

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年9月30日

【発行者名】 ヘンダーソン・マネジメント・エスエー
(Henderson Management, S.A.)

【代表者の役職氏名】 取締役
トニー・サグルー (Tony Sugrue)
イグナチオ・デ・ラ・マーサ (Ignacio de la Maza)
マッテオ・カンドルフィーニー (Matteo Candolfini)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルク大公国、ルクセンブルク市L-1273、
ビトブル通り2番地
(2 rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 森 下 国 彦

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 橋 本 雅 行
同 島 田 充 生
同 上 山 紗 穂
同 東 直 希

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

【電話番号】 (03)6775-1000

【届出の対象とした募集外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
ジャナス・セレクション (Janus Selection)

【届出の対象とした募集外国投資信託受益証券の金額】
受益証券総額3兆円を限度とします。
それぞれのサブファンドごとの最大発行価額は以下のとおりです。

最大発行価額

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

(愛称：「足下しっかり型」)

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

(愛称：「剣と盾型」)

当初申込期間（2020年8月31日（月）から2020年9月29日（火）まで）

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

継続申込期間（2020年10月1日（木）から2021年6月30日（水）まで）

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

ジャナス・ハイイールド・ファンド

(愛称：「収穫型」)

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

クラスA(米ドル)受益証券(毎月分配型) 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券(毎月分配型) 3,000億円

ジャナス・バランス・ファンド

(愛称：「全天候型」)

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

(愛称：「みにくいアヒルの子型」)

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

ジャナス・フォーティ・ファンド

(愛称：「ノアの箱舟 厳選型」)

クラスA(米ドル)受益証券 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券 3,000億円

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

(愛称：「大地の実り型」)

クラスA(米ドル)受益証券（四半期分配型） 30億米ドル(約3,232億円)

クラスA(円)受益証券（四半期分配型） 3,000億円

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

(注1) 本書中における各種通貨の円貨換算は、別段の記載のあるものを除き、2020年6月30日現在の株式会社三菱UFJ銀行公表の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=107.74円)によります。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2020年8月13日付で提出した有価証券届出書（2020年8月31日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済。）の記載事項を新たな情報により訂正及び更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

【訂正事項】

第二部 ファンド情報

第3 ファンドの経理状況

1 財務諸表

- (1) 貸借対照表
- (2) 損益計算書
- (3) 投資有価証券明細表等
 - ① 投資株式明細表
 - ② 株式以外の投資有価証券明細表
 - ③ 投資不動産明細表
 - ④ その他投資資産明細表
 - ⑤ 借入金明細表

2 ファンドの現況

純資産額計算書

【訂正箇所】

訂正箇所は下線をもって示しております。

第3 【ファンドの経理状況】

以下の中間財務諸表が追加されます。

- (1) 当ファンドの2020年6月30日に終了した6ヶ月間の日本文の中間財務書類は、アイルランドにおいて一般に公正妥当と認められる会計基準及び1990年ユニット・トラスト法を含むアイルランドの法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものです(但し、円換算部分を除きます。)。これは、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)第76条第4項但し書きの規定の適用によるものです。
- (2) 当ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号)第1条の3第7項に規定される外国監査法人等をいいます。)の監査を受けておりません。
- (3) 当ファンドの原文の中間財務書類は米ドルで表示されています。日本文の未監査中間財務書類には、2020年6月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行公表の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=107.74円)を使用して換算された円換算額が、併記されています。金額は千円単位(単位金額未満は四捨五入)で表示されています。なお、日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総和と一致しない場合があります。

【2020年6月30日に終了した6ヶ月間の中間財務書類】

1 【財務諸表】

(1) 【貸借対照表】

財政状態計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産	409,967,655	44,169,915	400,007,719	43,096,832
現金及び外国通貨	—	—	534	58
未収金：				
売却投資証券	95,865	10,328	715,223	77,058
発行ファンド受益証券	837,161	90,196	1,563,764	168,480
管理会社からの未収金	1	0	1	0
ファンド資産現金残高	—	—	—	—
流動資産合計	410,900,682	44,270,439	402,287,241	43,342,427
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 負債	89,140	9,604	2,848	307
銀行当座借越及び外国通貨	7,020	756	—	—
未払金：				
購入投資証券	278,010	29,953	715,613	77,100
買戻しファンド受益証券	1,313,318	141,497	1,887,193	203,326
管理会社報酬	89,170	9,607	87,695	9,448
受益者サービス手数料	157,861	17,008	158,476	17,074
会計・管理・名義書換手数料	11,025	1,188	18,247	1,966
ファンド資産未払金	—	—	—	—
未払費用	53,743	5,790	155,935	16,800
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益 者に帰属する純資産を除く)	1,999,287	215,403	3,026,007	326,022
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純 資産	408,901,395	44,055,036	399,261,234	43,016,405

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	243,460,975	26,230,485	269,030,820	28,985,381
現金及び外国通貨	—	—	995	107
未収金：				
売却投資証券	53,880	5,805	1,579,682	170,195
発行ファンド受益証券	1,009,638	108,778	1,374,492	148,088
管理会社からの未収金	2	0	2	0
ファンド資産現金残高	—	—	—	—
流動資産合計	244,524,495	26,345,069	271,985,991	29,303,771
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	68,887	7,422	12,598	1,357
銀行当座借越及び外国通貨	4,983	537	—	—
未払金：				
購入投資証券	1,002,696	108,030	1,569,120	169,057
買戻しファンド受益証券	131,780	14,198	2,688,914	289,704
管理会社報酬	54,162	5,835	58,139	6,264
受益者サービス手数料	151,621	16,336	165,289	17,808
会計・管理・名義書換手数料	6,719	724	27,877	3,003
ファンド資産未払金	—	—	—	—
未払費用	34,567	3,724	68,674	7,399
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	1,455,415	156,806	4,590,611	494,592
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	243,069,080	26,188,263	267,395,380	28,809,178

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	92,461,799	9,961,834	91,451,486	9,852,983
現金及び外国通貨	—	—	1,533	165
未収金：				
売却投資証券	—	—	435,440	46,914
発行ファンド受益証券	218,271	23,517	812,383	87,526
管理会社からの未収金	—	—	—	—
ファンド資産現金残高	30,600	3,297	—	—
流動資産合計	92,710,670	9,988,648	92,700,842	9,987,589
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	49,055	5,285	7	1
銀行当座借越及び外国通貨	1,714	185	—	—
未払金：				
購入投資証券	93,305	10,053	438,468	47,241
買戻しファンド受益証券	—	—	181,373	19,541
管理会社報酬	20,043	2,159	19,809	2,134
受益者サービス手数料	64,191	6,916	64,940	6,997
会計・管理・名義書換手数料	2,359	254	5,801	625
ファンド資産未払金	30,600	3,297	—	—
未払費用	16,227	1,748	34,189	3,684
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	277,494	29,897	744,587	80,222
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	92,433,176	9,958,750	91,956,255	9,907,367

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産	52,910,306	5,700,556	60,363,797	6,503,595
現金及び外国通貨	2,568	277	1,382	149
未収金：				
売却投資証券	1,076,424	115,974	21,511	2,318
発行ファンド受益証券	1,050,793	113,212	458,534	49,402
管理会社からの未収金	183,900	19,813	13,153	1,417
ファンド資産現金残高	—	—	48,300	5,204
流動資産合計	55,223,991	5,949,833	60,906,677	6,562,085
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 負債	16,914	1,822	50	5
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
未払金：				
購入投資証券	999,162	107,650	431,442	46,484
買戻しファンド受益証券	1,106,610	119,226	130,716	14,083
管理会社報酬	183,900	19,813	13,153	1,417
受益者サービス手数料	37,015	3,988	41,904	4,515
会計・管理・名義書換手数料	1,308	141	4,472	482
ファンド資産未払金	—	—	48,300	5,204
未払費用	11,088	1,195	27,524	2,965
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益 者に帰属する純資産を除く)	2,355,997	253,835	697,561	75,155
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純 資産	52,867,994	5,695,998	60,209,116	6,486,930

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	199,169,499	21,458,522	139,962,638	15,079,575
現金及び外国通貨	—	—	1,598	172
未収金：				
売却投資証券	126,792	13,661	149,484	16,105
発行ファンド受益証券	1,422,913	153,305	2,121,410	228,561
管理会社からの未収金	—	—	—	—
ファンド資産現金残高	155,100	16,710	10,600	1,142
流動資産合計	200,874,304	21,642,198	142,245,730	15,325,555
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	85,717	9,235	264	28
銀行当座借越及び外国通貨	1,392	150	—	—
未払金：				
購入投資証券	43,623	4,700	150,111	16,173
買戻しファンド受益証券	1,629,246	175,535	977,026	105,265
管理会社報酬	43,176	4,652	30,173	3,251
受益者サービス手数料	135,543	14,603	96,665	10,415
会計・管理・名義書換手数料	7,278	784	9,536	1,027
ファンド資産未払金	155,100	16,710	10,600	1,142
未払費用	28,103	3,028	48,313	5,205
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	2,129,178	229,398	1,322,688	142,506
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	198,745,126	21,412,800	140,923,042	15,183,049

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・グローバル・ リアルエステート・ファンド	2020年6月30日現在		2019年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産	53,878,985	5,804,922	62,750,348	6,760,722
現金及び外国通貨	2,322	250	144	16
未収金：				
売却投資証券	110,207	11,874	90,249	9,723
発行ファンド受益証券	107,190	11,549	62,145	6,696
管理会社からの未収金	—	—	—	—
ファンド資産現金残高	—	—	—	—
流動資産合計	54,098,704	5,828,594	62,902,886	6,777,157
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 負債	30,523	3,289	692	75
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
未払金：				
購入投資証券	173,253	18,666	89,639	9,658
買戻しファンド受益証券	58,462	6,299	292,962	31,564
管理会社報酬	11,873	1,279	13,618	1,467
受益者サービス手数料	49,864	5,372	51,084	5,504
会計・管理・名義書換手数料	1,124	121	4,259	459
ファンド資産未払金	—	—	—	—
未払費用	11,148	1,201	39,152	4,218
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益 者に帰属する純資産を除く)	336,247	36,227	491,406	52,944
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純 資産	53,762,457	5,792,367	62,411,480	6,724,213

注記は財務諸表の一部を構成します。

(2) 【損益計算書】

包括利益計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	5,061,045	545,277	4,748,557	511,610
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純利益	20,988,810	2,261,334	15,366,599	1,655,597
収益合計	26,049,855	2,806,611	20,115,156	2,167,207
費用：				
管理会社報酬	497,446	53,595	415,228	44,737
受益者サービス報酬	894,688	96,394	747,314	80,516
監査報酬	4,483	483	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	42,909	4,623	36,850	3,970
その他費用	(14,012)	(1,510)	65,038	7,007
費用合計	1,425,514	153,585	1,269,339	136,759
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	1,425,514	153,585	1,269,339	136,759
運用利益	24,624,341	2,653,026	18,845,817	2,030,448
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加額	24,624,341	2,653,026	18,845,817	2,030,448

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	6,691,198	720,910	4,991,364	537,770
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純(損失)/利益	(20,680,311)	(2,228,097)	16,687,377	1,797,898
費用/収益合計	(13,989,113)	(1,507,187)	21,678,741	2,335,668
費用：				
管理会社報酬	308,022	33,186	285,125	30,719
受益者サービス報酬	862,073	92,880	797,856	85,961
監査報酬	4,638	500	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	25,488	2,746	25,933	2,794
その他費用	12,108	1,305	51,815	5,583
費用合計	1,212,329	130,616	1,165,638	125,586
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	1,212,329	130,616	1,165,638	125,586
運用(損失)/利益	(15,201,442)	(1,637,803)	20,513,103	2,210,082
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	(1,686,768)	(181,732)	(1,182,334)	(127,385)
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	(667,255)	(71,890)	(626,279)	(67,475)
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	(2,354,023)	(253,622)	(1,808,613)	(194,860)
運用による純資産の純(減少)/増加額	(17,555,465)	(1,891,426)	18,704,490	2,015,222

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純(損失)/利益	(844,587)	(90,996)	9,346,498	1,006,992
費用/収益合計	(844,587)	(90,996)	9,346,498	1,006,992
費用：				
管理会社報酬	111,447	12,007	99,956	10,769
受益者サービス報酬	378,739	40,805	339,574	36,586
監査報酬	4,487	483	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	8,487	914	9,334	1,006
その他費用	5,846	630	18,655	2,010
費用合計	509,006	54,840	472,428	50,899
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	509,006	54,840	472,428	50,899
運用(損失)/利益	(1,353,593)	(145,836)	8,874,070	956,092
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純(減少)/増加額	(1,353,593)	(145,836)	8,874,070	956,092

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純(損失)/利益	(7,494,493)	(807,457)	10,152,498	1,093,830
費用/収益合計	(7,494,493)	(807,457)	10,152,498	1,093,830
費用：				
管理会社報酬	67,329	7,254	79,790	8,597
受益者サービス報酬	228,519	24,621	270,822	29,178
監査報酬	4,506	485	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	4,370	471	7,573	816
その他費用	1,601	172	13,226	1,425
費用合計	306,325	33,003	376,320	40,545
費用補填の控除	(67,329)	(7,254)	(79,790)	(8,597)
費用補填考慮後純費用	238,996	25,749	296,530	31,948
運用(損失)/利益	(7,733,489)	(833,206)	9,855,968	1,061,882
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純(減少)/増加額	(7,733,489)	(833,206)	9,855,968	1,061,882

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純利益	23,131,782	2,492,218	32,281,840	3,478,045
収益合計	23,131,782	2,492,218	32,281,840	3,478,045
費用：				
管理会社報酬	210,456	22,675	182,623	19,676
受益者サービス報酬	712,942	76,812	617,000	66,476
監査報酬	4,670	503	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	15,468	1,667	18,392	1,982
その他費用	17,825	1,920	30,030	3,235
費用合計	961,361	103,577	852,954	91,897
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	961,361	103,577	852,954	91,897
運用利益	22,170,421	2,388,641	31,428,886	3,386,148
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加額	22,170,421	2,388,641	31,428,886	3,386,148

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・グローバル・ リアルエステート・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	428,868	46,206	477,826	51,481
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純(損失)/利益	(7,271,256)	(783,405)	8,973,738	966,831
費用/収益合計	(6,842,388)	(737,199)	9,451,564	1,018,312
費用：				
管理会社報酬	68,450	7,375	67,257	7,246
受益者サービス報酬	204,892	22,075	201,588	21,719
監査報酬	4,511	486	4,909	529
会計・管理・名義書換手数料	5,438	586	6,055	652
その他費用	(10,939)	(1,179)	13,306	1,434
費用合計	272,352	29,343	293,115	31,580
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	272,352	29,343	293,115	31,580
運用(損失)/利益	(7,114,740)	(766,542)	9,158,449	986,731
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (四半期分配型)	(60,676)	(6,537)	(61,975)	(6,677)
投資純利益—クラスA(円) (四半期分配型)	(6,349)	(684)	(7,108)	(766)
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	(67,025)	(7,221)	(69,083)	(7,443)
運用による純資産の純(減少)/増加額	(7,181,765)	(773,763)	9,089,366	979,288

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加額	24,624,341	2,653,026	18,845,817	2,030,448
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	39,665,630	4,273,575	63,806,828	6,874,548
受益証券買戻し	(54,649,810)	(5,887,971)	(23,641,414)	(2,547,126)
資本取引による純(減少)/増加額	(14,984,180)	(1,614,396)	40,165,414	4,327,422
純資産の純増加額	9,640,161	1,038,631	59,011,231	6,357,870
純資産：				
期首	399,261,234	43,016,405	315,945,045	34,039,919
期末	408,901,395	44,055,036	374,956,276	40,397,789

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純(減少)/増加額	(17,555,465)	(1,891,426)	18,704,490	2,015,222
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	17,434,198	1,878,360	32,329,303	3,483,159
受益証券買戻し	(24,205,033)	(2,607,850)	(22,375,940)	(2,410,784)
資本取引による純(減少)/増加額	(6,770,835)	(729,490)	9,953,363	1,072,375
純資産の純(減少)/増加額	(24,326,300)	(2,620,916)	28,657,853	3,087,597
純資産：				
期首	267,395,380	28,809,178	219,307,841	23,628,227
期末	243,069,080	26,188,263	247,965,694	26,715,824

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純(減少)/増加額	(1,353,593)	(145,836)	8,874,070	956,092
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	12,671,683	1,365,247	7,935,135	854,931
受益証券買戻し	(10,841,169)	(1,168,028)	(15,026,102)	(1,618,912)
資本取引による純増加/(減少)額	1,830,514	197,220	(7,090,967)	(763,981)
純資産の純増加額	476,921	51,383	1,783,103	192,112
純資産：				
期首	91,956,255	9,907,367	78,497,874	8,457,361
期末	92,433,176	9,958,750	80,280,977	8,649,472

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純(減少)/増加額	(7,733,489)	(833,206)	9,855,968	1,061,882
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	7,501,874	808,252	6,723,929	724,436
受益証券買戻し	(7,109,507)	(765,978)	(13,305,508)	(1,433,535)
資本取引による純増加/(減少)額	392,367	42,274	(6,581,579)	(709,099)
純資産の純(減少)/増加額	(7,341,122)	(790,932)	3,274,389	352,783
純資産：				
期首	60,209,116	6,486,930	60,072,454	6,472,206
期末	52,867,994	5,695,998	63,346,843	6,824,989

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加額	22,170,421	2,388,641	31,428,886	3,386,148
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	94,731,085	10,206,327	25,573,157	2,755,252
受益証券買戻し	(59,079,422)	(6,365,217)	(77,202,059)	(8,317,750)
資本取引による純増加/(減少)額	35,651,663	3,841,110	(51,628,902)	(5,562,498)
純資産の純増加/(減少)額	57,822,084	6,229,751	(20,200,016)	(2,176,350)
純資産：				
期首	140,923,042	15,183,049	150,543,603	16,219,568
期末	198,745,126	21,412,800	130,343,587	14,043,218

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド	2020年6月30日に終了した期間		2019年6月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純(減少)/増加額	(7,181,765)	(773,763)	9,089,366	979,288
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	3,149,287	339,304	2,451,458	264,120
受益証券買戻し	(4,616,545)	(497,387)	(3,781,742)	(407,445)
資本取引による純減少額	(1,467,258)	(158,082)	(1,330,284)	(143,325)
純資産の純(減少)/増加額	(8,649,023)	(931,846)	7,759,082	835,963
純資産：				
期首	62,411,480	6,724,213	49,757,429	5,360,865
期末	53,762,457	5,792,367	57,516,511	6,196,829

注記は財務諸表の一部を構成します。

[次へ](#)

財務諸表に対する注記

1 一般事項

ジャナス・セレクション(以下「当トラスト」という。また、当トラストの有する6つのファンドを以下「ファンド」という。)は、オルタナティブ投資ファンド(以下「AIF」という。)ルールブックの第1章に従い、アイルランド中央銀行からリテール投資家向けAIFとして認可を受けています。管理会社は、2013年欧州連合(オルタナティブ投資ファンド運営者(以下「AIFM」という。))規則(以下「AIFM規則」という。)に従い、アイルランド中央銀行からAIFMとして認可を受けており、当トラストの外部AIFMとして業務を行います。AIFMは、オルタナティブ投資ファンド運用指令(以下「AIFMD」という。)を順守する義務を負い、この義務には、様々な組織的な要件を満たし、事業行為規範に従うこと、活動プログラム、様々な方針や手続(リスク管理、流動性管理及び報酬等の分野に関するもの)を採用及び実施すること、並びに現在の資本の維持、報告及び透明性の義務を順守することが含まれますが、これらに限定されません。

2 会計方針

財務諸表作成の基礎

本財務諸表は、財務報告基準第102号「英国及びアイルランドにおいて適用される財務報告基準」に付随する中間報告に対する報告基準である財務報告基準第104号「中間財務報告」(以下「FRS第104号」という。)及び1990年ユニット・トラスト法に準拠して作成されております。

主要な会計方針及び見積りの手法は、前年度の監査済年次財務諸表に適用されたものと一致しています。

3 関連当事者間取引

管理会社は、アイルランドに所在する非公開の有限責任株式会社であり、当トラストの全般的な管理について責任を負っています。管理会社は、ジャナスキャピタル・インターナショナル・リミテッド(以下「JCIL」という。)をファンドの投資顧問及び総販売会社を選任しました。JCILは、英国金融行動監視機構(以下「FCA」という。)により規制を受ける、イングランド及びウェールズの法律に基づいて設立された企業です。間接的にJCILを所有しているジャナス・キャピタル・マネージメント・エルエルシー(以下「JCM」という。)は、最終的にはジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーにより所有されています。関連当事者、取締役あるいは重大な利害関係のある当事者との取引は全て、通常業務の一環として、通常の商業取引の条件で行われています。

ファンドは、その資産の大部分を、ジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーのグループ内の投資顧問会社が運用するジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーのファンドに投資を行います。2020年6月30日現在、各ファンドが保有するアンダーライイング・ファンドの投資の価値は、投資有価証券明細表に開示されています。

管理会社の取締役報酬

管理会社の取締役は、取締役によって随時決定される報酬率に応じて、サービスに対する報酬を受け取る権利を有しています。取締役は、現在の取締役報酬の金額が取締役1名につき年間10,000ユーロの年間報酬であることに合意しています。イアン・ダイブル氏とアリスター・セイヤー氏*はジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーの役員であり、2020年6月30日及び2019年6月30日に終了した会計期間における取締役報酬の権利を放棄しています。当会計期間に支払われる取締役報酬は10,000ユーロでした。2020年6月30日までに当トラストにより支払われた取締役報酬は11,233米ドル（約10,000ユーロ）でした。2019年6月30日までに当トラストにより支払われた取締役報酬は11,368米ドル（約10,000ユーロ）でした。

* アリスター・セイヤー氏は、2020年7月17日までジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーの役員でした。

管理会社報酬

AIFMでもある管理会社は、各ファンドの資産から管理会社報酬を受け取る権利を有しています。かかる管理会社報酬は、各ファンドの純資産価額に対する一定の割合として計算及び計上され、1ヶ月毎に後払いされます。

各ファンドについて、管理会社報酬はファンドの純資産価額の年率0.25%を超過しないものとします。管理会社は、ファンドから受領した管理会社報酬の中から、投資顧問会社であるJCILの報酬を支払います。管理会社報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。

受益者サービス報酬

クラスA受益証券及びクラスB受益証券に関する受益者サービス報酬(年率)は、各ファンドの資産から、該当するクラスに帰属するファンドの平均日次純資産価額の年率0.85%を上限として、総販売会社であるJCILに支払われます。受益者サービス報酬は、日々計算され、1ヶ月毎に後払いされます。受益者サービス報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。

販売会社報酬

クラスB受益証券に関する販売会社報酬は、ファンドの資産から、該当するクラスに帰属するファンドの平均日次純資産価額の年率0.50%を上限として、総販売会社であるJCILに支払われます。販売会社報酬は、日々計算され、1ヶ月毎に後払いされます。販売会社報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。2020年6月30日に終了した会計期間に計上された販売会社報酬の該当はありませんでした。

ファンドの費用の上限

管理会社は、会計期間中に各受益証券クラスに配分されたファンドに関する管理事務代行報酬、受託報酬及び立替費用の合計(管理会社報酬、管理会社及びJCILの立替費用、受益者サービス報酬及び販売会社報酬、並びにアンダーライニング・ファンドにより発生したあらゆる手数料を除く)が、いずれのファンドについても各クラスに帰属する日次総純資産価額の0.25%を超えないようにするために必要な範囲において、管理会社報酬の全部又は一部を権利放棄することに同意しています。目論見書の規定では、かかる超過額は、ジャンス・グローバル・リアルエステート・ファンドを除いて、翌会計期間に(過年度に関連するかかる未払超過額と併せて)繰り越すことができるとされています。ただし、かかる繰越費用は、関連する会計期間に適用されるファンドの費用の上限の対象となります。ジャンス・グローバル・リアルエステート・ファンドに関しては、管理会社が規定するファンドの上限を超える手数料及び費用は、翌会計期間に繰り越すことはできません。また、JCILは当該ファンドの費用合計の上限を超えないようにするために必要な範囲において、当該ファンドに関する運用報酬の一部を権利放棄する予定です。ファンドの費用の上限に関する詳細は、包括利益計算書の「費用補填の控除」として表示されています。

管理会社は、ジャンス・ストラテジック・バリュー・ファンドについて、運用報酬を放棄することを選択しています。アンダーライニング・ファンドには、一定の手数料及び費用が課されますが、これは費用の上限によって制限されています。2020年6月30日及び2019年6月30日に終了した会計期間にアンダーライニング・ファンドに適用される費用の上限は、以下のとおりです。

ジャンス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー アンダーライニング・ファンド	費用の上限(%)
ジャンス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド	クラス I (米ドル)inc : 0.80
ジャンス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド	クラス I (米ドル)inc : 0.90
ジャンス・ヘンダーソン・バランス・ファンド	クラス I (米ドル)acc : 1.05
ジャンス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド	クラス I (米ドル)acc : 1.20
ジャンス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド	クラス I (米ドル)acc : 1.20
ジャンス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド	クラス I (米ドル)inc : 1.25

管理会社の取締役は、(i)管理会社が当トラストに関して、JCIL、受託会社及び／又は代理人あるいはこれらのグループ会社(以下「関連当事者」という。)と行う取引が、独立当事者間の取引条件で行われ、当該取引が受益者にとって最も有利な取引であることを確保するために、(文書化された手順によって明示された)取決めがあり、また(ii)当期において締結された、管理会社が当トラストに関して関連当事者で行った全ての取引が、独立当事者間の取引条件で行われ、受益者にとって最も有利な取引であったと確信しています。

管理事務代行会社が計上した報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。受託会社が計上した報酬は、包括利益計算書のその他費用に含まれています。

4 税金

当トラストは、1997年税連結法（改正）の第739B条に規定される投資会社としての資格を有しています。そのため、当トラストの収益又は利益には、通常アイルランドの税金が課税されません。

当トラストに課税事由が発生した場合には、アイルランドの税金が発生する可能性があります。課税事由には、受益者への分配金の支払、あるいは受益証券の現金化、中止、買戻しによる換金又は譲渡及び受益証券のそれぞれの取得から8年目の期末時点における受益証券保有数などが含まれます。アイルランドの税金は、課税事由の発生時に差し引かれます。以下の事項に該当する課税事由に関しては、税金は発生しません。

- (i) 課税事由の発生時にアイルランドの居住者でない受益者及び税務上アイルランドに通常居住していない受益者。ただし、当トラストが1997年税連結法（改正）の条項に準拠した適切で有効な宣言書を保有している、又は適切な宣言書がない場合には当トラストが総額を支払うことをアイルランド国税局に承認されていること。
- (ii) 当トラストに必要な署名済みの法定宣言書を提出した、特定の免税となるアイルランドに居住する投資家。

課税事由について当トラストに納税義務が生じた場合、当該課税額を支払うために、当トラストは当該課税事由から発生する支払いから適切な税額に等しい金額を控除することができ、及び／もしくは該当する場合には、受益者もしくは実質受益者が保有する受益証券の必要数を割り当てるもしくは消却することができます。当該受益者は、当トラストが課税事由の発生により課税されることにより、当トラストに損失が生じないように、当トラストを補償します。

当トラストが保有する投資有価証券により受領した配当金、利息及びキャピタル・ゲイン(ある場合)は、当該国で課税される源泉税などの課税対象となる可能性があり、かかる課税は当トラスト又は受益者に還付されない場合があります。

5 現金預金

全ての現金残高は、2020年6月30日及び2019年6月30日に終了した会計期間においては、保管受託会社に保管されていました。

6 ソフト・コミッション契約

投資顧問会社は、内部及び外部のリサーチを利用して、その意思決定について情報提供することができます。2020年6月30日に終了した会計期間及び2019年12月31日終了会計年度において、投資顧問会社は当該リサーチ使用料を自己の費用として決済しています。

7 効率的なポートフォリオの運用

ファンドは、ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)及びジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)の場合を除き、効率的なポートフォリオの運用及び通貨リスクのヘッジ目的で、アイルランド中央銀行が定めた条件及び限度内で、通貨関連の先物契約を締結し、あるいはコール・オプションの売却及びプット・オプションの購入を行います。ファンドは、また、格付の高い専門金融機関と、「店頭」契約ベースで通貨の先渡売買及び為替取引を行う場合があります。当期において、ファンドは、ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)及びジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)の場合を除き、特定の受益証券の円クラスの価額をヘッジするために先渡為替取引を締結しました。2020年6月30日現在の未決済デリバティブ・ポジションは、関連するファンドの投資有価証券明細表に開示されています。

8 為替レート

当トラストの機能通貨は米ドルです。

下記の為替レートは、米ドル以外の通貨建ての資産及び負債の米ドルへの換算に使用されています。

2020年6月30日現在	2019年12月31日現在
日本円 107.9600	日本円 108.6400

9 リスク要因及びその他の特別な検討事項

目論見書に記載されている投資目標を達成するため、各ファンドはジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの対応するアンダーライニング・ファンドにのみ投資を行います。リスクの監視及び管理は全て、アンダーライニング・ファンドに対して行われています。

FRS第102号により要求されるリスクの評価及び監視に関する詳細は、添付のジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの財務諸表の注記13（訳者注：原文）に記載されています。

投資リスク

各ファンドは、対応するアンダーライニング・ファンドへの投資を行います。そのため、各ファンドの投資家は、関連する各アンダーライニング・ファンドが保有する投資ポジションに係るリスクの対象となります。

ファンド又はアンダーライニング・ファンドが投資目標を達成するという保証はありません。異なる国々の企業及び政府によって発行された異なる通貨建ての投資有価証券は一定のリスクを伴っており、受益証券の価額の下落を招く可能性もあります。受益証券の価額は、アンダーライニング・ファンドが投資する有価証券の資本価値の変動の結果として、アンダーライニング・ファンドの価額とともに上昇又は下落する可能性があります。

為替リスク

ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)及びジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)はクラスレベルでのヘッジを行わないため、このクラスに対する投資は為替リスクにさらされる可能性があります。

ファンドは、円クラスの為替リスクのヘッジに努めるものの(上記で開示したものを除きます)、円クラスの価額が米ドルに対する円の水準によって影響を受けないという保証は一切できません。

信用リスク

各ファンドは、アンダーライニング・ファンドが取引を行う取引相手の信用リスクにさらされており、結果として、決済不履行のリスクも負うこととなります。アンダーライニング・ファンドは、認可を受けた、信用できる取引所で、複数のカウンターパーティと取引を行うことにより、信用リスクの集中を最小限に抑えています。

ファンドの資産は全て、預託の必要のない金融デリバティブ商品を除いて、現在、シティ・デポジタリー・サービス・アイルランド・デジグネイテッド・アクティビティ・カンパニーの預託ネットワーク内に保護預けられています。受託会社の破産又は倒産により、ファンドの受託会社に係る権利行使が遅延又は制限される場合があります。管理会社は、受託会社の信用の質及び財政状態を監視することにより、当該リスクを監視しています。

2020年6月30日の保管受託会社の信用格付けはA+（2019年12月31日：A+）です。先渡為替予約のカウンターパーティはシティバンクです。2020年6月30日のシティバンクの信用格付けはA+（2019年12月31日：A+）です。

英国のEU離脱リスク

2020年1月31日、英国はEUから正式に離脱しました(以下「ブレグジット」という。)。英国とEUの間で締結された離脱協定の条件に基づき、移行期間は2020年12月31日までとなり、その間、英国は引き続き多くのEU法の恩恵を受け、EU法に拘束されることになります。

英国とEUとの将来の係に係る条件については不確実であり、英国とEUがブレグジット後の係をどのように再交渉するかにより左右されます。このことを考慮すると、英国のEU離脱がどのように実施され、アイルランドの資産運用業界やより広範な欧州及び世界の金融市場に対してどのような意味を持つかを予測することは困難です。

この不確実性から生じる通貨のボラティリティは、ファンドとその投資のリターンが、市場の動向、英ポンド及び／又はユーロの価値の潜在的な下落、並びに英国のソブリン信用格付けの格下げによって悪影響を受けることを意味する場合があります。この不確実性は、経済全般及び関連するファンドとその投資がそれぞれの戦略を遂行し、魅力的なリターンを受け取る能力に悪影響を与え、また関連するファンドに対するコストの増加をもたらす可能性があります。

流動性リスク

管理会社は、当トラストに関して適切な流動性管理システムを採用し、ファンドの流動性リスクを監視し、ファンドの投資の流動性プロファイルによって当トラストが通常の状態において償還請求を満たすことを可能にする文書化された手順を採用しています。さらに、管理会社が例外的な状況において当トラストの流動性を管理することを可能にする手順があります。

全てのファンドについて、管理会社は、営業日に買い戻されたファンドの受益証券（あるファンドから他のファンドの受益証券への転換の一環として買い戻された受益証券を含む）の数を当該ファンドの発行されている総受益証券数の10%以内に制限する権利を有しています。この場合、この制限は当該営業日に当該ファンドの受益証券の換金（買戻し）を希望している全ての受益者に対し比例して適用されるため、当該受益証券のうち買戻しが許容される割合で実現することとなります。買い戻されてはいないが、買い戻される予定であった受益証券は、翌営業日に換金（買戻し）を請求されたものとみなされ、当初請求していた受益証券すべての換金（買戻し）が終了するまで、その翌営業日に買戻換金（買戻）されていき、当該営業日に残存する受益証券はその日の1口当たりの純資産価格で評価されます（換金（買戻し）を行う受益者には、当該営業日の受益証券1口当たりの純資産価格が変動するリスクがあります）。翌営業日には、繰り延べられた換金（買戻し）請求がその後の換金（買戻し）請求に優先し、換金（買戻し）請求が受領された順番に処理されます。換金（買戻し）請求がそのように繰り延べられる場合は、管理会社は影響を受ける受益者に通知します。

換金（買戻し）請求中には、受益者の保有する当該受益証券を換金（買戻し）又は交換する権利も同様に停止されますが、停止期間中に受益者は保留中の換金（買戻し）請求を取り下げることができます。

公正価値の見積り

FRS第102号では、各ファンドは、測定を行う際に使用されたインプットの重要性を反映する公正価値ヒエラルキーを用いて投資を分類することが要求されています。

財政状態計算書において公正価値で保有されている金融商品については、ファンドは、金融商品の各クラスについて、公正価値測定が区分される以下の公正価値ヒエラルキーのレベルに係る分析を開示するよう要求されています。公正価値測定は、公正価値測定全体に重要な最低レベルのインプットに基づいて、その全体が区分されています。公正価値ヒエラルキーは以下のレベルに分けられます。

レベル1－同一の資産又は負債の活発な市場における相場価格(無調整)。

レベル2－レベル1に含まれる相場価格以外の重要な観察可能なインプットを用いて決定される価格。観察可能なインプットとは、市場参加者が有価証券の価格を決定する際に利用する仮定を反映したインプットで、報告企業から独立した情報源から得た市場データに基づいています。

レベル3－重要な観察不能なインプットを用いて決定される価格。観察不能なインプットとは、相場価格又は観察可能なインプットが入手可能でない、あるいは関連性が低いと考えられる場合（例えば、期末時点で投資に関する市場取引がほとんどない、又は市場取引がない場合）、市場参加者が有価証券の価格を決定する際に使用するファクターに関する報告企業独自の仮定を反映したインプットであり、そのような状況において入手可能な最善の情報に基づくものです。

公正価値測定に対する特定のインプットの重要性の全体としての評価には、資産又は負債に特有の要素の判断及び検討が要求されます。

アンダーライニング・ファンド及び先渡為替予約はレベル2とされます。2020年6月30日に終了した会計期間において異なるレベル間の振替はありませんでした（2019年：なし）。

10 純資産の比較

	2020年6月30日		2019年12月31日		2018年12月31日	
	純資産	1口当たり 純資産価格	純資産	1口当たり 純資産価格	純資産	1口当たり 純資産価格
ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$391,534,741	\$221.29	\$382,308,500	\$208.08	\$303,644,270	\$192.17
クラスA(円)	\$16,833,777	\15,266.00	\$16,916,088	\14,535.00	\$12,257,892	\13,840.00
クラスI(円)	\$532,877	\19,077.00	\$36,646	\18,010.00	\$42,883	\16,703.00
ジャナス・ハイイールド・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$156,205,014	\$255.25	\$174,696,022	\$270.98	\$151,603,637	\$238.60
クラスA(米ドル) (毎月分配型)	\$52,218,272	\$81.25	\$59,406,989	\$89.00	\$35,886,454	\$83.13
クラスA(円)	\$12,974,220	\18,108.00	\$12,029,166	\19,444.00	\$11,624,066	\17,632.00
クラスA(円) (毎月分配型)	\$21,577,389	\8,534.00	\$21,114,509	\9,407.00	\$20,061,900	\8,863.00
クラスI(円)	\$94,185	\21,682.00	\$148,694	\23,083.00	\$131,783	\20,359.00
ジャナス・バランス・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$83,224,919	\$274.45	\$83,061,247	\$277.51	\$71,541,268	\$231.62
クラスA(円)	\$9,170,193	\20,097.00	\$8,858,668	\20,483.00	\$6,880,404	\17,585.00
クラスI(円)	\$38,064	\27,213.00	\$36,340	\27,572.00	\$76,202	\23,018.00
ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$49,745,417	\$281.37	\$56,391,854	\$323.53	\$56,009,787	\$257.04
クラスA(円)	\$3,025,963	\21,785.00	\$3,717,591	\25,200.00	\$3,962,187	\20,575.00
クラスI(円)	\$96,614	\23,949.00	\$99,671	\27,594.00	\$100,480	\21,928.00
ジャナス・フォーティ・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$186,238,328	\$423.72	\$131,268,822	\$384.95	\$141,561,415	\$286.46
クラスA(円)	\$12,208,359	\33,410.00	\$8,471,700	\30,479.00	\$7,906,758	\23,308.00
クラスI(円)	\$298,439	\44,926.00	\$1,182,520	\40,898.00	\$1,075,429	\30,442.00

	2020年6月30日		2019年12月31日		2018年12月31日	
	純資産	1口当たり 純資産価格	純資産	1口当たり 純資産価格	純資産	1口当たり 純資産価格
ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド						
クラスA(米ドル)	\$48,149,178	\160.78	\$56,303,382	\$181.78	\$44,649,671	\$141.14
クラスA(円)	\$5,444,121	\12,783.00	\$5,930,953	\14,579.00	\$5,066,788	\11,661.00
クラスI(円)	\$169,158	\17,481.00	\$177,145	\19,790.00	\$40,970	\15,347.00

11 受益証券の資本取引

議決権：各受益者は、投票により受益者の表決に付された当トラストに関する事項について、各受益証券(議決権を有しない単位未満の受益証券は除外する)につき1議決権を与えられています。各受益者は、かかる集会に本人又は代理人により出席し、議決権を行使することができます。当トラスト又はファンドについて行使された議決権の50%以上が書面によって承認した決議は、いかなる目的においても、当トラスト又はファンドの正式に承認された通常決議として取り扱われるものとします。特定のファンドのみに影響を与える事項については、当該ファンドの受益者のみが議決権を行使する権利を有しています。上記の規則は、ファンドにおけるあらゆる種類の集会に対して同様に適用されるものとします。

買戻可能受益証券：受益者は、営業日に受益証券の全部又は一部の換金（買戻し）を請求する場合があります。ファンド又は受益証券クラスにおける受益者の保有額が、換金（買戻し）によって当該受益証券の最低当初投資額を下回る場合、管理会社又は管理事務代行会社はかかるファンド又は受益証券クラスにおける受益者の保有額を全て買い戻すことができます。全てのファンドについて、管理会社は、営業日に買い戻されたファンドの受益証券（あるファンドから他のファンドの受益証券への転換の一環として買い戻された受益証券を含む）の数を当該ファンドの発行されている総受益証券数の10%以内に制限する権利を有しています。この場合、この制限は当該営業日に当該ファンドの受益証券の換金（買戻し）を希望している全ての受益者に対し比例して適用されるため、当該受益証券のうち買戻しが許容される割合で実現することとなります。買い戻されてはいないが、買い戻される予定であった受益証券は、翌営業日に換金（買戻し）を請求されたものとみなされ、当初請求していた受益証券すべての換金（買戻し）が終了するまで、その翌営業日に買戻換金（買戻）されていき、当該営業日に残存する受益証券はその日の1口当たりの純資産価格で評価されます（換金（買戻し）を行う受益者には、当該営業日の受益証券1口当たりの純資産価格が変動するリスクがあります）。翌営業日には、繰り延べられた換金（買戻し）請求がその後の換金（買戻し）請求に優先し、換金（買戻し）請求が受領された順番に処理されます。

2020年6月30日に終了した会計期間における各ファンドの受益証券の発行及び換金（買戻し）に関する詳細は、以下の通りです。

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	1,837,352	126,441	221
受益証券の発行	169,619	21,722	2,812
受益証券買戻し	(237,657)	(29,114)	(17)
期末	1,769,314	119,049	3,016

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(米ドル) (毎月分配型)	クラスA(円)	クラスA(円) (毎月分配型)	クラスI(円)
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	644,679	667,486	67,209	243,851	700
受益証券の発行	40,803	14,648	15,270	41,063	—
受益証券買戻し	(73,513)	(39,454)	(5,125)	(11,945)	(231)
期末	611,969	642,680	77,354	272,969	469

ジャナス・バランス・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	299,314	46,987	143
受益証券の発行	39,542	10,126	189
受益証券買戻し	(35,618)	(7,851)	(181)
期末	303,238	49,262	151

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	174,299	16,027	392
受益証券の発行	26,219	870	77
受益証券買戻し	(23,723)	(1,901)	(33)
期末	176,795	14,996	436

ジャナス・フォーティ・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	341,006	30,197	3,141
受益証券の発行	235,921	24,754	1,635
受益証券買戻し	(137,399)	(15,501)	(4,059)
期末	439,528	39,450	717

