mae Pool 'BH5623' 3% 1/6/2032	853,899	0.04
USD 858,985	Fannie Mae Pool 'BH5704' 3% 1/10/2032	854,429	0.04
USD 830,323	Fannie Mae Pool 'BH6518' 3% 1/9/2032	825,920	0.04
USD 142,794	Fannie Mae Pool 'BH7433' 3% 1/8/2032	142,037	0.01
USD 31,890	Fannie Mae Pool 'BJ2995' 3% 1/1/2033	31,746	0.00
USD 830,318	Fannie Mae Pool 'BJ2996' 3% 1/1/2033	825,906	0.04
USD 53,992	Fannie Mae Pool 'BJ3002' 3% 1/2/2033	53,705	0.00
USD 144,886	Fannie Mae Pool 'BJ3883' 3% 1/1/2033	144,104	0.01
USD 132,284	Fannie Mae Pool 'BJ4268' 3% 1/12/2032	131,584	0.01
USD 180,828	Fannie Mae Pool 'BJ4694' 3% 1/1/2033	179,869	0.01
USD 39,592	Fannie Mae Pool 'BJ4734' 3% 1/12/2032	39,378	0.00
USD 70,865	Fannie Mae Pool 'BJ5289' 3% 1/2/2033	70,489	0.00
USD 37,809	Fannie Mae Pool 'BJ5985' 3% 1/12/2032	37,605	0.00
USD 829,818	Fannie Mae Pool 'BJ8563' 3% 1/3/2033	825,408	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 120,806	Fannie Mae Pool 'BJ8655' 3% 1/1/2033	120,165	0.01
USD 1,632,563	Fannie Mae Pool 'BK0931' 3% 1/7/2033	1,623,751	0.08
USD 102,193	Fannie Mae Pool 'BK4972' 3% 1/5/2033	101,650	0.01
USD 47,836	Fannie Mae Pool 'BK5161' 3% 1/6/2033	47,582	0.00
USD 754,000	Fannie Mae Pool 'BK5480' 3% 1/8/2033	749,930	0.04
USD 36,887	Fannie Mae Pool 'BK6720' 3% 1/6/2033	36,688	0.00
USD 900,008	Fannie Mae Pool 'CA0787' 3% 1/11/2032	895,230	0.05
USD 523,782	Fannie Mae Pool 'CA1095' 3% 1/2/2033	520,992	0.03
USD 50,757	Fannie Mae Pool 'MA0909' 3% 1/11/2021	50,813	0.00
USD 806,657	Fannie Mae Pool 'MA2561' 3% 1/3/2031	802,303	0.04
USD 143,851	Fannie Mae Pool 'MA2684' 3% 1/7/2031	143,074	0.01
USD 59,583	Fannie Mae Pool 'MA2903' 3% 1/2/2032	59,262	0.00
USD 30,270	Fannie Mae Pool 'MA3283' 3% 1/2/2033	30,106	0.00
USD 2,448,646	Fannie Mae Pool 'MA3339' 3% 1/4/2033	2,435,637	0.12
USD 1,699,998	Fannie Mae Pool 'MA3391' 3% 1/6/2033	1,690,958	0.09
USD 5,356,996	Fannie Mae REMICS 'Series 2013-133 NA' 3% 25/5/2036	5,333,635	0.27
USD 2,953,669	Fannie Mae REMICS 'Series 2015-10 KA' 3% 25/7/2040	2,915,762	0.15
USD 4,022,388	Fannie Mae-Aces 'Series 2013-M5 X2' FRN 25/1/2022	144,599	0.01
USD 234,472,124	Fannie Mae-Aces 'Series 2014-M13 X2' FRN 25/8/2024	1,640,531	0.08
USD 1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,293,947	0.07
USD 3,555,000	Ford Credit Auto Owner Trust 2017-C 'Series 2017-C A3' 2.01% 15/3/2022	3,511,500	0.18
USD 4,500,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-1 A2' FRN 15/2/2021	4,516,934	0.23
USD 8,500,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-3 A2' FRN 15/7/2021	8,535,777	0.43
USD 9,590,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-3 A1' 1.55% 15/7/2021	9,489,640	0.48
USD 3,000,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A 'Series 2016-5 A1' 1.95% 15/11/2021	2,967,255	0.15
USD 1,015,000	Ford Motor Credit Co LLC 1.897% 12/8/2019	1,003,102	0.05
USD 4,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.262% 28/3/2019	4,484,250	0.23
USD 3,500,000	Ford Motor Credit Co LLC 3.157% 4/8/2020	3,465,194	0.18
USD 2,510,000	Ford Motor Credit Co LLC 4.14% 15/2/2023	2,477,548	0.13
USD 8,247,462	Freddie Mac Gold Pool 'G15602' 2.5% 1/11/2027	8,062,788	0.41
USD 108,799,135	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series K040 X1' FRN 25/9/2024	4,024,757	0.20
USD 3,346,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ05 A2' 2.158% 25/10/2021	3,271,419	0.17
USD 2,890,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KJ18 A2' 3.065% 25/8/2022	2,891,864	0.15
USD 3,323,196	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KP03 A2' 1.78% 25/7/2019	3,300,540	0.17
USD 13,685,755	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 'Series KW01 X1' FRN 25/1/2026	751,133	0.04
USD 7,529,940	Freddie Mac Non Gold Pool '849692' FRN 1/5/2045	7,527,325	0.38
USD 5,895,222	Freddie Mac REMICS 'Series 4223 DG' 3% 15/12/2038	5,927,717	0.30
USD 2,145,874	Freddie Mac REMICS 'Series 4482 DH' 3% 15/6/2042	2,140,411	0.11
USD 3,849,963	Freddie Mac REMICS 'Series 4459 BN' 3% 15/8/2043	3,789,100	0.19