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラスA(米ドル) (四半期分配型)	クラスA(円) (四半期分配型)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	309,741	44,195	972
受益証券の発行	14,105	5,365	1,120
受益証券買戻し	(24,372)	(3,581)	(1,047)
期末	299,474	45,979	1,045

2019年12月31日終了会計年度における各ファンドの受益証券の発行及び換金（買戻し）に関する詳細は、以下の通りです。

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	1,580,107	97,065	281
受益証券の発行	595,421	51,620	198
受益証券買戻し	(338,176)	(22,244)	(258)
期末	1,837,352	126,441	221

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(米ドル) (毎月分配型)	クラスA(円)	クラスA(円) (毎月分配型)	クラスI(円)
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	635,392	431,700	72,249	248,061	709
受益証券の発行	136,656	279,342	15,632	29,161	93
受益証券買戻し	(127,369)	(43,556)	(20,672)	(33,371)	(102)
期末	644,679	667,486	67,209	243,851	700

ジャナス・バランス・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	308,877	42,880	363
受益証券の発行	79,291	14,449	204
受益証券買戻し	(88,854)	(10,342)	(424)
期末	299,314	46,987	143

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	217,905	21,104	502
受益証券の発行	32,144	344	785
受益証券買戻し	(75,750)	(5,421)	(895)
期末	174,299	16,027	392

ジャナス・フォーティ・ファンド

	クラスA(米ドル)	クラスA(円)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	494,168	37,176	3,872
受益証券の発行	146,356	6,147	1,814
受益証券買戻し	(299,518)	(13,126)	(2,545)
期末	341,006	30,197	3,141

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラスA(米ドル) (四半期分配型)	クラスA(円) (四半期分配型)	クラスI(円)
	口数	口数	口数
期首	316,357	47,616	293
受益証券の発行	34,804	2,145	1,003
受益証券買戻し	(41,420)	(5,566)	(324)
期末	309,741	44,195	972

12 （訳文では省略）

13 当期中に生じた重要な事象

2020年度第1四半期は、COVID-19のパンデミックを要因として、全ての金融市場のボラティリティが急激に増加しました。投資顧問会社は状況を積極的に監視しており、設定された投資とリスクのパラメータの範囲内に収まるようにファンドの資産を引き続き管理しています。取締役は、ファンドを管理するために、このような不確実性の高い期間においては継続して状況を見直していきます。

2020年6月30日に終了した会計期間において、ファンドに重要な影響を及ぼす他の事象はありませんでした。

14 後発事象

2020年7月6日にアイルランド中央銀行は会社の新しい目論見書を発表しました。

J.P.モルガン・アドミニストレーション・サービスズ（アイルランド）リミテッドが会社の管理事務代行会社に任命されました。J.P.モルガン・アドミニストレーション・サービスズ（アイルランド）リミテッドは、2020年7月6日よりシティバンク・ヨーロッパ・ピーエルシーの後継会社となります。

J.P.モルガン・バンク（アイルランド）ピーエルシーは会社の保管受託会社に任命されました。J.P.モルガン・バンク（アイルランド）ピーエルシーは、2020年7月6日よりシティ・デポジタリー・サービスズ・アイルランド・デジグネイテッド・アクティビティ・カンパニーの後継会社となります。

インターナショナル・ファイナンシャル・データ・サービスズ（アイルランド）リミテッドは、2020年7月6日より会社の名義書換代理人に任命されました。

アリスター・セイヤー氏は2020年7月17日付で取締役会を辞任しました。

ポートフォリオ・マネージャーのマーク・ピント氏は、2021年4月2日付で退職することをを表明しています。

当会計期間末以降、他の重要な後発事象はありませんでした。

15 財務諸表の承認

本財務諸表は、2020年8月21日に管理会社の取締役会により承認されました。

(3) 【投資有価証券明細表等】

① 【投資株式明細表】

該当事項はありません。

② 【株式以外の投資有価証券明細表】

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 100.16%; USD 399,908,717)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド			
クラス I (米ドル)inc受益証券 アイルランドUCITS	31,294,983	100.26	409,964,284
投資有価証券合計		100.26	409,964,284

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.02%; USD 99,002)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 11,110,099	USD 102,904	102,919	2020年7月8日	15
USD 1,433	JPY 153,892	1,425	2020年7月8日	8
USD 36,330	JPY 3,907,800	36,200	2020年7月8日	130
USD 10,548	JPY 1,136,820	10,531	2020年7月8日	17
USD 55,305	JPY 5,945,859	55,080	2020年7月8日	225
USD 9,301	JPY 1,001,880	9,281	2020年7月8日	20
USD 40,363	JPY 4,337,258	40,179	2020年7月8日	184
USD 1,027	JPY 110,232	1,021	2020年7月8日	6
USD 14,181	JPY 1,522,054	14,099	2020年7月8日	82
USD 52,945	JPY 5,680,201	52,619	2020年7月8日	326
USD 7,153	JPY 767,968	7,114	2020年7月8日	39
USD 216,961	JPY 23,209,188	215,000	2020年7月8日	1,961
USD 26,655	JPY 2,855,181	26,450	2020年7月8日	205
USD 1,143	JPY 121,783	1,128	2020年7月8日	15
USD 1,430	JPY 153,421	1,421	2020年7月8日	9
USD 13,379	JPY 1,430,283	13,250	2020年7月8日	129
合計				3,371
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				409,967,655

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年：0%；USD (2,848))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	1,000,000	USD	9,366	9,264	2020年7月8日	(102)
JPY	1,812,692,726	USD	16,877,173	16,791,988	2020年7月8日	(85,185)
JPY	10,795,112	USD	100,313	100,001	2020年7月8日	(312)
JPY	9,644,568	USD	89,583	89,343	2020年7月8日	(240)
JPY	9,575,220	USD	89,594	88,700	2020年7月8日	(894)
JPY	3,032,866	USD	28,388	28,095	2020年7月8日	(293)
JPY	958,731	USD	8,962	8,882	2020年7月8日	(80)
JPY	10,828,083	USD	101,368	100,307	2020年7月8日	(1,061)
JPY	10,000,000	USD	92,989	92,636	2020年7月8日	(353)
USD	46,510	JPY	5,062,185	46,126	2020年7月8日	(384)
USD	66,888	JPY	7,246,016	66,652	2020年7月8日	(236)
合計						(89,140)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(89,140)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・ハイイールド・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 100.58%; USD 268,953,353)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド			
クラス I (米ドル)inc受益証券 アイルランドUCITS	28,947,992	100.16	243,452,610
投資有価証券合計		100.16	243,452,610

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.03%; USD 77,467)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 18,153,079	USD 167,273	168,162	2020年7月8日	889
JPY 18,240,159	USD 167,654	168,969	2020年7月8日	1,315
JPY 15,017,692	USD 137,346	139,118	2020年7月8日	1,772
USD 47,106	JPY 5,056,399	46,840	2020年7月8日	266
USD 8,847	JPY 953,009	8,828	2020年7月8日	19
USD 46,127	JPY 4,933,123	45,698	2020年7月8日	429
USD 232,432	JPY 24,976,357	231,370	2020年7月8日	1,062
USD 1,968	JPY 211,310	1,957	2020年7月8日	11
USD 61,088	JPY 6,552,151	60,697	2020年7月8日	391
USD 31,845	JPY 3,409,828	31,587	2020年7月8日	258
USD 47,756	JPY 5,106,311	47,303	2020年7月8日	453
USD 999	JPY 107,016	991	2020年7月8日	8
USD 97,237	JPY 10,433,158	96,648	2020年7月8日	589
USD 31,951	JPY 3,415,837	31,643	2020年7月8日	308
USD 62,842	JPY 6,738,735	62,425	2020年7月8日	417
USD 16,918	JPY 1,813,300	16,797	2020年7月8日	121
USD 33,132	JPY 3,570,499	33,075	2020年7月8日	57
合計				8,365
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				243,460,975

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年：0%；USD (12,598))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	30,000,000	USD	280,264	277,907	2020年7月8日	(2,357)
JPY	500,000	USD	4,648	4,631	2020年7月8日	(17)
JPY	1,355,356,564	USD	12,619,120	12,555,427	2020年7月8日	(63,693)
JPY	7,959,065	USD	73,959	73,729	2020年7月8日	(230)
JPY	11,370,938	USD	105,661	105,335	2020年7月8日	(326)
JPY	9,975,962	USD	92,653	92,413	2020年7月8日	(240)
JPY	8,164,332	USD	76,106	75,631	2020年7月8日	(475)
JPY	18,366,544	USD	171,144	170,139	2020年7月8日	(1,005)
USD	154,467	JPY	16,733,382	153,923	2020年7月8日	(544)
合計						(68,887)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(68,887)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・バランス・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 99.40%; USD 91,400,114)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド			
クラス I (米ドル)acc受益証券 アイルランドUCITS	2,379,816	100.02	92,455,836
投資有価証券合計		100.02	92,455,836

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.06%; USD 51,372)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 5,188,647	USD 47,811	48,065	2020年7月8日	254
JPY 6,155,987	USD 56,583	57,027	2020年7月8日	444
JPY 14,083,361	USD 128,801	130,462	2020年7月8日	1,661
JPY 5,219,639	USD 48,346	48,353	2020年7月8日	7
USD 28,662	JPY 3,080,265	28,534	2020年7月8日	128
USD 206	JPY 22,034	204	2020年7月8日	2
USD 24,091	JPY 2,585,965	23,955	2020年7月8日	136
USD 10,154	JPY 1,093,780	10,132	2020年7月8日	22
USD 292,807	JPY 31,464,091	291,470	2020年7月8日	1,337
USD 26,714	JPY 2,866,010	26,549	2020年7月8日	165
USD 7,615	JPY 815,421	7,553	2020年7月8日	62
USD 12,565	JPY 1,343,415	12,444	2020年7月8日	121
USD 132,087	JPY 14,172,418	131,287	2020年7月8日	800
USD 124,289	JPY 13,327,960	123,465	2020年7月8日	824
合計				5,963
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				92,461,799

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年：0 %；USD (7))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	955,169,150	USD	8,893,153	8,848,266	2020年7月8日	(44,887)
JPY	7,252,843	USD	67,395	67,187	2020年7月8日	(208)
JPY	968,055	USD	9,015	8,967	2020年7月8日	(48)
JPY	6,911,992	USD	64,196	64,030	2020年7月8日	(166)
JPY	4,490,000	USD	41,764	41,594	2020年7月8日	(170)
JPY	5,441,925	USD	50,552	50,412	2020年7月8日	(140)
JPY	5,927,528	USD	55,255	54,910	2020年7月8日	(345)
JPY	17,112,403	USD	159,458	158,522	2020年7月8日	(936)
JPY	6,435,823	USD	60,453	59,619	2020年7月8日	(834)
JPY	500,000	USD	4,695	4,632	2020年7月8日	(63)
JPY	7,330,739	USD	68,612	67,909	2020年7月8日	(703)
JPY	7,240,598	USD	67,222	67,074	2020年7月8日	(148)
USD	34,859	JPY	3,806,954	34,452	2020年7月8日	(407)
合計						(49,055)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(49,055)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 100.22%; USD 60,342,510)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド			
クラス I (米ドル)acc受益証券 アイルランドUCITS	1,761,147	100.07	52,904,860
投資有価証券合計		100.07	52,904,860

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.04%; USD 21,287)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 1,000,000	USD 9,188	9,264	2020年7月8日	76
JPY 2,901,264	USD 26,734	26,876	2020年7月8日	142
JPY 6,634,399	USD 60,980	61,458	2020年7月8日	478
JPY 2,364,821	USD 21,659	21,907	2020年7月8日	248
JPY 7,864,813	USD 71,928	72,856	2020年7月8日	928
JPY 4,341,363	USD 40,211	40,217	2020年7月8日	6
USD 4,088	JPY 439,312	4,070	2020年7月8日	18
USD 10,322	JPY 1,105,946	10,245	2020年7月8日	77
USD 5,155	JPY 555,304	5,144	2020年7月8日	11
USD 1,413	JPY 152,113	1,409	2020年7月8日	4
USD 55,841	JPY 5,993,998	55,525	2020年7月8日	316
USD 63,201	JPY 6,759,095	62,614	2020年7月8日	587
USD 191,671	JPY 20,596,379	190,796	2020年7月8日	875
USD 13,639	JPY 1,462,887	13,552	2020年7月8日	87
USD 29,875	JPY 3,198,822	29,633	2020年7月8日	242
USD 6,354	JPY 679,413	6,294	2020年7月8日	60
USD 10,743	JPY 1,147,018	10,626	2020年7月8日	117
USD 24,440	JPY 2,612,939	24,205	2020年7月8日	235
USD 2,495	JPY 265,767	2,462	2020年7月8日	33
USD 81,793	JPY 8,776,095	81,298	2020年7月8日	495
USD 61,943	JPY 6,642,353	61,532	2020年7月8日	411
合計				5,446
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				52,910,306

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0%; USD (50))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	1,000,000	USD	9,286	9,264	2020年7月8日	(22)
JPY	500,000	USD	4,671	4,632	2020年7月8日	(39)
JPY	321,615,934	USD	2,994,422	2,979,308	2020年7月8日	(15,114)
JPY	7,774,837	USD	72,245	72,022	2020年7月8日	(223)
JPY	7,711,267	USD	71,619	71,433	2020年7月8日	(186)
JPY	5,372,448	USD	50,081	49,768	2020年7月8日	(313)
JPY	3,341,583	USD	31,171	30,955	2020年7月8日	(216)
JPY	4,910,219	USD	45,755	45,486	2020年7月8日	(269)
JPY	3,562,227	USD	33,340	32,998	2020年7月8日	(342)
JPY	4,628,309	USD	42,969	42,874	2020年7月8日	(95)
USD	26,964	JPY	2,920,998	26,869	2020年7月8日	(95)
合計						(16,914)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(16,914)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・フォーティ・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 99.28%; USD 139,913,677)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド			
クラス I (米ドル)acc受益証券 アイルランドUCITS	4,000,517	100.20	199,145,739
投資有価証券合計		100.20	199,145,739

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.03%; USD 48,961)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 2,000,000	USD 18,413	18,527	2020年7月8日	114
JPY 15,644,002	USD 144,153	144,919	2020年7月8日	766
JPY 13,427,472	USD 123,418	124,386	2020年7月8日	968
JPY 172,855	USD 1,588	1,601	2020年7月8日	13
JPY 25,977,091	USD 238,110	240,640	2020年7月8日	2,530
JPY 29,292,447	USD 267,897	271,353	2020年7月8日	3,456
USD 160,849	JPY 17,286,032	160,130	2020年7月8日	719
USD 99,905	JPY 10,746,289	99,549	2020年7月8日	356
USD 97,947	JPY 10,530,325	97,548	2020年7月8日	399
USD 15,082	JPY 1,624,621	15,050	2020年7月8日	32
USD 1,825	JPY 195,344	1,810	2020年7月8日	15
USD 381,011	JPY 40,705,330	377,076	2020年7月8日	3,935
USD 673,268	JPY 72,347,209	670,193	2020年7月8日	3,075
USD 12,036	JPY 1,290,941	11,959	2020年7月8日	77
USD 113,196	JPY 12,109,010	112,173	2020年7月8日	1,023
USD 13,397	JPY 1,430,446	13,251	2020年7月8日	146
USD 20,163	JPY 2,155,678	19,969	2020年7月8日	194
USD 114,996	JPY 12,247,312	113,454	2020年7月8日	1,542
USD 10,840	JPY 1,159,791	10,744	2020年7月8日	96
USD 325,059	JPY 34,877,581	323,090	2020年7月8日	1,969
USD 340,034	JPY 36,463,065	337,778	2020年7月8日	2,256
USD 20,851	JPY 2,242,325	20,772	2020年7月8日	79
合計				23,760
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				199,169,499

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年：0%；USD（264）)

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	1,327,397,532	USD	12,358,806	12,296,427	2020年7月8日	(62,379)
JPY	40,000	USD	372	371	2020年7月8日	(1)
JPY	9,104,519	USD	84,603	84,340	2020年7月8日	(263)
JPY	24,020,000	USD	223,694	222,511	2020年7月8日	(1,183)
JPY	12,091,262	USD	112,299	112,008	2020年7月8日	(291)
JPY	1,000,000	USD	9,286	9,264	2020年7月8日	(22)
JPY	6,890,046	USD	64,350	63,826	2020年7月8日	(524)
JPY	12,362,527	USD	114,829	114,521	2020年7月8日	(308)
JPY	8,875,953	USD	82,739	82,223	2020年7月8日	(516)
JPY	9,336,471	USD	87,360	86,489	2020年7月8日	(871)
JPY	15,505,166	USD	144,536	143,633	2020年7月8日	(903)
JPY	6,113,057	USD	56,957	56,629	2020年7月8日	(328)
JPY	10,896,900	USD	101,648	100,944	2020年7月8日	(704)
JPY	2,001,880	USD	18,659	18,544	2020年7月8日	(115)
JPY	24,905,317	USD	232,074	230,712	2020年7月8日	(1,362)
JPY	2,701,713	USD	25,254	25,0280	2020年7月8日	(226)
JPY	10,604,876	USD	99,257	98,239	2020年7月8日	(1,018)
JPY	866,700	USD	8,109	8,029	2020年7月8日	(80)
JPY	15,686,242	USD	146,553	145,310	2020年7月8日	(1,243)
JPY	9,216,936	USD	86,577	85,382	2020年7月8日	(1,195)
JPY	16,830,498	USD	157,524	155,910	2020年7月8日	(1,614)
JPY	1,123,736	USD	10,490	10,410	2020年7月8日	(80)
JPY	15,200,312	USD	141,120	140,809	2020年7月8日	(311)
USD	163,821	JPY	17,890,823	161,909	2020年7月8日	(1,912)
USD	545,568	JPY	59,786,598	537,300	2020年7月8日	(8,268)
合計						(85,717)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(85,717)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	時価 (米ドル)
ミューチュアル・ファンド(2019年: 100.49%; USD 62,716,344)			
合同運用型スキーム			
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー			
ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド			
クラスI(米ドル)inc受益証券 アイルランドUCITS			
	3,309,039	100.20	53,871,154
投資有価証券合計		100.20	53,871,154

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年: 0.05%; USD 34,004)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	未実現評価益(米ドル)
Citibank				
JPY 8,964,216	USD 82,602	83,041	2020年7月8日	439
JPY 13,474,836	USD 123,854	124,825	2020年7月8日	971
JPY 14,794,792	USD 135,307	137,052	2020年7月8日	1,745
JPY 6,095,007	USD 56,453	56,461	2020年7月8日	8
USD 12,293	JPY 1,321,140	12,238	2020年7月8日	55
USD 4,128	JPY 444,528	4,118	2020年7月8日	10
USD 54,903	JPY 5,893,315	54,593	2020年7月8日	310
USD 76,272	JPY 8,157,004	75,563	2020年7月8日	709
USD 261,512	JPY 28,101,210	260,318	2020年7月8日	1,194
USD 19,998	JPY 2,141,237	19,836	2020年7月8日	162
USD 17,059	JPY 1,824,033	16,897	2020年7月8日	162
USD 89,829	JPY 9,603,942	88,966	2020年7月8日	863
USD 10,963	JPY 1,172,962	10,866	2020年7月8日	97
USD 105,180	JPY 11,285,409	104,543	2020年7月8日	637
USD 67,754	JPY 7,265,526	67,305	2020年7月8日	449
USD 5,346	JPY 574,927	5,326	2020年7月8日	20
合計				7,831
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				53,878,985

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉(2019年：0%；USD (692))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	未実現評価損(米ドル)
Citibank						
JPY	10,000,000	USD	93,347	92,635	2020年7月8日	(712)
JPY	499,018,277	USD	4,646,136	4,622,685	2020年7月8日	(23,451)
JPY	16,971,620	USD	157,704	157,218	2020年7月8日	(486)
JPY	3,625,764	USD	33,863	33,587	2020年7月8日	(276)
JPY	9,059,502	USD	84,157	83,924	2020年7月8日	(233)
JPY	16,258,075	USD	151,554	150,608	2020年7月8日	(946)
JPY	4,159,009	USD	38,796	38,527	2020年7月8日	(269)
JPY	48,794,885	USD	454,930	452,014	2020年7月8日	(2,916)
JPY	7,813,463	USD	72,808	72,381	2020年7月8日	(427)
JPY	4,219,312	USD	39,490	39,085	2020年7月8日	(405)
USD	34,455	JPY	3,762,839	34,053	2020年7月8日	(402)
合計						(30,523)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(30,523)

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの報酬体系は、Appendix（訳者注：原文の記載事項）に開示されています。

注記は財務諸表の一部を構成します。

③ 【投資不動産明細表】

該当事項はありません。

④ 【その他投資資産明細表】

該当事項はありません。

⑤ 【借入金明細表】

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

(参考情報)

以下のとおり更新されます。

当ファンドは、アンダーライイング・ファンドであるジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンドを投資対象としています。ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンドの投資有価証券及びその他の資産の2020年6月30日現在の内訳は、以下の通りです。

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド 投資有価証券明細表

(2020年6月30日現在)			
銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保／商業不動産担保証券 (2019年: 6.97%; USD 46,256,597)			
Angel Oak Mortgage Trust I LLC 2018-2, 3.6740%, 期日 27/7/48 (144A).....	170,904	0.02	174,796
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, 4.1940%, 期日 7/6/49 (144A)	1,323,000	0.15	1,161,810
Arroyo Mortgage Trust 2018-1, 3.7630%, 期日 25/4/48 (144A).....	712,116	0.10	734,514
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DSNY, 1.0348%, 期日 15/9/34 (144A).....	634,000	0.08	603,057
BANK 2018-BNK12, 4.2550%, 期日 15/5/61.....	2,330,170	0.37	2,752,242
BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust, 1.0348%, 期日 15/8/36 (144A).....	548,000	0.07	523,510
BBCMS Trust 2015-SRCH, 4.1970%, 期日 10/8/35 (144A)	1,712,000	0.25	1,885,549
BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, 0.9348%, 期日 15/11/35 (144A)	1,178,333	0.16	1,167,058
BXP Trust 2017-GM, 3.3790%, 期日 13/6/39 (144A)	1,820,000	0.27	1,995,960
CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, 1.1148%, 期日 15/11/36 (144A).....	1,083,247	0.14	1,037,924
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R02, 2.4845%, 期日 25/8/31 (144A).....	272,905	0.04	268,937
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, 2.2845%, 期日 25/10/39 (144A)	1,644,000	0.21	1,594,077
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, 0.9845%, 期日 25/1/40 (144A).....	375,904	0.05	373,611
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, 2.1845%, 期日 25/1/40 (144A).....	1,842,163	0.23	1,740,953
Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2, 3.9400%, 期日 15/7/27 (144A).....	1,007,000	0.14	1,039,436
DB Master Finance LLC, 3.7870%, 期日 20/5/49 (144A)	742,390	0.10	762,876
DB Master Finance LLC, 4.0210%, 期日 20/5/49 (144A)	302,713	0.04	318,479
DB Master Finance LLC, 4.3520%, 期日 20/5/49 (144A)	429,753	0.06	455,895
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.0820%, 期日 25/7/47 (144A).....	275,925	0.04	278,998
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.6680%, 期日 25/10/49 (144A).....	2,420,835	0.34	2,542,329
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1160%, 期日 25/7/48 (144A).....	1,456,065	0.21	1,546,026
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.3280%, 期日 25/7/48 (144A).....	694,628	0.10	754,185
Drive Auto Receivables Trust 2017-1, 5.1700%, 期日 16/9/24	1,590,000	0.22	1,622,794
Drive Auto Receivables Trust 2017-2, 5.2700%, 期日 15/11/24	1,400,000	0.19	1,434,474
Drive Auto Receivables Trust 2017-3, 3.5300%, 期日 15/12/23 (144A).....	198,468	0.03	201,294

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Drive Auto Receivables Trust 2017-A, 4.1600%, 期日 15/5/24 (144A).....	538,063	0.07	546,730
Exeter Automobile Receivables Trust 2018-1, 3.0300%, 期日 17/1/23 (144A).....	670,385	0.09	673,729
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 1.1345%, 期日 25/10/29.....	24,133	—	24,111
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.1845%, 期日 25/3/31	1,351,848	0.17	1,303,147
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.1845%, 期日 25/7/39 (144A).....	1,915,251	0.25	1,873,509
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.2845%, 期日 25/6/39 (144A).....	386,846	0.05	373,907
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.3345%, 期日 25/9/31 (144A).....	1,428,710	0.19	1,408,776
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.5345%, 期日 25/1/31	482,978	0.06	472,765
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 3.7345%, 期日 25/7/29	951,141	0.13	966,975
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 4.4345%, 期日 25/1/29	541,171	0.07	555,066
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 5.1845%, 期日 25/7/25	1,659,215	0.23	1,699,562
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 5.8845%, 期日 25/4/28	453,081	0.06	472,511
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 6.0845%, 期日 25/10/28.....	230,903	0.03	240,104
Fannie Mae REMICS, 3.0000%, 期日 25/11/49	2,507,458	0.35	2,595,728
Fannie Mae REMICS, 3.0000%, 期日 25/5/48.....	1,724,753	0.25	1,853,176
Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, 1.8845%, 期日 25/1/50 (144A).....	1,196,000	0.15	1,106,974
GS Mortgage Securities Corp II, 4.1550%, 期日 10/7/51	446,370	0.07	524,126
GS Mortgage Securities Trust 2018-GS9, 3.9920%, 期日 10/3/51	742,876	0.12	863,543
Jack in the Box Funding LLC, 3.9820%, 期日 25/8/49 (144A) ...	1,227,830	0.17	1,263,595
Jack in the Box Funding LLC, 4.4760%, 期日 25/8/49 (144A) ...	1,631,800	0.23	1,694,220
Jack in the Box Funding LLC, 4.9700%, 期日 25/8/49 (144A) ...	1,232,805	0.17	1,262,766
Mello Warehouse Securitization Trust 2018-1, 1.0345%, 期日 25/11/51 (144A)	2,382,000	0.32	2,382,727
Mello Warehouse Securitization Trust 2018-1, 1.2345%, 期日 25/11/51 (144A)	666,667	0.09	667,131
Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, 3.8090%, 期日 15/12/48.....	3,775,000	0.55	4,154,732
Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11, 2.7820%, 期日 15/8/49	741,000	0.11	788,752
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3, 4.1770%, 期日 15/7/51	1,393,605	0.22	1,639,239
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4, 4.3100%, 期日 15/12/51.....	2,084,627	0.33	2,483,727
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-2, 4.5000%, 期日 25/2/58 (144A).....	886,919	0.13	946,413
OneMain Direct Auto Receivables Trust 2017-2, 2.8200%, 期日 15/7/24 (144A).....	633,000	0.08	634,933
OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1, 3.8500%, 期日 14/10/25 (144A)	414,000	0.06	416,886
OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1, 4.4000%, 期日 14/1/28 (144A).....	446,000	0.06	460,927
Planet Fitness Master Issuer LLC, 3.8580%, 期日 5/12/49 (144A).....	1,161,165	0.13	1,000,344
Santander Drive Auto Receivables Trust 2016-3, 4.2900%, 期日 15/2/24	2,281,000	0.31	2,317,567
Sequoia Mortgage Trust 2013-5, 2.5000%, 期日 25/5/43 (144A).....	509,558	0.07	519,716
Sequoia Mortgage Trust 2013-7, 3.0000%, 期日 25/6/43.....	176,404	0.02	181,750

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Sequoia Mortgage Trust 2013-9, 3.5000%, 期日 25/7/43 (144A).....	85,665	0.01	88,126
Station Place Securitization Trust Series 2019-10, 1.0848%, 期日 24/10/20 (144A).....	3,988,000	0.52	3,997,811
Taco Bell Funding LLC, 4.9400%, 期日 25/11/48 (144A).....	262,995	0.04	279,233
Wendy's Funding LLC, 3.7830%, 期日 15/6/49 (144A)	682,080	0.10	718,075
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C25, 3.6310%, 期日 15/11/47.....	1,252,000	0.18	1,363,437
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1180%, 期日 25/7/47 (144A).....	444,600	0.06	477,671
Wendys Funding LLC 2018-1, 3.5730%, 期日 15/3/48 (144A)	465,075	0.06	481,205
Wendys Funding LLC 2018-1, 3.8840%, 期日 15/3/48 (144A)	663,975	0.09	704,083
資産担保／商業不動産担保証券合計.....		10.06	75,450,289

社債 (2019年: 43.92%; USD 291,404,183)

航空宇宙産業及び防衛

BAE Systems plc, 3.4000%, 期日 15/4/30 (144A)	610,000	0.09	666,620
Boeing Co., 2.2500%, 期日 15/6/26	359,000	0.05	347,314
Boeing Co., 3.6000%, 期日 1/5/34.....	1,687,000	0.21	1,598,418
Boeing Co., 4.5080%, 期日 1/5/23.....	1,708,000	0.24	1,804,662
Boeing Co., 4.8750%, 期日 1/5/25.....	1,358,000	0.20	1,480,237
Boeing Co., 5.7050%, 期日 1/5/40.....	678,000	0.10	769,102
Boeing Co., 5.8050%, 期日 1/5/50.....	678,000	0.11	801,802
Boeing Co., 5.9300%, 期日 1/5/60.....	678,000	0.11	804,531
General Dynamics Corp., 3.2500%, 期日 1/4/25.....	737,000	0.11	817,885
General Dynamics Corp., 3.5000%, 期日 1/4/27.....	1,066,000	0.16	1,221,923
General Dynamics Corp., 4.2500%, 期日 1/4/50.....	293,000	0.05	382,338
Northrop Grumman Corp., 4.4000%, 期日 1/5/30.....	766,000	0.12	930,258
Northrop Grumman Corp., 5.1500%, 期日 1/5/40.....	555,000	0.10	741,021
Northrop Grumman Corp., 5.2500%, 期日 1/5/50.....	285,000	0.05	411,609
		1.70	12,777,720

農業運営

Cargill, Inc., 1.3750%, 期日 23/7/23 (144A)	364,000	0.05	370,434
Cargill, Inc., 2.1250%, 期日 23/4/30 (144A)	535,000	0.07	561,414
		0.12	931,848

アプリケーション・ソフトウェア

Intuit, Inc., 0.9500%, 期日 15/7/25	311,000	0.05	311,643
Intuit, Inc., 1.3500%, 期日 15/7/27	325,000	0.04	326,970
		0.09	638,613

自動車－乗用車及び小型トラック

General Motors Co., 4.2000%, 期日 1/10/27	511,000	0.07	520,908
General Motors Co., 5.0000%, 期日 1/10/28	1,303,000	0.19	1,384,655
General Motors Co., 5.4000%, 期日 1/4/48.....	544,000	0.07	538,422
General Motors Financial Co., Inc., 4.3000%, 期日 13/7/25	320,000	0.04	333,652
General Motors Financial Co., Inc., 4.3500%, 期日 17/1/27	848,000	0.12	878,494
General Motors Financial Co., Inc., 4.3500%, 期日 9/4/25.....	942,000	0.13	995,446
		0.62	4,651,577

飲料－アルコール以外

Coca-Cola Co., 3.3750%, 期日 25/3/27.....	1,296,000	0.20	1,487,348
Coca-Cola Femsa SAB de C.V., 2.7500%, 期日 22/1/30.....	816,000	0.12	865,292
Fomento Economico Mexicano, S.A.B. de C.V., 3.5000%, 期日 16/1/50	1,222,000	0.17	1,264,610
Keurig Dr Pepper, Inc., 3.2000%, 期日 1/5/30.....	190,000	0.03	210,628
Keurig Dr Pepper, Inc., 3.8000%, 期日 1/5/50.....	434,000	0.07	497,379
Keurig Dr Pepper, Inc., 4.5970%, 期日 25/5/28	1,948,000	0.30	2,339,922
PepsiCo, Inc., 2.2500%, 期日 19/3/25.....	845,000	0.12	904,469
PepsiCo, Inc., 2.6250%, 期日 19/3/27.....	261,000	0.04	285,527
		1.05	7,855,175

飲料－ワイン及び蒸留酒

Diageo Capital plc, 2.3750%, 期日 24/10/29.....	1,932,000	0.28	2,063,744
---	-----------	------	-----------

醸造

Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4.9000%, 期日 1/2/46.....	1,698,000	0.28	2,083,316
---	-----------	------	-----------

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4.3500%, 期日 1/6/40…	885,000	0.13 0.41	1,011,229 3,094,545
建築—住宅及び商業			
MDC Holdings, Inc., 5.5000%, 期日 15/1/24 ……………	1,393,000	0.20	1,495,587
建築製品—セメント及び骨材			
Vulcan Materials Co., 3.5000%, 期日 1/6/30……………	754,000	0.11	819,799
ケーブルTV／衛星TV			
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2.8000%, 期日 1/4/31…………	1,201,000	0.16	1,220,201
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.7000%, 期日 1/4/51…………	1,311,000	0.17	1,282,231
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.8000%, 期日 1/3/50…………	2,261,000	0.35	2,573,211
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.3750%, 期日 1/5/47…………	264,000	0.04	312,093
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.4840%, 期日 23/10/45……	329,000	0.06	438,651
Comcast Corp., 3.1000%, 期日 1/4/25 ……………	204,000	0.03	224,429
Comcast Corp., 3.1500%, 期日 1/3/26 ……………	533,000	0.08	596,846
Comcast Corp., 3.3000%, 期日 1/4/27 ……………	556,000	0.08	626,303
Comcast Corp., 3.7500%, 期日 1/4/40 ……………	222,000	0.03	262,057
Comcast Corp., 4.6000%, 期日 15/10/38 ……………	1,604,000	0.27	2,045,304
CSC Holdings LLC, 4.1250%, 期日 1/12/30 (144A)…………	1,675,000	0.22	1,662,538
Sirius XM Radio, Inc., 4.1250%, 期日 1/7/30 (144A)…………	2,346,000	0.32 1.81	2,323,033 13,566,897
カジノ・ホテル			
MGM Resorts International, 7.7500%, 期日 15/3/22…………	462,000	0.06	470,974
携帯電話通信			
T-Mobile USA, Inc., 1.5000%, 期日 15/2/26 (144A)…………	1,038,000	0.14	1,040,522
T-Mobile USA, Inc., 2.0500%, 期日 15/2/28 (144A)…………	797,000	0.11	799,367
T-Mobile USA, Inc., 2.5500%, 期日 15/2/31 (144A)…………	1,297,000	0.17	1,304,808
T-Mobile USA, Inc., 3.5000%, 期日 15/4/25 (144A)…………	873,000	0.13	953,224
T-Mobile USA, Inc., 3.7500%, 期日 15/4/27 (144A)…………	2,226,000	0.33	2,472,530
T-Mobile USA, Inc., 3.8750%, 期日 15/4/30 (144A)…………	428,000	0.06	477,838
T-Mobile USA, Inc., 6.3750%, 期日 1/3/25……………	2,121,000	0.29 1.23	2,181,449 9,229,738
化学—特殊			
Ecolab, Inc., 4.8000%, 期日 24/3/30	667,000	0.11	846,973
商業銀行—米国東部			
Citizens Financial Group, Inc., 3.7500%, 期日 1/7/24…………	1,016,000	0.15	1,093,445
Citizens Financial Group, Inc., 4.3000%, 期日 3/12/25 ……………	1,206,000	0.18	1,351,038
Citizens Financial Group, Inc., 4.3500%, 期日 1/8/25…………	700,000	0.10 0.43	775,673 3,220,156
商業銀行—米国西部			
SVB Financial Group, 3.1250%, 期日 5/6/30 ……………	3,551,000	0.51	3,810,630
商業サービス			
CoStar Group, Inc., 2.8000%, 期日 15/7/30 (144A)…………	1,928,000	0.26	1,976,782
RELX Capital, Inc., 3.0000%, 期日 22/5/30 ……………	970,000	0.14 0.40	1,051,704 3,028,486
商業サービス—金融			
Equifax, Inc., 2.6000%, 期日 15/12/25 ……………	1,271,000	0.18	1,356,625
Equifax, Inc., 3.1000%, 期日 15/5/30……………	1,159,000	0.16	1,234,579
Equinix, Inc., 2.6000%, 期日 1/12/24……………	2,610,000	0.38	2,763,706
Experian Finance plc, 2.7500%, 期日 8/3/30 (144A) ……………	3,727,000	0.53	3,977,812
Global Payments, Inc., 2.9000%, 期日 15/5/30……………	1,181,000	0.16	1,236,720
Global Payments, Inc., 3.2000%, 期日 15/8/29……………	427,000	0.06	458,204
Global Payments, Inc., 4.8000%, 期日 1/4/26 ……………	3,328,000	0.52	3,907,013
IHS Markit, Ltd., 4.0000%, 期日 1/3/26 (144A) ……………	775,000	0.11	858,952
IHS Markit, Ltd., 4.7500%, 期日 15/2/25 (144A)…………	2,696,000	0.41	3,027,905
IHS Markit, Ltd., 5.0000%, 期日 1/11/22 (144A)…………	1,072,000	0.15	1,151,180
PayPal Holdings, Inc., 1.3500%, 期日 1/6/23 ……………	332,000	0.05	339,148
PayPal Holdings, Inc., 2.3000%, 期日 1/6/30 ……………	712,000	0.10	741,512
PayPal Holdings, Inc., 2.4000%, 期日 1/10/24……………	746,000	0.11	792,725
PayPal Holdings, Inc., 2.6500%, 期日 1/10/26……………	2,231,000	0.32	2,426,551

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
PayPal Holdings, Inc., 3.2500%, 期日 1/6/50	981,000	0.14 3.38	1,073,398 25,346,030
コンピュータ支援設計			
Cadence Design Systems, Inc., 4.3750%, 期日 15/10/24.....	3,570,000	0.53	3,981,572
コンピュータ・サービス			
Leidos, Inc., 2.9500%, 期日 15/5/23 (144A).....	215,000	0.03	224,906
Leidos, Inc., 3.6250%, 期日 15/5/25 (144A).....	833,000	0.12	911,406
Leidos, Inc., 4.3750%, 期日 15/5/30 (144A).....	1,183,000	0.18 0.33	1,335,548 2,471,860
コンサルティング・サービス			
Verisk Analytics, Inc., 3.6250%, 期日 15/5/50	131,000	0.02	148,816
Verisk Analytics, Inc., 5.5000%, 期日 15/6/45	1,350,000	0.25 0.27	1,856,400 2,005,216
梱包材—紙製及びプラスチック製			
Bemis Co., Inc., 2.6300%, 期日 19/6/30.....	2,067,000	0.28	2,121,466
データ処理及び管理			
Broadridge Financial Solutions, Inc., 2.9000%, 期日 1/12/29	3,008,000	0.43	3,219,709
意思決定支援ソフトウェア			
MSCI, Inc., 3.8750%, 期日 15/2/31 (144A).....	2,167,000	0.30	2,214,403
診断装置			
DH Europe Finance II S.a.r.l., 2.2000%, 期日 15/11/24	705,000	0.10	741,417
DH Europe Finance II S.a.r.l., 2.6000%, 期日 15/11/29	387,000	0.06	412,592
DH Europe Finance II S.a.r.l., 3.4000%, 期日 15/11/49	498,000	0.07	560,812
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4.1330%, 期日 25/3/25	527,000	0.08	602,311
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4.4970%, 期日 25/3/30	1,235,000	0.20 0.51	1,529,460 3,846,592
透析センター			
DaVita, Inc., 4.6250%, 期日 1/6/30 (144A)	1,371,000	0.18	1,364,316
多角的銀行機関			
Bank of America Corp., 2.5920%, 期日 29/4/31.....	1,778,000	0.25	1,884,773
Bank of America Corp., 3.5590%, 期日 23/4/27.....	3,337,000	0.50	3,726,335
Bank of America Corp., 3.7050%, 期日 24/4/28.....	3,370,000	0.51	3,810,985
Bank of America Corp., 6.1000%, 期日 29/12/49	636,000	0.09	671,422
Bank of America Corp., 6.2500%, 期日 29/9/49.....	1,454,000	0.20	1,507,909
BNP Paribas S.A., 2.8190%, 期日 19/11/25 (144A)	668,000	0.09	700,021
BNP Paribas S.A., 3.0520%, 期日 13/1/31 (144A).....	2,196,000	0.31	2,312,938
BNP Paribas S.A., 4.7050%, 期日 10/1/25 (144A).....	983,000	0.15	1,089,061
Citigroup, Inc., 2.9760%, 期日 5/11/30.....	643,000	0.09	684,686
Citigroup, Inc., 3.8870%, 期日 10/1/28.....	2,290,000	0.34	2,582,365
Citigroup, Inc., 5.9000%, 期日 29/12/49	141,000	0.02	140,277
Citigroup, Inc., 5.9500%, 期日 15/11/66	725,000	0.10	721,255
Citigroup, Inc., 5.9500%, 期日 29/12/49	1,106,000	0.15	1,099,049
Credit Agricole Corp., 1.9070%, 期日 16/6/26 (144A)	332,000	0.04	336,962
Credit Agricole S.A., 3.2500%, 期日 14/1/30 (144A).....	2,318,000	0.33	2,489,631
Credit Agricole S.A., 4.3750%, 期日 17/3/25 (144A).....	995,000	0.15	1,101,975
Goldman Sachs Group, Inc., 3.5000%, 期日 1/4/25	3,356,000	0.50	3,683,868
Goldman Sachs Group, Inc., 4.3696%, 期日 10/11/68	2,663,000	0.33	2,467,824
JPMorgan Chase & Co., 2.0830%, 期日 22/4/26	2,031,000	0.28	2,109,638
JPMorgan Chase & Co., 2.9560%, 期日 13/5/31	3,783,000	0.54	4,031,400
JPMorgan Chase & Co., 3.9600%, 期日 29/1/27	3,760,000	0.57	4,286,072
JPMorgan Chase & Co., 4.4520%, 期日 5/12/29	4,022,000	0.64	4,825,150
Morgan Stanley, 2.1880%, 期日 28/4/26	3,265,000	0.45	3,399,525
Morgan Stanley, 3.9500%, 期日 23/4/27	2,092,000	0.31	2,356,766
Societe Generale S.A., 2.6250%, 期日 22/1/25 (144A)	2,403,000	0.33 7.27	2,455,106 54,474,993
多角的金融サービス			
USAA Capital Corp., 2.1250%, 期日 1/5/30 (144A)	150,000	0.02	154,636
多角的製造業			
General Electric Co., 3.4500%, 期日 1/5/27.....	496,000	0.07	509,234
General Electric Co., 5.0000%, 期日 29/12/49.....	2,406,000	0.25	1,892,669
General Electric Co., 6.7500%, 期日 15/3/32	769,000	0.13 0.45	942,286 3,344,189

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Eコマース／サービス			
Booking Holdings, Inc., 4.1000%, 期日 13/4/25	3,514,000	0.52	3,952,530
Booking Holdings, Inc., 4.5000%, 期日 13/4/27	966,000	0.15	1,110,539
Booking Holdings, Inc., 4.6250%, 期日 13/4/30	674,000	0.11	789,805
		0.78	5,852,874
電力－送電			
PPL WEM, Ltd. / Western Power Distribution plc, 5.3750%, 期 日 1/5/21 (144A)	1,806,000	0.25	1,850,089
電力－総合			
Ameren Corp., 3.5000%, 期日 15/1/31	2,455,000	0.37	2,750,310
Berkshire Hathaway Energy Co., 4.2500%, 期日 15/10/50 (144A)	1,362,000	0.23	1,713,668
Black Hills Corp., 2.5000%, 期日 15/6/30	2,854,805	0.39	2,922,534
CMS Energy Corp., 4.7500%, 期日 1/6/50	1,558,000	0.21	1,591,662
Dominion Energy, Inc., 3.3750%, 期日 1/4/30	1,081,000	0.16	1,198,289
IPALCO Enterprises, Inc., 4.2500%, 期日 1/5/30 (144A)	3,230,000	0.48	3,512,635
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2.7500%, 期日 1/5/25	718,000	0.10	776,672
Pacific Gas and Electric Co., 2.1000%, 期日 1/8/27	689,000	0.09	682,158
Pacific Gas and Electric Co., 2.5000%, 期日 1/2/31	1,415,000	0.18	1,386,842
Southern Co., 3.7000%, 期日 30/4/30	1,633,000	0.25	1,870,653
		2.46	18,405,423
電気－伝送			
AEP Transmission Co. LLC, 3.6500%, 期日 1/4/50	450,000	0.07	521,817
Oncor Electric Delivery Co., LLC, 3.8000%, 期日 1/6/49	1,772,000	0.29	2,150,294
		0.36	2,672,111
電子構成部品－半導体			
Broadcom, Inc., 3.1500%, 期日 15/11/25 (144A)	1,726,000	0.24	1,834,739
Broadcom, Inc., 4.1500%, 期日 15/11/30 (144A)	1,763,000	0.26	1,922,218
Broadcom, Inc., 4.3000%, 期日 15/11/32 (144A)	1,138,000	0.17	1,259,272
Broadcom, Inc., 4.7000%, 期日 15/4/25 (144A)	975,000	0.15	1,098,903
Marvell Technology Group, Ltd., 4.2000%, 期日 22/6/23	523,000	0.08	562,606
Marvell Technology Group, Ltd., 4.8750%, 期日 22/6/28	3,065,000	0.49	3,691,046
Microchip Technology, Inc., 2.6700%, 期日 1/9/23 (144A)	1,811,000	0.25	1,865,036
Microchip Technology, Inc., 4.2500%, 期日 1/9/25 (144A)	1,419,000	0.19	1,432,046
Micron Technology, Inc., 2.4970%, 期日 24/4/23	1,695,000	0.23	1,761,639
		2.06	15,427,505
電子計測器			
Keysight Technologies, Inc., 3.0000%, 期日 30/10/29	1,919,000	0.28	2,078,184
Trimble, Inc., 4.7500%, 期日 1/12/24	3,074,000	0.45	3,348,045
Trimble, Inc., 4.9000%, 期日 15/6/28	3,378,000	0.51	3,881,842
		1.24	9,308,071
信託銀行			
Bank of New York Mellon Corp., 4.7000%, 期日 20/9/68	2,250,000	0.31	2,345,625
金融－クレジット・カード			
Mastercard, Inc., 3.3000%, 期日 26/3/27	652,000	0.10	739,428
Mastercard, Inc., 3.3500%, 期日 26/3/30	827,000	0.13	958,674
		0.23	1,698,102
金融－投資銀行／証券会社			
Charles Schwab Corp., 4.2000%, 期日 24/3/25	1,236,000	0.19	1,419,300
Charles Schwab Corp., 5.3750%, 期日 1/9/68	3,389,000	0.48	3,629,009
		0.67	5,048,309
金融－その他のサービス			
Cboe Global Markets, Inc., 3.6500%, 期日 12/1/27	2,025,000	0.30	2,278,380
食品－ケータリング			
Aramark Services, Inc., 6.3750%, 期日 1/5/25 (144A)	2,362,000	0.33	2,443,501

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
食品―菓子			
J M Smucker Co., 2.3750%, 期日 15/3/30	1,269,000	0.17	1,298,087
J M Smucker Co., 3.5500%, 期日 15/3/50	432,000	0.06	447,568
Mondelez International Holdings Netherlands B.V., 2.2500%, 期日 19/9/24 (144A)	1,704,000	0.24	1,794,752
Mondelez International, Inc., 2.1250%, 期日 13/4/23	277,000	0.04	287,086
		0.51	3,827,493
食品―肉製品			
JBS USA LUX S.A. / JBS USA Finance, Inc., 6.7500%, 期日 15/2/28 (144A)	381,000	0.05	403,315
食品―その他／各種			
Campbell Soup Co., 3.9500%, 期日 15/3/25	587,000	0.09	660,735
Mars, Inc., 2.7000%, 期日 1/4/25 (144A)	772,000	0.11	827,406
Mars, Inc., 4.2000%, 期日 1/4/59 (144A)	821,000	0.14	1,056,000
McCormick & Co, Inc./MD, 2.5000%, 期日 15/4/30	646,000	0.09	675,152
		0.43	3,219,293
食品―卸売り／流通			
Sysco Corp., 2.4000%, 期日 15/2/30	365,000	0.05	361,486
Sysco Corp., 5.6500%, 期日 1/4/25	1,254,000	0.20	1,468,530
Sysco Corp., 5.9500%, 期日 1/4/30	1,588,000	0.26	1,993,632
Sysco Corp., 6.6000%, 期日 1/4/40	652,000	0.12	885,152
Sysco Corp., 6.6000%, 期日 1/4/50	1,266,000	0.23	1,745,751
		0.86	6,454,551
ガス―供給			
East Ohio Gas Co., 1.3000%, 期日 15/6/25 (144A)	205,000	0.03	206,367
East Ohio Gas Co., 2.0000%, 期日 15/6/30 (144A)	188,000	0.03	188,025
East Ohio Gas Co., 3.0000%, 期日 15/6/50 (144A)	273,000	0.03	273,891
		0.09	668,283
ホテル及びモーテル			
Choice Hotels International, Inc., 3.7000%, 期日 1/12/29	1,375,000	0.18	1,381,731
Marriott International, Inc. / MD, 5.7500%, 期日 1/5/25	1,662,000	0.25	1,813,173
		0.43	3,194,904
独立系発電事業者			
NRG Energy, Inc., 6.6250%, 期日 15/1/27	872,000	0.12	912,548
NRG Energy, Inc., 7.2500%, 期日 15/5/26	2,745,000	0.39	2,902,330
		0.51	3,814,878
保険ブローカー			
Brown & Brown, Inc., 4.5000%, 期日 15/3/29	929,000	0.13	1,002,322
インターネット・コンテンツ・エンターテインメント			
Netflix, Inc., 3.6250%, 期日 15/6/25 (144A)	3,735,000	0.50	3,779,353
投資管理及び投資顧問業			
Raymond James Financial, Inc., 4.6500%, 期日 1/4/30	222,000	0.04	265,922
Raymond James Financial, Inc., 4.9500%, 期日 15/7/46	1,538,000	0.24	1,865,647
Raymond James Financial, Inc., 5.6250%, 期日 1/4/24	576,000	0.09	657,039
		0.37	2,788,608
機械―一般産業			
Otis Worldwide Corp., 2.0560%, 期日 5/4/25 (144A)	870,000	0.12	912,760
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3.2000%, 期日 15/6/25	1,532,000	0.21	1,565,728
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3.4500%, 期日 15/11/26	956,000	0.13	985,442
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4.4000%, 期日 15/3/24	1,231,000	0.17	1,306,567
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4.9500%, 期日 15/9/28	2,189,000	0.33	2,438,867
		0.96	7,209,364

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
医療－医薬品			
AbbVie, Inc., 2.6000%, 期日 21/11/24 (144A)	997,000	0.14	1,062,336
AbbVie, Inc., 2.8000%, 期日 15/3/23 (144A)	117,000	0.02	121,480
AbbVie, Inc., 3.2500%, 期日 1/10/22 (144A)	1,145,000	0.16	1,198,427
AbbVie, Inc., 3.4500%, 期日 15/3/22 (144A)	1,939,000	0.26	2,015,208
AbbVie, Inc., 3.8000%, 期日 15/3/25 (144A)	1,324,000	0.20	1,477,835
Bristol-Myers Squibb Co., 3.4000%, 期日 26/7/29 (144A)	716,000	0.11	835,145
Pfizer, Inc., 2.6250%, 期日 1/4/30	392,000	0.06	431,790
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd., 3.0250%, 期日 9/7/40	536,000	0.07	542,073
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd., 3.3750%, 期日 9/7/60	536,000	0.07	538,964
Upjohn, Inc., 1.6500%, 期日 22/6/25 (144A)	291,000	0.04	297,009
Upjohn, Inc., 2.3000%, 期日 22/6/27 (144A)	338,000	0.05	349,490
Upjohn, Inc., 3.8500%, 期日 22/6/40 (144A)	337,000	0.05	362,681
		1.23	9,232,438
医療－HMO			
Centene Corp., 3.3750%, 期日 15/2/30	1,078,000	0.15	1,090,154
Centene Corp., 4.2500%, 期日 15/12/27	1,747,000	0.24	1,806,791
Centene Corp., 4.6250%, 期日 15/12/29	3,305,000	0.47	3,507,497
Centene Corp., 4.7500%, 期日 15/5/22	106,000	0.01	107,698
Molina Healthcare, Inc., 4.3750%, 期日 15/6/28 (144A)	3,466,000	0.46	3,481,164
		1.33	9,993,304
医療－病院			
HCA, Inc., 5.3750%, 期日 1/2/25	682,000	0.10	732,506
医療機器			
Boston Scientific Corp., 3.7500%, 期日 1/3/26	770,000	0.12	875,012
Boston Scientific Corp., 4.0000%, 期日 1/3/29	977,000	0.15	1,118,490
Boston Scientific Corp., 4.7000%, 期日 1/3/49	599,000	0.10	765,186
		0.37	2,758,688
医療用品			
Baxter International, Inc., 3.7500%, 期日 1/10/25 (144A)	699,000	0.10	796,960
Baxter International, Inc., 3.9500%, 期日 1/4/30 (144A)	609,000	0.10	722,917
		0.20	1,519,877
金属－アルミニウム			
Constellium N.V., 5.7500%, 期日 15/5/24 (144A)	1,017,000	0.14	1,020,707
事務用品・フォーム			
Avery Dennison Corp., 2.6500%, 期日 30/4/30	2,028,000	0.28	2,082,466
石油会社－探査及び生産			
EOG Resources, Inc., 4.3750%, 期日 15/4/30	1,789,000	0.28	2,133,840
EOG Resources, Inc., 4.9500%, 期日 15/4/50	1,469,000	0.26	1,919,218
WPX Energy, Inc., 4.5000%, 期日 15/1/30	1,514,000	0.18	1,340,730
		0.72	5,393,788
石油精製及び販売			
Phillips 66, 3.7000%, 期日 6/4/23	348,000	0.05	372,255
Phillips 66, 3.8500%, 期日 9/4/25	348,000	0.05	386,146
		0.10	758,401
紙及び関連製品			
Georgia-Pacific LLC, 3.1630%, 期日 15/11/21 (144A)	3,304,000	0.45	3,397,936
薬局サービス			
Cigna Corp., 2.4000%, 期日 15/3/30	639,000	0.09	663,797
Cigna Corp., 3.2000%, 期日 15/3/40	291,000	0.04	309,272
Cigna Corp., 3.4000%, 期日 15/3/50	439,000	0.06	475,169
Cigna Corp., 3.4000%, 期日 17/9/21	210,000	0.03	217,152
CVS Health Corp., 3.0000%, 期日 15/8/26	186,000	0.03	203,645
CVS Health Corp., 4.1000%, 期日 25/3/25	2,557,000	0.39	2,892,311
CVS Health Corp., 4.1250%, 期日 1/4/40	411,000	0.06	486,416
CVS Health Corp., 4.2500%, 期日 1/4/50	203,000	0.03	245,267
CVS Health Corp., 4.3000%, 期日 25/3/28	1,274,000	0.20	1,490,393
		0.93	6,983,422

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
パイプライン			
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 3.7000%, 期日 15/11/29 (144A).....	3,233,000	0.45	3,316,682
Energy Transfer Operating L.P., 4.9500%, 期日 15/6/28	150,000	0.02	161,158
Energy Transfer Operating L.P., 5.5000%, 期日 1/6/27.....	176,000	0.03	196,566
Energy Transfer Operating L.P., 5.8750%, 期日 15/1/24	954,000	0.14	1,067,775
Energy Transfer Operating L.P., 6.0000%, 期日 15/6/48	440,000	0.06	457,041
Hess Midstream Partners L.P., 5.1250%, 期日 15/6/28 (144A)...	2,311,000	0.30	2,226,325
Kinder Morgan, Inc., 4.3000%, 期日 1/3/28	423,000	0.06	479,919
Kinder Morgan, Inc., 6.5000%, 期日 15/9/20.....	72,000	0.01	72,797
NGPL PipeCo LLC, 4.3750%, 期日 15/8/22 (144A)	2,659,000	0.37	2,744,513
ONEOK, Inc., 5.8500%, 期日 15/1/26.....	426,000	0.06	487,029
ONEOK, Inc., 6.3500%, 期日 15/1/31.....	911,000	0.14	1,068,252
ONEOK, Inc., 7.1500%, 期日 15/1/51.....	238,000	0.04	290,023
Plains All American Pipeline L.P. / PAA Finance Corp., 4.6500%, 期日 15/10/25.....	797,000	0.11	851,689
TransCanada Pipeline, Ltd., 4.1000%, 期日 15/4/30	977,000	0.15	1,114,623
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC, 3.2500%, 期日 15/5/30 (144A).....	1,321,000	0.19	1,413,638
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC, 3.9500%, 期日 15/5/50 (144A).....	824,000	0.12	885,760
		2.25	16,833,790
不動産管理／サービス			
Jones Lang LaSalle, Inc., 4.4000%, 期日 15/11/22.....	2,481,000	0.35	2,602,396
REIT－アパート			
Camden Property Trust, 2.8000%, 期日 15/5/30.....	1,652,000	0.24	1,788,418
REIT－各種			
Crown Castle International Corp., 3.1000%, 期日 15/11/29.....	1,813,000	0.26	1,946,947
Crown Castle International Corp., 3.6500%, 期日 1/9/27.....	783,000	0.12	873,443
Crown Castle International Corp., 4.3000%, 期日 15/2/29	973,000	0.15	1,129,713
Equinix, Inc., 1.8000%, 期日 15/7/27.....	1,786,000	0.24	1,796,770
Equinix, Inc., 2.6250%, 期日 18/11/24	750,000	0.11	799,950
Equinix, Inc., 2.9000%, 期日 18/11/26	628,000	0.09	678,406
Equinix, Inc., 3.2000%, 期日 18/11/29	1,413,000	0.20	1,536,164
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 3.3500%, 期日 1/9/24.....	251,000	0.03	251,714
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 4.0000%, 期日 15/1/30	2,438,000	0.32	2,429,784
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 4.0000%, 期日 15/1/31	431,000	0.06	426,944
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 5.2500%, 期日 1/6/25.....	509,000	0.07	555,075
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 5.3000%, 期日 15/1/29	107,000	0.02	116,093
GLP Capital L.P., 5.3750%, 期日 15/4/26	934,000	0.14	1,022,912
		1.81	13,563,915
REIT－オフィス・ビル			
Alexandria Real Estate Equities, Inc., 4.9000%, 期日 15/12/30.....	693,000	0.12	866,528
REIT－シングル・テナント			
Realty Income Corp., 3.2500%, 期日 15/1/31.....	1,363,000	0.20	1,477,510
小売り－自動車部品			
AutoZone, Inc., 3.7500%, 期日 18/4/29	1,821,000	0.28	2,072,045
O'Reilly Automotive, Inc., 3.6000%, 期日 1/9/27	35,000	0.01	39,388
O'Reilly Automotive, Inc., 3.9000%, 期日 1/6/29	1,894,000	0.28	2,184,023
O'Reilly Automotive, Inc., 4.3500%, 期日 1/6/28	268,000	0.04	312,818
		0.61	4,608,274
小売り－建材製品			
Lowe's Cos, Inc., 4.0000%, 期日 15/4/25	784,000	0.12	895,570
Lowe's Cos, Inc., 4.5000%, 期日 15/4/30	812,000	0.13	997,916
Lowe's Cos, Inc., 5.0000%, 期日 15/4/40	576,000	0.10	750,785
Lowe's Cos, Inc., 5.1250%, 期日 15/4/50	1,058,000	0.20	1,466,760
		0.55	4,111,031

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
小売りーコンビニエンス・ストア			
Alimentation Couche-Tard, Inc., 2.9500%, 期日 25/1/30 (144A).....	389,000	0.05	404,062
小売りー大手デパート			
Nordstrom, Inc., 4.3750%, 期日 1/4/30	1,644,000	0.17	1,291,980
小売りーレストラン			
McDonald's Corp., 3.3000%, 期日 1/7/25.....	296,000	0.04	329,213
McDonald's Corp., 3.5000%, 期日 1/7/27.....	930,000	0.14	1,057,443
McDonald's Corp., 3.6250%, 期日 1/9/49.....	1,122,000	0.17	1,249,165
		0.35	2,635,821
半導体装置			
Lam Research Corp., 4.0000%, 期日 15/3/29	284,000	0.05	337,675
造船			
Huntington Ingalls Industries, Inc., 3.8440%, 期日 1/5/25 (144A).....	1,011,000	0.15	1,098,966
Huntington Ingalls Industries, Inc., 4.2000%, 期日 1/5/30 (144A).....	1,529,000	0.23	1,706,752
Huntington Ingalls Industries, Inc., 5.0000%, 期日 15/11/25 (144A).....	3,345,000	0.46	3,463,885
		0.84	6,269,603
ソフトウェア・ツール			
VMware, Inc., 4.5000%, 期日 15/5/25	882,000	0.13	966,035
VMware, Inc., 4.6500%, 期日 15/5/27	990,000	0.15	1,096,486
		0.28	2,062,521
鉄鋼ー製造業者			
Reliance Steel & Aluminum Co., 4.5000%, 期日 15/4/23.....	2,141,000	0.31	2,300,440
Steel Dynamics, Inc., 5.5000%, 期日 1/10/24	467,000	0.06	480,134
		0.37	2,780,574
大型地域銀行			
Wells Fargo & Co., 1.6540%, 期日 2/6/24	1,562,000	0.21	1,587,973
Wells Fargo & Co., 2.1640%, 期日 11/2/26.....	4,092,000	0.56	4,226,091
Wells Fargo & Co., 2.1880%, 期日 30/4/26.....	1,688,000	0.24	1,747,336
Wells Fargo & Co., 5.8750%, 期日 15/6/25.....	1,487,000	0.21	1,548,483
		1.22	9,109,883
電話ー総合			
AT&T, Inc., 3.6000%, 期日 15/7/25	146,000	0.02	162,260
AT&T, Inc., 4.7500%, 期日 15/5/46	571,000	0.09	677,237
AT&T, Inc., 4.8500%, 期日 1/3/39.....	1,512,000	0.24	1,825,416
CenturyLink, Inc., 5.8000%, 期日 15/3/22.....	608,000	0.08	626,073
CenturyLink, Inc., 6.4500%, 期日 15/6/21.....	1,477,000	0.20	1,515,144
Level 3 Financing, Inc., 3.8750%, 期日 15/11/29 (144A).....	1,865,000	0.27	1,970,624
Verizon Communications, Inc., 2.6250%, 期日 15/8/26	1,641,000	0.24	1,787,011
Verizon Communications, Inc., 3.0000%, 期日 22/3/27	567,000	0.08	629,832
Verizon Communications, Inc., 4.0000%, 期日 22/3/50	490,000	0.08	619,737
Verizon Communications, Inc., 4.5220%, 期日 15/9/48	217,000	0.04	287,263
Verizon Communications, Inc., 4.8620%, 期日 21/8/46	588,000	0.11	800,646
		1.45	10,901,243
玩具			
Hasbro, Inc., 3.0000%, 期日 19/11/24.....	781,000	0.11	818,814
Hasbro, Inc., 3.5500%, 期日 19/11/26.....	1,383,000	0.20	1,463,504
Hasbro, Inc., 3.9000%, 期日 19/11/29.....	2,796,000	0.38	2,916,561
		0.69	5,198,879
運輸ーサービス			
United Parcel Service, Inc., 3.9000%, 期日 1/4/25	538,000	0.08	611,393
United Parcel Service, Inc., 5.2000%, 期日 1/4/40	246,000	0.05	340,665
United Parcel Service, Inc., 5.3000%, 期日 1/4/50	531,000	0.10	761,920
		0.23	1,713,978
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health, Inc., 5.0220%, 期日 28/8/23	671,000	0.09	707,486
水			
American Water Capital Corp., 2.8000%, 期日 1/5/30.....	507,000	0.07	553,346
American Water Capital Corp., 3.4500%, 期日 1/5/50.....	603,000	0.09	680,717
		0.16	1,234,063
社債合計.....		54.84	411,112,961

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
政府発行証券 (2019年: 22.00%; USD 145,992,284)			
米国財務省中期証券／長期証券			
0.3750%, 期日 30/4/25	704,000	0.09	707,286
0.5000%, 期日 31/3/25	900	—	910
0.6250%, 期日 15/5/30	41,800	0.01	41,679
1.1250%, 期日 15/5/40	7,735,000	1.02	7,664,146
1.1250%, 期日 28/2/22	15,129,000	2.05	15,371,300
1.5000%, 期日 15/2/30	12,341,000	1.78	13,341,778
2.0000%, 期日 15/2/50	15,597,200	2.38	17,858,185
2.1250%, 期日 31/5/21	10,291,600	1.41	10,477,130
2.3750%, 期日 15/11/49	6,703,500	1.10	8,277,775
2.6250%, 期日 31/12/23	262,000	0.04	284,203
2.7500%, 期日 15/8/42	13,511,400	2.31	17,328,898
2.8750%, 期日 30/11/23	420,000	0.06	458,268
		12.25	91,811,558
政府発行証券合計		12.25	91,811,558
不動産担保証券 (2019年: 29.59%; USD 196,374,219)			
Fannie Mae			
2.0000%, 期日 25/3/50	111,300	0.02	113,585
2.0000%, 期日 25/9/34	799,300	0.11	826,496
2.5000%, 期日 1/1/50	222,866	0.03	234,110
2.5000%, 期日 1/11/34	87,408	0.01	92,399
2.5000%, 期日 25/12/49	3,885,000	0.54	4,040,738
2.5000%, 期日 25/8/34	2,703,700	0.38	2,830,057
2.5000%, 期日 25/8/49	3,885,000	0.54	4,048,287
3.0000%, 期日 1/1/43	40,686	0.01	43,513
3.0000%, 期日 1/1/50	497,719	0.07	524,405
3.0000%, 期日 1/10/34	363,957	0.05	384,713
3.0000%, 期日 1/11/34	51,562	0.01	55,008
3.0000%, 期日 1/11/48	4,028,522	0.57	4,251,523
3.0000%, 期日 1/12/34	50,401	0.01	53,720
3.0000%, 期日 1/2/43	37,657	0.01	40,227
3.0000%, 期日 1/2/47	12,010,889	1.71	12,844,377
3.0000%, 期日 1/2/48	658,737	0.09	709,948
3.0000%, 期日 1/2/57	1,469,915	0.21	1,575,571
3.0000%, 期日 1/3/50	4,143,896	0.58	4,371,255
3.0000%, 期日 1/5/43	1,171,208	0.17	1,241,421
3.0000%, 期日 1/5/48	360,231	0.05	382,004
3.0000%, 期日 1/6/57	9,615	—	10,302
3.0000%, 期日 1/8/49	476,613	0.07	511,039
3.0000%, 期日 1/9/46	827,009	0.12	884,399
3.0000%, 期日 1/9/49	103,528	0.01	110,103
3.0000%, 期日 25/2/34	290,500	0.04	305,264
3.0000%, 期日 25/6/47	96,900	0.01	102,021
3.5000%, 期日 1/1/48	928,229	0.13	991,960
3.5000%, 期日 1/11/43	2,729	—	2,957
3.5000%, 期日 1/12/42	1,003,071	0.15	1,087,112
3.5000%, 期日 1/12/45	471,086	0.07	519,122
3.5000%, 期日 1/12/47	1,054,298	0.15	1,124,673
3.5000%, 期日 1/2/43	5,183,192	0.75	5,616,638
3.5000%, 期日 1/2/45	2,381,183	0.34	2,576,425
3.5000%, 期日 1/2/57	2,699,796	0.39	2,955,879
3.5000%, 期日 1/3/43	1,373,569	0.20	1,486,193
3.5000%, 期日 1/3/48	2,084,841	0.30	2,234,644
3.5000%, 期日 1/4/43	648,294	0.09	701,450
3.5000%, 期日 1/4/44	537,090	0.08	592,613
3.5000%, 期日 1/7/46	915,516	0.13	997,910
3.5000%, 期日 1/8/47	379,134	0.05	400,190
3.5000%, 期日 1/8/56	2,205,391	0.32	2,398,016
3.5000%, 期日 25/6/47	3,755,933	0.52	3,949,879
3.5000%, 期日 25/7/33	1,803,981	0.25	1,894,409
4.0000%, 期日 1/1/48	3,062,382	0.44	3,296,785
4.0000%, 期日 1/10/47	1,187,055	0.17	1,274,898

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
4.0000%, 期日 1/11/47	113,641	0.02	121,150
4.0000%, 期日 1/12/47	326,156	0.05	347,706
4.0000%, 期日 1/2/49	675,907	0.10	715,443
4.0000%, 期日 1/3/48	860,747	0.12	927,359
4.0000%, 期日 1/6/47	335,439	0.05	358,340
4.0000%, 期日 1/7/47	305,194	0.05	325,359
4.0000%, 期日 1/8/47	384,683	0.05	410,100
4.0000%, 期日 1/9/47	65,738	0.01	70,916
4.0000%, 期日 1/9/49	1,079,314	0.16	1,172,157
4.0000%, 期日 25/12/24	515,423	0.07	545,106
4.5000%, 期日 1/10/44	470,971	0.07	536,522
4.5000%, 期日 1/10/47	74,426	0.01	80,277
4.5000%, 期日 1/11/42	223,329	0.03	249,455
4.5000%, 期日 1/11/47	247,060	0.04	266,485
4.5000%, 期日 1/2/46	860,267	0.13	960,902
4.5000%, 期日 1/3/45	734,863	0.11	837,144
4.5000%, 期日 1/3/48	322,558	0.05	347,494
4.5000%, 期日 1/4/48	355,735	0.05	383,237
4.5000%, 期日 1/5/47	767,269	0.10	846,403
4.5000%, 期日 1/5/48	419,883	0.06	452,344
4.5000%, 期日 1/6/45	428,674	0.06	478,058
4.5000%, 期日 1/6/47	586,783	0.09	634,548
4.5000%, 期日 1/6/48	316,705	0.04	341,190
4.5000%, 期日 1/7/47	908,670	0.14	980,111
4.5000%, 期日 1/8/47	458,199	0.07	494,404
4.5000%, 期日 1/9/47	820,341	0.11	884,837
5.0000%, 期日 1/5/48	136,129	0.02	148,646
5.0000%, 期日 1/7/44	641,789	0.10	716,523
6.0000%, 期日 1/2/37	94,761	0.02	113,827
		11.93	89,434,281
Freddie Mac Gold Pool			
3.0000%, 期日 1/6/43	71,300	0.01	75,044
3.0000%, 期日 1/8/46	562,225	0.08	593,446
3.5000%, 期日 1/4/47	2,339,746	0.35	2,550,661
3.5000%, 期日 1/7/42	20,933	—	22,692
3.5000%, 期日 1/7/46	1,772,000	0.27	1,953,133
3.5000%, 期日 1/8/42	48,006	—	52,040
3.5000%, 期日 1/9/47	458,490	0.06	484,064
4.0000%, 期日 1/2/46	435,769	0.06	473,894
4.5000%, 期日 1/5/44	416,258	0.06	464,388
5.0000%, 期日 1/9/48	101,934	0.01	111,976
6.0000%, 期日 1/4/40	165,013	0.03	198,884
		0.93	6,980,222
Freddie Mac Pool			
2.5000%, 期日 1/1/50	103,885	0.01	109,126
2.5000%, 期日 1/11/34	204,792	0.03	216,485
2.5000%, 期日 1/12/33	2,559,769	0.35	2,684,407
3.0000%, 期日 1/1/33	292,992	0.04	310,504
3.0000%, 期日 1/1/45	931,163	0.13	987,665
3.0000%, 期日 1/1/50	1,013,593	0.14	1,069,391
3.0000%, 期日 1/10/32	116,872	0.02	122,981
3.0000%, 期日 1/10/34	932,115	0.13	988,063
3.0000%, 期日 1/10/49	1,150,897	0.17	1,213,054
3.0000%, 期日 1/11/49	1,495,978	0.21	1,574,706
3.0000%, 期日 1/12/49	1,121,825	0.17	1,180,747
3.0000%, 期日 1/2/50	118,027	0.02	124,625
3.0000%, 期日 1/3/43	1,798,072	0.26	1,922,752
3.0000%, 期日 1/3/50	319,952	0.04	337,601
3.0000%, 期日 1/4/47	873,256	0.12	921,595
3.0000%, 期日 1/5/31	1,814,478	0.26	1,921,851
3.0000%, 期日 1/5/50	1,165,781	0.16	1,231,369
3.0000%, 期日 1/8/49	152,745	0.02	163,778
3.0000%, 期日 1/9/32	521,951	0.07	553,147
3.5000%, 期日 1/11/47	778,090	0.11	830,899

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.5000%, 期日 1/12/47	581,280	0.08	620,732
3.5000%, 期日 1/2/43	420,258	0.06	454,652
3.5000%, 期日 1/2/44	585,512	0.08	633,430
3.5000%, 期日 1/2/48	541,417	0.08	576,503
3.5000%, 期日 1/3/50	11,951	—	12,757
3.5000%, 期日 1/7/46	542,426	0.08	589,104
3.5000%, 期日 1/8/49	2,120,888	0.30	2,241,628
4.0000%, 期日 1/3/47	97,698	0.01	106,212
4.0000%, 期日 1/4/48	2,014,698	0.29	2,141,682
4.0000%, 期日 1/5/48	1,460,882	0.21	1,546,012
4.5000%, 期日 1/7/48	550,913	0.08	594,092
		3.73	27,981,550
Ginnie Mae			
2.5000%, 期日 20/12/49	2,806,100	0.39	2,946,095
3.0000%, 期日 20/7/49	778,100	0.11	823,933
4.0000%, 期日 15/1/45	2,604,160	0.38	2,837,379
4.0000%, 期日 15/11/47	294,447	0.04	320,478
4.0000%, 期日 15/12/47	391,052	0.06	425,623
4.0000%, 期日 15/8/47	203,273	0.03	221,244
4.0000%, 期日 20/6/48	1,196,936	0.17	1,277,861
4.0000%, 期日 20/8/47	351,730	0.05	379,414
4.5000%, 期日 15/8/46	3,065,287	0.46	3,401,100
4.5000%, 期日 20/2/48	536,573	0.08	579,160
4.5000%, 期日 20/5/48	1,470,733	0.21	1,582,015
5.0000%, 期日 20/4/49	2,228,622	0.32	2,416,883
5.0000%, 期日 20/5/48	1,463,959	0.21	1,596,516
5.0000%, 期日 20/6/48	860,078	0.13	937,956
5.0000%, 期日 20/8/48	1,467,453	0.21	1,591,415
		2.85	21,337,072
不動産担保証券合計		19.44	145,733,125
優先株式 (2019年: 0.17%; USD 1,101,306)			
トランシュ・ローン (2019年: 0.00%; USD 5,726)			
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health Term Loan, 0.0000%, 期日 4/2/27	3,441,449	0.44	3,290,886
トランシュ・ローン合計		0.44	3,290,886
投資有価証券合計 (取得原価: USD 693,972,168)		97.03	727,398,819

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

先物契約（2019年： 0 %）

カウンターパーティ	契約数		純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	9	U.S. Treasury Note 10 Year Bond Future 21/9/20	—	4,430

クレジット・デフォルト・スワップ[†]（2019年： 0 %）

カウンターパーティ	参照資産	名目元本	終了日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	Markit MCDX Buying Protection	750,000	2025年 6 月20日	—	8,578
Goldman Sachs	Markit MCDX Buying Protection	720,000	2025年 6 月20日	—	5,190
合計				—	13,768

先渡為替予約、2020年 6 月30日現在の建玉
(2019年： 0.04%；USD 260,197)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citibank							
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	40,000	USD	26,145	27,597	2020年7月8日	—	1,452
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	8,700	USD	5,982	6,002	2020年7月8日	—	20
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	984,909	USD	642,849	679,512	2020年7月8日	—	36,663
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	1,771,330	USD	1,156,145	1,222,083	2020年7月8日	0.01	65,938
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	9,012	USD	5,891	6,218	2020年7月8日	—	327
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	217,002	USD	144,302	149,715	2020年7月8日	—	5,413
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	11,495	USD	7,741	7,930	2020年7月8日	—	189
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	8,508	USD	5,730	5,870	2020年7月8日	—	140
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	252,031	USD	167,963	173,882	2020年7月8日	—	5,919
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	25,361	USD	17,472	17,497	2020年7月8日	—	25
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	16,297	USD	11,222	11,244	2020年7月8日	—	22
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	10,796	USD	7,423	7,448	2020年7月8日	—	25
AUD ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	156,037	USD	107,076	107,654	2020年7月8日	—	578
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	18	USD	19	20	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	23	USD	25	25	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	14	USD	16	16	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	230	USD	253	259	2020年7月8日	—	6
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	106	USD	116	119	2020年7月8日	—	3
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	112	USD	124	126	2020年7月8日	—	2
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	287	USD	313	322	2020年7月8日	—	9
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	252	USD	281	284	2020年7月8日	—	3
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	2,608	USD	2,846	2,931	2020年7月8日	—	85
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	7,979,688	USD	8,700,852	8,965,794	2020年7月8日	0.04	264,942
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	1,314,352	USD	1,433,137	1,476,776	2020年7月8日	0.01	43,639
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	48,404	USD	52,779	54,386	2020年7月8日	—	1,607
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	3,462	USD	3,775	3,890	2020年7月8日	—	115
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	17,319,676	USD	18,884,942	19,459,990	2020年7月8日	0.08	575,048
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	848,003	USD	924,642	952,797	2020年7月8日	—	28,155
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	4,276	USD	4,667	4,804	2020年7月8日	—	137
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	87,346	USD	95,351	98,140	2020年7月8日	—	2,789
EUR ⁽²⁾⁽³⁾ _{CA}	133,439	USD	146,262	149,929	2020年7月8日	—	3,667

EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	7,090	USD	7,771	7,966	2020年7月8日	—	195
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	34,146	USD	37,257	38,366	2020年7月8日	—	1,109

。保有担保の詳細については、注記5（訳者注：Appendixの注記5．Cash at Bank）を参照してください。

† ICE（セントラル・カウンターパーティー（「CCP」））を通じて清算されます。

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0.04%；USD 260,197)

	購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)	
EUR ^{(2)(A)}	878,270	USD	965,544	986,804	2020年7月8日	—	21,260
EUR ^{(2)(A)}	177,102	USD	194,701	198,988	2020年7月8日	—	4,287
EUR ^{(2)(A)}	3,965	USD	4,363	4,454	2020年7月8日	—	91
EUR ^{(2)(A)}	182,928	USD	201,314	205,534	2020年7月8日	—	4,220
EUR ^{(2)(A)}	39,611	USD	43,888	44,505	2020年7月8日	—	617
EUR ^{(2)(A)}	4,764	USD	5,279	5,353	2020年7月8日	—	74
EUR ^{(2)(A)}	45,635	USD	50,876	51,275	2020年7月8日	—	399
EUR ^{(2)(A)}	6,802	USD	7,584	7,643	2020年7月8日	—	59
EUR ^{(2)(A)}	112,471	USD	125,149	126,370	2020年7月8日	—	1,221
EUR ^{(2)(A)}	5,172	USD	5,755	5,811	2020年7月8日	—	56
EUR ^{(2)(A)}	775,696	USD	861,566	871,555	2020年7月8日	—	9,989
EUR ^{(2)(A)}	162,447	USD	180,941	182,521	2020年7月8日	—	1,580
EUR ^{(2)(A)}	145,100	USD	162,126	163,031	2020年7月8日	—	905
EUR ^{(2)(A)}	3,482	USD	3,902	3,912	2020年7月8日	—	10
EUR ^{(2)(A)}	1,037,873	USD	1,163,227	1,166,130	2020年7月8日	—	2,903
EUR ^{(2)(A)}	10,490	USD	11,739	11,786	2020年7月8日	—	47
EUR ^{(2)(A)}	15,616	USD	17,476	17,546	2020年7月8日	—	70
EUR ^{(2)(A)}	54,721	USD	61,413	61,483	2020年7月8日	—	70
EUR ^{(2)(A)}	7,102	USD	7,971	7,980	2020年7月8日	—	9
EUR ^{(2)(A)}	40,654	USD	45,623	45,678	2020年7月8日	—	55
EUR ^{(2)(A)}	25,508	USD	28,626	28,661	2020年7月8日	—	35
EUR ^{(2)(A)}	25,356	USD	28,469	28,489	2020年7月8日	—	20
EUR ^{(2)(A)}	5,000	USD	5,614	5,618	2020年7月8日	—	4
USD ^{(2)(A)}	647	AUD	936	646	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(A)}	153	EUR	136	153	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(A)}	1,458	AUD	2,106	1,453	2020年7月8日	—	5
USD ^{(2)(A)}	620	EUR	551	619	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(A)}	259	EUR	230	259	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(A)}	16,805	EUR	14,824	16,656	2020年7月8日	—	149
USD ^{(2)(A)}	20,860	AUD	29,693	20,485	2020年7月8日	—	375
USD ^{(2)(A)}	38,144	EUR	33,747	37,917	2020年7月8日	—	227
USD ^{(2)(A)}	1,411	EUR	1,244	1,398	2020年7月8日	—	13
USD ^{(2)(A)}	9,414	EUR	8,261	9,282	2020年7月8日	—	132
USD ^{(2)(A)}	11,393	EUR	10,075	11,320	2020年7月8日	—	73
USD ^{(2)(A)}	11,593	EUR	10,252	11,519	2020年7月8日	—	74
USD ^{(2)(A)}	24,731	EUR	21,871	24,573	2020年7月8日	—	158
USD ^{(2)(A)}	20,058	EUR	17,724	19,915	2020年7月8日	—	143
USD ^{(2)(A)}	2,824	EUR	2,495	2,804	2020年7月8日	—	20
USD ^{(2)(A)}	7,817	EUR	6,943	7,800	2020年7月8日	—	17
USD ^{(2)(A)}	15,577	EUR	13,834	15,544	2020年7月8日	—	33
USD ^{(2)(A)}	4,057	EUR	3,604	4,050	2020年7月8日	—	7
USD ^{(2)(A)}	52,209	EUR	46,120	51,819	2020年7月8日	—	390
USD ^{(2)(A)}	3,849	EUR	3,398	3,818	2020年7月8日	—	31
USD ^{(2)(A)}	11,714	EUR	10,399	11,685	2020年7月8日	—	29
USD ^{(2)(A)}	14,147	EUR	12,585	14,140	2020年7月8日	—	7
USD ^{(2)(A)}	706	AUD	1,022	705	2020年7月8日	—	1

USD ^(注5) _(注4)	1,241	AUD	1,792	1,237	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	1,760	EUR	1,559	1,752	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	11,719	EUR	10,382	11,665	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	551	AUD	797	550	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	5,365	EUR	4,749	5,336	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	783	EUR	693	779	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	367	EUR	325	365	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	1,915,670	EUR	1,702,061	1,912,397	2020年7月8日
USD ^(注5) _(注4)	957	EUR	852	957	2020年7月8日

—	4
—	8
—	54
—	1
—	29
—	4
—	2
—	3,273
—	—

† ICE(セントラル・カウンターパーティー(「CCP」))を通じて清算されます。

^(注4) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0.04%；USD 260,197)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
USD ^(注)	2,949 EUR	2,624	2020年7月8日	—	—
USD ^(注)	5,430 EUR	4,832	2020年7月8日	—	—
USD ^(注)	21,629 EUR	19,250	2020年7月8日	—	1
USD ^(注)	5,531 EUR	4,922	2020年7月8日	—	—
合計				0.14	1,091,466
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					728,508,483