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 4,601,478	Freddie Mac REMICS 'Series 4748 HC' 3% 15/1/2044	4,549,309	0.23
USD 6,361,104	Freddie Mac REMICS 'Series 4735 BA' 3% 15/4/2047	6,250,929	0.32
USD 9,940,258	Freddie Mac REMICS 'Series 4705 D' 3.5% 15/10/2041	10,041,317	0.51
USD 2,640,987	Freddie Mac REMICS 'Series 4390 CA' 3.5% 15/6/2050	2,658,673	0.14
USD 4,524,010	Freddie Mac REMICS 'Series 4446 MA' 3.5% 15/12/2050	4,540,110	0.23
USD 3,588,873	Freddie Mac REMICS 'Series 4286 MP' 4% 15/12/2043	3,660,804	0.19
USD 5,849,206	Freddie Mac REMICS 'Series 4593 MP' 4% 15/4/2054	6,024,508	0.31
USD 169,681	Freddie Mac REMICS 'Series 3817 MA' 4.5% 15/10/2037	173,196	0.01
USD 318,787	Freddie Mac REMICS 'Series 3986 M' 4.5% 15/9/2041	330,932	0.02
USD 254,562	Freddie Mac REMICS 'Series 3959 MA' 4.5% 15/11/2041	265,560	0.01
USD 6,525,828	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-DNA2 M1' FRN 25/10/2029	6,598,171	0.34
USD 6,758,856	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 'Series 2017-HQA3 M1' FRN 25/4/2030	6,760,664	0.34
USD 635,000	General Motors Financial Co Inc 2.4% 9/5/2019	633,117	0.03
USD 1,495,000	General Motors Financial Co Inc 3.15% 15/1/2020*	1,495,684	0.08
USD 3,470,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	3,429,498	0.17
USD 2,295,000	General Motors Financial Co Inc 3.25% 5/1/2023	2,226,327	0.11
USD 1,535,000	General Motors Financial Co Inc 4.15% 19/6/2023	1,535,125	0.08
USD 970,000	Gilead Sciences Inc 2.5% 1/9/2023	929,138	0.05
USD 380,000	Goldman Sachs Group Inc/The 2% 25/4/2019	378,262	0.02
USD 9,725,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3% 26/4/2022	9,552,936	0.49
USD 535,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.2% 23/2/2023	526,738	0.03
USD 8,791,057	Government National Mortgage Association 'Series 2012-120 IO' FRN 16/2/2053	430,601	0.02
USD 5,019,537	Government National Mortgage Association 'Series 2018-36 AM' 3% 20/7/2045	4,965,989	0.25
USD 12,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust 'Series 2014-GRCE A' '144A' 3.369% 10/6/2028	12,411,444	0.63
USD 2,130,000	Great Wolf Trust 2017-WOLF 'Series 2017-WOLF A' '144A' FRN 15/9/2034	2,132,638	0.11
USD 4,530,000	Greystone Commercial Real Estate Notes 2017-FL1 Ltd 'Series 2017-FL1A A' '144A' FRN 15/3/2027	4,518,869	0.23
USD 5,773,857	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ7 'Series 2012-GCJ7 A4' 3.377% 10/5/2045	5,798,726	0.29
USD 3,360,000	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 'Series 2013-GC16 AAB' 3.813% 10/11/2046	3,421,882	0.17
USD 3,495,242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 'Series 2014-GC18 A4' 4.074% 10/1/2047	3,605,034	0.18
USD 1,940,000	Harley-Davidson Financial Services Inc '144A' 2.15% 26/2/2020	1,908,074	0.10
USD 1,293,000	Hartford Financial Services Group Inc/The 5.125% 15/4/2022	1,364,692	0.07
USD 2,224,000	Hewlett Packard Enterprise Co 2.85% 5/10/2018	2,224,355	0.11
USD 3,350,000	Hewlett Packard Enterprise Co 3.6% 15/10/2020	3,374,820	0.17
USD 4,731,000	Holmes Master Issuer Plc 'Series 2018-2A A2' '144A' FRN 15/10/2054	4,734,307	0.24
USD 2,475,000	Huntington National Bank/The 2.375% 10/3/2020	2,448,045	0.12
USD 3,260,000	Huntington National Bank/The 2.875% 20/8/2020	3,238,142	0.16
USD 1,710,000	Hyundai Capital America '144A' 1.75% 27/9/2019	1,690,720	0.09

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 880,000	Hyundai Capital America '144A' 2.4% 30/10/2018	879,718	0.04
USD 220,000	Hyundai Capital America '144A' 2.5% 18/3/2019	220,158	0.01
USD 1,575,000	Hyundai Capital America '144A' 2.55% 3/4/2020	1,550,776	0.08
USD 1,170,000	Hyundai Floorplan Master Owner Trust Series 2016-1 ' Series 2016-1A A2 ' '144A' 1.81% 15/3/2021	1,164,889	0.06
USD 3,151,000	International Lease Finance Corp 4.625% 15/4/2021	3,223,312	0.16
USD 4,190,000	International Lease Finance Corp 5.875% 1/4/2019	4,258,506	0.22
USD 1,030,000	International Lease Finance Corp '144A' 7.125% 1/9/2018	1,030,000	0.05
USD 900,000	ITC Holdings Corp 2.7% 15/11/2022	867,953	0.04
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-BCON ' Series 2018-BCON A ' '144A' 3.735% 5/1/2031	3,837,853	0.20
USD 1,725,000	John Deere Capital Corp 2.35% 8/1/2021	1,699,279	0.09
USD 6,610,000	John Deere Owner Trust 2017-B ' Series 2017-B A3 ' 1.82% 15/10/2021	6,521,618	0.33
USD 5,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-C1BX ' Series 2012-CBX A4 ' 3.483% 15/6/2045	5,029,397	0.26
USD 4,304,977	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C16 ' Series 2013-C16 ASB ' 3.674% 15/12/2046	4,358,795	0.22
USD 6,651,745	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-LC11 ' Series 2013-LC11 ASB ' 2.554% 15/4/2046	6,567,424	0.33
USD 6,000,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C20 ' Series 2014-C20 A2 ' 2.872% 15/7/2047	5,999,621	0.31
USD 12,834,951	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP4 ' Series 2016-JP4 XA ' FRN 15/12/2049	533,356	0.03
USD 5,326,321	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 ' Series 2016-2 A1 ' '144A' FRN 25/6/2046	5,290,438	0.27
USD 5,460,189	JP Morgan Mortgage Trust 2017-1 ' Series 2017-1 A4 ' '144A' FRN 25/1/2047	5,441,323	0.28
USD 14,234,373	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 ' Series 2017-3 1A6 ' '144A' FRN 25/8/2047	13,834,193	0.70
USD 8,467,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17 ' Series 2013-C17 ASB ' 3.705% 15/1/2047	8,589,528	0.44
USD 3,830,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ' Series 2014-C23 ASB ' 3.657% 15/9/2047	3,882,125	0.20
USD 1,055,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 ' Series 2014-C26 ASB ' 3.288% 15/1/2048	1,055,994	0.05
USD 3,380,000	JPMorgan Chase & Co FRN 18/6/2022	3,386,256	0.17
USD 6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	5,958,013	0.30
USD 2,305,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	2,295,891	0.12
USD 3,975,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/7/2024	3,989,264	0.20
USD 7,565,000	JPMorgan Chase & Co 2.2% 22/10/2019	7,515,665	0.38
USD 1,100,000	JPMorgan Chase & Co 2.972% 15/1/2023	1,077,304	0.05
USD 2,355,000	Keurig Dr Pepper Inc '144A' 4.057% 25/5/2023	2,369,853	0.12
USD 3,000,000	KeyBank NA/Cleveland OH 2.25% 16/3/2020	2,963,194	0.15
USD 250,000	KeyBank NA/Cleveland OH 3.35% 15/6/2021	250,604	0.01
USD 1,340,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 3.5% 1/3/2021	1,344,754	0.07
USD 1,500,000	Kinder Morgan Inc/DE 3.15% 15/1/2023	1,472,414	0.07
USD 2,715,000	Kinder Morgan Inc/DE '144A' 5% 15/2/2021	2,813,193	0.14
USD 971,000	Lam Research Corp 2.75% 15/3/2020	966,593	0.05
USD 8,855,000	Lam Research Corp 2.8% 15/6/2021	8,731,070	0.44