† ICE(セントラル・カウンターパーティー(「CCP」))を通じて清算されます。

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0%；USD（786）

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Citibank					
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	8 USD	6	2020年7月8日	—	—
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	56,288 USD	39,043	2020年7月8日	—	(208)
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	2,000 USD	1,392	2020年7月8日	—	(12)
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	10,432 USD	7,234	2020年7月8日	—	(36)
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	8,666 USD	6,009	2020年7月8日	—	(30)
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	20,200 USD	14,152	2020年7月8日	—	(216)
AUD ⁽²⁾⁽³⁾	209 USD	144	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	30 USD	34	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	21 USD	24	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	6 USD	6	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	276,681 USD	313,859	2020年7月8日	—	(2986)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	296 USD	333	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	20,000 USD	22,510	2020年7月8日	—	(38)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	81 USD	92	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	249 USD	280	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	15,842 USD	17,819	2020年7月8日	—	(19)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	6,585 USD	7,407	2020年7月8日	—	(8)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	209,439 USD	237,429	2020年7月8日	—	(2108)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	44,706 USD	50,680	2020年7月8日	—	(450)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	104,884 USD	118,512	2020年7月8日	—	(666)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	6,824 USD	7,711	2020年7月8日	—	(43)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	56,444 USD	63,802	2020年7月8日	—	(383)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	7,785 USD	8,800	2020年7月8日	—	(53)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	4,621 USD	5,216	2020年7月8日	—	(24)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	267 USD	302	2020年7月8日	—	(1)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	109,042 USD	123,081	2020年7月8日	—	(563)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	7,160 USD	8,093	2020年7月8日	—	(48)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	442 USD	499	2020年7月8日	—	(3)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	12,864 USD	14,541	2020年7月8日	—	(87)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	214 USD	244	2020年7月8日	—	(3)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	5,087 USD	5,797	2020年7月8日	—	(81)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	9,445 USD	10,763	2020年7月8日	—	(150)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	8,896 USD	10,132	2020年7月8日	—	(137)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	65,224 USD	74,287	2020年7月8日	—	(1002)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	54,744 USD	61,640	2020年7月8日	—	(131)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	5,325 USD	5,995	2020年7月8日	—	(13)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	13,533 USD	15,320	2020年7月8日	—	(114)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	4,047 USD	4,581	2020年7月8日	—	(34)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	4,432 USD	4,982	2020年7月8日	—	(1)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	105,250 USD	118,291	2020年7月8日	—	(35)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	45,265 USD	50,985	2020年7月8日	—	(127)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	6,439 USD	7,253	2020年7月8日	—	(18)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	47,348 USD	53,332	2020年7月8日	—	(133)
EUR ⁽²⁾⁽³⁾	29,858 USD	33,563	2020年7月8日	—	(16)

EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	125,430	USD	141,240	140,930	2020年7月8日	—	(310)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	9,709	USD	10,933	10,909	2020年7月8日	—	(24)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	25,123	USD	28,289	28,227	2020年7月8日	—	(62)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	21,185	USD	23,954	23,803	2020年7月8日	—	(151)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	16,467	USD	18,619	18,502	2020年7月8日	—	(117)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	28,686	USD	32,233	32,231	2020年7月8日	—	(2)
USD ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	69	AUD	101	69	2020年7月8日	—	—
USD ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	59	AUD	86	59	2020年7月8日	—	—

⁽²⁾_(C)⁽⁵⁾_(A) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0%；USD（786）

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ^(注1)	17 EUR	15	2020年7月8日	—	—
USD ^(注1)	4,851 EUR	4,426	2020年7月8日	—	(122)
USD ^(注1)	6,538 AUD	10,002	2020年7月8日	—	(363)
USD ^(注1)	27,868 EUR	25,541	2020年7月8日	—	(829)
USD ^(注1)	23,456 EUR	21,118	2020年7月8日	—	(272)
USD ^(注1)	4,469 EUR	4,012	2020年7月8日	—	(39)
USD ^(注1)	4,052 EUR	3,615	2020年7月8日	—	(10)
USD ^(注1)	668 EUR	597	2020年7月8日	—	(3)
USD ^(注1)	669 EUR	597	2020年7月8日	—	(2)
USD ^(注1)	149 EUR	133	2020年7月8日	—	—
USD ^(注1)	761 AUD	1,106	2020年7月8日	—	(2)
USD ^(注1)	649 AUD	942	2020年7月8日	—	(1)
USD ^(注1)	4,483 EUR	3,995	2020年7月8日	—	(5)
合計				—	(12,291)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(12,291)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	63.01
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	28.12
OTC金融デリバティブ商品	0.14
その他の資産	8.73
資産合計	100.00

^(注1) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保／商業不動産担保証券（2019年：0.87%；USD 4,484,959）			
S-Jets 2017-1, Ltd., 5.6820%, 期日 15/8/42 (144A)	648,511	0.09	394,182
Zephyrus Capital Aviation Partners 2018-1, Ltd., 4.6050%, 期 日 15/10/38 (144A)	1,204,198	0.22	991,891
資産担保／商業不動産担保証券合計		0.31	1,386,073
普通株式（2019年：3.47%；USD 17,988,805）			
自動車－乗用車及び小型トラック			
Ford Motor Co.	453,713	0.61	2,758,575
カジノ・ホテル			
Las Vegas Sands Corp.	42,957	0.43	1,956,262
カジノ・サービス			
Eldorado Resorts, Inc.	22,923	0.20	918,295
商業銀行－米国西部			
Western Alliance Bancorp.	14,089	0.12	533,550
コンピュータ			
Dell Technologies, Inc.	21,696	0.26	1,191,978
電子構成部品－半導体			
Micron Technology, Inc.	46,702	0.53	2,406,087
金属－アルミニウム			
Constellium S.E.	284,793	0.49	2,187,210
REIT－各種			
VICI Properties, Inc.	59,366	0.26	1,198,600
小売り－スポーツ用品			
Quiksilver, Inc.*	45,962	0.45	2,042,551
電話－総合			
GCI Liberty, Inc.	24,830	0.39	1,765,910
普通株式合計		3.74	16,959,018
社債（2019年：84.47%；USD 437,983,990）			
航空宇宙産業及び防衛－機械装置			
TransDigm, Inc., 6.2500%, 期日 15/3/26 (144A)	1,958,000	0.43	1,960,154
TransDigm, Inc., 7.5000%, 期日 15/3/27	3,295,000	0.70	3,172,327
		1.13	5,132,481
農薬			
OCI N.V., 5.2500%, 期日 1/11/24 (144A)	855,000	0.18	824,006
航空会社			
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 4.8000%, 期日 15/8/27 (144A)	933,000	0.21	945,306
Delta Air Lines, Inc., 7.3750%, 期日 15/1/26	1,953,000	0.42	1,891,432
Southwest Airlines Co., 4.7500%, 期日 4/5/23	955,000	0.22	986,751
Southwest Airlines Co., 5.2500%, 期日 4/5/25	876,000	0.20	925,047
		1.05	4,748,536
自動車－乗用車及び小型トラック			
Ford Motor Co., 6.3750%, 期日 1/2/29	284,000	0.06	278,689
Ford Motor Co., 7.4500%, 期日 16/7/31	2,450,000	0.57	2,587,996
Ford Motor Co., 8.5000%, 期日 21/4/23	3,691,000	0.86	3,910,153
Ford Motor Co., 9.0000%, 期日 22/4/25	4,248,000	1.02	4,601,115
Ford Motor Co., 9.6250%, 期日 22/4/30	1,363,000	0.36	1,616,757
Ford Motor credit Co. LLC, 3.0870%, 期日 9/1/23	500,000	0.11	476,405
Ford Motor credit Co. LLC, 3.2190%, 期日 9/1/22	1,314,000	0.28	1,284,711
Ford Motor Credit Co., LLC, 3.3500%, 期日 1/11/22	629,000	0.13	604,802
General Motors Financial Co., Inc., 5.7500%, 期日 30/3/66	2,242,000	0.44	1,983,822
		3.83	17,344,450
自動車－トラックの部品及び装置－オリジナル			
American Axle & Manufacturing, Inc., 6.2500%, 期日 15/3/26	845,000	0.18	816,321

* グローバル・プライシング・コミッティーにより2020年6月30日に公正価値評価されました。

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
放送サービス及びプログラミング			
Liberty Interactive LLC, 8.2500%, 期日 1/2/30	3,116,000	0.67	3,039,175
Nexstar Broadcasting, Inc., 5.6250%, 期日 15/7/27 (144A).....	1,136,000	0.25	1,138,874
		0.92	4,178,049
建築—大型建設			
Great Lakes Dredge & Dock Corp., 8.0000%, 期日 15/5/22.....	3,409,000	0.77	3,506,208
建築—メンテナンス及びサービス			
ServiceMaster Co. LLC, 5.1250%, 期日 15/11/24 (144A).....	1,017,000	0.23	1,033,633
建築—住宅及び商業			
LGI Homes, Inc., 6.8750%, 期日 15/7/26 (144A)	3,098,000	0.70	3,163,244
TRI Pointe Group, Inc., 5.7000%, 期日 15/6/28	1,661,000	0.37	1,694,220
		1.07	4,857,464
建築及び建設—その他			
Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp., 6.6250%, 期日 15/8/25	2,333,000	0.53	2,379,660
建築及び建築物—その他			
Builders FirstSource, Inc., 6.7500%, 期日 1/6/27 (144A)	956,000	0.22	981,511
建築製品—セメント及び骨材			
Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp., 5.1250%, 期日 1/6/25 (144A)	2,336,000	0.51	2,315,315
Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp., 6.1250%, 期日 15/7/23	2,752,000	0.61	2,744,060
		1.12	5,059,375
建築製品—ドア及び窓			
JELD-WEN, Inc., 4.8750%, 期日 15/12/27 (144A)	2,056,000	0.44	1,986,610
Masonite International Corp., 5.3750%, 期日 1/2/28 (144A) ..	1,406,000	0.32	1,440,011
Masonite International Corp., 5.7500%, 期日 15/9/26 (144A)...	367,000	0.08	379,317
		0.84	3,805,938
ケーブルTV／衛星TV			
Altice Financing S.A., 5.0000%, 期日 15/1/28 (144A)	2,679,000	0.59	2,665,484
Altice Finco S.A., 7.6250%, 期日 15/2/25 (144A)	2,496,000	0.57	2,604,963
Block Communications, Inc., 4.8750%, 期日 1/3/28 (144A)	1,581,000	0.35	1,565,403
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., 4.5000%, 期日 15/8/30 (144A).....	1,853,000	0.42	1,897,759
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., 5.0000%, 期日 1/2/28 (144A)	3,678,000	0.84	3,801,213
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., 5.1250%, 期日 1/5/27 (144A)	6,514,000	1.50	6,748,830
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp., 5.3750%, 期日 1/6/29 (144A)	1,588,000	0.37	1,677,150
CSC Holdings LLC, 5.2500%, 期日 1/6/24.....	1,041,000	0.24	1,108,118
CSC Holdings LLC, 5.3750%, 期日 1/2/28 (144A)	2,785,000	0.64	2,918,415
CSC Holdings LLC, 5.7500%, 期日 15/1/30 (144A).....	1,594,000	0.37	1,667,157
CSC Holdings LLC, 5.8750%, 期日 15/9/22	1,318,000	0.30	1,380,243
CSC Holdings LLC, 7.5000%, 期日 1/4/28 (144A)	2,354,000	0.57	2,575,641
CSC Holdings LLC, 7.7500%, 期日 15/7/25	3,881,000	0.89	4,047,922
GCI LLC, 6.6250%, 期日 15/6/24 (144A)	4,271,000	0.99	4,482,329
GCI LLC, 6.8750%, 期日 15/4/25.....	1,427,000	0.33	1,475,011
LCPR Senior Secured Financing DAC, 6.7500%, 期日 15/10/27 (144A).....	1,232,000	0.28	1,258,722
Virgin Media Finance plc, 5.0000%, 期日 15/7/30 (144A).....	1,177,000	0.25	1,155,049
Ziggo Bond Co B.V., 5.1250%, 期日 28/2/30 (144A).....	4,022,000	0.88	3,997,546
		10.38	47,026,955
カジノ・ホテル			
Station Casinos LLC, 4.5000%, 期日 15/2/28 (144A)	1,406,000	0.26	1,185,434
携帯電話通信			
SFR Group S.A., 7.3750%, 期日 1/5/26 (144A)	6,497,000	1.50	6,789,300
Sprint Corp., 7.1250%, 期日 15/6/24	1,900,000	0.47	2,148,786
T-Mobile USA, Inc., 6.5000%, 期日 15/1/24	2,778,000	0.63	2,846,936
		2.60	11,785,022

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
化学－各種			
Blue Cube SpinCo. LLC, 10.0000%, 期日 15/10/25	531,000	0.12	553,512
Olin Corp., 9.5000%, 期日 1/6/25 (144A)	1,306,000	0.32	1,458,639
		0.44	2,012,151
化学－プラスチック			
PolyOne Corp., 5.7500%, 期日 15/5/25 (144A)	1,381,000	0.31	1,423,293
化学－特殊			
Atotech Alpha 2 B.V., 8.7500%, 期日 1/6/23 (144A)	1,100,000	0.24	1,101,260
Element Solutions, Inc., 5.8750%, 期日 1/12/25 (144A)	2,842,000	0.64	2,878,385
Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp., 7.0000%, 期日 15/4/25 (144A)	958,000	0.21	966,153
PQ Corp., 5.7500%, 期日 15/12/25 (144A)	59,000	0.01	59,658
Starfruit Finco B.V. / Starfruit US Holdco LLC, 8.0000%, 期 日 1/10/26 (144A)	1,947,000	0.44	1,999,267
Tronox, Inc., 6.5000%, 期日 1/5/25 (144A)	1,525,000	0.34	1,535,484
Valvoline, Inc., 4.2500%, 期日 15/2/30 (144A)	2,662,000	0.58	2,626,649
		2.46	11,166,856
コンピュータ・ソフトウェア			
J2 Global, Inc., 1.7500%, 期日 1/11/26 (144A)	1,176,000	0.22	994,887
コンピュータ－記憶装置			
Western Digital Corp., 1.5000%, 期日 1/2/24	1,623,000	0.34	1,533,790
コンサルティング・サービス			
Gartner, Inc., 4.5000%, 期日 1/7/28 (144A)	1,196,000	0.27	1,212,983
梱包材－金属製及びガラス製			
ARD Finance S.A., 6.5000%, 期日 30/6/27 (144A)	8,188,572	1.79	8,115,407
Ardagh Packaging Finance plc / Ardagh Holdings USA, Inc., 5.2500%, 期日 15/8/27 (144A)	2,748,000	0.59	2,702,136
Mauser Packaging Solutions Holding Co., 7.2500%, 期日 15/4/25 (144A)	4,236,000	0.85	3,853,659
Trivium Packaging Finance B.V., 5.5000%, 期日 15/8/26 (144A)	1,157,000	0.26	1,172,909
Trivium Packaging Finance B.V., 8.5000%, 期日 15/8/27 (144A)	1,885,000	0.45	2,018,958
		3.94	17,863,069
梱包材－紙製及びプラスチック製			
LABL Escrow Issuer LLC, 10.5000%, 期日 15/7/27 (144A)	4,070,000	0.96	4,333,655
LABL Escrow Issuer LLC, 6.7500%, 期日 15/7/26 (144A)	1,959,000	0.45	2,042,561
		1.41	6,376,216
クルーズ・ライン			
Royal Caribbean Cruises, Ltd., 11.5000%, 期日 1/6/25 (144A)	569,000	0.13	593,601
診断装置			
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. / Ortho-Clinical Diagnostics S.A., 7.2500%, 期日 1/2/28 (144A)	2,592,000	0.58	2,641,196
Ortho-Clinical Diagnostics, Inc. / Ortho-Clinical Diagnostics S.A., 7.3750%, 期日 1/6/25 (144A)	1,108,000	0.25	1,128,083
		0.83	3,769,279
流通／卸売り			
Univar Solutions USA, Inc./Washington, 5.1250%, 期日 1/12/27 (144A)	2,102,000	0.47	2,129,978
多角的銀行機関			
Bank of America Corp., 4.3000%, 期日 28/7/68	473,000	0.09	422,886
Citigroup, Inc., 4.7000%, 期日 30/7/68	1,465,000	0.30	1,301,543
JPMorgan Chase & Co., 4.0000%, 期日 10/1/68	284,000	0.05	248,757
JPMorgan Chase & Co., 4.6000%, 期日 1/8/68	473,000	0.09	422,318
JPMorgan Chase & Co., 5.0000%, 期日 1/2/68	1,180,000	0.25	1,135,959
		0.78	3,531,463
多角的製造業			
General Electric Co., 5.0000%, 期日 29/12/49	11,976,000	2.08	9,420,865

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Eコマース／サービス			
Expedia Group, Inc., 6.2500%, 期日 1/5/25 (144A).....	1,713,000	0.40	1,832,773
Expedia Group, Inc., 7.0000%, 期日 1/5/25 (144A).....	1,502,000	0.35	1,565,174
		0.75	3,397,947
電気－発電			
Vistra Operations Co. LLC, 5.5000%, 期日 1/9/26 (144A).....	582,000	0.13	597,158
電力－総合			
DPL, Inc., 4.1250%, 期日 1/7/25 (144A).....	717,000	0.16	718,993
金融－消費者ローン			
Springleaf Finance Corp., 5.3750%, 期日 15/11/29.....	1,975,000	0.41	1,868,745
Springleaf Finance Corp., 7.7500%, 期日 1/10/21	876,000	0.20	913,427
Springleaf Finance Corp., 8.8750%, 期日 1/6/25.....	955,000	0.23	1,022,867
		0.84	3,805,039
食品－ケータリング			
Aramark Services, Inc., 6.3750%, 期日 1/5/25 (144A)	1,692,000	0.39	1,750,382
食品－乳製品			
FAGE International S.A./ FAGE USA Dairy Industry, Inc., 5.6250%, 期日 15/8/26 (144A).....	1,187,000	0.25	1,120,006
食品－肉製品			
JBS USA LUX S.A. / JBS USA Finance, Inc., 6.7500%, 期日 15/2/28 (144A).....	2,408,000	0.56	2,549,037
JBS USA LUX S.A. / JBS USA Food Co. / JBS USA Finance, Inc., 5.5000%, 期日 15/1/30 (144A).....	1,780,000	0.40	1,827,508
JBS USA LUX S.A. / JBS USA Food Co. / JBS USA Finance, Inc., 6.5000%, 期日15/4/29 (144A).....	2,380,000	0.56	2,531,273
NBM US Holdings, Inc., 6.6250%, 期日 6/8/29 (144A).....	1,292,000	0.29	1,315,030
Smithfield Foods, Inc., 5.2000%, 期日 1/4/29 (144A)	1,172,000	0.28	1,268,808
		2.09	9,491,656
食品－その他／各種			
Dole Food Co., Inc., 7.2500%, 期日 15/6/25 (144A)	4,658,000	0.99	4,477,013
Kraft Heinz Foods Co., 3.7500%, 期日 1/4/30 (144A).....	2,418,000	0.55	2,498,168
Kraft Heinz Foods Co., 4.8750%, 期日 1/10/49 (144A)	519,000	0.12	529,130
		1.66	7,504,311
食品－小売り			
Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons L.P. / Albertsons LLC, 4.6250%, 期日 15/1/27 (144A).....	3,494,000	0.76	3,497,686
Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons L.P. / Albertsons LLC, 4.8750%, 期日 15/2/30 (144A).....	1,618,000	0.37	1,657,042
Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons L.P. / Albertsons LLC, 5.8750%, 期日 15/2/28 (144A).....	769,000	0.18	794,731
		1.31	5,949,459
賭博－ホテル以外			
Colt Merger Sub, Inc., 5.7500%, 期日 1/7/25 (144A).....	1,095,000	0.24	1,103,213
Downstream Development Authority of the Quapaw Tribe of Oklahoma, 10.5000%, 期日 15/2/23 (144A)	3,870,000	0.72	3,284,256
Enterprise Development Authority, 12.0000%, 期日 15/7/24 (144A).....	2,555,000	0.57	2,577,088
Golden Entertainment, Inc., 7.6250%, 期日 15/4/26 (144A).....	4,142,000	0.84	3,822,921
Mohegan Gaming & Entertainment, 7.8750%, 期日 15/10/24 (144A).....	1,264,000	0.23	1,053,727
Scientific Games International, Inc., 7.0000%, 期日 15/5/28 (144A).....	2,388,000	0.43	1,914,436
Scientific Games International, Inc., 8.2500%, 期日 15/3/26 (144A).....	1,637,000	0.33	1,455,629
Scientific Games International, Inc., 8.6250%, 期日 1/7/25 (144A).....	795,000	0.16	745,074
Twin River Worldwide Holdings, Inc., 6.7500%, 期日 1/6/27 (144A).....	1,829,000	0.39	1,744,061
		3.91	17,700,405

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
ホテル及びモーテル			
Hilton Domestic Operating Co., Inc., 5.3750%, 期日 1/5/25 (144A).....	731,000	0.16	731,457
Wyndham Destinations, Inc., 6.3500%, 期日 1/10/25	1,914,000	0.43	1,940,748
		0.59	2,672,205
ヒューマン・リソース			
AMN Healthcare, Inc., 4.6250%, 期日 1/10/27 (144A).....	3,364,000	0.73	3,285,568
工作機械及び関連製品			
Colfax Corp., 6.0000%, 期日 15/2/24 (144A).....	323,000	0.07	333,935
医療－医薬品			
Bausch Health Americas, Inc., 8.5000%, 期日 31/1/27 (144A)...	1,655,000	0.39	1,759,637
Bausch Health Cos, Inc., 5.0000%, 期日 30/1/28 (144A)	2,470,000	0.51	2,328,568
Bausch Health Cos, Inc., 7.0000%, 期日 15/1/28 (144A)	1,191,000	0.27	1,228,743
Bausch Health Cos, Inc., 9.0000%, 期日 15/12/25 (144A).....	2,221,000	0.53	2,395,149
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V., 3.1500%, 期日 1/10/26.....	5,758,000	1.14	5,162,796
		2.84	12,874,893
医療－HMO			
Molina Healthcare, Inc., 4.3750%, 期日 15/6/28 (144A)	4,190,000	0.93	4,208,331
Molina Healthcare, Inc., 4.8750%, 期日 15/6/25 (144A)	1,974,000	0.44	1,991,065
		1.37	6,199,396
医療－病院			
CHS/Community Health Systems, Inc., 6.6250%, 期日 15/2/25 (144A).....	2,159,000	0.45	2,034,858
CHS/Community Health Systems, Inc., 8.1250%, 期日 30/6/24 (144A).....	2,635,000	0.39	1,773,658
HCA, Inc., 3.5000%, 期日 1/9/30	2,220,000	0.48	2,140,432
Surgery Center Holdings, Inc., 6.7500%, 期日 1/7/25 (144A)...	4,465,000	0.89	4,045,937
Tenet Healthcare Corp., 4.8750%, 期日 1/1/26 (144A)	1,812,000	0.39	1,777,536
Tenet Healthcare Corp., 8.1250%, 期日 1/4/22.....	2,854,000	0.66	3,001,837
		3.26	14,774,258
医療－外来及び在宅医療			
Hadrian Merger Sub, Inc., 8.5000%, 期日 1/5/26 (144A)	2,231,000	0.45	2,027,845
医療情報システム			
Change Healthcare Holdings LLC / Change Healthcare Finance, Inc., 5.7500%, 期日 1/3/25 (144A)	4,886,000	1.07	4,836,261
医療検査サービス			
MEDNAX, Inc., 6.2500%, 期日 15/1/27 (144A).....	1,880,000	0.42	1,886,495
金属－アルミニウム			
Arconic Corp., 6.1250%, 期日 15/2/28 (144A)	2,402,000	0.53	2,408,185
Constellium N.V., 5.7500%, 期日 15/5/24 (144A).....	1,309,000	0.29	1,313,771
Novelis Corp., 4.7500%, 期日 30/1/30 (144A)	1,747,000	0.37	1,672,718
Novelis Corp., 5.8750%, 期日 30/9/26 (144A)	3,880,000	0.86	3,884,540
		2.05	9,279,214
金属－銅			
First Quantum Minerals, Ltd., 6.8750%, 期日 1/3/26 (144A) ...	2,482,000	0.52	2,357,441
First Quantum Minerals, Ltd., 7.2500%, 期日 1/4/23 (144A) ...	6,827,000	1.45	6,562,898
HudBay Minerals, Inc., 7.2500%, 期日 15/1/23 (144A)	2,406,000	0.52	2,378,680
Hudbay Minerals, Inc., 7.6250%, 期日 15/1/25 (144A)	1,415,000	0.30	1,358,549
		2.79	12,657,568
その他の製造業			
Hillenbrand, Inc., 5.7500%, 期日 15/6/25.....	592,000	0.14	613,460
石油及びガス採掘			
Transocean Pontus, Ltd., 6.1250%, 期日 1/8/25 (144A).....	713,090	0.14	627,519

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
石油会社—探査及び生産			
Apache Corp., 4.2500%, 期日 15/1/30	2,129,000	0.41	1,843,515
Endeavor Energy Resources L.P. / EER Finance, Inc., 5.7500%, 期日 30/1/28 (144A)	1,999,000	0.42	1,923,668
Endeavor Energy Resources L.P. / EER Finance, Inc., 6.6250%, 期日 15/7/25 (144A)	1,583,000	0.35	1,599,337
Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp., 9.0000%, 期日 30/9/21 (144A)	5,641,000	0.75	3,384,600
Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp., 6.0000%, 期日 1/8/26 (144A)	3,753,000	0.79	3,584,115
Occidental Petroleum Corp., 3.2000%, 期日 15/8/26	1,103,000	0.20	895,200
Occidental Petroleum Corp., 3.5000%, 期日 15/8/29	1,467,000	0.24	1,079,565
Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp., 5.2500%, 期日 15/8/25 (144A)	1,518,000	0.32	1,463,344
Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp., 5.6250%, 期日 15/10/27 (144A)	1,292,000	0.28	1,275,611
Viper Energy Partners L.P., 5.3750%, 期日 1/11/27 (144A)	2,251,000	0.49	2,211,855
		4.25	19,260,810
石油精製及び販売			
PBF Holding Co. LLC / PBF Finance Corp., 7.2500%, 期日 15/6/25	1,699,000	0.34	1,546,268
パイプライン			
DCP Midstream Operating L.P., 5.1250%, 期日 15/5/29	1,269,000	0.27	1,214,040
EnLink Midstream LLC, 5.3750%, 期日 1/6/29	1,563,000	0.26	1,176,791
EnLink Midstream Partners L.P., 4.1500%, 期日 1/6/25	2,328,000	0.40	1,798,624
Hess Midstream Operations L.P., 5.6250%, 期日 15/2/26 (144A)	2,252,000	0.49	2,233,466
Hess Midstream Partners L.P., 5.1250%, 期日 15/6/28 (144A)	1,687,000	0.36	1,625,188
NGL Energy Partners L.P. / NGL Energy Finance Corp., 6.1250%, 期日 1/3/25	2,865,000	0.48	2,173,518
Tallgrass Energy Partners L.P. / Tallgrass Energy Finance Corp., 6.0000%, 期日 1/3/27 (144A)	811,000	0.16	721,790
Tallgrass Energy Partners L.P. / Tallgrass Energy Finance Corp., 5.5000%, 期日 15/1/28 (144A)	2,795,000	0.53	2,425,794
Targa Resources Partners L.P. / Targa Resources Partners Finance Corp., 6.5000%, 期日 15/7/27	977,000	0.22	981,885
Western Midstream Operating L.P., 4.0500%, 期日 1/2/30	3,162,000	0.67	3,055,203
		3.84	17,406,299
出版—新聞			
TEGNA, Inc., 4.6250%, 期日 15/3/28 (144A)	1,741,000	0.36	1,611,861
不動産運用／開発			
AT Securities B.V., 5.2500%, 期日 21/7/65	1,500,000	0.33	1,502,529
REIT—各種			
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 4.0000%, 期日 15/1/31	688,000	0.15	681,526
研究開発			
Jaguar Holding Co. II / PPD Development L.P., 5.0000%, 期日 15/6/28 (144A)	1,542,000	0.35	1,581,514
リゾート及びテーマパーク			
Six Flags Entertainment Corp., 5.5000%, 期日 15/4/27 (144A)	709,000	0.14	634,555
Vail Resorts, Inc., 6.2500%, 期日 15/5/25 (144A)	3,638,000	0.84	3,822,174
		0.98	4,456,729
小売り—石油製品			
eG Global Finance plc, 6.7500%, 期日 7/2/25 (144A)	1,225,000	0.27	1,209,051
小売り—レストラン			
Golden Nugget, Inc., 6.7500%, 期日 15/10/24 (144A)	854,000	0.14	614,880
Golden Nugget, Inc., 8.7500%, 期日 1/10/25 (144A)	3,411,000	0.43	1,937,840
IRB Holding Corp., 6.7500%, 期日 15/2/26 (144A)	2,620,000	0.55	2,511,427
IRB Holding Corp., 7.0000%, 期日 15/6/25 (144A)	1,153,000	0.26	1,188,311
Newco GB SAS, 8.0000%, 期日 15/12/22	699,814	0.16	713,466
Wendy's International LLC, 7.0000%, 期日 15/12/25	883,000	0.20	915,287
		1.74	7,881,211

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
衛星通信			
Connect Finco S.a.r.l. / Connect US Finco LLC, 6.7500%, 期日 1/10/26 (144A).....	3,143,000	0.66	2,976,107
セキュリティ・サービス			
Brink's Co., 5.5000%, 期日 15/7/25 (144A)	2,575,000	0.58	2,629,152
鉄鋼－製造業者			
Infrabuild Australia Pty, Ltd., 12.0000%, 期日 1/10/24 (144A).....	912,000	0.18	827,640
鉄鋼－特殊			
Allegheny Technologies, Inc., 5.8750%, 期日 1/12/27	3,896,000	0.81	3,651,916
Allegheny Technologies, Inc., 7.8750%, 期日 15/8/23	6,900,000	1.56	7,081,850
		2.37	10,733,766
通信機器			
CommScope, Inc., 8.2500%, 期日 1/3/27 (144A).....	1,032,000	0.23	1,062,403
通信サービス			
Altice France Holding S.A., 10.5000%, 期日 15/5/27 (144A) ...	5,433,000	1.33	6,008,491
Altice France Holding S.A., 6.0000%, 期日 15/2/28 (144A).....	1,289,000	0.27	1,226,168
Sable International Finance, Ltd., 5.7500%, 期日 7/9/27 (144A).....	3,029,000	0.68	3,093,942
		2.28	10,328,601
電話－総合			
CenturyLink, Inc., 5.1250%, 期日 15/12/26 (144A).....	1,001,000	0.22	1,000,054
CenturyLink, Inc., 5.6250%, 期日 1/4/25	866,000	0.20	897,700
CenturyLink, Inc., 7.5000%, 期日 1/4/24	1,886,000	0.46	2,075,845
Level 3 Financing, Inc., 5.2500%, 期日 15/3/26.....	1,107,000	0.25	1,143,160
		1.13	5,116,759
治療法			
Horizon Pharma USA, Inc., 5.5000%, 期日 1/8/27 (144A)	2,496,000	0.57	2,600,982
トランザクション・ソフトウェア			
Solera LLC / Solera Finance, Inc., 10.5000%, 期日 1/3/24 (144A).....	1,697,000	0.38	1,734,393
運輸－航空貨物			
Cargo Aircraft Management, Inc., 4.7500%, 期日 1/2/28 (144A).....	3,469,000	0.76	3,447,319
運輸－鉄道			
Watco Cos LLC / Watco Finance Corp., 6.5000%, 期日 15/6/27 (144A).....	1,819,000	0.41	1,872,806
ビタミン・栄養関連製品			
Herbalife Nutrition, Ltd. / HLF Financing, Inc., 7.8750%, 期日 1/9/25 (144A).....	980,000	0.23	1,013,688
HLF Financing S.a.r.l. LLC / Herbalife International, Inc., 7.2500%, 期日 15/8/26 (144A).....	3,572,000	0.79	3,595,450
		1.02	4,609,138
社債合計.....		89.58	405,874,311
政府発行証券 (2019年: 3.26%; USD 16,900,000)			
優先株式 (2019年: 0.97%; USD 5,018,535)			
携帯電話通信			
2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust (144A)	2,281	0.51	2,332,437
診断装置			
Avantor, Inc.	15,000	0.19	861,000
ドラッグ・デリバリー・システム			
Becton Dickinson and Co.	30,550	0.36	1,625,260
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health, Inc.	31,757	0.27	1,220,739
優先株式合計.....		1.33	6,039,436

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
トランシュ・ローン (2019年: 5.86%; USD 30,424,522)			
エンターテインメント			
18 Fremont, 0.0000%, 期日 1/7/25	2,262,000	0.45	2,018,835
金融－投資銀行／証券会社			
Jane Street Group LLC, 4.1349%, 期日 25/8/22	5,942	—	5,805
金融サービス			
Cornerstone Term Loan, 0.0000%, 期日 22/4/27	331,000	0.07	326,244
Tacala, 0.0000%, 期日 1/2/26	2,211,828	0.44	2,012,763
		0.51	2,339,007
食品－乳製品			
Chobani LLC, 4.5000%, 期日 10/10/23	638,454	0.14	617,009
賭博－ホテル以外			
Mohegan Gaming & Entertainment, 5.3011%, 期日 13/10/21	365,184	0.07	312,885
レーザーシステム部品			
II-VI, Inc., 3.7838%, 期日 24/9/26	2,549	—	2,488
プロスポーツ			
Delta 2 LUX S.a.r.l., 3.5000%, 期日 1/2/24	1,378,928	0.29	1,317,745
運輸－鉄道			
Patriot Rail Co. LLC, 5.4348%, 期日 22/10/26	1,480,000	0.31	1,420,800
トランシュ・ローン合計		1.77	8,034,574
投資有価証券合計 (取得原価: USD 452,015,479)		96.73	438,293,412

先物契約（2019年：0%）

カウンターパーティ	契約数		純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	309	U.S. Treasury 2 Year Bond Future 30/9/20	0.01	26,555

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉
(2019年：0.08%；USD 403,194)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citibank							
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	500	USD	332	344	2020年7月8日	—	12
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	100	USD	68	69	2020年7月8日	—	1
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	8,890,270	USD	5,802,670	6,133,610	2020年7月8日	0.07	330,940
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	1,542,582	USD	1,006,842	1,064,265	2020年7月8日	0.01	57,423
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	8,475	USD	5,542	5,848	2020年7月8日	—	306
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	48,846	USD	31,939	33,700	2020年7月8日	—	1,761
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	82,483	USD	54,948	56,906	2020年7月8日	—	1,958
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	14,212	USD	9,468	9,805	2020年7月8日	—	337
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	10,516	USD	6,958	7,255	2020年7月8日	—	297
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	60,761	USD	40,201	41,920	2020年7月8日	—	1,719
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	251	USD	166	173	2020年7月8日	—	7
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	20,645	USD	14,197	14,244	2020年7月8日	—	47
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	119,167	USD	81,947	82,216	2020年7月8日	—	269
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	200	USD	137	138	2020年7月8日	—	1
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	47,222	USD	32,152	32,580	2020年7月8日	—	428
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	8,294	USD	5,647	5,722	2020年7月8日	—	75
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	294	USD	203	203	2020年7月8日	—	—
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	20,788	USD	14,312	14,342	2020年7月8日	—	30
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	117,548	USD	80,931	81,099	2020年7月8日	—	168
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	439	USD	301	303	2020年7月8日	—	2
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	445	USD	306	308	2020年7月8日	—	2
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,502	USD	351	354	2020年7月8日	—	3
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	3,601	USD	508	509	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	778	USD	108	110	2020年7月8日	—	2
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	761	USD	107	108	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	269,181	USD	37,559	38,059	2020年7月8日	—	500
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	703	USD	98	99	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	753	USD	105	106	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,555	USD	356	361	2020年7月8日	—	5
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	1,843	USD	256	260	2020年7月8日	—	4
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	3,481	USD	488	492	2020年7月8日	—	4
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	285	USD	40	40	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	530	USD	75	75	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	1,434	USD	202	203	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	154	USD	22	22	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	15	USD	17	18	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	19	USD	21	21	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	27	USD	30	31	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	36	USD	40	40	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	39	USD	44	44	2020年7月8日	—	—

EUR ⁽²⁾ _(C)	72	USD	80	82	2020年7月8日	—	2
EUR ⁽²⁾ _(C)	1,500	USD	1,649	1,685	2020年7月8日	—	36
EUR ⁽²⁾ _(C)	1,430	USD	1,560	1,606	2020年7月8日	—	46
EUR ⁽²⁾ _(C)	4,980	USD	5,518	5,596	2020年7月8日	—	78
EUR ⁽²⁾ _(C)	1,519	USD	1,670	1,707	2020年7月8日	—	37
EUR ⁽²⁾ _(C)	113	USD	123	127	2020年7月8日	—	4
EUR ⁽²⁾ _(C)	16,816	USD	18,859	18,894	2020年7月8日	—	35
EUR ⁽²⁾ _(C)	400	USD	448	449	2020年7月8日	—	1

⁽²⁾_(C) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年: 0.08%; USD 403,194)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,841 USD	3,097	3,191	2020年7月8日	— 94
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,756,336 USD	4,095,814	4,220,532	2020年7月8日	0.03 124,718
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,305,872 USD	1,423,890	1,467,248	2020年7月8日	0.01 43,358
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,915,148 USD	3,178,604	3,275,393	2020年7月8日	0.02 96,789
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	10,347,993 USD	11,283,193	11,626,767	2020年7月8日	0.08 343,574
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	267,966 USD	292,183	301,080	2020年7月8日	— 8,897
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	10,891 USD	11,938	12,237	2020年7月8日	— 299
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	20,353 USD	22,210	22,868	2020年7月8日	— 658
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	15,432 USD	16,840	17,339	2020年7月8日	— 499
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,967 USD	7,603	7,828	2020年7月8日	— 225
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	55,350 USD	60,400	62,190	2020年7月8日	— 1,790
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	35,719 USD	39,284	40,133	2020年7月8日	— 849
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	12,188 USD	13,404	13,694	2020年7月8日	— 290
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,501 USD	2,751	2,810	2020年7月8日	— 59
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	26,967 USD	29,658	30,299	2020年7月8日	— 641
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	96,782 USD	106,441	108,743	2020年7月8日	— 2,302
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	134,275 USD	147,771	150,868	2020年7月8日	— 3,097
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	25,678 USD	28,290	28,850	2020年7月8日	— 560
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	8,847 USD	9,747	9,940	2020年7月8日	— 193
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,794 USD	1,976	2,015	2020年7月8日	— 39
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	19,685 USD	21,688	22,118	2020年7月8日	— 430
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	70,127 USD	77,262	78,793	2020年7月8日	— 1,531
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,433 USD	3,804	3,858	2020年7月8日	— 54
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,466 USD	1,628	1,647	2020年7月8日	— 19
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	39,970 USD	44,395	44,910	2020年7月8日	— 515
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	54,208 USD	60,744	60,908	2020年7月8日	— 164
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	18,274 USD	20,477	20,532	2020年7月8日	— 55
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,667 USD	4,109	4,120	2020年7月8日	— 11
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	39,356 USD	44,101	44,220	2020年7月8日	— 119
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	141,564 USD	158,631	159,058	2020年7月8日	— 427
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	48,992 USD	54,945	55,046	2020年7月8日	— 101
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,370 USD	3,780	3,787	2020年7月8日	— 7
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	36,289 USD	40,699	40,774	2020年7月8日	— 75
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	129,288 USD	144,998	145,266	2020年7月8日	— 268
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,210 USD	4,719	4,731	2020年7月8日	— 12
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,199 USD	3,590	3,594	2020年7月8日	— 4
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,990 USD	4,480	4,483	2020年7月8日	— 3
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	88 USD	108	110	2020年7月8日	— 2
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	153 USD	188	189	2020年7月8日	— 1
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	113 USD	138	139	2020年7月8日	— 1
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	16,247 USD	19,793	20,129	2020年7月8日	— 336
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2 GBP	2	2	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1 EUR	1	1	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	12 EUR	11	12	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	11 EUR	9	11	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	14 EUR	13	14	2020年7月8日	— —

USD ^(注5) _(注4)	49	GBP	40	49	2020年7月8日	—	—
USD ^(注5) _(注4)	90	GBP	71	88	2020年7月8日	—	2
USD ^(注5) _(注4)	91	EUR	81	90	2020年7月8日	—	1
USD ^(注5) _(注4)	241	EUR	214	241	2020年7月8日	—	—
USD ^(注5) _(注4)	278	EUR	245	276	2020年7月8日	—	2
USD ^(注5) _(注4)	57	EUR	50	57	2020年7月8日	—	—
USD ^(注5) _(注4)	38	GBP	30	38	2020年7月8日	—	—
USD ^(注5) _(注4)	1,040	EUR	916	1,028	2020年7月8日	—	12
USD ^(注5) _(注4)	67	GBP	52	65	2020年7月8日	—	2
USD ^(注5) _(注4)	16,863	EUR	14,962	16,811	2020年7月8日	—	52
USD ^(注5) _(注4)	156	GBP	125	155	2020年7月8日	—	1