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 6,790,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 'Series 2018-1A A' '144A' 3.81% 21/12/2026	6,819,054	0.35
USD 2,814,923	LFRR '2015-1' '144A' 4% 30/10/2027	2,801,975	0.14
USD 1,385,000	Madison Avenue Trust 2013-650M 'Series 2013-650M A' '144A' 3.843% 12/10/2032	1,400,236	0.07
USD 1,624,000	Marriott International Inc/MD 3% 1/3/2019	1,624,580	0.08
USD 3,750,000	Maxim Integrated Products Inc 2.5% 15/11/2018	3,749,274	0.19
USD 7,042,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2016-B 'Series 2016-BA A' '144A' FRN 17/5/2021	7,070,312	0.36
USD 9,820,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2017-B 'Series 2017-BA A' '144A' FRN 16/5/2022	9,853,806	0.50
USD 12,850,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2018-BA 'Series 2018-BA A' '144A' FRN 15/5/2023	12,881,809	0.65
USD 5,387,225	Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 'Series 2016-1 A1' '144A' FRN 25/4/2057	5,299,108	0.27
USD 2,000,000	Moody's Corp 2.625% 15/1/2023	1,921,623	0.10
USD 325,000	Moody's Corp 2.75% 15/12/2021	318,914	0.02
USD 3,740,000	Morgan Stanley FRN 24/4/2024	3,735,721	0.19
USD 3,710,000	Morgan Stanley 2.375% 23/7/2019	3,698,740	0.19
USD 3,000,000	Morgan Stanley 2.625% 17/11/2021	2,929,741	0.15
USD 4,580,000	Morgan Stanley 2.75% 19/5/2022	4,465,713	0.23
USD 1,935,826	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 'Series 2013-C10 ASB' FRN 15/7/2046	1,969,725	0.10
USD 4,656,457	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C9 'Series 2013-C9 AAB' 2.657% 15/5/2046	4,609,628	0.23
USD 6,585,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C19 'Series 2014-C19 A2' 3.101% 15/12/2047	6,598,296	0.34
USD 4,036,294	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14 'Series 2014-C14 A2' 2.916% 15/2/2047	4,036,525	0.21
USD 3,740,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 'Series 2014-C18 ASB' 3.621% 15/10/2047	3,778,625	0.19
USD 4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-MP 'Series 2014-MP A' '144A' 3.469% 11/8/2033	4,991,664	0.25
USD 5,270,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A A1R' '144A' FRN 18/4/2027	5,274,317	0.27
USD 1,395,000	MPLX LP 3.375% 15/3/2023	1,373,308	0.07
USD 870,000	National Retail Properties Inc 5.5% 15/7/2021	911,241	0.05
USD 1,264,705	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2B' '144A' FRN 15/2/2029	1,279,308	0.07
USD 2,042,498	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-AA A2A' '144A' 2.74% 15/2/2029	2,013,349	0.10
USD 172,707	Navient Private Education Loan Trust 2014-CT 'Series 2014-CTA A' '144A' FRN 16/9/2024	172,946	0.01
USD 10,628,481	Navient Private Education Loan Trust 2018-B 'Series 2018-BA A1' '144A' FRN 15/12/2059	10,630,824	0.54
USD 2,795,000	NetApp Inc 2% 27/9/2019	2,772,124	0.14
USD 3,400,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd 'Series 2017-26A A' '144A' FRN 18/10/2030	3,405,948	0.17
USD 1,043,614	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 'Series 2016-3A A1B' '144A' FRN 25/9/2056	1,033,002	0.05
USD 4,608,351	New Residential Mortgage Trust 2018-1 'Series 2018-1A A1A' '144A' FRN 25/12/2057	4,660,550	0.24
USD 5,505,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 3.342% 1/9/2020	5,529,384	0.28

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

	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(続き)		
USD	8,200,000	Nissan Master Owner Trust Receivables ' Series 2017-B A ' FRN 18/4/2022	8,234,684	0.42
USD	7,610,000	Nissan Master Owner Trust Receivables ' Series 2016-A A2 ' 1.54% 15/6/2021	7,543,658	0.38
USD	117,446	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	121,298	0.01
USD	7,525,000	OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1A A ' ' 144A ' 3.43% 16/12/2024	7,531,426	0.38
USD	4,730,000	Pacific Gas & Electric Co ' 144A ' 4.25% 1/8/2023	4,764,101	0.24
USD	1,000,000	Palmer Square CLO 2013-2 Ltd ' Series 2013-2A A1AR ' ' 144A ' FRN 17/10/2027	1,000,323	0.05
USD	1,450,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 2.7% 14/3/2023	1,378,120	0.07
USD	4,389,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 3.05% 9/1/2020	4,376,265	0.22
USD	4,635,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.125% 1/8/2023	4,663,440	0.24
USD	1,075,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A ' 4.25% 17/1/2023	1,089,637	0.06
USD	9,405,000	PFS Financing Corp ' Series 2017-C A ' ' 144A ' FRN 15/10/2021	9,418,494	0.48
USD	1,490,000	PFS Financing Corp ' Series 2016-BA A ' ' 144A ' 1.87% 15/10/2021	1,473,073	0.08
USD	3,630,000	PFS Financing Corp ' Series 2018-B A ' ' 144A ' 2.89% 15/2/2023	3,598,585	0.18
USD	2,399,000	Pioneer Natural Resources Co 3.45% 15/1/2021	2,405,538	0.12
USD	2,000,000	PNC Bank NA 2.3% 1/6/2020	1,973,475	0.10
USD	1,505,000	PNC Bank NA 2.45% 5/11/2020	1,483,731	0.08
USD	1,445,000	Pricoa Global Funding I ' 144A ' 2.45% 21/9/2022	1,397,770	0.07
USD	4,510,000	QUALCOMM Inc 2.6% 30/1/2023	4,346,711	0.22
USD	1,570,000	QUALCOMM Inc 3% 20/5/2022	1,550,741	0.08
USD	1,587,259	RAIT 2017-FL7 Trust ' Series 2017-FL7 A ' ' 144A ' FRN 15/6/2037	1,588,497	0.08
USD	2,675,000	Reynolds American Inc 6.875% 1/5/2020	2,824,674	0.14
USD	2,400,000	Ryder System Inc 2.65% 2/3/2020	2,382,661	0.12
USD	885,000	Ryder System Inc 2.875% 1/9/2020	879,653	0.04
USD	1,640,000	Ryder System Inc 3.75% 9/6/2023	1,649,438	0.08
USD	651,524	Santander Drive Auto Receivables Trust 2017-1 ' Series 2017-1 A3 ' 1.77% 15/9/2020	650,855	0.03
USD	5,871,094	Santander Drive Auto Receivables Trust 2017-2 ' Series 2017-2 A3 ' 1.87% 15/12/2020	5,864,463	0.30
USD	2,810,000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2018-1 ' Series 2018-1 A3 ' 2.32% 16/8/2021	2,797,582	0.14
USD	1,340,000	Santander Drive Auto Receivables Trust 2018-3 ' Series 2018-3 A3 ' 3.03% 15/2/2022	1,340,972	0.07
USD	550,000	Santander Holdings USA Inc 3.4% 18/1/2023	534,761	0.03
USD	1,535,000	Santander Holdings USA Inc 3.7% 28/3/2022	1,524,184	0.08
USD	2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021	2,757,365	0.14
USD	2,755,000	Sempra Energy 1.625% 7/10/2019	2,711,672	0.14
USD	4,065,362	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 ' Series 2017-CH1 A2 ' ' 144A ' FRN 25/8/2047	4,041,547	0.21
USD	2,282,300	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2 ' Series 2017-CH2 A10 ' ' 144A ' FRN 25/12/2047	2,303,141	0.12