^(注5)_(注4) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年: 0.08%; USD 403,194)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	251	EUR	222	250	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _(CA)	22,481	AUD	32,411	22,361	2020年7月8日	—	120
USD ^{(2)(S)} _(CA)	958	EUR	845	949	2020年7月8日	—	9
USD ^{(2)(S)} _(CA)	161	EUR	142	160	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6,391	EUR	5,656	6,355	2020年7月8日	—	36
USD ^{(2)(S)} _(CA)	9,571	AUD	13,624	9,399	2020年7月8日	—	172
USD ^{(2)(S)} _(CA)	21,206	AUD	30,347	20,937	2020年7月8日	—	269
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,706	AUD	5,304	3,659	2020年7月8日	—	47
USD ^{(2)(S)} _(CA)	483	EUR	425	478	2020年7月8日	—	5
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2,827	EUR	2,492	2,800	2020年7月8日	—	27
USD ^{(2)(S)} _(CA)	5,792	EUR	5,097	5,727	2020年7月8日	—	65
USD ^{(2)(S)} _(CA)	11,504	EUR	10,125	11,376	2020年7月8日	—	128
USD ^{(2)(S)} _(CA)	39,551	EUR	34,808	39,110	2020年7月8日	—	441
USD ^{(2)(S)} _(CA)	14,444	EUR	12,712	14,283	2020年7月8日	—	161
USD ^{(2)(S)} _(CA)	4,662	AUD	6,716	4,633	2020年7月8日	—	29
USD ^{(2)(S)} _(CA)	26,694	AUD	38,453	26,530	2020年7月8日	—	164
USD ^{(2)(S)} _(CA)	19,818	EUR	17,408	19,559	2020年7月8日	—	259
USD ^{(2)(S)} _(CA)	7,427	EUR	6,524	7,330	2020年7月8日	—	97
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,370	EUR	1,204	1,352	2020年7月8日	—	18
USD ^{(2)(S)} _(CA)	14,848	EUR	13,042	14,654	2020年7月8日	—	194
USD ^{(2)(S)} _(CA)	52,449	EUR	46,069	51,763	2020年7月8日	—	686
USD ^{(2)(S)} _(CA)	26,442	EUR	23,384	26,273	2020年7月8日	—	169
USD ^{(2)(S)} _(CA)	207,735	EUR	183,565	206,249	2020年7月8日	—	1,486
USD ^{(2)(S)} _(CA)	79,074	EUR	69,873	78,508	2020年7月8日	—	566
USD ^{(2)(S)} _(CA)	29,383	EUR	25,964	29,173	2020年7月8日	—	210
USD ^{(2)(S)} _(CA)	58,529	EUR	51,719	58,110	2020年7月8日	—	419
USD ^{(2)(S)} _(CA)	5,421	EUR	4,790	5,382	2020年7月8日	—	39
USD ^{(2)(S)} _(CA)	365	GBP	289	358	2020年7月8日	—	7
USD ^{(2)(S)} _(CA)	44,292	AUD	64,043	44,185	2020年7月8日	—	107
USD ^{(2)(S)} _(CA)	31,349	AUD	45,231	31,206	2020年7月8日	—	143
USD ^{(2)(S)} _(CA)	5,747	AUD	8,292	5,721	2020年7月8日	—	26
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,245	EUR	2,870	3,225	2020年7月8日	—	20
USD ^{(2)(S)} _(CA)	4,019	EUR	3,550	3,989	2020年7月8日	—	30
USD ^{(2)(S)} _(CA)	11,160	EUR	9,853	11,070	2020年7月8日	—	90
USD ^{(2)(S)} _(CA)	827	EUR	731	820	2020年7月8日	—	7
USD ^{(2)(S)} _(CA)	9,218	EUR	8,138	9,144	2020年7月8日	—	74
USD ^{(2)(S)} _(CA)	11,467	EUR	10,180	11,438	2020年7月8日	—	29
USD ^{(2)(S)} _(CA)	9,825	EUR	8,740	9,820	2020年7月8日	—	5
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,062	EUR	2,722	3,058	2020年7月8日	—	4
USD ^{(2)(S)} _(CA)	566	EUR	503	565	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _(CA)	21,531	EUR	19,136	21,501	2020年7月8日	—	30
USD ^{(2)(S)} _(CA)	8,119	EUR	7,215	8,108	2020年7月8日	—	11
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6,154	EUR	5,469	6,145	2020年7月8日	—	9
USD ^{(2)(S)} _(CA)	191	EUR	169	190	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _(CA)	19,677	EUR	17,402	19,553	2020年7月8日	—	124
USD ^{(2)(S)} _(CA)	8,238	EUR	7,331	8,237	2020年7月8日	—	1

USD ⁽²⁾ _(C/A)	29,754	EUR	26,479	29,751	2020年7月8日	—	3
USD ⁽²⁾ _(C/A)	11,217	EUR	9,983	11,216	2020年7月8日	—	1
USD ⁽²⁾ _(C/A)	4,228	EUR	3,763	4,228	2020年7月8日	—	—
USD ⁽²⁾ _(C/A)	793	EUR	706	793	2020年7月8日	—	—
USD ⁽²⁾ _(C/A)	6,438	EUR	5,712	6,418	2020年7月8日	—	20
USD ⁽²⁾ _(C/A)	1,207	EUR	1,071	1,203	2020年7月8日	—	4
USD ⁽²⁾ _(C/A)	45,376	EUR	40,261	45,237	2020年7月8日	—	139
USD ⁽²⁾ _(C/A)	12,505	EUR	11,096	12,467	2020年7月8日	—	38
合計						0.22	1,036,427
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計							439,356,394

⁽²⁾_(C/A) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

クレジット・デフォルト・スワップ[†] (2019年: (0.18%); USD (911,058))

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年: 0%; USD (542))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Citibank					
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	144 USD	100	2020年7月8日	—	—
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	300 USD	211	2020年7月8日	—	(4)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	111,137 USD	76,690	2020年7月8日	—	(14)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	19,259 USD	13,290	2020年7月8日	—	(2)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	3,982 USD	2,758	2020年7月8日	—	(10)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	200 USD	139	2020年7月8日	—	(1)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	17,219 USD	12,032	2020年7月8日	—	(152)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	98,809 USD	69,045	2020年7月8日	—	(874)
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	223 USD	154	2020年7月8日	—	—
AUD ^{(2)(S)} _{CA}	147 USD	102	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _{CA}	18 USD	3	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _{CA}	244 USD	35	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _{CA}	2,753 USD	389	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	15 USD	17	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	32 USD	36	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	3,013 USD	3,405	2020年7月8日	—	(20)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	54 USD	61	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	39 USD	43	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	8,898 USD	10,087	2020年7月8日	—	(90)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	178 USD	201	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	4,191 USD	4,718	2020年7月8日	—	(10)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	2,655 USD	2,991	2020年7月8日	—	(7)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	6,006 USD	6,755	2020年7月8日	—	(7)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	14,990 USD	16,993	2020年7月8日	—	(151)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	7,990 USD	9,028	2020年7月8日	—	(51)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	2,345 USD	2,650	2020年7月8日	—	(15)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	32,365 USD	36,584	2020年7月8日	—	(220)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	115,643 USD	130,719	2020年7月8日	—	(785)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	44,118 USD	49,869	2020年7月8日	—	(299)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	15,175 USD	17,153	2020年7月8日	—	(103)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	4,637 USD	5,242	2020年7月8日	—	(31)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	99,990 USD	113,020	2020年7月8日	—	(673)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	11,889 USD	13,487	2020年7月8日	—	(128)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	8,718 USD	9,934	2020年7月8日	—	(139)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	2,256 USD	2,551	2020年7月8日	—	(16)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	20,988 USD	23,631	2020年7月8日	—	(49)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	7,721 USD	8,693	2020年7月8日	—	(18)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	1,424 USD	1,604	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	15,299 USD	17,225	2020年7月8日	—	(36)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	54,569 USD	61,440	2020年7月8日	—	(127)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	5,441 USD	6,159	2020年7月8日	—	(46)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	39,156 USD	44,008	2020年7月8日	—	(13)
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	139,541 USD	156,831	2020年7月8日	—	(46)

EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	53,566	USD	60,204	60,186	2020年7月8日	—	(18)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	19,745	USD	22,191	22,184	2020年7月8日	—	(7)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	3,647	USD	4,099	4,098	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	4,113	USD	4,629	4,621	2020年7月8日	—	(8)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	2,071	USD	2,327	2,327	2020年7月8日	—	—
GBP ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	87	USD	109	108	2020年7月8日	—	(1)
GBP ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	226	USD	284	280	2020年7月8日	—	(4)
GBP ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	206	USD	258	255	2020年7月8日	—	(3)
GBP ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	181	USD	229	224	2020年7月8日	—	(5)
GBP ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	221	USD	277	273	2020年7月8日	—	(4)

^{(2)(S)}_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

クレジット・デフォルト・スワップ[†]（2019年：(0.18%); USD (911,058)）

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0%; USD (542))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	8 EUR	7	8	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	2 CNH	14	2	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	11 EUR	10	11	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	6 EUR	5	6	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	13 EUR	12	13	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	25 EUR	22	25	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	58 CNH	408	58	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	244 EUR	218	245	2020年7月8日	(1)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	1,273 EUR	1,136	1,277	2020年7月8日	(4)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	38 CNH	270	38	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	68 GBP	56	69	2020年7月8日	(1)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	7,076 AUD	10,826	7,469	2020年7月8日	(393)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	124 CNH	876	124	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	152 CNH	1,074	152	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	145 CNH	1,024	145	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	192 CNH	1,357	192	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	78 GBP	63	78	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	86 EUR	77	86	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	92 CNH	652	92	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	83 GBP	67	83	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	211 CNH	1,494	211	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	118 EUR	108	121	2020年7月8日	(3)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	9,388 EUR	8,604	9,667	2020年7月8日	(279)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	3,631 EUR	3,303	3,711	2020年7月8日	(80)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	25,305 AUD	38,054	26,254	2020年7月8日	(949)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	5,595 AUD	8,432	5,817	2020年7月8日	(222)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	8,018 EUR	7,198	8,088	2020年7月8日	(70)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	7,479 EUR	6,715	7,544	2020年7月8日	(65)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	170 CNH	1,206	170	2020年7月8日	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	33,171 AUD	48,472	33,442	2020年7月8日	(271)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	109,409 AUD	158,796	109,557	2020年7月8日	(148)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	19,111 AUD	27,734	19,134	2020年7月8日	(23)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	671 CNH	4,755	672	2020年7月8日	(1)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	10,892 AUD	15,834	10,924	2020年7月8日	(32)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	1,927 AUD	2,801	1,933	2020年7月8日	(6)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	13,752 EUR	12,276	13,793	2020年7月8日	(41)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	48,539 EUR	43,328	48,683	2020年7月8日	(144)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	24,915 AUD	36,288	25,036	2020年7月8日	(121)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	18,440 EUR	16,460	18,495	2020年7月8日	(55)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	6,888 EUR	6,149	6,908	2020年7月8日	(20)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	4,407 AUD	6,418	4,428	2020年7月8日	(21)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	92,251 EUR	82,309	92,481	2020年7月8日	(230)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _(CA)	8,258 AUD	12,019	8,292	2020年7月8日	(34)

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	46,678	AUD	67,937	46,871	2020年7月8日	—	(193)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	34,040	EUR	30,377	34,130	2020年7月8日	—	(90)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	13,033	EUR	11,630	13,068	2020年7月8日	—	(35)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,444	EUR	2,181	2,450	2020年7月8日	—	(6)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	25,387	EUR	22,655	25,454	2020年7月8日	—	(67)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	91,508	EUR	81,653	91,743	2020年7月8日	—	(235)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	318	CNH	2,257	319	2020年7月8日	—	(1)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,616	AUD	3,799	2,621	2020年7月8日	—	(5)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	14,784	AUD	21,473	14,815	2020年7月8日	—	(31)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	85,128	EUR	75,857	85,231	2020年7月8日	—	(103)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	23,279	AUD	33,872	23,369	2020年7月8日	—	(90)

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

クレジット・デフォルト・スワップ[†]°（2019年：(0.18%); USD (911,058)）

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0%; USD (542))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ²⁵ _{CA}	4,118 AUD	5,992	4,134	2020年7月8日	— (16)
USD ²⁵ _{CA}	20,237 AUD	29,578	20,407	2020年7月8日	— (170)
USD ²⁵ _{CA}	3,581 AUD	5,233	3,611	2020年7月8日	— (30)
USD ²⁵ _{CA}	14,651 EUR	13,080	14,696	2020年7月8日	— (45)
USD ²⁵ _{CA}	5,742 EUR	5,127	5,760	2020年7月8日	— (18)
USD ²⁵ _{CA}	11,265 EUR	10,058	11,300	2020年7月8日	— (35)
USD ²⁵ _{CA}	40,199 EUR	35,889	40,324	2020年7月8日	— (125)
USD ²⁵ _{CA}	1,074 EUR	959	1,077	2020年7月8日	— (3)
合計				—	(8,704)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(8,704)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	90.52
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	3.76
規制市場において取引されている金融デリバティブ商品	0.01
OTC金融デリバティブ商品	0.22
その他の資産	5.49
資産合計	100.00

²⁵_{CA} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド 投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保／商業不動産担保証券 (2019年: 1.90%; EUR 68,446,880)			
Angel Oak Mortgage Trust I LLC 2018-2, 3.6740%, 期日 27/7/48 (144A).....	226,996	0.01	232,164
Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, 4.1940%, 期日 7/6/49 (144A)	1,896,000	0.04	1,664,998
Arroyo Mortgage Trust 2018-1, 3.7630%, 期日 25/4/48 (144A)...	223,598	0.01	230,630
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DSNY, 1.0348%, 期日 15/9/34 (144A).....	850,000	0.02	808,514
BANK 2018-BNK12, 4.2550%, 期日 15/5/61.....	6,617,003	0.19	7,815,563
BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust, 1.0348%, 期日 15/8/36 (144A).....	1,530,000	0.03	1,461,626
BBCMS Trust 2015-SRCH, 4.1970%, 期日 10/8/35 (144A)	964,000	0.03	1,061,723
BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND, 0.9348%, 期日 15/11/35 (144A)	1,368,749	0.03	1,355,653
BXP Trust 2017-GM, 3.3790%, 期日 13/6/39 (144A)	3,861,000	0.10	4,234,287
CarMax Auto Owner Trust 2017-3, 2.7200%, 期日 15/5/23	1,984,000	0.05	2,000,876
CHT 2017-COSMO Mortgage Trust, 1.1148%, 期日 15/11/36 (144A).....	3,336,499	0.08	3,196,901
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R02, 2.4845%, 期日 25/8/31 (144A).....	611,803	0.01	602,907
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, 2.2845%, 期日 25/10/39 (144A)	3,427,463	0.08	3,323,382
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, 0.9845%, 期日 25/1/40 (144A).....	1,001,071	0.02	994,963
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, 2.1845%, 期日 25/1/40 (144A).....	4,144,223	0.09	3,916,535
Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2, 3.9400%, 期日 15/7/27 (144A).....	367,000	0.01	378,821
DB Master Finance LLC, 3.7870%, 期日 20/5/49 (144A)	801,940	0.02	824,070
DB Master Finance LLC, 4.0210%, 期日 20/5/49 (144A)	703,683	0.02	740,332
DB Master Finance LLC, 4.3520%, 期日 20/5/49 (144A)	641,155	0.02	680,158
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.0820%, 期日 25/7/47 (144A).....	410,475	0.01	415,046
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.6680%, 期日 25/10/49 (144A).....	4,151,140	0.10	4,359,473
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1160%, 期日 25/7/48 (144A).....	1,964,018	0.05	2,085,362
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.3280%, 期日 25/7/48 (144A).....	1,448,205	0.04	1,572,375
Drive Auto Receivables Trust 2017-1, 5.1700%, 期日 16/9/24...	1,590,000	0.04	1,622,794
Drive Auto Receivables Trust 2017-2, 5.2700%, 期日 15/11/24.....	1,400,000	0.03	1,434,474
Drive Auto Receivables Trust 2017-3, 3.5300%, 期日 15/12/23 (144A).....	533,234	0.01	540,827
Drive Auto Receivables Trust 2017-A, 4.1600%, 期日 15/5/24 (144A).....	413,660	0.01	420,323
Drive Auto Receivables Trust, 3.6600%, 期日 15/11/24.....	7,709,917	0.18	7,795,783
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 1.1345%, 期日 25/10/29.....	33,273	—	33,243
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.1845%, 期日 25/3/31	2,519,264	0.06	2,428,507
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.1845%, 期日 25/7/39 (144A).....	3,560,153	0.08	3,482,561
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.2845%, 期日 25/6/39 (144A).....	644,447	0.01	622,890

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.3345%, 期日 25/9/31 (144A).....	2,347,499	0.05	2,314,745
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 2.5345%, 期日 25/1/31	1,237,413	0.03	1,211,246
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 3.7345%, 期日 25/7/29	2,147,086	0.05	2,182,831
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 4.4345%, 期日 25/1/29	1,482,674	0.04	1,520,744
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 5.1845%, 期日 25/7/25	4,559,338	0.11	4,670,207
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 5.8845%, 期日 25/4/28	1,192,114	0.03	1,243,238
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 6.0845%, 期日 25/10/28.....	632,619	0.02	657,827
Fannie Mae REMICS, 3.0000%, 期日 25/11/49	4,150,244	0.10	4,296,343
Fannie Mae REMICS, 3.0000%, 期日 25/5/48.....	1,673,661	0.04	1,798,281
Freddie Mac Stac Remic Trust 2020-DNA1, 1.8845%, 期日 25/1/50 (144A).....	2,783,000	0.06	2,575,843
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, 0.9345%, 期日 25/3/30	59,647	—	59,562
GS Mortgage Securities Corp II, 4.1550%, 期日 10/7/51	1,188,768	0.03	1,395,846
GS Mortgage Securities Trust 2018-GS9, 3.9920%, 期日 10/3/51	1,978,569	0.05	2,299,952
Jack in the Box Funding LLC, 3.9820%, 期日 25/8/49 (144A) ...	1,890,500	0.05	1,945,568
Jack in the Box Funding LLC, 4.4760%, 期日 25/8/49 (144A) ...	5,491,405	0.14	5,701,464
Jack in the Box Funding LLC, 4.9700%, 期日 25/8/49 (144A) ...	1,890,500	0.05	1,936,446
Mello Warehouse Securitization Trust 2018-1, 1.0345%, 期日 25/11/51 (144A)	7,383,333	0.18	7,385,588
Mello Warehouse Securitization Trust 2018-1, 1.2345%, 期日 25/11/51 (144A)	364,667	0.01	364,921
Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, 3.8090%, 期日 15/12/48.....	10,657,000	0.27	11,729,002
Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11, 2.7820%, 期日 15/8/49	2,042,000	0.05	2,173,592
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3, 4.1770%, 期日 15/7/51	3,120,147	0.09	3,670,097
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4, 4.3100%, 期日 15/12/51.....	4,669,927	0.13	5,563,981
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-2, 4.5000%, 期日 25/2/58 (144A).....	282,960	0.01	301,941
OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1, 3.8500%, 期日 14/10/25 (144A)	188,000	—	189,310
OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1, 4.4000%, 期日 14/1/28 (144A).....	187,000	—	193,259
Planet Fitness Master Issuer LLC, 3.8580%, 期日 5/12/49 (144A).....	2,207,905	0.05	1,902,111
Santander Drive Auto Receivables Trust 2016-3, 4.2900%, 期日 15/2/24	1,868,000	0.04	1,897,946
Sequoia Mortgage Trust 2013-5, 2.5000%, 期日 25/5/43 (144A).....	1,782,521	0.04	1,818,056
Sequoia Mortgage Trust 2013-7, 3.0000%, 期日 25/6/43.....	493,375	0.01	508,327
Sequoia Mortgage Trust 2013-9, 3.5000%, 期日 25/7/43 (144A).....	236,182	0.01	242,965
Station Place Securitization Trust Series 2019-10, 1.0848%, 期日 24/10/20 (144A).....	7,564,000	0.18	7,582,609
Taco Bell Funding LLC, 4.9400%, 期日 25/11/48 (144A).....	505,305	0.01	536,504
Wendy's Funding LLC, 3.7830%, 期日 15/6/49 (144A)	1,333,780	0.03	1,404,167
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C25, 3.6310%, 期日 15/11/47.....	3,444,000	0.09	3,750,540

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1180%, 期日 25/7/47 (144A).....	594,750	0.02	638,990
Wendys Funding LLC 2018-1, 3.5730%, 期日 15/3/48 (144A)	615,225	0.02	636,562
Wendys Funding LLC 2018-1, 3.8840%, 期日 15/3/48 (144A)	1,551,225	0.04	1,644,928
資産担保／商業不動産担保証券合計.....		3.61	152,283,300
普通株式 (2019年: 61.78%; EUR 2,221,545,668)			
航空宇宙産業及び防衛			
General Dynamics Corp.....	312,646	1.11	46,728,071
アプリケーション・ソフトウェア			
Microsoft Corp.	1,005,517	4.85	204,632,765
Salesforce.com, Inc.....	163,838	0.73	30,691,773
		5.58	235,324,538
スポーツ・シューズ			
NIKE, Inc. - Class B.....	357,374	0.83	35,040,521
飲料－アルコール以外			
Monster Beverage Corp.....	409,090	0.67	28,358,119
ケーブルTV／衛星TV			
Comcast Corp. - Class A	1,338,685	1.24	52,181,941
携帯電話通信			
T-Mobile U.S., Inc.	264,430	0.33	13,828,174
コーティング及び塗料製品			
Sherwin-Williams Co.....	29,973	0.41	17,319,898
商業サービス－金融			
S&P Global, Inc.....	37,372	0.29	12,313,327
コンピュータ・サービス			
Accenture plc - Class A	272,529	1.39	58,517,427
コンピュータ			
Apple, Inc.	328,603	2.84	119,874,374
消費財－その他			
Clorox Co.....	50,054	0.26	10,980,346
化粧品及びトイレタリー			
Estee Lauder Cos, Inc. - Class A.....	46,540	0.21	8,781,167
Procter & Gamble Co.....	291,228	0.82	34,822,132
		1.03	43,603,299
診断装置			
Thermo Fisher Scientific, Inc.....	105,888	0.91	38,367,458
多角的銀行機関			
Bank of America Corp.	1,212,620	0.68	28,799,725
Morgan Stanley.....	637,865	0.73	30,808,880
		1.41	59,608,605
Eコマース／製品			
Amazon.com, Inc.....	34,036	2.23	93,899,198
電力－送電			
Sempra Energy	101,333	0.28	11,879,268
電子構成部品－半導体			
Intel Corp.	777,573	1.10	46,522,193
NVIDIA Corp.....	97,833	0.88	37,167,735
Texas Instruments, Inc.	250,076	0.75	31,752,150
		2.73	115,442,078
電子フォーム			
Adobe, Inc.	188,748	1.95	82,163,892
金融－消費者ローン			
Synchrony Financial	386,364	0.20	8,561,826
金融－クレジット・カード			
American Express Co.....	257,902	0.58	24,552,270
Mastercard, Inc. - Class A.....	344,571	2.41	101,889,645
		2.99	126,441,915
金融－その他のサービス			
CME Group, Inc.	180,881	0.70	29,400,398

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
食品－菓子			
Hershey Co.	147,014	0.45	19,055,955
食品－卸売り／流通			
Sysco Corp.	199,772	0.26	10,919,538
ホテル及びモーテル			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	250,745	0.44	18,417,220
制御機器			
Honeywell International, Inc.	261,135	0.89	37,757,510
保険ブローカー			
Marsh & McLennan Cos, Inc.	115,704	0.29	12,423,138
機械－農業			
Deere & Co.	162,471	0.61	25,532,318
医療－医薬品			
AbbVie, Inc.	290,433	0.68	28,514,712
Bristol-Myers Squibb Co.	734,998	1.02	43,217,882
Eli Lilly and Co.	329,351	1.28	54,072,847
Merck & Co., Inc.	844,410	1.55	65,298,225
		4.53	191,103,666
医療－HMO			
UnitedHealth Group, Inc.	289,744	2.03	85,459,993
医療機器			
Intuitive Surgical, Inc.	16,353	0.22	9,318,430
Medtronic plc	286,536	0.62	26,275,351
		0.84	35,593,781
医療用品			
Abbott Laboratories	492,953	1.07	45,070,693
Stryker Corp.	61,024	0.26	10,995,915
		1.33	56,066,608
マルチメディア			
Walt Disney Co.	249,249	0.66	27,793,756
プライベート・エクイティ			
Apollo Global Management, Inc.	102,762	0.12	5,129,879
Blackstone Group, Inc.	636,999	0.86	36,092,363
		0.98	41,222,242
損害保険			
Progressive Corp.	636,970	1.21	51,027,667
不動産管理／サービス			
CBRE Group, Inc. - Class A	419,217	0.45	18,956,993
REIT－各種			
Crown Castle International Corp.	164,130	0.65	27,467,156
REIT－ホテル			
MGM Growth Properties LLC	486,714	0.31	13,243,488
小売り－建材製品			
Home Depot, Inc.	324,561	1.93	81,305,776
小売り－ディスカウント			
Costco Wholesale Corp.	155,964	1.12	47,289,844
Dollar General Corp.	207,850	0.94	39,597,504
		2.06	86,887,348
小売り－レストラン			
McDonald's Corp.	323,576	1.41	59,690,065
Starbucks Corp.	289,965	0.50	21,338,524
		1.91	81,028,589
半導体装置			
Lam Research Corp.	161,544	1.24	52,253,022
大型地域銀行			
U.S. Bancorp.	508,022	0.44	18,705,370
通信機器光ファイバー			
Corning, Inc.	613,748	0.38	15,896,073
タバコ			
Altria Group, Inc.	696,350	0.65	27,331,738

ジャンナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
玩具			
Hasbro, Inc.	274,006	0.49	20,536,750
運輸—鉄道			
CSX Corp.	430,767	0.71	30,041,691
運輸—サービス			
United Parcel Service, Inc. - Class B	146,476	0.39	16,285,202
ウェブ・ポータル／インターネット・サービス・プロバイダー			
Alphabet, Inc. - Class C	65,117	2.18	92,050,042
普通株式合計		57.69	2,434,197,303
社債 (2019年: 15.38%; EUR 553,178,610)			
航空宇宙産業及び防衛			
BAE Systems plc, 3.4000%, 期日 15/4/30 (144A)	1,665,000	0.04	1,819,545
Boeing Co., 2.2500%, 期日 15/6/26	263,000	0.01	254,439
Boeing Co., 3.6000%, 期日 1/5/34	3,962,000	0.09	3,753,960
Boeing Co., 4.5080%, 期日 1/5/23	7,135,000	0.17	7,538,794
Boeing Co., 4.8750%, 期日 1/5/25	1,413,000	0.04	1,540,187
Boeing Co., 5.7050%, 期日 1/5/40	3,641,000	0.10	4,130,236
Boeing Co., 5.8050%, 期日 1/5/50	2,187,000	0.06	2,586,345
Boeing Co., 5.9300%, 期日 1/5/60	1,706,000	0.05	2,024,380
General Dynamics Corp., 3.2500%, 期日 1/4/25	2,637,000	0.07	2,926,408
General Dynamics Corp., 3.5000%, 期日 1/4/27	3,814,000	0.10	4,371,870
General Dynamics Corp., 4.2500%, 期日 1/4/50	748,000	0.02	976,071
Northrop Grumman Corp., 4.4000%, 期日 1/5/30	2,659,000	0.08	3,229,184
Northrop Grumman Corp., 5.1500%, 期日 1/5/40	1,155,000	0.04	1,542,124
Northrop Grumman Corp., 5.2500%, 期日 1/5/50	1,486,000	0.05	2,146,141
		0.92	38,839,684
農業運営			
Cargill, Inc., 1.3750%, 期日 23/7/23 (144A)	1,021,000	0.02	1,039,048
Cargill, Inc., 2.1250%, 期日 23/4/30 (144A)	1,501,000	0.04	1,575,106
		0.06	2,614,154
アプリケーション・ソフトウェア			
Intuit, Inc., 0.9500%, 期日 15/7/25	730,000	0.02	731,510
Intuit, Inc., 1.3500%, 期日 15/7/27	762,000	0.02	766,618
		0.04	1,498,128
自動車—乗用車及び小型トラック			
General Motors Co., 4.2000%, 期日 1/10/27	990,000	0.02	1,009,196
General Motors Co., 5.0000%, 期日 1/10/28	3,436,000	0.09	3,651,323
General Motors Co., 5.4000%, 期日 1/4/48	969,000	0.02	959,065
General Motors Financial Co., Inc., 4.3000%, 期日 13/7/25	402,000	0.01	419,151
General Motors Financial Co., Inc., 4.3500%, 期日 17/1/27	2,007,000	0.05	2,079,172
General Motors Financial Co., Inc., 4.3500%, 期日 9/4/25	2,429,000	0.06	2,566,815
		0.25	10,684,722
飲料—アルコール以外			
Coca-Cola Co., 3.3750%, 期日 25/3/27	3,401,000	0.09	3,903,142
Coca-Cola Femsa SAB de C.V., 2.7500%, 期日 22/1/30	1,799,000	0.05	1,907,671
Fomento Economico Mexicano, S.A.B. de C.V., 3.5000%, 期日 16/1/50	2,412,000	0.06	2,496,104
Keurig Dr Pepper, Inc., 3.2000%, 期日 1/5/30	741,000	0.02	821,448
Keurig Dr Pepper, Inc., 3.8000%, 期日 1/5/50	1,692,000	0.05	1,939,092
Keurig Dr Pepper, Inc., 4.5970%, 期日 25/5/28	3,926,000	0.11	4,715,881
PepsiCo, Inc., 2.2500%, 期日 19/3/25	2,429,000	0.06	2,599,946
PepsiCo, Inc., 2.6250%, 期日 19/3/27	751,000	0.02	821,573
		0.46	19,204,857
飲料—ワイン及び蒸留酒			
Diageo Capital plc, 1.3750%, 期日 29/9/25	2,332,000	0.06	2,374,256
Diageo Capital plc, 2.0000%, 期日 29/4/30	2,197,000	0.05	2,276,145
Diageo Capital plc, 2.1250%, 期日 29/4/32	1,762,000	0.04	1,829,267
		0.15	6,479,668

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
醸造			
Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4.9000%, 期日 1/2/46	3,820,000	0.11	4,686,848
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc., 4.3500%, 期日 1/6/40	2,470,000	0.07	2,822,299
		0.18	7,509,147
放送サービス及びプログラミング			
Fox Corp., 4.0300%, 期日 25/1/24	1,698,000	0.04	1,883,386
建築—住宅及び商業			
MDC Holdings, Inc., 5.5000%, 期日 15/1/24	1,745,000	0.04	1,873,511
建築製品—セメント及び骨材			
Vulcan Materials Co., 3.5000%, 期日 1/6/30	2,079,000	0.05	2,260,426
ケーブルTV／衛星TV			
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2.8000%, 期日 1/4/31	6,587,000	0.16	6,692,309
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.7000%, 期日 1/4/51	3,463,000	0.08	3,387,006
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4.8000%, 期日 1/3/50	3,549,000	0.10	4,039,065
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5.3750%, 期日 1/5/47	430,000	0.01	508,334
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6.4840%, 期日 23/10/45	537,000	0.02	715,974
Comcast Corp., 3.1000%, 期日 1/4/25	1,026,000	0.03	1,128,745
Comcast Corp., 3.1500%, 期日 1/3/26	1,577,000	0.04	1,765,903
Comcast Corp., 3.3000%, 期日 1/4/27	2,795,000	0.07	3,148,409
Comcast Corp., 3.7500%, 期日 1/4/40	1,117,000	0.03	1,318,550
Comcast Corp., 4.6000%, 期日 15/10/38	1,525,000	0.05	1,944,569
CSC Holdings LLC, 4.1250%, 期日 1/12/30 (144A)	4,260,000	0.10	4,228,306
Sirius XM Radio, Inc., 4.1250%, 期日 1/7/30 (144A)	5,158,000	0.12	5,107,503
		0.81	33,984,673
カジノ・ホテル			
MGM Resorts International, 7.7500%, 期日 15/3/22	273,000	0.01	278,303
携帯電話通信			
T-Mobile USA, Inc., 1.5000%, 期日 15/2/26 (144A)	945,000	0.02	947,296
T-Mobile USA, Inc., 2.0500%, 期日 15/2/28 (144A)	871,000	0.02	873,587
T-Mobile USA, Inc., 2.5500%, 期日 15/2/31 (144A)	1,181,000	0.03	1,188,110
T-Mobile USA, Inc., 3.5000%, 期日 15/4/25 (144A)	3,478,000	0.09	3,797,611
T-Mobile USA, Inc., 3.7500%, 期日 15/4/27 (144A)	8,870,000	0.23	9,852,353
T-Mobile USA, Inc., 3.8750%, 期日 15/4/30 (144A)	2,983,000	0.08	3,330,355
T-Mobile USA, Inc., 6.3750%, 期日 1/3/25	3,235,000	0.08	3,327,198
		0.55	23,316,510
化学—特殊			
Ecolab, Inc., 4.8000%, 期日 24/3/30	1,752,000	0.05	2,224,734
商業銀行—米国東部			
Citizens Financial Group, Inc., 3.7500%, 期日 1/7/24	269,000	0.01	289,505
Citizens Financial Group, Inc., 4.3000%, 期日 3/12/25	1,799,000	0.04	2,015,354
Citizens Financial Group, Inc., 4.3500%, 期日 1/8/25	254,000	0.01	281,458
		0.06	2,586,317
商業銀行—米国西部			
First Republic Bank, 4.6250%, 期日 13/2/47	1,304,000	0.04	1,569,871
商業サービス			
CoStar Group, Inc., 2.8000%, 期日 15/7/30 (144A)	4,341,000	0.11	4,450,835
商業サービス—金融			
Equifax, Inc., 2.6000%, 期日 15/12/25	3,473,000	0.09	3,706,970
Equifax, Inc., 3.1000%, 期日 15/5/30	3,166,000	0.08	3,372,457
Equinix, Inc., 2.6000%, 期日 1/12/24	5,335,000	0.13	5,649,185
Experian Finance plc, 2.7500%, 期日 8/3/30 (144A)	7,617,000	0.19	8,129,594
Global Payments, Inc., 2.9000%, 期日 15/5/30	3,166,000	0.08	3,315,372
Global Payments, Inc., 3.2000%, 期日 15/8/29	667,000	0.02	715,742
Global Payments, Inc., 4.8000%, 期日 1/4/26	2,152,000	0.06	2,526,410

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
IHS Markit, Ltd., 4.7500%, 期日 15/2/25 (144A).....	1,816,000	0.05	2,039,568
IHS Markit, Ltd., 5.0000%, 期日 1/11/22 (144A).....	1,502,000	0.04	1,612,940
PayPal Holdings, Inc., 1.3500%, 期日 1/6/23	885,000	0.02	904,054
PayPal Holdings, Inc., 1.6500%, 期日 1/6/25	1,644,000	0.04	1,703,673
PayPal Holdings, Inc., 2.3000%, 期日 1/6/30	1,900,000	0.05	1,978,754
PayPal Holdings, Inc., 2.4000%, 期日 1/10/24.....	1,318,000	0.03	1,400,552
PayPal Holdings, Inc., 2.6500%, 期日 1/10/26.....	5,189,000	0.13	5,643,826
PayPal Holdings, Inc., 3.2500%, 期日 1/6/50	2,617,000	0.07	2,863,488
		1.08	45,562,585
コンピュータ支援設計			
Cadence Design Systems, Inc., 4.3750%, 期日 15/10/24.....	1,400,000	0.04	1,561,401
コンピュータ・サービス			
Leidos, Inc., 2.9500%, 期日 15/5/23 (144A).....	593,000	0.01	620,322
Leidos, Inc., 3.6250%, 期日 15/5/25 (144A).....	2,299,000	0.06	2,515,393
Leidos, Inc., 4.3750%, 期日 15/5/30 (144A).....	3,283,000	0.09	3,706,343
		0.16	6,842,058
コンピュータ			
Dell International LLC / EMC Corp., 5.8750%, 期日 15/6/21 (144A).....	4,028,000	0.10	4,035,512
コンサルティング・サービス			
Verisk Analytics, Inc., 3.6250%, 期日 15/5/50	2,182,000	0.06	2,478,755
Verisk Analytics, Inc., 5.5000%, 期日 15/6/45	1,601,000	0.05	2,201,553
		0.11	4,680,308
化粧品及びトイレットリー			
Procter & Gamble Co., 3.0000%, 期日 25/3/30	881,000	0.02	1,010,802
Procter & Gamble Co., 3.5500%, 期日 25/3/40	1,754,000	0.05	2,120,012
Procter & Gamble Co., 3.6000%, 期日 25/3/50	933,000	0.03	1,164,888
		0.10	4,295,702
データ処理及び管理			
Broadridge Financial Solutions, Inc., 2.9000%, 期日 1/12/29	6,087,000	0.15	6,515,415
意思決定支援ソフトウェア			
MSCI, Inc., 3.6250%, 期日 1/9/30 (144A)	2,512,000	0.06	2,503,761
MSCI, Inc., 3.8750%, 期日 15/2/31 (144A).....	3,517,000	0.08	3,593,934
MSCI, Inc., 4.0000%, 期日 15/11/29 (144A)	316,000	0.01	322,854
		0.15	6,420,549
診断装置			
DH Europe Finance II S.a.r.l., 2.2000%, 期日 15/11/24	1,334,000	0.03	1,402,909
DH Europe Finance II S.a.r.l., 2.6000%, 期日 15/11/29	731,000	0.02	779,341
DH Europe Finance II S.a.r.l., 3.4000%, 期日 15/11/49	941,000	0.03	1,059,687
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4.1330%, 期日 25/3/25	2,044,000	0.06	2,336,097
Thermo Fisher Scientific, Inc., 4.4970%, 期日 25/3/30	4,794,000	0.13	5,937,028
		0.27	11,515,062
透析センター			
DaVita, Inc., 4.6250%, 期日 1/6/30 (144A)	3,310,000	0.08	3,293,864
多角的銀行機関			
Bank of America Corp., 2.5920%, 期日 29/4/31.....	10,405,000	0.26	11,029,845
Bank of America Corp., 3.7050%, 期日 24/4/28.....	7,082,000	0.19	8,008,723
Bank of America Corp., 3.9700%, 期日 5/3/29	2,666,000	0.07	3,057,880
Bank of America Corp., 6.1000%, 期日 29/12/49	1,430,000	0.04	1,509,644
Bank of America Corp., 6.2500%, 期日 29/9/49.....	3,269,000	0.08	3,390,205
BNP Paribas S.A., 2.8190%, 期日 19/11/25 (144A)	1,399,000	0.03	1,466,062
BNP Paribas S.A., 3.0520%, 期日 13/1/31 (144A).....	3,919,000	0.10	4,127,689
BNP Paribas S.A., 4.7050%, 期日 10/1/25 (144A).....	2,058,000	0.05	2,280,049
Citigroup, Inc., 3.8870%, 期日 10/1/28.....	7,661,000	0.20	8,639,082
Citigroup, Inc., 4.4120%, 期日 31/3/31.....	5,023,000	0.14	5,947,861
Citigroup, Inc., 5.9000%, 期日 29/12/49	314,000	0.01	312,389
Citigroup, Inc., 5.9500%, 期日 15/11/66	1,631,000	0.04	1,622,574
Citigroup, Inc., 5.9500%, 期日 29/12/49	2,486,000	0.06	2,470,376
Credit Agricole Corp., 1.9070%, 期日 16/6/26 (144A)	1,353,000	0.03	1,373,221
Goldman Sachs Group, Inc., 3.5000%, 期日 1/4/25	11,466,000	0.31	12,586,181
Goldman Sachs Group, Inc., 4.3696%, 期日 10/11/68	6,198,000	0.14	5,743,737

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
JPMorgan Chase & Co., 2.0830%, 期日 22/4/26	12,346,000	0.31	12,824,023
JPMorgan Chase & Co., 2.9560%, 期日 13/5/31	9,584,000	0.24	10,213,305
JPMorgan Chase & Co., 3.9600%, 期日 29/1/27	6,018,000	0.16	6,859,995
JPMorgan Chase & Co., 4.4520%, 期日 5/12/29	6,030,000	0.17	7,234,126
Morgan Stanley, 2.1880%, 期日 28/4/26	9,020,000	0.22	9,391,642
Morgan Stanley, 3.9500%, 期日 23/4/27	4,602,000	0.12	5,184,435
Morgan Stanley, 4.3500%, 期日 8/9/26	2,586,000	0.07	2,984,494
		3.04	128,257,538
多角的金融サービス			
USAA Capital Corp., 2.1250%, 期日 1/5/30 (144A)	210,000	0.01	216,490
多角的製造業			
General Electric Co., 3.4500%, 期日 1/5/27	1,373,000	0.03	1,409,634
General Electric Co., 5.0000%, 期日 29/12/49	3,541,000	0.07	2,785,511
General Electric Co., 6.7500%, 期日 15/3/32	1,988,000	0.06	2,435,975
		0.16	6,631,120
Eコマース／サービス			
Booking Holdings, Inc., 4.1000%, 期日 13/4/25	8,148,000	0.21	9,164,831
Booking Holdings, Inc., 4.5000%, 期日 13/4/27	4,393,000	0.12	5,050,309
Booking Holdings, Inc., 4.6250%, 期日 13/4/30	3,065,000	0.09	3,591,619
		0.42	17,806,759
電力－送電			
PPL WEM, Ltd. / Western Power Distribution plc, 5.3750%, 期 日 1/5/21 (144A)	1,906,000	0.05	1,952,530
電力－総合			
Ameren Corp., 3.5000%, 期日 15/1/31	8,633,000	0.22	9,671,458
Berkshire Hathaway Energy Co., 4.2500%, 期日 15/10/50 (144A)	3,587,000	0.11	4,513,163
Black Hills Corp., 2.5000%, 期日 15/6/30	1,302,000	0.03	1,332,890
Dominion Energy, Inc., 3.3750%, 期日 1/4/30	4,390,000	0.12	4,866,315
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2.7500%, 期日 1/5/25	1,922,000	0.05	2,079,057
Pacific Gas and Electric Co., 2.1000%, 期日 1/8/27	1,535,000	0.04	1,519,757
Pacific Gas and Electric Co., 2.5000%, 期日 1/2/31	3,152,000	0.07	3,089,275
Southern Co., 3.7000%, 期日 30/4/30	6,559,000	0.18	7,513,539
		0.82	34,585,454
電気－伝送			
AEP Transmission Co. LLC, 3.6500%, 期日 1/4/50	2,101,000	0.06	2,436,304
Oncor Electric Delivery Co., LLC, 3.8000%, 期日 1/6/49	2,886,000	0.08	3,502,115
		0.14	5,938,419
電子構成部品－半導体			
Broadcom, Inc., 3.1500%, 期日 15/11/25 (144A)	4,622,000	0.12	4,913,189
Broadcom, Inc., 4.1500%, 期日 15/11/30 (144A)	3,810,000	0.10	4,154,085
Broadcom, Inc., 4.3000%, 期日 15/11/32 (144A)	3,048,000	0.08	3,372,814
Broadcom, Inc., 4.7000%, 期日 15/4/25 (144A)	5,464,000	0.15	6,158,362
Marvell Technology Group, Ltd., 4.2000%, 期日 22/6/23	1,269,000	0.03	1,365,100
Marvell Technology Group, Ltd., 4.8750%, 期日 22/6/28	5,539,000	0.15	6,670,377
Microchip Technology, Inc., 2.6700%, 期日 1/9/23 (144A)	4,752,000	0.12	4,893,787
Microchip Technology, Inc., 4.2500%, 期日 1/9/25 (144A)	3,724,000	0.09	3,758,237
Micron Technology, Inc., 2.4970%, 期日 24/4/23	4,848,000	0.12	5,038,599
		0.96	40,324,550
電子計測器			
Keysight Technologies, Inc., 3.0000%, 期日 30/10/29	3,530,000	0.09	3,822,820
Trimble, Inc., 4.7500%, 期日 1/12/24	3,802,000	0.10	4,140,946
Trimble, Inc., 4.9000%, 期日 15/6/28	6,887,000	0.19	7,914,224
		0.38	15,877,990
信託銀行			
Bank of New York Mellon Corp., 4.7000%, 期日 20/9/68	6,282,000	0.16	6,548,985