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,600,000	SLM Private Education Loan Trust 2011-B 'Series 2011-B A3' '144A' FRN 16/6/2042	1,642,786	0.08
USD 685,853	SLM Private Education Loan Trust 2011-C 'Series 2011-C A2B' '144A' 4.54% 17/10/2044	693,771	0.04
USD 554,236	SLM Private Education Loan Trust 2012-A 'Series 2012-A A2' '144A' 3.83% 17/1/2045	556,531	0.03
USD 936,672	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A A2B' '144A' FRN 15/1/2026	940,482	0.05
USD 672,909	SLM Private Education Loan Trust 2014-A 'Series 2014-A A2A' '144A' 2.59% 15/1/2026	671,761	0.03
USD 1,578,301	SLM Student Loan Trust 2013-4 'Series 2013-4 A' FRN 25/6/2043	1,587,831	0.08
USD 2,910,063	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 'Series 2015-C A2A' '144A' 2.75% 15/7/2027	2,887,326	0.15
USD 2,105,262	SMB Private Education Loan Trust 2016-A 'Series 2016-A A2A' '144A' 2.7% 15/5/2031	2,061,812	0.10
USD 2,459,855	SMB Private Education Loan Trust 2016-B 'Series 2016-B A2A' '144A' 2.43% 17/2/2032	2,390,372	0.12
USD 2,464,874	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 'Series 2017-A A1' '144A' FRN 17/6/2024	2,466,280	0.13
USD 5,260,000	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 'Series 2017-A A2B' '144A' FRN 15/9/2034	5,298,448	0.27
USD 693,855	SoFi Professional Loan Program 2014-B LLC 'Series 2014-B A2' '144A' 2.55% 27/8/2029	688,589	0.04
USD 1,072,898	SoFi Professional Loan Program 2015-A LLC 'Series 2015-A A1' '144A' FRN 25/3/2033	1,083,528	0.06
USD 4,296,944	SoFi Professional Loan Program 2015-d LLC 'Series 2015-D A2' '144A' 2.72% 27/10/2036	4,239,416	0.22
USD 1,712,638	SoFi Professional Loan Program 2016-A LLC 'Series 2016-A A2' '144A' 2.76% 26/12/2036	1,692,283	0.09
USD 1,130,000	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC 'Series 2016-C A2B' '144A' 2.36% 27/12/2032	1,109,039	0.06
USD 505,343	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC 'Series 2016-D A2A' '144A' 1.53% 25/4/2033	504,186	0.03
USD 1,010,000	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC 'Series 2016-D A2B' '144A' 2.34% 25/4/2033	991,244	0.05
USD 6,390,000	SoFi Professional Loan Program 2016-E LLC 'Series 2016-E A2B' '144A' 2.49% 25/1/2036	6,302,439	0.32
USD 2,172,651	SoFi Professional Loan Program 2017-C LLC 'Series 2017-C A2A' '144A' 1.75% 25/7/2040	2,152,986	0.11
USD 21,000,000	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC 'Series 2017-D A2FX' '144A' 2.65% 25/9/2040	20,475,528	1.04
USD 670,000	Sound Point Clo XII Ltd 'Series 2016-2A A' '144A' FRN 20/10/2028	670,734	0.03
USD 105,348	Soundview Home Loan Trust 2003-2 'Series 2003-2 A2' FRN 25/11/2033	108,772	0.01
USD 620,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	642,919	0.03
USD 1,351,916	Springleaf Funding Trust 2015-A 'Series 2015-AA A' '144A' 3.16% 15/11/2024	1,352,582	0.07
USD 1,367,000	Sprint Communications Inc '144A' 9% 15/11/2018	1,382,379	0.07
USD 751,563	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 3.36% 20/9/2021	749,728	0.04
USD 2,975,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20/3/2025	2,982,438	0.15
USD 1,375,000	Stryker Corp 2% 8/3/2019	1,370,905	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 960,000	Sunoco Logistics Partners Operations LP 5.5% 15/2/2020	988,279	0.05
USD 390,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.875% 15/1/2023	385,125	0.02
USD 3,730,000	SunTrust Banks Inc 2.7% 27/1/2022	3,642,727	0.19
USD 250,000	Synchrony Bank 3% 15/6/2022	240,765	0.01
USD 2,120,000	Synchrony Financial 2.6% 15/1/2019	2,118,358	0.11
USD 2,515,000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 2.8% 15/10/2022	2,430,700	0.12
USD 1,705,000	Thermo Fisher Scientific Inc 3% 15/4/2023	1,659,633	0.08
USD 760,000	Thermo Fisher Scientific Inc 3.15% 15/1/2023	748,286	0.04
USD 695,000	Time Warner Cable LLC 8.25% 1/4/2019	716,192	0.04
USD 1,130,000	Time Warner Cable LLC 8.75% 14/2/2019	1,159,149	0.06
USD 420,000	Total System Services Inc 3.75% 1/6/2023	418,418	0.02
USD 1,350,000	Total System Services Inc 4% 1/6/2023	1,359,293	0.07
USD 3,268,351	Towd Point Mortgage Trust 2016-3 'Series 2016-3 A1' ' 144A' FRN 25/4/2056	3,205,644	0.16
USD 4,372,003	Towd Point Mortgage Trust 2016-4 'Series 2016-4 A1' ' 144A' FRN 25/7/2056	4,270,608	0.22
USD 3,810,000	Toyota Auto Receivables 2016-B Owner Trust 'Series 2016-B A4' 1.52% 16/8/2021	3,758,198	0.19
USD 14,555,000	Toyota Auto Receivables 2017-D Owner Trust 'Series 2017-D A3' 1.93% 18/1/2022	14,325,824	0.73
USD 10,250,000	Toyota Auto Receivables 2018-A Owner Trust 'Series 2018-A A3' 2.35% 16/5/2022	10,150,423	0.52
USD 13,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 31/7/2019*	12,878,379	0.65
USD 101,900,000	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/10/2020*	99,720,716	5.07
USD 40,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 30/9/2019	39,691,406	2.02
USD 30,000,000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15/8/2019	30,325,195	1.54
USD 3,190,000	United Technologies Corp 3.35% 16/8/2021	3,203,977	0.16
USD 2,135,000	United Technologies Corp 3.65% 16/8/2023	2,147,650	0.11
USD 3,145,414	US Airways 2011-1 Class B Pass Through Trust 9.75% 22/10/2018	3,183,411	0.16
USD 1,378,911	US Airways 2012-1 Class B Pass Through Trust 8% 1/10/2019	1,435,738	0.07
USD 2,560,000	US Bank NA/Cincinnati OH 2.125% 28/10/2019	2,543,017	0.13
USD 143,000	Viacom Inc 2.75% 15/12/2019	141,705	0.01
USD 1,240,000	Virginia Electric & Power Co 5% 30/6/2019	1,262,329	0.06
USD 5,745,000	Voya CLO 2014-3 Ltd 'Series 2014-3A A1R' '144A' FRN 25/7/2026	5,745,677	0.29
USD 1,030,000	Waldorf Astoria Boca Raton Trust 2016-BOCA 'Series 2016-BOCA A' '144A' FRN 15/6/2029	1,032,207	0.05
USD 2,520,000	Walgreen Co 3.1% 15/9/2022	2,479,107	0.13
USD 5,856,000	Walgreens Boots Alliance Inc 2.7% 18/11/2019	5,836,485	0.30
USD 1,220,000	Warner Media LLC 4.7% 15/1/2021	1,258,931	0.06
USD 2,285,000	WEC Energy Group Inc 3.375% 15/6/2021	2,293,618	0.12
USD 2,355,000	Wells Fargo & Co 2.125% 22/4/2019	2,347,649	0.12
USD 1,195,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	1,171,483	0.06
USD 4,065,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 'Series 2014-LC16 ASB' 3.477% 15/8/2050	4,095,012	0.21
USD 500,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22 'Series 2015-LC22 ASB' 3.571% 15/9/2058	505,966	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,000,000	WestRock Co '144A' 3.75% 15/3/2025	1,972,159	0.10
USD 4,345,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C7 'Series 2012-C7 AFL' '144A' FRN 15/6/2045	4,452,325	0.23
USD 4,335,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 'Series 2012-C8 AFL' '144A' FRN 15/8/2045	4,404,733	0.22
USD 5,550,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 'Series 2014- C21 ASB' 3.393% 15/8/2047	5,579,610	0.28
USD 326,715	Wheels SPV 2 LLC 'Series 2016-1A A2' '144A' 1.59% 20/5/2025	325,664	0.02
USD 953,273	Wheels SPV 2 LLC 'Series 2017-1A A2' '144A' 1.88% 20/4/2026	946,590	0.05
USD 1,740,000	Williams Cos Inc/The 3.6% 15/3/2022	1,737,081	0.09
USD 1,765,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/11/2021	1,788,115	0.09
USD 2,275,000	Williams Cos Inc/The 4.55% 24/6/2024	2,332,785	0.12
USD 1,670,000	Willis North America Inc 3.6% 15/5/2024	1,635,059	0.08
USD 3,205,000	Xerox Corp 3.5% 20/8/2020	3,197,255	0.16
USD 1,576,000	Xerox Corp 3.625% 15/3/2023	1,486,472	0.08
USD 2,345,000	Xilinx Inc 2.125% 15/3/2019	2,338,789	0.12
USD 719,000	ZF North America Capital Inc '144A' 4.5% 29/4/2022	732,949	0.04
		1,554,907,086	79.00
債券合計		1,819,296,370	92.44
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲 渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,954,817,242	99.32