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
金融－クレジット・カード			
Capital One Financial Corp., 3.7500%, 期日 28/7/26……………	7,616,000	0.20	8,317,344
Mastercard, Inc., 3.3000%, 期日 26/3/27 ……………	3,281,000	0.09	3,720,954
Mastercard, Inc., 3.3500%, 期日 26/3/30 ……………	4,158,000	0.11	4,820,033
		0.40	16,858,331
金融－投資銀行／証券会社			
Charles Schwab Corp., 4.2000%, 期日 24/3/25 ……………	3,246,000	0.09	3,727,385
Charles Schwab Corp., 5.3750%, 期日 1/9/68……………	11,214,000	0.28	12,008,175
		0.37	15,735,560
金融－その他のサービス			
Choe Global Markets, Inc., 3.6500%, 期日 12/1/27……………	2,020,000	0.05	2,272,754
食品－ケータリング			
Aramark Services, Inc., 6.3750%, 期日 1/5/25 (144A) ……………	6,269,000	0.15	6,485,312
食品－菓子			
J M Smucker Co., 2.3750%, 期日 15/3/30……………	2,158,000	0.05	2,207,464
J M Smucker Co., 3.5500%, 期日 15/3/50……………	1,015,000	0.02	1,051,577
Mondelez International Holdings Netherlands B.V., 2.2500%, 期日 19/9/24 (144A) ……………	2,995,000	0.08	3,154,508
Mondelez International, Inc., 2.1250%, 期日 13/4/23 ……………	1,078,000	0.03	1,117,253
Mondelez International, Inc., 2.7500%, 期日 13/4/30 ……………	531,000	0.01	573,938
		0.19	8,104,740
食品－肉製品			
JBS USA LUX S.A. / JBS USA Finance, Inc., 6.7500%, 期日 15/2/28 (144A)……………	945,000	0.02	1,000,349
食品－その他／各種			
Campbell Soup Co., 3.9500%, 期日 15/3/25……………	1,507,000	0.04	1,696,298
Mars, Inc., 2.7000%, 期日 1/4/25 (144A) ……………	815,000	0.02	873,492
Mars, Inc., 4.2000%, 期日 1/4/59 (144A) ……………	1,427,000	0.04	1,835,460
		0.10	4,405,250
食品－卸売り／流通			
Sysco Corp., 2.4000%, 期日 15/2/30……………	891,000	0.02	882,422
Sysco Corp., 2.5000%, 期日 15/7/21……………	282,000	0.01	286,927
Sysco Corp., 5.6500%, 期日 1/4/25 ……………	2,804,000	0.08	3,283,698
Sysco Corp., 5.9500%, 期日 1/4/30 ……………	5,771,000	0.17	7,245,120
Sysco Corp., 6.6000%, 期日 1/4/40 ……………	3,485,000	0.11	4,731,216
Sysco Corp., 6.6000%, 期日 1/4/50 ……………	2,689,000	0.09	3,707,997
		0.48	20,137,380
ガス－供給			
East Ohio Gas Co., 1.3000%, 期日 15/6/25 (144A) ……………	520,000	0.01	523,467
East Ohio Gas Co., 2.0000%, 期日 15/6/30 (144A) ……………	478,000	0.01	478,064
East Ohio Gas Co., 3.0000%, 期日 15/6/50 (144A) ……………	695,000	0.02	697,270
		0.04	1,698,801
ホテル及びモーテル			
Choice Hotels International, Inc., 3.7000%, 期日 1/12/29………	2,717,000	0.06	2,730,300
Marriott International, Inc. / MD, 5.7500%, 期日 1/5/25 ……	4,725,000	0.13	5,154,778
		0.19	7,885,078
独立系発電事業者			
NRG Energy, Inc., 6.6250%, 期日 15/1/27 ……………	3,861,000	0.09	4,040,537
NRG Energy, Inc., 7.2500%, 期日 15/5/26 ……………	3,521,000	0.09	3,722,806
		0.18	7,763,343
保険ブローカー			
Brown & Brown, Inc., 4.5000%, 期日 15/3/29……………	2,008,000	0.05	2,166,483
投資管理及び投資顧問業			
Raymond James Financial, Inc., 4.6500%, 期日 1/4/30 ……………	1,472,000	0.04	1,763,228
Raymond James Financial, Inc., 4.9500%, 期日 15/7/46……………	2,338,000	0.07	2,836,075
Raymond James Financial, Inc., 5.6250%, 期日 1/4/24 ……………	762,000	0.02	869,208
		0.13	5,468,511

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
機械—一般産業			
Otis Worldwide Corp., 2.0560%, 期日 5/4/25 (144A)	2,172,000	0.05	2,278,754
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3.2000%, 期日 15/6/25	3,631,000	0.09	3,710,939
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 3.4500%, 期日 15/11/26	513,000	0.01	528,799
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4.4000%, 期日 15/3/24	2,855,000	0.07	3,030,260
Westinghouse Air Brake Technologies Corp., 4.9500%, 期日 15/9/28	8,148,000	0.22 0.44	9,078,067 18,626,819
医療—医薬品			
AbbVie, Inc., 2.6000%, 期日 21/11/24 (144A)	2,501,000	0.06	2,664,896
AbbVie, Inc., 2.8000%, 期日 15/3/23 (144A)	98,000	—	101,753
AbbVie, Inc., 3.2500%, 期日 1/10/22 (144A)	1,211,000	0.03	1,267,506
AbbVie, Inc., 3.4500%, 期日 15/3/22 (144A)	3,916,000	0.09	4,069,909
AbbVie, Inc., 3.8000%, 期日 15/3/25 (144A)	1,467,000	0.04	1,637,451
Bristol-Myers Squibb Co., 3.4000%, 期日 26/7/29 (144A)	1,594,000	0.04	1,859,248
Pfizer, Inc., 2.6250%, 期日 1/4/30	1,031,000	0.03	1,135,653
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd., 3.0250%, 期日 9/7/40	1,053,000	0.03	1,064,930
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd., 3.3750%, 期日 9/7/60	1,053,000	0.03	1,058,823
Upjohn, Inc., 1.6500%, 期日 22/6/25 (144A)	660,000	0.02	673,629
Upjohn, Inc., 2.3000%, 期日 22/6/27 (144A)	765,000	0.02	791,006
Upjohn, Inc., 3.8500%, 期日 22/6/40 (144A)	763,000	0.02 0.41	821,145 17,145,949
医療—HMO			
Centene Corp., 3.3750%, 期日 15/2/30	2,572,000	0.06	2,600,999
Centene Corp., 4.2500%, 期日 15/12/27	4,249,000	0.10	4,394,422
Centene Corp., 4.6250%, 期日 15/12/29	5,933,000	0.15	6,296,515
Centene Corp., 4.7500%, 期日 15/5/22	218,000	0.01	221,491
Centene Escrow I Corp., 5.3750%, 期日 1/6/26 (144A)	4,649,000	0.11	4,838,331
Molina Healthcare, Inc., 4.3750%, 期日 15/6/28 (144A)	8,881,000	0.22 0.65	8,919,854 27,271,612
医療—病院			
HCA, Inc., 3.5000%, 期日 1/9/30	5,199,000	0.12	5,012,661
HCA, Inc., 4.7500%, 期日 1/5/23	2,671,000	0.07	2,899,385
HCA, Inc., 5.3750%, 期日 1/2/25	1,581,000	0.04	1,698,081
HCA, Inc., 5.3750%, 期日 1/9/26	639,000	0.02	697,277
HCA, Inc., 5.6250%, 期日 1/9/28	903,000	0.02	1,009,301
HCA, Inc., 5.8750%, 期日 1/2/29	1,475,000	0.04	1,671,610
HCA, Inc., 5.8750%, 期日 15/2/26	831,000	0.02 0.33	913,240 13,901,555
医療機器			
Boston Scientific Corp., 3.7500%, 期日 1/3/26	2,115,000	0.06	2,403,443
Boston Scientific Corp., 4.0000%, 期日 1/3/29	510,000	0.01	583,859
Boston Scientific Corp., 4.7000%, 期日 1/3/49	1,398,000	0.04 0.11	1,785,860 4,773,162
医療用品			
Baxter International, Inc., 3.7500%, 期日 1/10/25 (144A)	3,513,000	0.09	4,005,325
Baxter International, Inc., 3.9500%, 期日 1/4/30 (144A)	3,066,000	0.09 0.18	3,639,514 7,644,839
金属—アルミニウム			
Constellium N.V., 5.7500%, 期日 15/5/24 (144A)	2,747,000	0.07	2,757,013
金属—銅			
HudBay Minerals, Inc., 7.2500%, 期日 15/1/23 (144A)	2,646,000	0.06	2,615,955
事務用品・フォーム			
Avery Dennison Corp., 2.6500%, 期日 30/4/30	3,928,000	0.10	4,033,495
石油会社—探査及び生産			
WPX Energy, Inc., 4.5000%, 期日 15/1/30	3,325,000	0.07	2,944,470

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
紙及び関連製品			
Georgia-Pacific LLC, 3.1630%, 期日 15/11/21 (144A).....	2,943,000	0.07	3,026,673
薬局サービス			
Cigna Corp., 2.4000%, 期日 15/3/30.....	1,501,000	0.04	1,559,247
Cigna Corp., 3.2000%, 期日 15/3/40.....	683,000	0.02	725,885
Cigna Corp., 3.4000%, 期日 15/3/50.....	1,030,000	0.03	1,114,861
Cigna Corp., 3.4000%, 期日 17/9/21.....	270,000	0.01	279,196
CVS Health Corp., 3.0000%, 期日 15/8/26	292,000	0.01	319,701
CVS Health Corp., 4.1000%, 期日 25/3/25	3,075,000	0.07	3,478,239
CVS Health Corp., 4.1250%, 期日 1/4/40.....	1,817,000	0.05	2,150,408
CVS Health Corp., 4.2500%, 期日 1/4/50.....	897,000	0.03	1,083,768
CVS Health Corp., 4.3000%, 期日 25/3/28	2,790,000	0.07	3,263,890
CVS Health Corp., 5.0500%, 期日 25/3/48	1,885,000	0.06	2,455,960
		0.39	16,431,155
パイプライン			
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 3.7000%, 期日 15/11/29 (144A)	6,239,000	0.15	6,400,488
Energy Transfer Operating L.P., 4.9500%, 期日 15/6/28	70,000	—	75,207
Energy Transfer Operating L.P., 5.5000%, 期日 1/6/27.....	1,064,000	0.03	1,188,329
Energy Transfer Operating L.P., 5.8750%, 期日 15/1/24	973,000	0.03	1,089,041
Hess Midstream Partners L.P., 5.1250%, 期日 15/6/28 (144A)...	5,095,000	0.12	4,908,319
Kinder Morgan, Inc., 4.3000%, 期日 1/3/28	1,200,000	0.03	1,361,473
Kinder Morgan, Inc., 6.5000%, 期日 15/9/20.....	60,000	—	60,664
NGPL PipeCo LLC, 4.3750%, 期日 15/8/22 (144A)	2,148,000	0.05	2,217,079
ONEOK, Inc., 5.8500%, 期日 15/1/26.....	1,170,000	0.03	1,337,614
ONEOK, Inc., 6.3500%, 期日 15/1/31.....	2,501,000	0.07	2,932,710
ONEOK, Inc., 7.1500%, 期日 15/1/51.....	653,000	0.02	795,735
Plains All American Pipeline L.P. / PAA Finance Corp., 4.6500%, 期日 15/10/25.....	977,000	0.02	1,044,040
TransCanada Pipeline, Ltd., 4.1000%, 期日 15/4/30	5,449,000	0.15	6,216,560
		0.70	29,627,259
不動産管理／サービス			
Jones Lang LaSalle, Inc., 4.4000%, 期日 15/11/22.....	2,565,000	0.06	2,690,507
REIT—アパート			
Camden Property Trust, 2.8000%, 期日 15/5/30.....	4,525,000	0.12	4,898,663
REIT—各種			
Crown Castle International Corp., 3.1000%, 期日 15/11/29.....	3,021,000	0.08	3,244,196
Crown Castle International Corp., 3.6500%, 期日 1/9/27.....	1,675,000	0.04	1,868,477
Crown Castle International Corp., 4.3000%, 期日 15/2/29	2,225,000	0.06	2,583,362
Equinix, Inc., 1.8000%, 期日 15/7/27.....	4,363,000	0.10	4,389,309
Equinix, Inc., 2.1500%, 期日 15/7/30.....	1,982,000	0.05	1,965,312
Equinix, Inc., 2.6250%, 期日 18/11/24	1,328,000	0.03	1,416,445
Equinix, Inc., 2.9000%, 期日 18/11/26	1,112,000	0.03	1,201,255
Equinix, Inc., 3.2000%, 期日 18/11/29	3,316,000	0.09	3,605,039
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 3.3500%, 期日 1/9/24.....	406,000	0.01	407,155
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 4.0000%, 期日 15/1/30	3,108,000	0.07	3,097,526
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 4.0000%, 期日 15/1/31	1,374,000	0.03	1,361,071
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 5.2500%, 期日 1/6/25.....	656,000	0.02	715,381
GLP Capital L.P. / GLP Financing II, Inc., 5.3000%, 期日 15/1/29	239,000	0.01	259,311
GLP Capital L.P., 5.3750%, 期日 15/4/26	2,117,000	0.05	2,318,528
		0.67	28,432,367

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
REIT－オフィス・ビル			
Alexandria Real Estate Equities, Inc., 4.9000%, 期日 15/12/30	3,542,000	0.10	4,428,919
小売り－自動車部品			
AutoZone, Inc., 3.7500%, 期日 18/4/29	3,636,000	0.10	4,137,263
O'Reilly Automotive, Inc., 3.6000%, 期日 1/9/27	48,000	—	54,018
O'Reilly Automotive, Inc., 3.9000%, 期日 1/6/29	3,942,000	0.11	4,545,627
O'Reilly Automotive, Inc., 4.3500%, 期日 1/6/28	367,000	0.01	428,374
		0.22	9,165,282
小売り－建材製品			
Lowe's Cos, Inc., 4.0000%, 期日 15/4/25	3,943,000	0.11	4,504,123
Lowe's Cos, Inc., 4.5000%, 期日 15/4/30	4,081,000	0.12	5,015,390
Lowe's Cos, Inc., 5.0000%, 期日 15/4/40	2,085,000	0.06	2,717,684
Lowe's Cos, Inc., 5.1250%, 期日 15/4/50	2,850,000	0.09	3,951,101
		0.38	16,188,298
小売り－コンビニエンス・ストア			
Alimentation Couche-Tard, Inc., 2.9500%, 期日 25/1/30 (144A)	899,000	0.02	933,809
小売り－ディスカウント			
Dollar General Corp., 3.5000%, 期日 3/4/30	2,413,000	0.06	2,708,424
Dollar General Corp., 4.1250%, 期日 3/4/50	2,329,000	0.07	2,791,803
		0.13	5,500,227
小売り－大手デパート			
Nordstrom, Inc., 4.3750%, 期日 1/4/30	3,744,000	0.07	2,942,320
小売り－レストラン			
McDonald's Corp., 3.3000%, 期日 1/7/25	1,113,000	0.03	1,237,887
McDonald's Corp., 3.5000%, 期日 1/7/27	3,498,000	0.10	3,977,349
McDonald's Corp., 3.6250%, 期日 1/9/49	2,041,000	0.05	2,272,323
		0.18	7,487,559
半導体部品／集積回路			
Analog Devices, Inc., 2.9500%, 期日 1/4/25	2,071,000	0.05	2,246,370
半導体装置			
Lam Research Corp., 4.0000%, 期日 15/3/29	409,000	0.01	486,299
造船			
Huntington Ingalls Industries, Inc., 3.8440%, 期日 1/5/25 (144A)	2,645,000	0.07	2,875,140
Huntington Ingalls Industries, Inc., 4.2000%, 期日 1/5/30 (144A)	4,748,000	0.12	5,299,974
Huntington Ingalls Industries, Inc., 5.0000%, 期日 15/11/25 (144A)	4,747,000	0.12	4,915,714
		0.31	13,090,828
ソフトウェア・ツール			
VMware, Inc., 4.5000%, 期日 15/5/25	3,449,000	0.09	3,777,614
VMware, Inc., 4.6500%, 期日 15/5/27	3,869,000	0.10	4,285,155
		0.19	8,062,769
鉄鋼－製造業者			
Reliance Steel & Aluminum Co., 4.5000%, 期日 15/4/23	1,724,000	0.04	1,852,386
Steel Dynamics, Inc., 5.5000%, 期日 1/10/24	2,486,000	0.06	2,555,919
		0.10	4,408,305
鉄鋼－特殊			
Allegheny Technologies, Inc., 5.8750%, 期日 1/12/27	2,673,000	0.06	2,505,537
大型地域銀行			
Wells Fargo & Co., 1.6540%, 期日 2/6/24	4,119,000	0.10	4,187,490
Wells Fargo & Co., 2.1640%, 期日 11/2/26	8,736,000	0.22	9,022,271
Wells Fargo & Co., 2.1880%, 期日 30/4/26	6,527,000	0.16	6,756,437
Wells Fargo & Co., 2.8790%, 期日 30/10/30	4,010,000	0.10	4,288,942
Wells Fargo & Co., 5.8750%, 期日 15/6/25	3,344,000	0.08	3,482,264
		0.66	27,737,404

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
電話—総合			
AT&T, Inc., 3.6000%, 期日 15/7/25	1,684,000	0.04	1,871,550
AT&T, Inc., 4.5000%, 期日 9/3/48	2,960,000	0.09	3,479,171
AT&T, Inc., 4.7500%, 期日 15/5/46	1,329,000	0.04	1,576,266
AT&T, Inc., 4.8500%, 期日 1/3/39	1,832,000	0.05	2,211,748
AT&T, Inc., 5.2500%, 期日 1/3/37	392,000	0.01	485,112
CenturyLink, Inc., 5.8000%, 期日 15/3/22	1,321,000	0.03	1,360,267
CenturyLink, Inc., 6.4500%, 期日 15/6/21	2,157,000	0.05	2,212,705
Level 3 Financing, Inc., 3.8750%, 期日 15/11/29 (144A)	4,073,000	0.11	4,303,674
Verizon Communications, Inc., 2.6250%, 期日 15/8/26	2,471,000	0.06	2,690,861
Verizon Communications, Inc., 3.0000%, 期日 22/3/27	1,662,000	0.04	1,846,173
Verizon Communications, Inc., 4.0000%, 期日 22/3/50	1,005,000	0.03	1,271,094
Verizon Communications, Inc., 4.5220%, 期日 15/9/48	1,124,000	0.04	1,487,941
Verizon Communications, Inc., 4.8620%, 期日 21/8/46	1,184,000	0.04	1,612,185
		0.63	26,408,747
玩具			
Hasbro, Inc., 3.0000%, 期日 19/11/24	1,543,000	0.04	1,617,708
Hasbro, Inc., 3.5500%, 期日 19/11/26	2,852,000	0.07	3,018,013
Hasbro, Inc., 3.9000%, 期日 19/11/29	6,229,000	0.15	6,497,590
		0.26	11,133,311
運輸—サービス			
United Parcel Service, Inc., 3.9000%, 期日 1/4/25	2,242,000	0.06	2,547,850
United Parcel Service, Inc., 5.2000%, 期日 1/4/40	1,280,000	0.04	1,772,568
United Parcel Service, Inc., 5.3000%, 期日 1/4/50	2,767,000	0.10	3,970,308
		0.20	8,290,726
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health, Inc., 5.0220%, 期日 28/8/23	704,000	0.02	742,280
水			
American Water Capital Corp., 2.8000%, 期日 1/5/30	2,769,000	0.07	3,022,123
American Water Capital Corp., 3.4500%, 期日 1/5/50	3,288,000	0.09	3,711,769
		0.16	6,733,892
社債合計		22.73	959,417,484
政府発行証券 (2019年: 11.97%; EUR 430,372,487)			
米国財務省中期証券／長期証券			
0.3750%, 期日 30/4/25	7,344,000	0.17	7,378,282
0.5000%, 期日 31/3/25	16,236,200	0.39	16,411,247
0.6250%, 期日 15/5/30	324,400	0.01	323,462
1.5000%, 期日 15/2/30	32,898,200	0.84	35,566,038
1.7500%, 期日 31/7/21	16,112,000	0.39	16,387,037
2.0000%, 期日 15/2/50	40,664,000	1.10	46,558,692
2.1250%, 期日 31/5/21	38,108,000	0.92	38,794,986
2.3750%, 期日 15/11/49	13,962,600	0.42	17,241,629
2.7500%, 期日 15/8/42	30,871,000	0.94	39,593,263
2.8750%, 期日 30/11/23	8,982,000	0.23	9,800,379
		5.41	228,055,015
政府発行証券合計		5.41	228,055,015
不動産担保証券 (2019年: 10.87%; EUR 390,869,645)			
Fannie Mae			
2.0000%, 期日 25/3/50	271,400	0.01	276,971
2.0000%, 期日 25/9/34	1,948,900	0.05	2,015,211
2.5000%, 期日 1/1/50	665,961	0.02	699,560
2.5000%, 期日 1/11/34	1,369,706	0.03	1,447,909
2.5000%, 期日 25/12/49	1,941,000	0.05	2,018,809
2.5000%, 期日 25/8/34	3,631,228	0.09	3,800,933
2.5000%, 期日 25/8/49	1,941,000	0.05	2,022,580
3.0000%, 期日 1/1/43	2,776,789	0.07	2,966,596
3.0000%, 期日 1/1/46	59,967	—	63,432
3.0000%, 期日 1/1/47	171,111	—	180,247
3.0000%, 期日 1/1/50	1,487,266	0.04	1,567,009

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.0000%, 期日 1/10/34	618,168	0.02	653,422
3.0000%, 期日 1/11/34	261,895	0.01	279,400
3.0000%, 期日 1/11/46	332,905	0.01	350,678
3.0000%, 期日 1/11/48	3,712,172	0.09	3,917,661
3.0000%, 期日 1/12/34	253,688	0.01	270,392
3.0000%, 期日 1/2/43	1,195,092	0.03	1,276,657
3.0000%, 期日 1/2/47	2,760,355	0.07	2,951,908
3.0000%, 期日 1/2/48	393,275	0.01	423,849
3.0000%, 期日 1/2/57	2,640,869	0.07	2,830,692
3.0000%, 期日 1/3/43	3,687,404	0.09	3,938,407
3.0000%, 期日 1/3/47	1,163,619	0.03	1,246,419
3.0000%, 期日 1/3/50	17,510,859	0.45	18,471,609
3.0000%, 期日 1/5/43	4,307,999	0.11	4,567,615
3.0000%, 期日 1/5/48	214,514	0.01	227,480
3.0000%, 期日 1/6/57	59,844	—	64,119
3.0000%, 期日 1/7/45	4,186,001	0.11	4,470,944
3.0000%, 期日 1/8/49	228,019	0.01	244,489
3.0000%, 期日 1/9/42	2,134,550	0.05	2,280,259
3.0000%, 期日 1/9/46	5,850,867	0.15	6,254,832
3.0000%, 期日 1/9/49	309,168	0.01	328,801
3.0000%, 期日 25/2/34	1,288,100	0.03	1,353,565
3.5000%, 期日 1/1/48	1,278,456	0.04	1,366,645
3.5000%, 期日 1/11/43	1,468,037	0.04	1,591,034
3.5000%, 期日 1/11/48	1,617,996	0.04	1,773,542
3.5000%, 期日 1/12/42	859,164	0.02	931,147
3.5000%, 期日 1/12/45	293,619	0.01	323,559
3.5000%, 期日 1/12/47	1,472,274	0.03	1,576,461
3.5000%, 期日 1/2/43	446,686	0.01	483,311
3.5000%, 期日 1/2/45	400,841	0.01	433,708
3.5000%, 期日 1/2/57	3,783,234	0.10	4,142,084
3.5000%, 期日 1/3/43	874,467	0.02	946,168
3.5000%, 期日 1/3/48	525,070	0.01	562,683
3.5000%, 期日 1/4/44	377,415	0.01	416,430
3.5000%, 期日 1/4/48	977,103	0.03	1,071,037
3.5000%, 期日 1/5/56	2,008,561	0.05	2,183,994
3.5000%, 期日 1/7/46	537,411	0.01	585,777
3.5000%, 期日 1/7/49	1,286,540	0.03	1,352,135
3.5000%, 期日 1/8/47	992,489	0.03	1,066,025
3.5000%, 期日 1/8/56	6,226,949	0.16	6,770,829
3.5000%, 期日 25/6/47	28,569,035	0.71	30,044,263
3.5000%, 期日 25/7/33	4,398,869	0.11	4,619,371
4.0000%, 期日 1/1/48	4,412,513	0.12	4,757,948
4.0000%, 期日 1/10/47	1,235,190	0.04	1,323,972
4.0000%, 期日 1/11/47	639,786	0.01	682,058
4.0000%, 期日 1/12/47	1,705,473	0.04	1,818,158
4.0000%, 期日 1/2/49	675,039	0.02	714,525
4.0000%, 期日 1/3/48	980,677	0.03	1,056,570
4.0000%, 期日 1/5/48	720,210	0.02	762,337
4.0000%, 期日 1/6/47	418,195	—	446,744
4.0000%, 期日 1/7/47	381,186	—	406,372
4.0000%, 期日 1/8/47	476,873	0.01	508,381
4.0000%, 期日 1/9/47	51,970	—	56,063
4.0000%, 期日 1/9/49	4,096,968	0.11	4,449,390
4.0000%, 期日 25/12/24	1,256,800	0.03	1,329,179
4.0000%, 期日 25/5/47	3,937,000	0.10	4,171,464
4.5000%, 期日 1/10/44	848,968	0.02	967,130
4.5000%, 期日 1/10/47	176,571	—	190,454
4.5000%, 期日 1/11/42	388,976	0.01	434,479
4.5000%, 期日 1/11/47	593,338	0.02	639,987
4.5000%, 期日 1/2/46	1,702,848	0.05	1,902,050
4.5000%, 期日 1/3/45	1,325,399	0.04	1,509,872

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
4.5000%, 期日 1/3/48	732,481	0.02	789,186
4.5000%, 期日 1/4/48	736,258	0.02	793,177
4.5000%, 期日 1/5/47	1,431,153	0.03	1,578,874
4.5000%, 期日 1/5/48	867,450	0.02	934,511
4.5000%, 期日 1/6/45	784,840	0.02	875,255
4.5000%, 期日 1/6/47	1,336,144	0.03	1,444,230
4.5000%, 期日 1/6/48	1,817,873	0.04	1,958,410
4.5000%, 期日 1/7/47	2,116,211	0.05	2,282,591
4.5000%, 期日 1/8/47	1,073,447	0.02	1,158,248
4.5000%, 期日 1/8/48	58,843	—	63,219
4.5000%, 期日 1/9/47	1,677,162	0.04	1,809,024
4.5000%, 期日 25/7/47	3,863,000	0.10	4,150,517
5.0000%, 期日 1/5/48	1,961,976	0.05	2,142,380
5.0000%, 期日 1/7/44	24,116	—	26,924
5.0000%, 期日 25/1/36	1,162,000	0.03	1,269,289
6.0000%, 期日 1/2/37	37,421	—	44,950
		4.39	185,150,576
Freddie Mac Gold Pool			
3.0000%, 期日 1/6/43	462,735	0.01	487,038
3.0000%, 期日 1/8/46	518,075	0.01	546,844
3.5000%, 期日 1/12/47	1,149,089	0.03	1,246,211
3.5000%, 期日 1/4/47	185,039	—	201,719
3.5000%, 期日 1/7/42	306,488	0.01	332,247
3.5000%, 期日 1/7/46	3,431,182	0.09	3,781,915
3.5000%, 期日 1/8/42	702,886	0.02	761,961
3.5000%, 期日 1/9/47	3,331,182	0.08	3,516,921
4.5000%, 期日 1/3/48	60,021	—	64,498
4.5000%, 期日 1/5/44	545,613	0.01	608,700
5.0000%, 期日 1/9/48	153,277	—	168,377
6.0000%, 期日 1/4/40	578,924	0.02	697,756
		0.28	12,414,187
Freddie Mac Pool			
2.5000%, 期日 1/1/50	310,427	0.01	326,088
2.5000%, 期日 1/11/34	3,039,343	0.08	3,212,873
2.5000%, 期日 1/12/33	4,409,685	0.11	4,624,398
3.0000%, 期日 1/1/33	706,400	0.02	748,620
3.0000%, 期日 1/1/45	853,994	0.02	905,813
3.0000%, 期日 1/1/46	1,186,852	0.03	1,289,239
3.0000%, 期日 1/1/50	3,028,781	0.08	3,195,518
3.0000%, 期日 1/10/32	758,493	0.02	798,142
3.0000%, 期日 1/10/34	1,583,177	0.04	1,678,205
3.0000%, 期日 1/10/46	1,044,607	0.03	1,111,361
3.0000%, 期日 1/10/49	2,260,440	0.05	2,381,116
3.0000%, 期日 1/11/43	8,139,434	0.21	8,694,627
3.0000%, 期日 1/11/49	2,165,641	0.06	2,280,147
3.0000%, 期日 1/12/49	3,005,673	0.07	3,163,540
3.0000%, 期日 1/2/43	7,599	—	8,118
3.0000%, 期日 1/2/50	639,193	0.02	674,924
3.0000%, 期日 1/3/43	1,078,728	0.03	1,153,522
3.0000%, 期日 1/3/50	3,507,984	0.08	3,701,484
3.0000%, 期日 1/4/47	804,681	0.02	849,225
3.0000%, 期日 1/5/31	4,128,463	0.10	4,372,767
3.0000%, 期日 1/5/50	5,161,327	0.13	5,451,709
3.0000%, 期日 1/8/49	226,937	—	241,761
3.0000%, 期日 1/9/32	1,246,243	0.03	1,320,728
3.5000%, 期日 1/11/47	825,759	0.02	881,804
3.5000%, 期日 1/12/44	2,637,100	0.07	2,852,919
3.5000%, 期日 1/12/47	624,997	0.02	667,416
3.5000%, 期日 1/2/43	349,196	0.01	377,774
3.5000%, 期日 1/2/44	360,504	0.01	390,008
3.5000%, 期日 1/2/48	1,101,767	0.02	1,173,166

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.5000%, 期日 1/3/50	1,652,190	0.04	1,763,626
3.5000%, 期日 1/7/46	583,008	0.02	633,177
3.5000%, 期日 1/7/49	15,706,969	0.40	16,640,417
3.5000%, 期日 1/8/49	606,890	0.02	637,833
3.5000%, 期日 1/9/49	1,271,076	0.03	1,345,026
4.0000%, 期日 1/3/47	477,482	0.01	519,097
4.0000%, 期日 1/3/48	721,886	0.02	777,543
4.0000%, 期日 1/4/48	1,941,749	0.05	2,065,518
4.0000%, 期日 1/5/48	1,093,321	0.03	1,157,032
4.5000%, 期日 1/12/48	616,835	0.02	679,912
4.5000%, 期日 1/5/49	1,889,015	0.05	2,046,734
4.5000%, 期日 1/7/48	783,666	0.02	845,088
		2.10	87,638,015
Ginnie Mae			
2.5000%, 期日 20/12/49	14,066,000	0.36	14,767,746
2.5000%, 期日 20/9/49	240,000	0.01	252,489
3.0000%, 期日 20/7/49	3,125,000	0.08	3,309,074
4.0000%, 期日 15/1/45	2,902,334	0.07	3,162,256
4.0000%, 期日 15/11/47	231,193	0.01	251,631
4.0000%, 期日 15/12/47	292,199	0.01	318,030
4.0000%, 期日 15/7/47	558,563	0.01	607,943
4.0000%, 期日 15/8/47	135,653	—	147,646
4.0000%, 期日 20/5/48	11,555,102	0.29	12,336,341
4.0000%, 期日 20/6/48	6,020,066	0.15	6,427,082
4.0000%, 期日 20/8/47	389,471	0.01	420,420
4.5000%, 期日 15/8/46	3,218,346	0.08	3,570,927
4.5000%, 期日 20/2/48	569,226	0.01	614,404
4.5000%, 期日 20/5/48	1,742,136	0.04	1,873,954
4.5000%, 期日 20/8/48	666,000	0.02	711,019
5.0000%, 期日 20/4/49	10,203,363	0.26	11,065,280
5.0000%, 期日 20/5/48	4,089,716	0.11	4,460,029
5.0000%, 期日 20/6/48	1,923,784	0.05	2,097,977
5.0000%, 期日 20/8/48	3,282,334	0.08	3,559,606
		1.65	69,953,854
不動産担保証券合計		8.42	355,156,632
優先株式 (2019年: 0.06%; USD 2,171,951)			
トランシュ・ローン (2019年: 0%)			
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health Term Loan, 0.0000%, 期日 4/2/27	6,863,763	0.16	6,563,473
トランシュ・ローン合計		0.16	6,563,473
投資有価証券合計 (取得原価: USD 3,694,891,560)		98.02	4,135,673,207

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citibank					
AUD ⁽²⁾ _{CA}	500 USD	342	345	2020年7月8日	— 3
AUD ⁽²⁾ _{CA}	550 USD	359	379	2020年7月8日	— 20
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,300 USD	895	897	2020年7月8日	— 2
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,200 USD	2,191	2,208	2020年7月8日	— 17
AUD ⁽²⁾ _{CA}	700 USD	479	483	2020年7月8日	— 4
AUD ⁽²⁾ _{CA}	700 USD	480	483	2020年7月8日	— 3
AUD ⁽²⁾ _{CA}	100 USD	69	69	2020年7月8日	— —
AUD ⁽²⁾ _{CA}	443,391 USD	289,401	305,906	2020年7月8日	— 16,505
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,381,893 USD	2,207,358	2,333,249	2020年7月8日	— 125,891
AUD ⁽²⁾ _{CA}	59,915,971 USD	39,107,094	41,337,466	2020年7月8日	0.05 2,230,372
AUD ⁽²⁾ _{CA}	400 USD	263	276	2020年7月8日	— 13
AUD ⁽²⁾ _{CA}	10,002 USD	6,538	6,901	2020年7月8日	— 363
AUD ⁽²⁾ _{CA}	77,480 USD	50,643	53,456	2020年7月8日	— 2,813
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,324 USD	2,214	2,293	2020年7月8日	— 79
AUD ⁽²⁾ _{CA}	444,586 USD	296,175	306,731	2020年7月8日	— 10,556
AUD ⁽²⁾ _{CA}	25,829 USD	17,207	17,820	2020年7月8日	— 613
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,455 USD	2,963	3,074	2020年7月8日	— 111
AUD ⁽²⁾ _{CA}	75,100 USD	49,940	51,813	2020年7月8日	— 1,873
AUD ⁽²⁾ _{CA}	7,773,355 USD	5,169,126	5,363,025	2020年7月8日	— 193,899
AUD ⁽²⁾ _{CA}	157,774 USD	104,305	108,852	2020年7月8日	— 4,547
AUD ⁽²⁾ _{CA}	6,363 USD	4,206	4,390	2020年7月8日	— 184
AUD ⁽²⁾ _{CA}	478,287 USD	316,452	329,981	2020年7月8日	— 13,529
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,207 USD	2,122	2,213	2020年7月8日	— 91
AUD ⁽²⁾ _{CA}	25,321 USD	16,753	17,469	2020年7月8日	— 716
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,600 USD	1,062	1,104	2020年7月8日	— 42
AUD ⁽²⁾ _{CA}	118,812 USD	79,181	81,971	2020年7月8日	— 2,790
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,300 USD	1,533	1,587	2020年7月8日	— 54
AUD ⁽²⁾ _{CA}	11,854 USD	8,057	8,178	2020年7月8日	— 121
AUD ⁽²⁾ _{CA}	396,486 USD	271,937	273,546	2020年7月8日	— 1,609
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,655 USD	1,821	1,832	2020年7月8日	— 11
AUD ⁽²⁾ _{CA}	20,877 USD	14,319	14,404	2020年7月8日	— 85
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,344 USD	926	927	2020年7月8日	— 1
AUD ⁽²⁾ _{CA}	182,551 USD	124,925	125,946	2020年7月8日	— 1,021
AUD ⁽²⁾ _{CA}	13,508 USD	9,244	9,320	2020年7月8日	— 76
AUD ⁽²⁾ _{CA}	440,645 USD	300,022	304,011	2020年7月8日	— 3,989
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,032 USD	2,065	2,092	2020年7月8日	— 27
AUD ⁽²⁾ _{CA}	24,300 USD	16,545	16,765	2020年7月8日	— 220
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,043 USD	2,784	2,790	2020年7月8日	— 6
AUD ⁽²⁾ _{CA}	53,816 USD	37,052	37,129	2020年7月8日	— 77
AUD ⁽²⁾ _{CA}	966,209 USD	665,229	666,611	2020年7月8日	— 1,382
AUD ⁽²⁾ _{CA}	8,435 USD	5,808	5,820	2020年7月8日	— 12
AUD ⁽²⁾ _{CA}	39,102 USD	26,766	26,977	2020年7月8日	— 211
AUD ⁽²⁾ _{CA}	47,669 USD	32,621	32,888	2020年7月8日	— 267
AUD ⁽²⁾ _{CA}	76,714 USD	52,681	52,927	2020年7月8日	— 246
AUD ⁽²⁾ _{CA}	21,646 USD	14,865	14,934	2020年7月8日	— 69

AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	3,843	USD	2,648	2,651	2020年7月8日	—	3
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	28,415	USD	19,580	19,604	2020年7月8日	—	24
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	503,642	USD	347,043	347,475	2020年7月8日	—	432
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	501,210	USD	343,362	345,797	2020年7月8日	—	2,435
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	3,833	USD	2,626	2,645	2020年7月8日	—	19
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	28,341	USD	19,416	19,554	2020年7月8日	—	138
AUD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	6,488	USD	4,452	4,476	2020年7月8日	—	24
CAD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	500	USD	368	369	2020年7月8日	—	1
CAD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	132,754	USD	95,242	97,806	2020年7月8日	—	2,564
CAD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	33,863,190	USD	24,153,505	24,948,637	2020年7月8日	0.02	795,132
CAD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	20,868,776	USD	14,885,015	15,375,029	2020年7月8日	0.01	490,014

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)	
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	6,931 USD	4,957	5,106	2020年7月8日	—	149
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	156,983 USD	114,195	115,656	2020年7月8日	—	1,461
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	257,356 USD	187,211	189,607	2020年7月8日	—	2,396
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	147,506 USD	107,138	108,675	2020年7月8日	—	1,537
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	240,820 USD	174,914	177,424	2020年7月8日	—	2,510
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	185,318 USD	134,553	136,533	2020年7月8日	—	1,980
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	474,784 USD	348,688	349,796	2020年7月8日	—	1,108
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	132,370 USD	96,987	97,523	2020年7月8日	—	536
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	221,355 USD	162,174	163,082	2020年7月8日	—	908
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	2,608 USD	1,916	1,921	2020年7月8日	—	5
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	1,157,313 USD	849,616	852,647	2020年7月8日	—	3,031
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	263,076 USD	192,832	193,821	2020年7月8日	—	989
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	166,265 USD	121,870	122,495	2020年7月8日	—	625
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	10,695 USD	7,826	7,879	2020年7月8日	—	53
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	165,068 USD	120,593	121,613	2020年7月8日	—	1,020
CAD ^{(2)(S)} _(CA)	262,998 USD	192,138	193,763	2020年7月8日	—	1,625
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	106 USD	15	15	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	268 USD	38	38	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	461 USD	65	65	2020年7月8日	—	—
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	538 USD	75	76	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	378,809 USD	52,856	53,560	2020年7月8日	—	704
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,333 USD	325	330	2020年7月8日	—	5
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,696 USD	375	381	2020年7月8日	—	6
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	1,487 USD	208	211	2020年7月8日	—	3
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	857 USD	120	121	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	1,904 USD	267	269	2020年7月8日	—	2
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,610 USD	366	369	2020年7月8日	—	3
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,204 USD	311	312	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,433 USD	343	344	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	5,280 USD	745	747	2020年7月8日	—	2
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,950 USD	416	417	2020年7月8日	—	1
CNH ^{(2)(S)} _(CA)	2,967 USD	419	419	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	99,756 USD	110,529	112,084	2020年7月8日	—	1,555
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	335 USD	376	377	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	684 USD	767	768	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	651 USD	730	731	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	431 USD	483	484	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	202,526,177 USD	220,829,480	227,553,754	2020年7月8日	0.16	6,724,274
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	299,654,529 USD	326,735,807	336,684,937	2020年7月8日	0.24	9,949,130
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,892,237 USD	3,153,623	3,249,651	2020年7月8日	—	96,028
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	58,701 USD	64,006	65,955	2020年7月8日	—	1,949
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	55,809 USD	60,852	62,705	2020年7月8日	—	1,853
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	36,671,464 USD	39,985,648	41,203,214	2020年7月8日	0.03	1,217,566
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	55,914,328 USD	60,967,585	62,824,053	2020年7月8日	0.04	1,856,468
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	76,462,135 USD	83,372,401	85,911,097	2020年7月8日	0.06	2,538,696
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	53,204 USD	58,317	59,779	2020年7月8日	—	1,462

EUR ^(注1) _(注A)	95,401	USD	104,569	107,190	2020年7月8日	—	2,621
EUR ^(注1) _(注A)	104,709	USD	114,772	117,649	2020年7月8日	—	2,877
EUR ^(注1) _(注A)	185,742	USD	203,592	208,696	2020年7月8日	—	5,104
EUR ^(注1) _(注A)	14,915	USD	16,348	16,758	2020年7月8日	—	410
EUR ^(注1) _(注A)	353	USD	395	396	2020年7月8日	—	1
EUR ^(注1) _(注A)	42,089	USD	45,923	47,290	2020年7月8日	—	1,367
EUR ^(注1) _(注A)	52,562	USD	57,350	59,057	2020年7月8日	—	1,707
EUR ^(注1) _(注A)	485,479	USD	529,706	545,473	2020年7月8日	—	15,767
EUR ^(注1) _(注A)	728,913	USD	795,317	818,990	2020年7月8日	—	23,673
EUR ^(注1) _(注A)	16,296	USD	17,780	18,309	2020年7月8日	—	529
EUR ^(注1) _(注A)	572,734	USD	629,890	643,511	2020年7月8日	—	13,621

^(注A) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	414,845 USD	456,245	466,111	2020年7月8日	— 9,866
EUR ⁽²⁾ _{CA}	272,729 USD	299,946	306,432	2020年7月8日	— 6,486
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,246,066 USD	2,470,212	2,523,628	2020年7月8日	— 53,416
EUR ⁽²⁾ _{CA}	22,011 USD	24,208	24,731	2020年7月8日	— 523
EUR ⁽²⁾ _{CA}	447 USD	491	502	2020年7月8日	— 11
EUR ⁽²⁾ _{CA}	425 USD	467	477	2020年7月8日	— 10
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,546,571 USD	1,700,911	1,737,692	2020年7月8日	— 36,781
EUR ⁽²⁾ _{CA}	3,597,966 USD	3,955,496	4,042,592	2020年7月8日	— 87,096
EUR ⁽²⁾ _{CA}	81,023 USD	89,074	91,035	2020年7月8日	— 1,961
EUR ⁽²⁾ _{CA}	220,886 USD	242,835	248,182	2020年7月8日	— 5,347
EUR ⁽²⁾ _{CA}	28,257 USD	31,097	31,749	2020年7月8日	— 652
EUR ⁽²⁾ _{CA}	246,103 USD	270,839	276,516	2020年7月8日	— 5,677
EUR ⁽²⁾ _{CA}	49,077 USD	54,010	55,142	2020年7月8日	— 1,132
EUR ⁽²⁾ _{CA}	102,595 USD	112,907	115,274	2020年7月8日	— 2,367
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,466,857 USD	1,616,110	1,648,127	2020年7月8日	— 32,017
EUR ⁽²⁾ _{CA}	395,109 USD	435,312	443,936	2020年7月8日	— 8,624
EUR ⁽²⁾ _{CA}	258,690 USD	285,012	290,658	2020年7月8日	— 5,646
EUR ⁽²⁾ _{CA}	542,295 USD	597,473	609,310	2020年7月8日	— 11,837
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,118,754 USD	2,334,337	2,380,583	2020年7月8日	— 46,246
EUR ⁽²⁾ _{CA}	20,507 USD	22,594	23,042	2020年7月8日	— 448
EUR ⁽²⁾ _{CA}	416 USD	459	468	2020年7月8日	— 9
EUR ⁽²⁾ _{CA}	396 USD	436	445	2020年7月8日	— 9
EUR ⁽²⁾ _{CA}	765,069 USD	847,689	859,614	2020年7月8日	— 11,925
EUR ⁽²⁾ _{CA}	11,278 USD	12,495	12,671	2020年7月8日	— 176
EUR ⁽²⁾ _{CA}	739,619 USD	819,490	831,018	2020年7月8日	— 11,528
EUR ⁽²⁾ _{CA}	64,915 USD	71,925	72,937	2020年7月8日	— 1,012
EUR ⁽²⁾ _{CA}	401,618 USD	446,077	451,249	2020年7月8日	— 5,172
EUR ⁽²⁾ _{CA}	11,568 USD	12,848	12,997	2020年7月8日	— 149
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,238 USD	1,375	1,391	2020年7月8日	— 16
EUR ⁽²⁾ _{CA}	59,276 USD	65,838	66,601	2020年7月8日	— 763
EUR ⁽²⁾ _{CA}	53,167 USD	59,220	59,737	2020年7月8日	— 517
EUR ⁽²⁾ _{CA}	70,105 USD	78,087	78,769	2020年7月8日	— 682
EUR ⁽²⁾ _{CA}	216,856 USD	241,545	243,654	2020年7月8日	— 2,109
EUR ⁽²⁾ _{CA}	215,174 USD	240,874	241,764	2020年7月8日	— 890
EUR ⁽²⁾ _{CA}	328,699 USD	367,959	369,318	2020年7月8日	— 1,359
EUR ⁽²⁾ _{CA}	17,385 USD	19,462	19,534	2020年7月8日	— 72
EUR ⁽²⁾ _{CA}	454,000 USD	508,272	510,104	2020年7月8日	— 1,832
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,740,541 USD	1,948,607	1,955,632	2020年7月8日	— 7,025
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,250,494 USD	1,399,979	1,405,026	2020年7月8日	— 5,047
EUR ⁽²⁾ _{CA}	25,543 USD	28,540	28,699	2020年7月8日	— 159
EUR ⁽²⁾ _{CA}	6,000 USD	6,704	6,741	2020年7月8日	— 37
EUR ⁽²⁾ _{CA}	40,870 USD	45,665	45,920	2020年7月8日	— 255
EUR ⁽²⁾ _{CA}	46,980 USD	52,493	52,786	2020年7月8日	— 293
EUR ⁽²⁾ _{CA}	33,716 USD	37,813	37,883	2020年7月8日	— 70
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,428,908 USD	2,724,035	2,729,065	2020年7月8日	— 5,030
EUR ⁽²⁾ _{CA}	426,714 USD	478,562	479,446	2020年7月8日	— 884

EUR ^(Z) _(CA)	651,461	USD	730,618	731,967	2020年7月8日	—	1,349
EUR ^(Z) _(CA)	891,981	USD	1,000,363	1,002,210	2020年7月8日	—	1,847
EUR ^(Z) _(CA)	3,418,427	USD	3,833,787	3,840,867	2020年7月8日	—	7,080
EUR ^(Z) _(CA)	145,018	USD	162,534	162,940	2020年7月8日	—	406
EUR ^(Z) _(CA)	58,559	USD	65,632	65,796	2020年7月8日	—	164
EUR ^(Z) _(CA)	75,219	USD	84,304	84,514	2020年7月8日	—	210
EUR ^(Z) _(CA)	44,128	USD	49,383	49,581	2020年7月8日	—	198
EUR ^(Z) _(CA)	66,639	USD	74,574	74,874	2020年7月8日	—	300
EUR ^(Z) _(CA)	20,395	USD	22,824	22,916	2020年7月8日	—	92
EUR ^(Z) _(CA)	490,694	USD	549,126	551,333	2020年7月8日	—	2,207
EUR ^(Z) _(CA)	142,640	USD	159,625	160,266	2020年7月8日	—	641

^(Z)_(CA) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
EUR ^(2/3) _{CA}	632,404	USD	709,696	710,554	2020年7月8日	—	858
EUR ^(2/3) _{CA}	7,167	USD	8,043	8,053	2020年7月8日	—	10
EUR ^(2/3) _{CA}	125,467	USD	140,802	140,972	2020年7月8日	—	170
EUR ^(2/3) _{CA}	4,838	USD	5,429	5,436	2020年7月8日	—	7
EUR ^(2/3) _{CA}	42,619	USD	47,852	47,886	2020年7月8日	—	34
EUR ^(2/3) _{CA}	296,812	USD	333,257	333,491	2020年7月8日	—	234
EUR ^(2/3) _{CA}	53,290	USD	59,833	59,875	2020年7月8日	—	42
EUR ^(2/3) _{CA}	52,426	USD	58,864	58,905	2020年7月8日	—	41
EUR ^(2/3) _{CA}	592,556	USD	664,113	665,782	2020年7月8日	—	1,669
EUR ^(2/3) _{CA}	2,297,343	USD	2,574,770	2,581,242	2020年7月8日	—	6,472
EUR ^(2/3) _{CA}	21,635	USD	24,248	24,309	2020年7月8日	—	61
EUR ^(2/3) _{CA}	453	USD	508	509	2020年7月8日	—	1
EUR ^(2/3) _{CA}	1,634,197	USD	1,831,543	1,836,147	2020年7月8日	—	4,604
EUR ^(2/3) _{CA}	284,168	USD	318,484	319,285	2020年7月8日	—	801
EUR ^(2/3) _{CA}	429,356	USD	481,205	482,415	2020年7月8日	—	1,210
GBP ^(2/3) _{CA}	1,949,270	USD	2,374,741	2,415,038	2020年7月8日	—	40,297
GBP ^(2/3) _{CA}	14,753	USD	18,150	18,279	2020年7月8日	—	129
GBP ^(2/3) _{CA}	14,033	USD	17,201	17,387	2020年7月8日	—	186
GBP ^(2/3) _{CA}	15,017	USD	18,442	18,605	2020年7月8日	—	163
SGD ^(2/3) _{CA}	110	USD	79	79	2020年7月8日	—	—
SGD ^(2/3) _{CA}	2,500	USD	1,761	1,794	2020年7月8日	—	33
SGD ^(2/3) _{CA}	1,193	USD	842	856	2020年7月8日	—	14
SGD ^(2/3) _{CA}	1,752	USD	1,234	1,257	2020年7月8日	—	23
SGD ^(2/3) _{CA}	156,659	USD	110,104	112,441	2020年7月8日	—	2,337
SGD ^(2/3) _{CA}	245,466	USD	172,520	176,182	2020年7月8日	—	3,662
SGD ^(2/3) _{CA}	1,869	USD	1,319	1,341	2020年7月8日	—	22
SGD ^(2/3) _{CA}	1,118	USD	788	803	2020年7月8日	—	15
SGD ^(2/3) _{CA}	931	USD	665	668	2020年7月8日	—	3
SGD ^(2/3) _{CA}	1,473	USD	1,052	1,057	2020年7月8日	—	5
SGD ^(2/3) _{CA}	1,815	USD	1,297	1,303	2020年7月8日	—	6
SGD ^(2/3) _{CA}	2,874	USD	2,053	2,063	2020年7月8日	—	10
SGD ^(2/3) _{CA}	1,007	USD	722	723	2020年7月8日	—	1
SGD ^(2/3) _{CA}	1,639	USD	1,175	1,177	2020年7月8日	—	2
SGD ^(2/3) _{CA}	4,645	USD	3,333	3,334	2020年7月8日	—	1
SGD ^(2/3) _{CA}	2,303	USD	1,652	1,653	2020年7月8日	—	1
SGD ^(2/3) _{CA}	1,199	USD	858	860	2020年7月8日	—	2
SGD ^(2/3) _{CA}	1,577	USD	1,129	1,132	2020年7月8日	—	3
USD ^(2/3) _{CA}	48	EUR	43	48	2020年7月8日	—	—
USD ^(2/3) _{CA}	155	EUR	136	153	2020年7月8日	—	2
USD ^(2/3) _{CA}	50	EUR	45	50	2020年7月8日	—	—
USD ^(2/3) _{CA}	879	EUR	780	876	2020年7月8日	—	3
USD ^(2/3) _{CA}	244	EUR	214	241	2020年7月8日	—	3
USD ^(2/3) _{CA}	93	SGD	129	93	2020年7月8日	—	—
USD ^(2/3) _{CA}	24,327	EUR	21,445	24,096	2020年7月8日	—	231
USD ^(2/3) _{CA}	468	AUD	677	467	2020年7月8日	—	1
USD ^(2/3) _{CA}	152	SGD	212	152	2020年7月8日	—	—

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	100	EUR	88	99	2020年7月8日	—	1
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,702	SGD	3,764	2,701	2020年7月8日	—	1
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	163	EUR	143	161	2020年7月8日	—	2
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	279	SGD	386	278	2020年7月8日	—	1
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	206,303	CAD	279,913	206,225	2020年7月8日	—	78
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	50,658	CAD	68,498	50,466	2020年7月8日	—	192
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,758	AUD	3,982	2,748	2020年7月8日	—	10
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	70,009	CAD	94,476	69,605	2020年7月8日	—	404
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	38,768	AUD	55,893	38,562	2020年7月8日	—	206
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	9,899	AUD	14,205	9,800	2020年7月8日	—	99
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	186,182	AUD	267,166	184,324	2020年7月8日	—	1,858

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
USD ⁽²⁾ _{CA}	1,261 AUD	1,810	1,248	2020年7月8日	— 13
USD ⁽²⁾ _{CA}	943,176 EUR	832,908	935,837	2020年7月8日	— 7,339
USD ⁽²⁾ _{CA}	1,339,920 EUR	1,183,267	1,329,494	2020年7月8日	— 10,426
USD ⁽²⁾ _{CA}	257,021 EUR	226,973	255,021	2020年7月8日	— 2,000
USD ⁽²⁾ _{CA}	252 EUR	223	250	2020年7月8日	— 2
USD ⁽²⁾ _{CA}	168,141 EUR	148,484	166,833	2020年7月8日	— 1,308
USD ⁽²⁾ _{CA}	265 EUR	234	263	2020年7月8日	— 2
USD ⁽²⁾ _{CA}	350,229 EUR	309,283	347,504	2020年7月8日	— 2,725
USD ⁽²⁾ _{CA}	13,061 EUR	11,534	12,959	2020年7月8日	— 102
USD ⁽²⁾ _{CA}	10,991 EUR	9,696	10,893	2020年7月8日	— 98
USD ⁽²⁾ _{CA}	40,945 EUR	36,118	40,582	2020年7月8日	— 363
USD ⁽²⁾ _{CA}	9,990 GBP	7,913	9,804	2020年7月8日	— 186
USD ⁽²⁾ _{CA}	100,935 CAD	136,229	100,367	2020年7月8日	— 568
USD ⁽²⁾ _{CA}	58,798 CAD	79,358	58,467	2020年7月8日	— 331
USD ⁽²⁾ _{CA}	28,166 EUR	25,006	28,096	2020年7月8日	— 70
USD ⁽²⁾ _{CA}	43,098 AUD	61,346	42,324	2020年7月8日	— 774
USD ⁽²⁾ _{CA}	75,185 AUD	107,019	73,835	2020年7月8日	— 1,350
USD ⁽²⁾ _{CA}	142,058 AUD	202,207	139,507	2020年7月8日	— 2,551
USD ⁽²⁾ _{CA}	792 AUD	1,133	782	2020年7月8日	— 10
USD ⁽²⁾ _{CA}	6,070 AUD	8,686	5,993	2020年7月8日	— 77
USD ⁽²⁾ _{CA}	115,475 AUD	165,252	114,011	2020年7月8日	— 1,464
USD ⁽²⁾ _{CA}	64,141 EUR	56,543	63,531	2020年7月8日	— 610
USD ⁽²⁾ _{CA}	160,038 EUR	140,848	158,254	2020年7月8日	— 1,784
USD ⁽²⁾ _{CA}	8,032 EUR	7,069	7,942	2020年7月8日	— 90
USD ⁽²⁾ _{CA}	581,543 EUR	511,810	575,060	2020年7月8日	— 6,483
USD ⁽²⁾ _{CA}	104,604 EUR	92,061	103,438	2020年7月8日	— 1,166
USD ⁽²⁾ _{CA}	216,601 EUR	190,629	214,186	2020年7月8日	— 2,415
USD ⁽²⁾ _{CA}	830,711 EUR	731,102	821,450	2020年7月8日	— 9,261
USD ⁽²⁾ _{CA}	6,067 GBP	4,758	5,895	2020年7月8日	— 172
USD ⁽²⁾ _{CA}	36,944 CAD	49,540	36,498	2020年7月8日	— 446
USD ⁽²⁾ _{CA}	61,931 CAD	83,046	61,184	2020年7月8日	— 747
USD ⁽²⁾ _{CA}	157,686 AUD	225,068	155,281	2020年7月8日	— 2,405
USD ⁽²⁾ _{CA}	79,162 EUR	69,470	78,056	2020年7月8日	— 1,106
USD ⁽²⁾ _{CA}	172,866 EUR	151,703	170,450	2020年7月8日	— 2,416
USD ⁽²⁾ _{CA}	77,886 CAD	104,309	76,849	2020年7月8日	— 1,037
USD ⁽²⁾ _{CA}	59,390 EUR	52,520	59,011	2020年7月8日	— 379
USD ⁽²⁾ _{CA}	267,208 EUR	236,302	265,504	2020年7月8日	— 1,704
USD ⁽²⁾ _{CA}	108,176 EUR	95,590	107,402	2020年7月8日	— 774
USD ⁽²⁾ _{CA}	2,196 EUR	1,940	2,180	2020年7月8日	— 16
USD ⁽²⁾ _{CA}	1,393,510 EUR	1,231,373	1,383,544	2020年7月8日	— 9,966
USD ⁽²⁾ _{CA}	7,827,641 EUR	6,916,881	7,771,658	2020年7月8日	— 55,983
USD ⁽²⁾ _{CA}	2,120,373 EUR	1,873,664	2,105,208	2020年7月8日	— 15,165
USD ⁽²⁾ _{CA}	2,896,942 EUR	2,559,878	2,876,223	2020年7月8日	— 20,719
USD ⁽²⁾ _{CA}	2,087 EUR	1,844	2,072	2020年7月8日	— 15
USD ⁽²⁾ _{CA}	11,122,716 EUR	9,827,701	11,042,191	2020年7月8日	— 80,525
USD ⁽²⁾ _{CA}	81,558 GBP	64,577	80,008	2020年7月8日	— 1,550

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	487,730	CAD	661,030	487,013	2020年7月8日	—	717
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	829,939	CAD	1,124,833	828,718	2020年7月8日	—	1,221
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	5,558	SGD	7,726	5,546	2020年7月8日	—	12
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	3,721	SGD	5,173	3,713	2020年7月8日	—	8
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	33,134	EUR	29,427	33,064	2020年7月8日	—	70
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	6,589	EUR	5,852	6,575	2020年7月8日	—	14
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	68,808	AUD	99,490	68,641	2020年7月8日	—	167
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	108,434	EUR	95,787	107,624	2020年7月8日	—	810
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	300,026	EUR	265,034	297,786	2020年7月8日	—	2,240
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	453,925	CAD	615,917	453,775	2020年7月8日	—	150
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	95,895	CAD	130,032	95,801	2020年7月8日	—	94

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.20%；USD 7,079,581)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)	
USD ^(注)	51,593	EUR 45,854	51,520	2020年7月8日	—	73
USD ^(注)	69,243	EUR 61,540	69,145	2020年7月8日	—	98
USD ^(注)	2,401	EUR 2,134	2,398	2020年7月8日	—	3
USD ^(注)	33,859	EUR 30,093	33,811	2020年7月8日	—	48
USD ^(注)	179,579	EUR 159,602	179,325	2020年7月8日	—	254
USD ^(注)	265,379	EUR 235,857	265,003	2020年7月8日	—	376
USD ^(注)	1,920	GBP 1,538	1,905	2020年7月8日	—	15
USD ^(注)	18,859	CAD 25,544	18,819	2020年7月8日	—	40
USD ^(注)	11,136	CAD 15,084	11,113	2020年7月8日	—	23
USD ^(注)	3,430	GBP 2,767	3,428	2020年7月8日	—	2
USD ^(注)	284,817	AUD 412,479	284,579	2020年7月8日	—	238
USD ^(注)	20,609	EUR 18,302	20,564	2020年7月8日	—	45
USD ^(注)	74,674	EUR 66,315	74,510	2020年7月8日	—	164
USD ^(注)	73,348	AUD 105,911	73,071	2020年7月8日	—	277
USD ^(注)	49,379	EUR 43,672	49,068	2020年7月8日	—	311
USD ^(注)	924	EUR 820	921	2020年7月8日	—	3
USD ^(注)	223,512	EUR 198,589	223,130	2020年7月8日	—	382
USD ^(注)	35,874	GBP 28,846	35,739	2020年7月8日	—	135
USD ^(注)	1,654	SGD 2,304	1,653	2020年7月8日	—	1
USD ^(注)	44,095	EUR 39,125	43,960	2020年7月8日	—	135
USD ^(注)	589,311	EUR 522,891	587,508	2020年7月8日	—	1,803
USD ^(注)	891,019	EUR 790,593	888,293	2020年7月8日	—	2,726
USD ^(注)	1,571	SGD 2,188	1,571	2020年7月8日	—	—
USD ^(注)	2,565	SGD 3,574	2,565	2020年7月8日	—	—
USD ^(注)	1,221,761	EUR 1,084,058	1,218,023	2020年7月8日	—	3,738
USD ^(注)	4,738,499	EUR 4,202,194	4,721,491	2020年7月8日	—	17,008
USD ^(注)	3,324,834	EUR 2,948,528	3,312,900	2020年7月8日	—	11,934
USD ^(注)	36,176	SGD 50,378	36,158	2020年7月8日	—	18
合計					0.61	27,130,555
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計						4,162,803,762

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0%; USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Citibank					
AUD ⁽²⁾ _{CA}	36 USD	25	2020年7月8日	—	—
AUD ⁽²⁾ _{CA}	450 USD	312	2020年7月8日	—	(2)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	300 USD	208	2020年7月8日	—	(1)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	771,789 USD	532,574	2020年7月8日	—	(98)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	5,200 USD	3,588	2020年7月8日	—	(1)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	40,871 USD	28,203	2020年7月8日	—	(5)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	5,018 USD	3,475	2020年7月8日	—	(13)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	18,602 USD	12,949	2020年7月8日	—	(115)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	323,974 USD	225,528	2020年7月8日	—	(2,011)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,950 USD	2,750	2020年7月8日	—	(25)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	51,529 USD	36,007	2020年7月8日	—	(456)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	968,379 USD	676,677	2020年7月8日	—	(8,569)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	6,573 USD	4,593	2020年7月8日	—	(58)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	19,035 USD	13,198	2020年7月8日	—	(66)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	357,590 USD	247,944	2020年7月8日	—	(1,234)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,436 USD	1,689	2020年7月8日	—	(8)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	750 USD	527	2020年7月8日	—	(9)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	263,439 USD	183,388	2020年7月8日	—	(1,635)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	850 USD	592	2020年7月8日	—	(5)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,150 USD	806	2020年7月8日	—	(12)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,900 USD	1,312	2020年7月8日	—	(1)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,022 USD	706	2020年7月8日	—	(1)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	441,563 USD	305,153	2020年7月8日	—	(508)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,170 USD	2,191	2020年7月8日	—	(4)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	24,823 USD	17,155	2020年7月8日	—	(29)
AUD ⁽²⁾ _{CA}	5,846 USD	4,049	2020年7月8日	—	(15)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	203,230 USD	150,550	2020年7月8日	—	(821)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	118,460 USD	87,753	2020年7月8日	—	(478)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	393,150 USD	291,093	2020年7月8日	—	(1,441)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	227,786 USD	168,656	2020年7月8日	—	(835)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	150,278 USD	111,300	2020年7月8日	—	(583)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	489,759 USD	365,570	2020年7月8日	—	(4,741)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	284,996 USD	212,729	2020年7月8日	—	(2,759)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	183,817 USD	136,718	2020年7月8日	—	(1,291)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	60,044 USD	44,938	2020年7月8日	—	(700)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	107,106 USD	79,621	2020年7月8日	—	(711)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	184,803 USD	137,380	2020年7月8日	—	(1,227)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	620,545 USD	458,302	2020年7月8日	—	(1,117)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	288,128 USD	212,796	2020年7月8日	—	(519)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	99,056 USD	73,051	2020年7月8日	—	(71)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	1,920 USD	1,419	2020年7月8日	—	(4)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	911,074 USD	671,651	2020年7月8日	—	(419)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	19,174 USD	14,149	2020年7月8日	—	(23)
CAD ⁽²⁾ _{CA}	137,831 USD	101,568	2020年7月8日	—	(21)

CAD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	233,353	USD	171,959	171,923	2020年7月8日	—	(36)
CNH ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	5,592	USD	791	791	2020年7月8日	—	—
CNH ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	630	USD	89	89	2020年7月8日	—	—
CNH ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	1,219	USD	173	173	2020年7月8日	—	—
CNH ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	1,433	USD	203	203	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2	USD	3	3	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2	USD	3	3	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	359	USD	404	403	2020年7月8日	—	(1)
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	377	USD	425	424	2020年7月8日	—	(1)
EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	63,034	USD	70,899	70,823	2020年7月8日	—	(76)

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0%; USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	573,594 USD	645,167	644,477	2020年7月8日	— (690)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	128,227 USD	144,227	144,073	2020年7月8日	— (154)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,300 USD	4,837	4,832	2020年7月8日	— (5)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	176,817 USD	198,880	198,667	2020年7月8日	— (213)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	17,984 USD	20,387	20,206	2020年7月8日	— (181)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	461,954 USD	523,690	519,041	2020年7月8日	— (4,649)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	171,148 USD	194,020	192,298	2020年7月8日	— (1,722)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	287,910 USD	326,387	323,490	2020年7月8日	— (2,897)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	28,469 USD	32,168	31,987	2020年7月8日	— (181)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	60,629 USD	68,507	68,122	2020年7月8日	— (385)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,655 USD	4,130	4,107	2020年7月8日	— (23)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	154,032 USD	174,045	173,066	2020年7月8日	— (979)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	112,883 USD	127,550	126,833	2020年7月8日	— (717)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	331,014 USD	374,023	371,920	2020年7月8日	— (2,103)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	42,118 USD	47,609	47,323	2020年7月8日	— (286)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	855 USD	966	960	2020年7月8日	— (6)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	813 USD	919	913	2020年7月8日	— (6)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,045,690 USD	3,442,741	3,422,067	2020年7月8日	— (20,674)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	535,440 USD	605,243	601,608	2020年7月8日	— (3,635)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	820,537 USD	927,507	921,937	2020年7月8日	— (5,570)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,119,127 USD	1,265,022	1,257,425	2020年7月8日	— (7,597)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,290,693 USD	4,850,049	4,820,924	2020年7月8日	— (29,125)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	301,824 USD	340,681	339,123	2020年7月8日	— (1,558)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	321 USD	362	360	2020年7月8日	— (2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	197,533 USD	222,964	221,944	2020年7月8日	— (1,020)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	15,792 USD	17,825	17,743	2020年7月8日	— (82)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,142,126 USD	1,289,163	1,283,266	2020年7月8日	— (5,897)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	414,711 USD	468,101	465,960	2020年7月8日	— (2,141)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	305 USD	344	342	2020年7月8日	— (2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,589,484 USD	1,794,114	1,785,907	2020年7月8日	— (8,207)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	117,082 USD	132,339	131,551	2020年7月8日	— (788)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	245,156 USD	277,103	275,452	2020年7月8日	— (1,651)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	23,610 USD	26,686	26,527	2020年7月8日	— (159)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	45,814 USD	51,784	51,476	2020年7月8日	— (308)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	30,184 USD	34,118	33,915	2020年7月8日	— (203)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	355,849 USD	402,219	399,823	2020年7月8日	— (2,396)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	75,877 USD	86,073	85,254	2020年7月8日	— (819)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	87,373 USD	99,114	98,171	2020年7月8日	— (943)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	41,500 USD	47,076	46,628	2020年7月8日	— (448)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	403,185 USD	457,361	453,009	2020年7月8日	— (4,352)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	646,664 USD	736,877	726,577	2020年7月8日	— (10,300)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	45,599 USD	51,961	51,235	2020年7月8日	— (726)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	140,661 USD	160,284	158,044	2020年7月8日	— (2,240)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	19,647 USD	22,217	22,075	2020年7月8日	— (142)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	46,962 USD	53,105	52,766	2020年7月8日	— (339)

EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	258,949	USD	292,817	290,949	2020年7月8日	—	(1,868)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	47,527	USD	53,743	53,400	2020年7月8日	—	(343)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	253,863	USD	287,066	285,235	2020年7月8日	—	(1,831)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	253,416	USD	285,338	284,732	2020年7月8日	—	(606)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	30,385	USD	34,212	34,139	2020年7月8日	—	(73)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	47,273	USD	53,228	53,115	2020年7月8日	—	(113)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	680,060	USD	765,727	764,100	2020年7月8日	—	(1,627)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	237,555	USD	267,441	266,912	2020年7月8日	—	(529)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	495,682	USD	558,091	556,937	2020年7月8日	—	(1,154)
EUR ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	1,902,835	USD	2,142,411	2,137,981	2020年7月8日	—	(4,430)

^{(2)(S)}_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0%; USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	18,597 USD	20,938	20,895	2020年7月8日	— (43)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,344,213 USD	1,513,457	1,510,328	2020年7月8日	— (3,129)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	362,899 USD	408,590	407,745	2020年7月8日	— (845)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	99,096 USD	112,179	111,341	2020年7月8日	— (838)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	15,063 USD	17,052	16,925	2020年7月8日	— (127)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	105 USD	119	118	2020年7月8日	— (1)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,577 USD	2,917	2,895	2020年7月8日	— (22)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	240,385 USD	272,123	270,091	2020年7月8日	— (2,032)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	51,563 USD	57,952	57,935	2020年7月8日	— (17)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,024 USD	1,151	1,151	2020年7月8日	— —
EUR ⁽²⁾ _{CA}	974 USD	1,095	1,095	2020年7月8日	— —
EUR ⁽²⁾ _{CA}	3,822,959 USD	4,296,658	4,295,389	2020年7月8日	— (1,269)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	544,559 USD	612,035	611,854	2020年7月8日	— (181)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,031,117 USD	1,158,881	1,158,539	2020年7月8日	— (342)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,135,912 USD	1,276,661	1,276,284	2020年7月8日	— (377)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	5,413,905 USD	6,084,736	6,082,939	2020年7月8日	— (1,797)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	548,431 USD	617,742	616,205	2020年7月8日	— (1,537)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	77,491 USD	87,284	87,067	2020年7月8日	— (217)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	161,786 USD	182,233	181,780	2020年7月8日	— (453)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	70,381 USD	79,276	79,079	2020年7月8日	— (197)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	199,507 USD	224,266	224,162	2020年7月8日	— (104)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	114,824 USD	129,074	129,014	2020年7月8日	— (60)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	41,901 USD	47,101	47,079	2020年7月8日	— (22)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	97,311 USD	109,388	109,337	2020年7月8日	— (51)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	63,230 USD	71,077	71,044	2020年7月8日	— (33)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	23,228 USD	26,111	26,099	2020年7月8日	— (12)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,345,753 USD	1,515,385	1,512,057	2020年7月8日	— (3,328)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	50,858 USD	57,269	57,143	2020年7月8日	— (126)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,066 USD	2,327	2,322	2020年7月8日	— (5)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	612,208 USD	689,377	687,863	2020年7月8日	— (1,514)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	191,276 USD	216,275	214,913	2020年7月8日	— (1,362)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	279,944 USD	316,532	314,538	2020年7月8日	— (1,994)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	27,635 USD	31,247	31,050	2020年7月8日	— (197)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	517,893 USD	585,392	581,892	2020年7月8日	— (3,500)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	19,052 USD	21,535	21,406	2020年7月8日	— (129)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	399 USD	451	448	2020年7月8日	— (3)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	380 USD	429	426	2020年7月8日	— (3)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,431,223 USD	1,617,762	1,608,090	2020年7月8日	— (9,672)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	247,617 USD	279,890	278,217	2020年7月8日	— (1,673)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	372,906 USD	421,509	418,989	2020年7月8日	— (2,520)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,003,824 USD	2,265,192	2,251,450	2020年7月8日	— (13,742)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	5,466 USD	6,152	6,141	2020年7月8日	— (11)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	106,468 USD	119,829	119,624	2020年7月8日	— (205)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	68,300 USD	76,872	76,741	2020年7月8日	— (131)
EUR ⁽²⁾ _{CA}	86,496 USD	97,351	97,185	2020年7月8日	— (166)

EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	10,953	USD	12,328	12,307	2020年7月8日	—	(21)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	21,506	USD	24,167	24,164	2020年7月8日	—	(3)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	451	USD	507	507	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	429	USD	482	482	2020年7月8日	—	—
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	285,077	USD	320,351	320,307	2020年7月8日	—	(44)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	591,754	USD	664,973	664,881	2020年7月8日	—	(92)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	2,294,316	USD	2,578,197	2,577,841	2020年7月8日	—	(356)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	1,622,992	USD	1,823,970	1,823,556	2020年7月8日	—	(414)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	430,934	USD	484,298	484,188	2020年7月8日	—	(110)
EUR ⁽²⁾ _(C) ⁽⁵⁾ _(A)	54,072	USD	60,757	60,754	2020年7月8日	—	(3)

⁽²⁾_(C)⁽⁵⁾_(A) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年：0%；USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	246,151 USD	276,582	276,569	2020年7月8日	— (13)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	73,931 USD	83,071	83,067	2020年7月8日	— (4)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	31,222 USD	35,082	35,080	2020年7月8日	— (2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,730,794 USD	4,192,032	4,191,834	2020年7月8日	— (198)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	2 USD	2	2	2020年7月8日	— —
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	11,682 USD	14,683	14,474	2020年7月8日	— (209)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	22,893 USD	28,713	28,364	2020年7月8日	— (349)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	28,166 USD	35,711	34,896	2020年7月8日	— (815)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	10,672 USD	13,499	13,222	2020年7月8日	— (277)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	12,672 USD	15,885	15,700	2020年7月8日	— (185)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	34,127 USD	42,836	42,281	2020年7月8日	— (555)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	13,370 USD	16,738	16,565	2020年7月8日	— (173)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	15,169 USD	18,835	18,794	2020年7月8日	— (41)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	15 USD	11	11	2020年7月8日	— —
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	1,052 USD	758	755	2020年7月8日	— (3)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	2,500 USD	1,795	1,795	2020年7月8日	— —
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	1,210 USD	870	868	2020年7月8日	— (2)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	2,273 USD	1,635	1,632	2020年7月8日	— (3)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	3,598 USD	2,588	2,583	2020年7月8日	— (5)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	5,100 USD	3,676	3,660	2020年7月8日	— (16)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	834 USD	599	598	2020年7月8日	— (1)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	1,718 USD	1,238	1,233	2020年7月8日	— (5)
SGD ^{(2)(S)} _(CA)	1,976 USD	1,422	1,419	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3 CNH	21	3	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	21 SGD	30	21	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6 EUR	6	6	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6 EUR	5	6	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	135 CNH	958	135	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	13 SGD	19	13	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	25 CNH	178	25	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	58 AUD	86	60	2020年7月8日	— (2)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	160 SGD	223	160	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	972 EUR	868	975	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	10,616 AUD	15,408	10,630	2020年7月8日	— (14)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	123 AUD	182	125	2020年7月8日	— (2)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	124 GBP	101	125	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	203 EUR	186	209	2020年7月8日	— (6)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	92 EUR	82	92	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	39,919 EUR	35,831	40,259	2020年7月8日	— (340)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	97 EUR	86	97	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6,944 AUD	10,630	7,333	2020年7月8日	— (389)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	911 AUD	1,394	962	2020年7月8日	— (51)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	123,050 AUD	188,325	129,930	2020年7月8日	— (6,880)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	241,067 AUD	367,016	253,213	2020年7月8日	— (12,146)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,045,879 EUR	958,559	1,077,010	2020年7月8日	— (31,131)

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	10,010	EUR	9,174	10,308	2020年7月8日	—	(298)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	193	EUR	177	199	2020年7月8日	—	(6)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	128,503	EUR	117,775	132,328	2020年7月8日	—	(3,825)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	195,935	EUR	179,576	201,767	2020年7月8日	—	(5,832)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	266,803	EUR	244,527	274,744	2020年7月8日	—	(7,941)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	700,918	EUR	642,399	721,781	2020年7月8日	—	(20,863)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	7,499	GBP	6,153	7,624	2020年7月8日	—	(125)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	76,193	CAD	106,781	78,671	2020年7月8日	—	(2,478)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	47,345	CAD	66,352	48,885	2020年7月8日	—	(1,540)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	554	SGD	788	566	2020年7月8日	—	(12)

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債
先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年: 0%; USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	353 SGD	503	360	2020年7月8日	— (7)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	164 CNH	1,179	166	2020年7月8日	— (2)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	98,402 AUD	150,548	103,867	2020年7月8日	— (5,465)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	136,810 CAD	188,700	139,024	2020年7月8日	— (2,214)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	106,653 EUR	97,013	109,001	2020年7月8日	— (2,348)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	11,086 EUR	10,084	11,330	2020年7月8日	— (244)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	17,228 EUR	15,670	17,607	2020年7月8日	— (379)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	393,072 EUR	357,543	401,726	2020年7月8日	— (8,654)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	118 AUD	179	123	2020年7月8日	— (5)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	6,423,818 EUR	5,837,128	6,558,442	2020年7月8日	— (134,624)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	7,657 EUR	6,957	7,817	2020年7月8日	— (160)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	658,051 CAD	905,207	666,909	2020年7月8日	— (8,858)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	12,495 AUD	18,829	12,991	2020年7月8日	— (496)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	454 AUD	682	470	2020年7月8日	— (16)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	454 SGD	633	454	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _{CA}	8,623 AUD	12,944	8,930	2020年7月8日	— (307)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	10,299 EUR	9,244	10,387	2020年7月8日	— (88)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	8,370 EUR	7,513	8,441	2020年7月8日	— (71)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	303 EUR	272	306	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	21,708 EUR	19,485	21,893	2020年7月8日	— (185)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	5,482 EUR	4,921	5,529	2020年7月8日	— (47)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	677 CAD	931	686	2020年7月8日	— (9)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	804 CAD	1,105	814	2020年7月8日	— (10)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	494,109 EUR	444,863	499,837	2020年7月8日	— (5,728)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	55,684 EUR	50,132	56,328	2020年7月8日	— (644)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	53,758 CAD	74,008	54,525	2020年7月8日	— (767)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	11,207 EUR	10,090	11,337	2020年7月8日	— (130)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	34,204 AUD	50,321	34,718	2020年7月8日	— (514)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	646 AUD	950	656	2020年7月8日	— (10)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	13,478 EUR	12,101	13,596	2020年7月8日	— (118)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	25,288 EUR	22,703	25,509	2020年7月8日	— (221)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	17,472 AUD	25,361	17,497	2020年7月8日	— (25)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	310,903 AUD	451,288	311,354	2020年7月8日	— (451)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	718 SGD	1,001	719	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	224 CNH	1,595	225	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	139 CNH	986	139	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(S)} _{CA}	81,123 AUD	117,725	81,221	2020年7月8日	— (98)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	1,543,225 AUD	2,239,512	1,545,093	2020年7月8日	— (1,868)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	1,850 CNH	13,114	1,854	2020年7月8日	— (4)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	305,823 AUD	445,979	307,692	2020年7月8日	— (1,869)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	152,804 CAD	207,706	153,027	2020年7月8日	— (223)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	242,572 AUD	352,291	243,054	2020年7月8日	— (482)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	71,536 AUD	103,893	71,678	2020年7月8日	— (142)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	1,963 AUD	2,853	1,969	2020年7月8日	— (6)
USD ^{(2)(S)} _{CA}	249 AUD	362	250	2020年7月8日	— (1)

USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	34,905	AUD	50,742	35,008	2020年7月8日	—	(103)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	42,342	AUD	61,497	42,428	2020年7月8日	—	(86)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	314,439	EUR	280,553	315,224	2020年7月8日	—	(785)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	408,092	EUR	364,115	409,110	2020年7月8日	—	(1,018)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	3,753	AUD	5,458	3,766	2020年7月8日	—	(13)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	66,924	AUD	97,331	67,151	2020年7月8日	—	(227)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	480	AUD	698	482	2020年7月8日	—	(2)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	22,824	EUR	20,395	22,916	2020年7月8日	—	(92)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	852,876	EUR	762,122	856,303	2020年7月8日	—	(3,427)
USD ^{(2)(S)} _{(C)(A)}	344,804	EUR	307,463	345,458	2020年7月8日	—	(654)