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
米国			
USD 350,000	Structured Asset Receivables Trust Series '2003-2' 0.649% 31/12/2049	-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		-	0.00
投資有価証券合計		1,954,817,242	99.32
その他の純資産		13,410,699	0.68
純資産合計(米ドル)		1,968,227,941	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	617,000	USD	5,541	Barclays	6/9/2018	28
USD	1,278,924	AUD	1,722,000	Bank of America	6/9/2018	36,512
USD	11,411,292	EUR	9,719,000	UBS	6/9/2018	99,431
USD	13,613,568	GBP	10,360,000	Toronto Dominion	6/9/2018	177,108
USD	11,090	JPY	1,234,000	Barclays	6/9/2018	(49)
RUB	1,878,334	USD	30,000	RBS Plc	12/9/2018	(2,311)
USD	30,000	RUB	1,905,735	RBS Plc	12/9/2018	1,907
ARS	3,556,125	USD	130,500	BNP Paribas	14/9/2018	(38,547)
ARS	3,784,200	USD	140,000	Citibank	14/9/2018	(42,149)
ARS	4,446,435	USD	164,500	JP Morgan	14/9/2018	(49,526)
USD	435,000	ARS	9,744,957	BNP Paribas	14/9/2018	183,019
ARS	1,587,450	USD	57,000	BNP Paribas	17/9/2018	(16,089)
USD	57,000	ARS	1,724,250	Citibank	17/9/2018	12,563
AUD	3,480,000	CAD	3,338,159	Morgan Stanley	20/9/2018	(48,287)
AUD	3,320,000	NZD	3,624,544	Toronto Dominion	20/9/2018	(9,156)
AUD	3,380,000	NZD	3,687,891	Citibank	20/9/2018	(7,890)
CAD	6,674,900	AUD	6,800,000	ANZ	20/9/2018	210,925
CAD	3,440,000	CHF	2,580,647	RBS Plc	20/9/2018	(30,119)
CAD	6,941,662	NZD	7,590,000	HSBC Bank Plc	20/9/2018	286,395
CHF	2,470,000	JPY	276,748,136	JP Morgan	20/9/2018	52,475
JPY	547,030,101	CHF	4,920,000	Goldman Sachs	20/9/2018	(142,701)
JPY	576,961,875	USD	5,250,000	Goldman Sachs	20/9/2018	(37,143)
NOK	20,085,967	AUD	3,320,000	Nomura	20/9/2018	13,296
NOK	21,577,180	CHF	2,630,000	HSBC Bank Plc	20/9/2018	(130,809)
NOK	40,897,563	EUR	4,310,000	HSBC Bank Plc	20/9/2018	(117,245)
SEK	44,584,741	EUR	4,370,000	JP Morgan	20/9/2018	(194,034)
EUR	513,000	USD	602,110	Toronto Dominion	3/10/2018	(3,848)
USD	602,219	EUR	513,000	Morgan Stanley	3/10/2018	3,957
USD	474,216	ZAR	6,308,750	Goldman Sachs	3/10/2018	46,371
USD	7,145	ZAR	94,976	Bank of America	3/10/2018	704
ZAR	6,403,726	USD	479,343	Bank of America	3/10/2018	(45,056)
USD	5,552	JPY	617,000	Barclays	4/10/2018	(29)
USD	48,860	IDR	720,877,766	Barclays	19/10/2018	1,270
MXN	19,295,860	USD	991,000	HSBC Bank Plc	26/11/2018	5,457
USD	991,000	MXN	19,333,248	HSBC Bank Plc	26/11/2018	(7,387)
未実現純評価益						209,043
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	133,706,175	USD	155,438,125	BNY Mellon	14/9/2018	272,648
USD	215,550	EUR	187,302	BNY Mellon	14/9/2018	(2,576)
未実現純評価益						270,072

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2018年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	282,595	USD	207,296	BNY Mellon	14/9/2018	(1,219)
USD	6,359	SGD	8,671	BNY Mellon	14/9/2018	36
未実現純評価損						(1,183)
未実現純評価益合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 277,577,526米ドル)						477,932

事後通告証券契約 2018年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
米国			
USD 5,250,000	Fannie Mae Pool '2 9/18' 2% TBA	4,951,535	0.25
USD 12,255,000	Fannie Mae Pool '2.5 10/18' 2.5% TBA	11,890,523	0.60
USD 26,047,000	Fannie Mae Pool '2.5 9/18' 2.5% TBA	25,315,444	1.29
USD 11,825,000	Fannie Mae Pool '3 9/18' 3% TBA	11,750,862	0.60
USD 5,855,000	Fannie Mae Pool '4 9/18' 4% TBA	5,991,655	0.30
USD 5,000,000	Fannie Mae Pool '4.5 9/18' 4.5% TBA	5,041,504	0.26
USD 12,500,000	Freddie Mac Gold Pool '3 9/18' 3% TBA	12,391,503	0.63
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 77,333,026米ドル)		77,333,026	3.93

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

未決済上場先物取引 2018年8月31日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	基礎となるエク スポージャー (米ドル)	未実現評価益/ (損) (米ドル)
5	EUR	Euro Bund	2018年9月	949,537	12,906
4,360	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2018年12月	921,322,500	213,918
1	USD	US Ultra Bond (CBT)	2018年12月	159,969	(425)
(24)	USD	US Long Bond (CBT)	2018年12月	3,470,250	(5,066)
(179)	USD	US Ultra 10 Year Note	2018年12月	22,942,766	24,222
(397)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2018年12月	47,770,266	(71,306)
(2,421)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2018年12月	274,518,703	(237,539)
合計				1,271,133,991	(63,290)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2018年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2020	11,182	3,896
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(7,379)	(3,847)
CDS	USD (150,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2022	(243)	10,650
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(71,289)	639,012
CDS	USD (10,245,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	20/12/2022	118,400	727,408
CDS	USD (5,000,000)	ファンドはCDX.NA.HY.30.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	50,554	338,422
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2020	(6,237)	(3,896)
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	11,883	3,847
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	20/12/2022	(8,357)	(213,004)
IRS	USD 37,040,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.135%の固定金利を支払う	Barclays	31/8/2020	1,194,536	1,194,536
IRS	USD 59,920,000	ファンドは1日USD LIBORの変動金利を受け取り、2.57%の固定金利を支払う	Citigroup	30/9/2020	54,726	54,726
IRS	EUR 31,100,000	ファンドは0.49361%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	227,524	227,524
IRS	EUR 31,100,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.44988%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	4/7/2019	(214,156)	(214,156)
IRS	USD 4,195,000	ファンドは2.645%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Deutsche Bank	20/1/2027	(44,109)	(44,109)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 202,701,517米ドル)					1,317,035	2,721,009

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 2018年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
JPY 7,480,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは25/7/2019より6ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を半年毎に受け取り、25/7/2019より1.38%の固定金利を半年毎に支払う	Credit Suisse	23/1/2019	(214,305)	8,246
USD 12,585,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは20/4/2022より3ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を四半期毎に受け取り、20/7/2022より3.35%の固定金利を半年毎に支払う	Deutsche Bank	18/1/2022	(104,911)	178,252
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 5,113,125米ドル)				(319,216)	186,498

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2019年6月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

資産総額	1,829,755,609円
負債総額	663,218円
純資産総額(-)	1,829,092,391円
発行済数量	1,932,155,680口
1 単位当たり純資産額(/)	0.9467円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行

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

6 受益権の譲渡

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

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

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件

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

8 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行ないません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

9 償還金

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

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

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

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する証券投資信託は2019年6月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)。

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	81本	1,538,584百万円
	単位型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		79本	6,420,264百万円
合計		160本	7,958,847百万円

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1963年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度(自2018年1月1日 至2018年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,097	23,891
立替金	11	2
前払費用	171	151
未収入金	3	11
未収委託者報酬	1,585	1,588
未収運用受託報酬	2,642	2,291
未収収益	2 1,384	1,402
為替予約	0	-
その他流動資産	33	18
流動資産計	24,928	29,359
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 946	1,484
器具備品	1 411	380
有形固定資産計	1,358	1,864
無形固定資産		
ソフトウェア	4	8
のれん	42	-
無形固定資産計	47	8
投資その他の資産		
投資有価証券	3	11
長期差入保証金	1,124	1,119
前払年金費用	588	696
長期前払費用	25	27
繰延税金資産	786	848
投資その他の資産計	2,528	2,702
固定資産計	3,934	4,575
資産合計	28,863	33,935

	第31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	119	97
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	74
未払手数料	593	515
その他未払金	1,737	1,184
未払費用	2	
未払消費税等	150	97
未払法人税等	438	440
為替予約	-	3
前受金	79	78
前受収益	15	-
賞与引当金	1,886	1,939
役員賞与引当金	144	142
早期退職慰労引当金	9	42
流動負債計	6,500	5,661
固定負債		
退職給付引当金	55	60
資産除去債務	262	781
固定負債計	318	842
負債合計	6,818	6,503
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,739	17,127
利益剰余金合計	12,076	17,464
株主資本合計	22,044	27,432
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等合計	0	0
純資産合計	22,044	27,431
負債・純資産合計	28,863	33,935

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,202	5,639
運用受託報酬	1	8,890	8,523
その他営業収益	1	12,257	13,511
営業収益計		26,350	27,674
営業費用			
支払手数料		1,830	1,856
広告宣伝費		208	191
調査費			
調査費		380	363
委託調査費	1	4,313	4,164
調査費計		4,693	4,528
委託計算費		86	84
営業雑経費			
通信費		50	59
印刷費		62	11
諸会費		32	34
営業雑経費計		145	106
営業費用計		6,964	6,767
一般管理費			
給料			
役員報酬		353	406
給料・手当		3,960	4,213
賞与		2,232	2,359
給料計		6,546	6,979
退職給付費用		287	275
福利厚生費		892	940
事務委託費	1	2,433	2,568
交際費		69	66
寄付金		2	3
旅費交通費		243	238
租税公課		231	245
不動産賃借料		735	804
水道光熱費		65	72
固定資産減価償却費		262	315
のれん償却額		56	42
資産除去債務利息費用		3	3
諸経費		363	424
一般管理費計		12,194	12,980
営業利益		7,191	7,926

	第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業外収益		
受取利息	0	0
有価証券売却益	0	0
雑益	0	0
営業外収益計	1	1
営業外費用		
為替差損	34	26
営業外費用計	34	26
経常利益	7,158	7,901
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	119	84
特別損失計	119	84
税引前当期純利益	7,039	7,817
法人税、住民税及び事業税	2,223	2,491
法人税等調整額	29	61
当期純利益	4,786	5,387

(3)【株主資本等変動計算書】

第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

(単位: 百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2017年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887
事業年度中の変動額											
新株の発行	685	685		685				1,370			1,370
当期純利益						4,786	4,786	4,786			4,786
株主資本以外の項目 の事業年度中の変動 額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額 合計	685	685	-	685	-	4,786	4,786	6,156	0	0	6,156
2017年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044

第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

(単位: 百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2018年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
事業年度中の変動額											
当期純利益						5,387	5,387	5,387			5,387
株主資本以外の項目 の事業年度中の変動 額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額 合計	-	-	-	-	-	5,387	5,387	5,387	0	0	5,387
2018年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

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

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

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

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

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

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

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

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

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

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

- (3) 賞与引当金の計上方法
従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
- (4) 役員賞与引当金の計上方法
役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
- (5) 早期退職慰労引当金の計上方法
早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準
外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
- (1) 消費税等の処理方法
消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。
- (2) 連結納税制度の適用
親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

（未適用の会計基準等）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の早期適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 2018年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。）が当事業年度の期末から適用できるようになったことに伴い、当事業年度から税効果会計基準一部改正を適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」860百万円及び「固定負債」の「繰延税金負債」74百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」786百万円に含めて表示しております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
建物附属設備	1,346 百万円	1,525 百万円
器具備品	821 百万円	950 百万円

2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
未収収益	508 百万円	554 百万円
未払金	1,713 百万円	1,168 百万円
未払費用	356 百万円	385 百万円

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

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
その他営業収益	4,670 百万円	5,680 百万円
委託調査費	438 百万円	704 百万円
事務委託費	824 百万円	864 百万円
運用受託報酬	48 百万円	149 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2017年12月31日）

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

当事業年度(2018年12月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	23,891	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	1,588	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	2,291	-
(4) 未収収益	1,402	1,402	-
(5) 長期差入保証金	1,119	1,112	6
資産計	30,293	30,287	6
(1) 未払手数料	515	515	-
(2) 未払費用	1,039	1,039	-
負債計	1,554	1,554	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

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

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

(5) 長期差入保証金

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度(2017年12月31日)

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

当事業年度（2018年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	-	-	-
(4) 未収収益	1,402	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	56	11
合計	29,174	1,051	56	11

（有価証券関係）

前事業年度（2017年12月31日）

その他有価証券

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

当事業年度（2018年12月31日）

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	11	12	0
合計		11	12	0

（退職給付関係）

前事業年度（自 2017年1月1日 至 2017年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,745
勤務費用	268
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	20
退職給付の支払額	170
退職給付債務の期末残高	1,832

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
年金資産の期首残高	2,381
期待運用収益	19
数理計算上の差異の発生額	83
事業主からの拠出額	290
退職給付の支払額	153
年金資産の期末残高	2,621

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (2017年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,776
年金資産	2,621
	845
非積立型制度の退職給付債務	55
未積立退職給付債務	789
未認識数理計算上の差異	242
未認識過去勤務費用	13
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532
退職給付引当金	55
前払年金費用	588
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
勤務費用	268
利息費用	8
期待運用収益	19
数理計算上の差異の費用処理額	35
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	216
特別退職金	119
合計	335

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

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

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
割引率	0.4%
長期期待運用収益率	0.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円でありました。

当事業年度（自 2018年1月1日 至 2018年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,832
勤務費用	269
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	11
退職給付の支払額	138
過去勤務費用の発生額	47
退職給付債務の期末残高	1,934

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
年金資産の期首残高	2,621
期待運用収益	23
数理計算上の差異の発生額	113
事業主からの拠出額	303
退職給付の支払額	138
年金資産の期末残高	2,696

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

(単位：百万円)

	当事業年度 (2018年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,874
年金資産	2,696
	821
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	761
未認識数理計算上の差異	73
未認識過去勤務費用	52
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635
退職給付引当金	60
前払年金費用	696
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
勤務費用	269
利息費用	7
期待運用収益	23
数理計算上の差異の費用処理額	44
過去勤務費用の処理額	8
確定給付制度に係る退職給付費用合計	200
特別退職金	84
合計	285

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2018年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券77%、株式20%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	206	167
賞与引当金	537	591
資産除去債務	80	239
資産調整勘定	4	-
未払事業税	74	83
早期退職慰労引当金	2	13
退職給付引当金	17	18
有形固定資産	4	3
その他	44	96
繰延税金資産合計	973	1,213
繰延税金負債		
退職給付引当金	180	213
資産除去債務に対応する除去費用	6	152
繰延税金負債合計	186	365
繰延税金資産の純額	786	848

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

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	786	848

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

	前事業年度 (2017年12月31日)		当事業年度 (2018年12月31日)	
法定実効税率	30.9	%	30.9	%
(調整)				
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.1		1.0	
損金不算入ののれん償却額	0.2		0.2	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.2		0.1	
所得拡大促進税制による税額控除	1.8		1.9	
その他	0.4		0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.0	%	31.1	%

(資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間約5年と見積り、割引率は0.16%~0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。当事業年度において、資産の除去時点において必要とされる除去費用の見積額が、固定資産の取得時における見積額を大幅に超過することが明らかになったことから、見積もりの変更による増加額を0.16%で割り引き、資産除去債務残高が440百万円増加しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
期首残高	258	262
有形固定資産の取得に伴う増加額	-	75
見積りの変更による増加額	-	440
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	262	781

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 (2017年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

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

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度 (2018年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	164	-	3	3
合計		164	-	3	3

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

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

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,639	8,523	13,511	27,674

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,237	11,293	3,143	27,674

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,830	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,458	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	14,286 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	48	未収収益	508
							受入手数料	4,670		
							委託調査費	438	未払費用	356
							事務委託費	824	その他未払金	67
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,645

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	149	未収収益	554
							受入手数料	5,680		
							委託調査費	704	未払費用	385
							事務委託費	864	その他未払金	165
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	その他未払金	1,002

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

該当事項はありません。

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

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,512	未収収益	296
							委託調査費	77	未払費用	17
							事務委託費	10		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	314百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	363	未収収益	28
							委託調査費	1,427	未払費用	129
							事務委託費	119	その他未払金	1

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,458	未収収益	330
							委託調査費	37	未払費用	4
							事務委託費	8		

(注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
1株当たり純資産額	1,469,634 円 10 銭	1,828,761 円 92 銭
1株当たり当期純利益金額	456,306 円 62 銭	359,180 円 40 銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,786	5,387
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	4,786	5,387
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,490	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2018年1月1日 至2018年12月31日)を対象としております。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(2019年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・資本金 : 51,000百万円(2019年3月末現在)
- ・事業の内容 : 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2019年3月末現在)	事業の内容
藍澤証券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社*	3,000	
株式会社SBI証券	48,323	
SMB C日興証券株式会社	10,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱UFJモルガン・スタンレーPB証券株式会社	8,000	
楽天証券株式会社	7,495	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。
株式会社伊予銀行*	20,948	

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

金商法第4条第1項又は第2項の規定による届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載します。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、以下「投信法」という。）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

2 交付目論見書の「投資リスク」記載箇所に金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨を記載します。

3 目論見書は別称として、「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

4 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

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

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2018年1月1日から2018年12月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2018年12月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2019年8月7日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員
公認会計士 辻村 和之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2018年12月21日から2019年6月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2019年6月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。