^{(2)(S)}_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債
先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0%；USD (18,296))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ^{(2)(A)}	508,334 EUR	453,283	509,299	2020年7月8日	— (965)
USD ^{(2)(A)}	131,906 EUR	117,621	132,156	2020年7月8日	— (250)
USD ^{(2)(A)}	4,604 EUR	4,106	4,613	2020年7月8日	— (9)
USD ^{(2)(A)}	98,468 EUR	87,804	98,655	2020年7月8日	— (187)
USD ^{(2)(A)}	64,715 EUR	57,706	64,838	2020年7月8日	— (123)
USD ^{(2)(A)}	35,059 CAD	47,605	35,073	2020年7月8日	— (14)
USD ^{(2)(A)}	21,842 CAD	29,658	21,851	2020年7月8日	— (9)
USD ^{(2)(A)}	261 SGD	364	261	2020年7月8日	— —
USD ^{(2)(A)}	37,469 AUD	54,534	37,624	2020年7月8日	— (155)
USD ^{(2)(A)}	4,853 AUD	7,063	4,873	2020年7月8日	— (20)
USD ^{(2)(A)}	663,352 AUD	965,466	666,099	2020年7月8日	— (2,747)
USD ^{(2)(A)}	46,388 EUR	41,396	46,511	2020年7月8日	— (123)
USD ^{(2)(A)}	924 EUR	825	926	2020年7月8日	— (2)
USD ^{(2)(A)}	935,435 EUR	834,761	937,918	2020年7月8日	— (2,483)
USD ^{(2)(A)}	1,282,122 EUR	1,144,137	1,285,525	2020年7月8日	— (3,403)
USD ^{(2)(A)}	619,815 EUR	553,060	621,405	2020年7月8日	— (1,590)
USD ^{(2)(A)}	4,976,986 EUR	4,439,765	4,988,417	2020年7月8日	— (11,431)
USD ^{(2)(A)}	3,497,852 EUR	3,120,012	3,505,573	2020年7月8日	— (7,721)
USD ^{(2)(A)}	220,878 CAD	301,020	221,776	2020年7月8日	— (898)
USD ^{(2)(A)}	367,114 CAD	500,352	368,633	2020年7月8日	— (1,519)
USD ^{(2)(A)}	782 CNH	5,543	784	2020年7月8日	— (2)
USD ^{(2)(A)}	144,856 EUR	129,080	145,031	2020年7月8日	— (175)
USD ^{(2)(A)}	219,955 CAD	300,577	221,449	2020年7月8日	— (1,494)
USD ^{(2)(A)}	629,679 AUD	916,191	632,102	2020年7月8日	— (2,423)
USD ^{(2)(A)}	33,670 GBP	27,323	33,852	2020年7月8日	— (182)
USD ^{(2)(A)}	346,351 CAD	473,302	348,704	2020年7月8日	— (2,353)
USD ^{(2)(A)}	743 CNH	5,261	744	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(A)}	4,805 AUD	6,991	4,823	2020年7月8日	— (18)
USD ^{(2)(A)}	35,526 AUD	51,691	35,663	2020年7月8日	— (137)
USD ^{(2)(A)}	44,880 EUR	39,972	44,911	2020年7月8日	— (31)
USD ^{(2)(A)}	101,845 AUD	148,458	102,425	2020年7月8日	— (580)
USD ^{(2)(A)}	51,791 AUD	75,473	52,071	2020年7月8日	— (280)
USD ^{(2)(A)}	303,293 CAD	414,777	305,586	2020年7月8日	— (2,293)
合計				—	(551,145)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(551,145)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	81.87
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	11.62
OTC金融デリバティブ商品	0.61
その他の資産	5.90
資産合計	100.00

^{(2)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・U Sストラテジック・バリュー・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式 (2019年: 96.91%; USD 117,139,091)			
航空宇宙産業及び防衛			
Raytheon Technologies Corp.	8,752	0.52	539,298
アパレルメーカー			
Levi Strauss & Co.	21,933	0.28	293,902
飲料—アルコール以外			
PepsiCo, Inc.	21,407	2.71	2,831,290
バイオテクノロジー			
Corteva, Inc.	40,238	1.03	1,077,976
放送サービス及びプログラミング			
Fox Corp.	28,700	0.74	770,308
化学—特殊			
NewMarket Corp.	3,611	1.38	1,446,133
W R Grace & Co.	29,018	1.41	1,474,405
		2.79	2,920,538
商業銀行—米国東部			
Citizens Financial Group, Inc.	75,445	1.82	1,904,232
商業銀行—米国南部			
First Horizon National Corp.	125,125	1.19	1,246,245
Pinnacle Financial Partners, Inc.	20,406	0.82	856,848
Regions Financial Corp.	115,437	1.23	1,283,659
		3.24	3,386,752
コンピュータ支援設計			
Synopsys, Inc.	3,575	0.67	697,125
コンピュータ・データ・セキュリティ			
Check Point Software Technologies, Ltd.	14,639	1.50	1,572,668
コンピュータ・サービス			
Cognizant Technology Solutions Corp.	33,702	1.83	1,914,948
コンピュータ・ソフトウェア			
Citrix Systems, Inc.	10,812	1.53	1,599,203
梱包材—紙製及びプラスチック製			
Graphic Packaging Holding Co.	26,071	0.35	364,733
化粧品及びトイレタリー			
Colgate-Palmolive Co.	32,415	2.27	2,374,723
多角的銀行機関			
Citigroup, Inc.	31,435	1.54	1,606,329
電力—送電			
CenterPoint Energy, Inc.	17,259	0.31	322,226
電力—総合			
Alliant Energy Corp.	21,804	1.00	1,043,103
Entergy Corp.	7,512	0.67	704,701
Evergy, Inc.	43,317	2.46	2,568,265
Exelon Corp.	47,334	1.64	1,717,751
		5.77	6,033,820
電子構成部品・機器			
Generac Holdings, Inc.	8,268	0.97	1,008,117
電子計測器			
Agilent Technologies, Inc.	3,773	0.32	333,420
企業向けソフトウェア／サービス			
Oracle Corp.	43,400	2.30	2,398,718
エンターテインメント・ソフトウェア			
Electronic Arts, Inc.	12,405	1.57	1,638,080
ろ過・分離製品			
Donaldson Co., Inc.	8,530	0.38	396,816
金融—クレジット・カード			
Discover Financial Services	27,556	1.32	1,380,280

ジャナス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
金融－投資銀行／証券会社			
Charles Schwab Corp.	46,504	1.50	1,569,045
食品－その他／各種			
Cal-Maine Foods, Inc.	31,820	1.35	1,415,354
Lamb Weston Holdings, Inc.	27,996	1.71	1,789,784
		3.06	3,205,138
制御機器			
Honeywell International, Inc.	5,181	0.72	749,121
インターネット・インフラストラクチャー・ソフトウェア			
F5 Networks, Inc.	14,214	1.90	1,982,569
リネンサプライ及び関連商品			
UniFirst Corp.	11,487	1.97	2,055,599
工作機械及び関連製品			
Lincoln Electric Holdings, Inc.	6,535	0.53	550,508
機械－電力会社			
BWX Technologies, Inc.	33,536	1.82	1,899,479
医療－生体臨床医学及び遺伝学			
Gilead Sciences, Inc.	22,305	1.64	1,716,147
医療－医薬品			
Coherus Biosciences, Inc.	18,606	0.32	332,303
Johnson & Johnson	22,120	2.98	3,110,736
Merck & Co., Inc.	27,995	2.07	2,164,853
Pfizer, Inc.	99,332	3.11	3,248,156
		8.48	8,856,048
医療－HMO			
Humana, Inc.	3,583	1.33	1,389,308
医療情報システム			
Cerner Corp.	4,532	0.30	310,669
医療検査サービス			
Laboratory Corp. of America Holdings	31,994	5.09	5,314,523
医療用品			
Stryker Corp.	3,344	0.58	602,555
マルチライン(生／損保併営)保険会社			
Chubb, Ltd.	23,199	2.81	2,937,457
Hartford Financial Services Group, Inc.	27,542	1.02	1,061,744
		3.83	3,999,201
無害廃棄物処理			
Waste Connections, Inc.	5,869	0.53	550,454
石油－油田サービス			
Schlumberger, Ltd.	57,833	1.02	1,063,549
石油会社－探査及び生産			
Brigham Minerals, Inc.	69,156	0.82	854,077
油田機器			
Thermon Group Holdings, Inc.	47,690	0.67	694,843
石油精製及び販売			
Valero Energy Corp.	5,263	0.30	309,570
損害保険			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	17,234	2.95	3,076,441
再保険			
Renaissancere Holdings, Ltd.	4,321	0.71	739,021
REIT－アパート			
Camden Property Trust	3,562	0.31	324,926
REIT－各種			
Lamar Advertising Co.	39,350	2.50	2,627,006
Weyerhaeuser Co.	16,724	0.36	375,621
		2.86	3,002,627
REIT－ホテル			
Sunstone Hotel Investors, Inc.	40,908	0.32	333,400
REIT－プレハブ住宅			
Equity LifeStyle Properties, Inc.	40,693	2.43	2,542,499

ジャナス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
REIT－オフィス・ビル Equity Commonwealth	86,322	2.66	2,779,568
REIT－保管 Public Storage	7,903	1.45	1,516,507
REIT－倉庫及び物流 Americold Realty Trust	42,447	1.48	1,540,826
小売り－コンビニエンス・ストア Casey's General Stores, Inc.	16,583	2.37	2,479,490
半導体部品／集積回路 Analog Devices, Inc.	11,371	1.33	1,394,539
Maxim Integrated Products	9,325	0.54	565,188
		1.87	1,959,727
大型地域銀行 U.S. Bancorp.	20,446	0.72	752,822
Wells Fargo & Co.	36,249	0.89	927,974
		1.61	1,680,796
運輸－鉄道 Union Pacific Corp.	6,239	1.01	1,054,828
ウェブ・ポータル／インターネット・サービス・プロバイダー Alphabet, Inc. - Class A	2,226	3.02	3,156,579
普通株式合計		96.90	101,225,140
政府発行証券（2019年：3.14%；USD 3,800,000）			
投資有価証券合計（取得原価：USD 90,583,749）		96.90	101,225,140

ジャナス・ヘンダーソン・U Sストラテジック・バリュー・ファンド

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0.09%; USD 108,409)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citibank					
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	111 USD	125	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	856 USD	960	2020年7月8日	—	2
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	1,736 USD	1,945	2020年7月8日	—	5
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	1,008 USD	1,109	2020年7月8日	—	24
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	4,764 USD	5,239	2020年7月8日	—	113
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	41,539 USD	45,293	2020年7月8日	—	1,379
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	606,817 USD	661,659	2020年7月8日	0.02	20,148
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	198,468 USD	216,404	2020年7月8日	0.01	6,590
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	7,744,872 USD	8,444,814	2020年7月8日	0.25	257,145
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	1,999 USD	2,181	2020年7月8日	—	65
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	14,715 USD	16,183	2020年7月8日	—	350
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	186,996 USD	205,657	2020年7月8日	—	4,447
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	979 USD	1,078	2020年7月8日	—	21
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	14,294 USD	15,749	2020年7月8日	—	312
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	4,664 USD	5,138	2020年7月8日	—	102
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	180,889 USD	199,295	2020年7月8日	—	3,948
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	366 USD	410	2020年7月8日	—	1
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	5,247 USD	5,879	2020年7月8日	—	16
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	67,364 USD	75,485	2020年7月8日	—	203
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	12,273 USD	13,764	2020年7月8日	—	25
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	4,074 USD	4,569	2020年7月8日	—	8
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	157,785 USD	176,956	2020年7月8日	—	327
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	591 USD	662	2020年7月8日	—	2
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	8,136 USD	9,118	2020年7月8日	—	23
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	2,785 USD	3,121	2020年7月8日	—	8
EUR ^{(2)(S)} _{CA}	106,795 USD	119,691	2020年7月8日	—	301
USD ^{(2)(S)} _{CA}	150 EUR	134	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(S)} _{CA}	37 EUR	33	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(S)} _{CA}	465 EUR	413	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _{CA}	995 EUR	874	2020年7月8日	—	13
USD ^{(2)(S)} _{CA}	13,751 EUR	12,201	2020年7月8日	—	42
USD ^{(2)(S)} _{CA}	7,479 EUR	6,645	2020年7月8日	—	13
USD ^{(2)(S)} _{CA}	226 EUR	200	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(S)} _{CA}	527 EUR	467	2020年7月8日	—	3
USD ^{(2)(S)} _{CA}	61,554 EUR	54,262	2020年7月8日	—	586
USD ^{(2)(S)} _{CA}	884 EUR	778	2020年7月8日	—	10
USD ^{(2)(S)} _{CA}	12,687 EUR	11,166	2020年7月8日	—	141
USD ^{(2)(S)} _{CA}	4,234 EUR	3,726	2020年7月8日	—	47
USD ^{(2)(S)} _{CA}	163,492 EUR	143,888	2020年7月8日	—	1,823
USD ^{(2)(S)} _{CA}	14,275 EUR	12,539	2020年7月8日	—	187
USD ^{(2)(S)} _{CA}	4,762 EUR	4,182	2020年7月8日	—	62
USD ^{(2)(S)} _{CA}	182,741 EUR	160,499	2020年7月8日	—	2,407
USD ^{(2)(S)} _{CA}	14,230 EUR	12,488	2020年7月8日	—	199
USD ^{(2)(S)} _{CA}	3,047 EUR	2,692	2020年7月8日	—	22
USD ^{(2)(S)} _{CA}	42,859 EUR	37,872	2020年7月8日	—	307

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	14,553	EUR	12,860	14,449	2020年7月8日	—	104
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	562,299	EUR	496,874	558,277	2020年7月8日	—	4,022
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	48,582	EUR	42,916	48,219	2020年7月8日	—	363
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	22,329	EUR	19,823	22,273	2020年7月8日	—	56
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	7,992	EUR	7,110	7,988	2020年7月8日	—	4
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	6,541	EUR	5,813	6,532	2020年7月8日	—	9
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,230	EUR	1,982	2,227	2020年7月8日	—	3
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	85,545	EUR	76,028	85,424	2020年7月8日	—	121
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	7,639	EUR	6,762	7,598	2020年7月8日	—	41

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.09%；USD 108,409)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
USD ^(注)	997	EUR 885	994	2020年7月8日	— 3
USD ^(注)	4,767	EUR 4,230	4,752	2020年7月8日	— 15
USD ^(注)	181,531	EUR 161,071	180,976	2020年7月8日	— 555
USD ^(注)	37,463	EUR 33,341	37,461	2020年7月8日	— 2
合計				0.28	306,727
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					101,531,867

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・U Sストラテジック・バリュー・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年：0%；USD (359))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Citibank					
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	465 USD	522	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,406 USD	7,198	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,378 USD	1,564	2020年7月8日	—	(15)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	292 USD	330	2020年7月8日	—	(2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	5,051 USD	5,689	2020年7月8日	—	(14)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	291 USD	330	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,172 USD	4,734	2020年7月8日	—	(47)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	53,514 USD	60,725	2020年7月8日	—	(598)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,010 USD	1,142	2020年7月8日	—	(7)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	14,488 USD	16,377	2020年7月8日	—	(98)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,811 USD	5,438	2020年7月8日	—	(33)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	186,281 USD	210,566	2020年7月8日	—	(1,264)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	564 USD	637	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	8,089 USD	9,131	2020年7月8日	—	(42)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,660 USD	3,002	2020年7月8日	—	(14)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	103,560 USD	116,892	2020年7月8日	—	(535)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	47,766 USD	54,429	2020年7月8日	—	(761)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	5,037 USD	5,696	2020年7月8日	—	(36)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	12,452 USD	14,021	2020年7月8日	—	(30)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	725 USD	816	2020年7月8日	—	(2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	133,544 USD	150,345	2020年7月8日	—	(298)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	10,188 USD	11,471	2020年7月8日	—	(24)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,447 USD	3,881	2020年7月8日	—	(8)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	432 USD	488	2020年7月8日	—	(4)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,061 USD	6,861	2020年7月8日	—	(50)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,026 USD	2,294	2020年7月8日	—	(17)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	79,168 USD	89,608	2020年7月8日	—	(656)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	8,904 USD	10,007	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,010 USD	3,383	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	116,233 USD	130,635	2020年7月8日	—	(39)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	633 USD	712	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,206 USD	2,479	2020年7月8日	—	—
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	84,316 USD	94,749	2020年7月8日	—	(13)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	18 EUR	16	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(S)} _(CA)	64 EUR	59	2020年7月8日	—	(2)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	79 EUR	71	2020年7月8日	—	(1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	— EUR	—	2020年7月8日	—	—
USD ^{(2)(S)} _(CA)	317 EUR	291	2020年7月8日	—	(9)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	123 EUR	110	2020年7月8日	—	(1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	389 EUR	349	2020年7月8日	—	(4)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,356 EUR	1,211	2020年7月8日	—	(4)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	267 EUR	238	2020年7月8日	—	(1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	154 EUR	138	2020年7月8日	—	(1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	274 EUR	245	2020年7月8日	—	(2)

USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	938	EUR	859	966	2020年7月8日	—	(28)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	12,155	EUR	11,140	12,517	2020年7月8日	—	(362)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	67,183	EUR	61,111	68,662	2020年7月8日	—	(1,479)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	12,573	EUR	11,348	12,750	2020年7月8日	—	(177)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	2,253	EUR	2,023	2,272	2020年7月8日	—	(19)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	748	EUR	671	754	2020年7月8日	—	(6)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	28,737	EUR	25,795	28,982	2020年7月8日	—	(245)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	1,132	EUR	1,018	1,144	2020年7月8日	—	(12)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	14,810	EUR	13,318	14,965	2020年7月8日	—	(155)
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	8,034	EUR	7,234	8,127	2020年7月8日	—	(93)

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・USストラテジック・バリュー・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年：0%；USD (359))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	8,582 EUR	7,705	8,657	2020年7月8日	— (75)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	4,021 EUR	3,595	4,039	2020年7月8日	— (18)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	96 EUR	86	96	2020年7月8日	— —
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	471 EUR	421	472	2020年7月8日	— (1)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	17,875 EUR	15,956	17,928	2020年7月8日	— (53)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	5,676 EUR	5,072	5,699	2020年7月8日	— (23)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	72,720 EUR	64,982	73,012	2020年7月8日	— (292)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	372 EUR	332	373	2020年7月8日	— (1)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	5,238 EUR	4,671	5,248	2020年7月8日	— (10)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	1,788 EUR	1,594	1,791	2020年7月8日	— (3)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	68,481 EUR	61,065	68,611	2020年7月8日	— (130)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	232,519 EUR	207,495	233,136	2020年7月8日	— (617)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	1,277 EUR	1,140	1,280	2020年7月8日	— (3)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	17,820 EUR	15,902	17,867	2020年7月8日	— (47)
USD ⁽²⁾⁽³⁾ _(CA)	6,105 EUR	5,448	6,121	2020年7月8日	— (16)
合計				—	(8,508)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(8,508)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	95.61
OTC金融デリバティブ商品	0.29
その他の資産	4.10
資産合計	100.00

⁽²⁾⁽³⁾_(CA) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・U S フォーティ・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式 (2019年: 98.09%; USD 372,962,914)			
航空宇宙産業及び防衛—機械装置			
L3Harris Technologies, Inc.	61,651	2.08	10,460,325
アプリケーション・ソフトウェア			
Microsoft Corp.	195,125	7.89	39,709,889
Salesforce.com, Inc.	97,975	3.65	18,353,657
		11.54	58,063,546
スポーツ・シューズ			
NIKE, Inc. - Class B	90,418	1.76	8,865,485
建築製品—セメント及び骨材			
Vulcan Materials Co.	32,195	0.74	3,729,791
携帯電話通信			
T-Mobile U.S., Inc.	116,398	2.41	12,122,852
コーティング及び塗料製品			
Sherwin-Williams Co.	17,477	2.01	10,099,084
商業サービス			
CoStar Group, Inc.	14,611	2.06	10,383,599
商業サービス—金融			
Avalara, Inc.	47,946	1.27	6,381,133
PayPal Holdings, Inc.	40,221	1.39	7,007,705
		2.66	13,388,838
コンピュータ			
Apple, Inc.	80,547	5.84	29,383,546
化粧品及びトイレタリー			
Procter & Gamble Co.	80,567	1.91	9,633,396
診断装置			
Danaher Corp.	73,977	2.60	13,081,353
Eコマース／製品			
Amazon.com, Inc.	14,532	7.97	40,091,172
Eコマース／サービス			
Booking Holdings, Inc.	3,866	1.22	6,155,986
Match Group, Inc.	48,828	1.04	5,227,037
		2.26	11,383,023
電子構成部品—半導体			
Microchip Technology, Inc.	40,278	0.84	4,241,676
NVIDIA Corp.	27,325	2.06	10,381,041
Texas Instruments, Inc.	86,643	2.19	11,001,062
投資有価証券合計		5.09	25,623,779
電子フォーム			
Adobe, Inc.	40,609	3.50	17,677,504
金融—クレジット・カード			
Mastercard, Inc. - Class A	99,781	5.86	29,505,242
産業用オーディオ・ビデオ製品			
Cognex Corp.	52,435	0.62	3,131,418
インターネット・コンテンツ—エンターテインメント			
Facebook, Inc.	57,195	2.58	12,987,269
Netflix, Inc.	30,966	2.80	14,090,769
Snap, Inc.	311,250	1.45	7,311,263
		6.83	34,389,301
医療—医薬品			
Merck & Co., Inc.	116,335	1.79	8,996,186
Zoetis, Inc.	60,905	1.66	8,346,421
		3.45	17,342,607

ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
医療機器			
Boston Scientific Corp.	482,937	3.37	16,955,918
Edwards Lifesciences Corp.	51,438	0.71	3,554,880
Intuitive Surgical, Inc.	15,548	1.76	8,859,717
		5.84	29,370,515
医療用品			
Cooper Cos, Inc.	21,984	1.24	6,235,542
マルチメディア			
Walt Disney Co.	53,771	1.19	5,996,004
プライベート・エクイティ			
Blackstone Group, Inc.	204,258	2.30	11,573,258
REIT－各種			
American Tower Corp.	56,231	2.89	14,537,963
小売り－アパレル・靴			
lululemon athletica, Inc.	12,354	0.77	3,854,572
小売り－建材製品			
Home Depot, Inc.	51,884	2.58	12,997,461
半導体装置			
ASML Holding N.V.	31,325	2.29	11,528,540
Lam Research Corp.	15,745	1.01	5,092,878
		3.30	16,621,418
テキスタイル－アパレル			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton S.A.	24,161	2.10	10,581,550
動物用診断薬等			
Elanco Animal Health, Inc.	271,829	1.16	5,830,732
ウェブ・ポータル／インターネット・サービス・プロバイダー			
Alphabet, Inc. - Class C	13,962	3.92	19,736,823
普通株式合計		98.48	495,691,699
G政府発行証券（2019年：1.95%；USD 7,400,000）			
投資有価証券合計（取得原価：USD 334,907,289）		98.48	495,691,699

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年: 0.09%; USD 344,014)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citibank							
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,256	USD	2,867	2,937	2020年7月8日	—	70
AUD ⁽²⁾ _{CA}	303,512	USD	198,102	209,400	2020年7月8日	—	11,298
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,014	USD	1,317	1,390	2020年7月8日	—	73
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,778	USD	1,838	1,917	2020年7月8日	—	79
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,374	USD	2,320	2,328	2020年7月8日	—	8
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,877	USD	2,639	2,674	2020年7月8日	—	35
AUD ⁽²⁾ _{CA}	6,021	USD	4,146	4,155	2020年7月8日	—	9
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,582	USD	1,774	1,781	2020年7月8日	—	7
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,090	USD	2,818	2,822	2020年7月8日	—	4
AUD ⁽²⁾ _{CA}	3,717	USD	2,547	2,565	2020年7月8日	—	18
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,300	USD	1,425	1,461	2020年7月8日	—	36
EUR ⁽²⁾ _{CA}	335	USD	366	377	2020年7月8日	—	11
EUR ⁽²⁾ _{CA}	300	USD	330	337	2020年7月8日	—	7
EUR ⁽²⁾ _{CA}	100	USD	111	112	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾ _{CA}	51,038	USD	55,650	57,345	2020年7月8日	—	1,695
EUR ⁽²⁾ _{CA}	3,472,256	USD	3,786,061	3,901,347	2020年7月8日	0.02	115,286
EUR ⁽²⁾ _{CA}	32,769	USD	35,730	36,818	2020年7月8日	—	1,088
EUR ⁽²⁾ _{CA}	785,730	USD	856,740	882,828	2020年7月8日	0.01	26,088
EUR ⁽²⁾ _{CA}	31,873,278	USD	34,753,825	35,812,082	2020年7月8日	0.21	1,058,257
EUR ⁽²⁾ _{CA}	13,751	USD	15,004	15,451	2020年7月8日	—	447
EUR ⁽²⁾ _{CA}	22,951	USD	25,045	25,787	2020年7月8日	—	742
EUR ⁽²⁾ _{CA}	5,163	USD	5,634	5,801	2020年7月8日	—	167
EUR ⁽²⁾ _{CA}	216	USD	236	243	2020年7月8日	—	7
EUR ⁽²⁾ _{CA}	209,495	USD	228,609	235,384	2020年7月8日	—	6,775
EUR ⁽²⁾ _{CA}	218,265	USD	239,954	245,238	2020年7月8日	—	5,284
EUR ⁽²⁾ _{CA}	290,402	USD	319,921	326,289	2020年7月8日	—	6,368
EUR ⁽²⁾ _{CA}	463	USD	510	520	2020年7月8日	—	10
EUR ⁽²⁾ _{CA}	302	USD	332	339	2020年7月8日	—	7
EUR ⁽²⁾ _{CA}	7,080	USD	7,801	7,956	2020年7月8日	—	155
EUR ⁽²⁾ _{CA}	32,112	USD	35,380	36,081	2020年7月8日	—	701
EUR ⁽²⁾ _{CA}	49,342	USD	54,671	55,440	2020年7月8日	—	769
EUR ⁽²⁾ _{CA}	467	USD	520	525	2020年7月8日	—	5
EUR ⁽²⁾ _{CA}	723	USD	805	813	2020年7月8日	—	8
EUR ⁽²⁾ _{CA}	455,898	USD	507,288	512,236	2020年7月8日	—	4,948
EUR ⁽²⁾ _{CA}	11,137	USD	12,393	12,514	2020年7月8日	—	121
EUR ⁽²⁾ _{CA}	49,441	USD	55,014	55,551	2020年7月8日	—	537
EUR ⁽²⁾ _{CA}	83,118	USD	92,319	93,389	2020年7月8日	—	1,070
EUR ⁽²⁾ _{CA}	58,233	USD	64,863	65,429	2020年7月8日	—	566
EUR ⁽²⁾ _{CA}	376	USD	421	422	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾ _{CA}	39,919	USD	44,732	44,852	2020年7月8日	—	120
EUR ⁽²⁾ _{CA}	365,976	USD	410,098	411,203	2020年7月8日	—	1,105
EUR ⁽²⁾ _{CA}	577	USD	646	648	2020年7月8日	—	2
EUR ⁽²⁾ _{CA}	8,886	USD	9,958	9,985	2020年7月8日	—	27
EUR ⁽²⁾ _{CA}	330	USD	370	371	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾ _{CA}	7,884	USD	8,842	8,858	2020年7月8日	—	16

EUR ^(Z) _(CA)	510	USD	572	573	2020年7月8日	—	1
EUR ^(Z) _(CA)	323,594	USD	362,945	363,583	2020年7月8日	—	638
EUR ^(Z) _(CA)	34,966	USD	39,218	39,287	2020年7月8日	—	69
EUR ^(Z) _(CA)	431	USD	483	484	2020年7月8日	—	1
EUR ^(Z) _(CA)	279	USD	313	314	2020年7月8日	—	1
EUR ^(Z) _(CA)	270,884	USD	303,638	304,359	2020年7月8日	—	721
EUR ^(Z) _(CA)	6,626	USD	7,428	7,446	2020年7月8日	—	18
EUR ^(Z) _(CA)	29,674	USD	33,262	33,341	2020年7月8日	—	79
EUR ^(Z) _(CA)	6,662	USD	7,477	7,486	2020年7月8日	—	9
EUR ^(Z) _(CA)	2,528	USD	2,838	2,840	2020年7月8日	—	2
EUR ^(Z) _(CA)	391,827	USD	439,144	440,248	2020年7月8日	—	1,104

^(Z)_(CA) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉

(2019年：0.09%；USD 344,014)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
EUR ^(注)	404 USD	453	454	2020年7月8日	— 1
EUR ^(注)	622 USD	698	700	2020年7月8日	— 2
EUR ^(注)	42,924 USD	48,107	48,228	2020年7月8日	— 121
EUR ^(注)	9,590 USD	10,748	10,775	2020年7月8日	— 27
USD ^(注)	755 EUR	666	749	2020年7月8日	— 6
USD ^(注)	3,228 EUR	2,853	3,205	2020年7月8日	— 23
USD ^(注)	173,968 EUR	154,669	173,782	2020年7月8日	— 186
USD ^(注)	2,779 AUD	3,989	2,751	2020年7月8日	— 28
USD ^(注)	11,695 EUR	10,327	11,604	2020年7月8日	— 91
USD ^(注)	51,400 EUR	45,391	51,000	2020年7月8日	— 400
USD ^(注)	485 EUR	429	481	2020年7月8日	— 4
USD ^(注)	476,640 EUR	420,915	472,931	2020年7月8日	— 3,709
USD ^(注)	11,142 EUR	9,829	11,043	2020年7月8日	— 99
USD ^(注)	220,385 EUR	194,895	218,979	2020年7月8日	— 1,406
USD ^(注)	4,340 EUR	3,838	4,312	2020年7月8日	— 28
USD ^(注)	51,328 EUR	45,356	50,961	2020年7月8日	— 367
USD ^(注)	220,420 EUR	194,774	218,844	2020年7月8日	— 1,576
USD ^(注)	2,080 EUR	1,838	2,065	2020年7月8日	— 15
USD ^(注)	2,046,622 EUR	1,808,494	2,031,985	2020年7月8日	— 14,637
USD ^(注)	56,198 EUR	49,910	56,079	2020年7月8日	— 119
USD ^(注)	1,029 EUR	914	1,026	2020年7月8日	— 3
USD ^(注)	26,731 EUR	23,732	26,664	2020年7月8日	— 67
USD ^(注)	9,469 EUR	8,409	9,448	2020年7月8日	— 21
USD ^(注)	22,061 EUR	19,591	22,013	2020年7月8日	— 48
USD ^(注)	1,075 EUR	954	1,072	2020年7月8日	— 3
USD ^(注)	113,920 EUR	101,080	113,571	2020年7月8日	— 349
USD ^(注)	1,670 EUR	1,481	1,665	2020年7月8日	— 5
USD ^(注)	25,826 EUR	22,915	25,747	2020年7月8日	— 79
USD ^(注)	1,050,956 EUR	932,504	1,047,740	2020年7月8日	— 3,216
合計				0.24	1,273,308
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					496,965,007

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

損益を通じて公正価値で測定する金融負債
先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年: 0%; USD (176))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Citibank					
AUD ^(2,5) _(CA)	3,056 USD	2,109	2,109	2020年7月8日	—
AUD ^(2,5) _(CA)	6,467 USD	4,519	4,462	2020年7月8日	(57)
AUD ^(2,5) _(CA)	2,069 USD	1,447	1,428	2020年7月8日	(19)
AUD ^(2,5) _(CA)	2,212 USD	1,534	1,526	2020年7月8日	(8)
AUD ^(2,5) _(CA)	2,212 USD	1,529	1,526	2020年7月8日	(3)
AUD ^(2,5) _(CA)	2,663 USD	1,843	1,838	2020年7月8日	(5)
AUD ^(2,5) _(CA)	3,742 USD	2,593	2,582	2020年7月8日	(11)
EUR ^(2,5) _(CA)	30 USD	34	34	2020年7月8日	—
EUR ^(2,5) _(CA)	286 USD	324	322	2020年7月8日	(2)
EUR ^(2,5) _(CA)	1,300 USD	1,464	1,461	2020年7月8日	(3)
EUR ^(2,5) _(CA)	370 USD	418	415	2020年7月8日	(3)
EUR ^(2,5) _(CA)	268 USD	303	302	2020年7月8日	(1)
EUR ^(2,5) _(CA)	450 USD	512	505	2020年7月8日	(7)
EUR ^(2,5) _(CA)	300 USD	337	337	2020年7月8日	—
EUR ^(2,5) _(CA)	300 USD	337	337	2020年7月8日	—
EUR ^(2,5) _(CA)	176 USD	199	198	2020年7月8日	(1)
EUR ^(2,5) _(CA)	6,722 USD	7,596	7,553	2020年7月8日	(43)
EUR ^(2,5) _(CA)	685,299 USD	774,638	769,986	2020年7月8日	(4,652)
EUR ^(2,5) _(CA)	16,791 USD	18,980	18,866	2020年7月8日	(114)
EUR ^(2,5) _(CA)	1,085 USD	1,227	1,220	2020年7月8日	(7)
EUR ^(2,5) _(CA)	74,277 USD	83,960	83,456	2020年7月8日	(504)
EUR ^(2,5) _(CA)	701 USD	792	787	2020年7月8日	(5)
EUR ^(2,5) _(CA)	18,724 USD	21,134	21,037	2020年7月8日	(97)
EUR ^(2,5) _(CA)	14,775 USD	16,700	16,601	2020年7月8日	(99)
EUR ^(2,5) _(CA)	103,976 USD	117,525	116,825	2020年7月8日	(700)
EUR ^(2,5) _(CA)	7,519 USD	8,529	8,448	2020年7月8日	(81)
EUR ^(2,5) _(CA)	21,167 USD	24,011	23,783	2020年7月8日	(228)
EUR ^(2,5) _(CA)	5,361 USD	6,094	6,023	2020年7月8日	(71)
EUR ^(2,5) _(CA)	219,750 USD	249,815	246,907	2020年7月8日	(2,908)
EUR ^(2,5) _(CA)	6,942 USD	7,911	7,800	2020年7月8日	(111)
EUR ^(2,5) _(CA)	5,845 USD	6,657	6,567	2020年7月8日	(90)
EUR ^(2,5) _(CA)	30,992 USD	35,298	34,822	2020年7月8日	(476)
EUR ^(2,5) _(CA)	292 USD	332	328	2020年7月8日	(4)
EUR ^(2,5) _(CA)	233,521 USD	265,967	262,379	2020年7月8日	(3,588)
EUR ^(2,5) _(CA)	400,014 USD	450,378	449,447	2020年7月8日	(931)
EUR ^(2,5) _(CA)	43,505 USD	48,982	48,881	2020年7月8日	(101)
EUR ^(2,5) _(CA)	635 USD	715	714	2020年7月8日	(1)
EUR ^(2,5) _(CA)	410 USD	462	461	2020年7月8日	(1)
EUR ^(2,5) _(CA)	10,079 USD	11,348	11,325	2020年7月8日	(23)
EUR ^(2,5) _(CA)	2,663 USD	2,992	2,992	2020年7月8日	—
EUR ^(2,5) _(CA)	7,752 USD	8,776	8,710	2020年7月8日	(66)
EUR ^(2,5) _(CA)	440 USD	495	495	2020年7月8日	—
EUR ^(2,5) _(CA)	440 USD	498	494	2020年7月8日	(4)
EUR ^(2,5) _(CA)	276,680 USD	313,165	310,872	2020年7月8日	(2,293)

EUR ^(注1) _(注2)	30,442	USD	34,456	34,204	2020年7月8日	—	(252)
EUR ^(注1) _(注2)	6,957	USD	7,874	7,816	2020年7月8日	—	(58)
EUR ^(注1) _(注2)	16,002	USD	17,985	17,980	2020年7月8日	—	(5)
EUR ^(注1) _(注2)	633,992	USD	712,550	712,340	2020年7月8日	—	(210)
EUR ^(注1) _(注2)	1,008	USD	1,133	1,133	2020年7月8日	—	—
EUR ^(注1) _(注2)	68,987	USD	77,535	77,512	2020年7月8日	—	(23)
EUR ^(注1) _(注2)	651	USD	731	731	2020年7月8日	—	—
EUR ^(注1) _(注2)	5,051	USD	5,689	5,675	2020年7月8日	—	(14)
EUR ^(注1) _(注2)	39,429	USD	44,322	44,301	2020年7月8日	—	(21)
EUR ^(注1) _(注2)	627	USD	709	705	2020年7月8日	—	(4)
EUR ^(注1) _(注2)	43,265	USD	48,872	48,612	2020年7月8日	—	(260)

^(注1) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
EUR ^(注1) _(注2)	394,702 USD	445,849	443,478	2020年7月8日	— (2,371)
EUR ^(注1) _(注2)	9,653 USD	10,904	10,846	2020年7月8日	— (58)
EUR ^(注1) _(注2)	407 USD	460	458	2020年7月8日	— (2)
EUR ^(注1) _(注2)	7,190 USD	8,130	8,079	2020年7月8日	— (51)
EUR ^(注1) _(注2)	25,428 USD	28,742	28,570	2020年7月8日	— (172)
EUR ^(注1) _(注2)	5,713 USD	6,457	6,418	2020年7月8日	— (39)
EUR ^(注1) _(注2)	232,694 USD	263,022	261,449	2020年7月8日	— (1,573)
EUR ^(注1) _(注2)	240 USD	271	269	2020年7月8日	— (2)
EUR ^(注1) _(注2)	37,597 USD	42,315	42,243	2020年7月8日	— (72)
EUR ^(注1) _(注2)	681 USD	765	765	2020年7月8日	— —
EUR ^(注1) _(注2)	428,712 USD	481,757	481,691	2020年7月8日	— (66)
EUR ^(注1) _(注2)	46,676 USD	52,451	52,444	2020年7月8日	— (7)
EUR ^(注1) _(注2)	10,522 USD	11,824	11,822	2020年7月8日	— (2)
USD ^(注1) _(注2)	33 EUR	30	34	2020年7月8日	— (1)
USD ^(注1) _(注2)	360 AUD	523	361	2020年7月8日	— (1)
USD ^(注1) _(注2)	468 EUR	429	482	2020年7月8日	— (14)
USD ^(注1) _(注2)	1,573 EUR	1,404	1,577	2020年7月8日	— (4)
USD ^(注1) _(注2)	113 EUR	101	114	2020年7月8日	— (1)
USD ^(注1) _(注2)	89 EUR	80	90	2020年7月8日	— (1)
USD ^(注1) _(注2)	2,586 AUD	3,957	2,731	2020年7月8日	— (145)
USD ^(注1) _(注2)	456,110 EUR	418,029	469,686	2020年7月8日	— (13,576)
USD ^(注1) _(注2)	11,256 EUR	10,316	11,591	2020年7月8日	— (335)
USD ^(注1) _(注2)	49,548 EUR	45,411	51,023	2020年7月8日	— (1,475)
USD ^(注1) _(注2)	730 EUR	669	752	2020年7月8日	— (22)
USD ^(注1) _(注2)	16,816 EUR	15,280	17,168	2020年7月8日	— (352)
USD ^(注1) _(注2)	11,963 EUR	10,707	12,030	2020年7月8日	— (67)
USD ^(注1) _(注2)	11,893 AUD	17,256	11,906	2020年7月8日	— (13)
USD ^(注1) _(注2)	15,658 EUR	13,971	15,697	2020年7月8日	— (39)
USD ^(注1) _(注2)	24,695 EUR	22,067	24,794	2020年7月8日	— (99)
USD ^(注1) _(注2)	1,512 EUR	1,348	1,515	2020年7月8日	— (3)
USD ^(注1) _(注2)	61,114 EUR	54,496	61,230	2020年7月8日	— (116)
USD ^(注1) _(注2)	97 EUR	87	97	2020年7月8日	— —
USD ^(注1) _(注2)	61 EUR	55	61	2020年7月8日	— —
USD ^(注1) _(注2)	6,480 EUR	5,778	6,492	2020年7月8日	— (12)
USD ^(注1) _(注2)	5,761 AUD	8,384	5,785	2020年7月8日	— (24)
USD ^(注1) _(注2)	988,883 EUR	882,457	991,508	2020年7月8日	— (2,625)
USD ^(注1) _(注2)	107,314 EUR	95,765	107,599	2020年7月8日	— (285)
USD ^(注1) _(注2)	1,013 EUR	904	1,016	2020年7月8日	— (3)
USD ^(注1) _(注2)	24,336 EUR	21,715	24,398	2020年7月8日	— (62)
USD ^(注1) _(注2)	6,091 AUD	8,864	6,115	2020年7月8日	— (24)
合計					— (41,879)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(41,879)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	98.15
OTC金融デリバティブ商品	0.25
その他の資産	1.60

資産合計	100.00
------	--------

⁽²⁾_(A) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式（2019年：98.92%；USD 157,612,983）			
建築—住宅及び商業			
NVR, Inc.	715	1.43	2,330,006
ホテル及びモーテル			
Marriott International, Inc. - Class A.....	21,206	1.11	1,817,990
不動産管理／サービス			
A-Living Services Co., Ltd. (144A).....	493,000	1.52	2,487,768
Deutsche Wohnen S.E.	110,000	3.02	4,934,234
Entra ASA (144A).....	70,000	0.55	895,007
Fastighets A.B. Balder.....	53,500	1.25	2,036,499
		6.34	10,353,508
不動産運用／開発			
Aroundtown S.A.	268,000	0.94	1,533,826
China Resources Land, Ltd.	1,130,000	2.61	4,270,032
Grainger plc.....	192,405	0.42	681,115
Hang Lung Properties, Ltd.	886,000	1.29	2,100,447
Helical plc	318,000	0.75	1,216,508
Instone Real Estate Group A.G. (144A)	78,000	1.04	1,690,253
LEG Immobilien A.G.	16,365	1.27	2,076,031
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	255,300	2.77	4,524,324
Prestige Estates Projects, Ltd.	385,205	0.65	1,070,953
Shimao Property Holdings, Ltd.	730,000	1.90	3,093,652
Sun Hung Kai Properties, Ltd.	219,333	1.71	2,795,289
Times China Holdings, Ltd.	711,000	0.81	1,315,652
VGP N.V.	22,468	1.76	2,865,417
		17.92	29,233,499
REIT—アパート			
American Homes 4 Rent	118,828	1.96	3,196,473
Invitation Homes, Inc.	178,061	3.00	4,902,019
UDR, Inc.	100,501	2.30	3,756,727
UNITE Group plc	120,147	0.86	1,398,039
		8.12	13,253,258
REIT—各種			
American Tower Corp.	10,879	1.72	2,812,657
Ascendas India Trust.....	1,653,000	0.98	1,603,761
Derwent London plc.....	18,500	0.39	635,612
Duke Realty Corp.	118,468	2.57	4,192,583
Gecina S.A.	18,500	1.40	2,283,488
Invesco Office J-Reit, Inc.	8,899	0.71	1,160,668
LaSalle Logiport REIT	451	0.43	695,605
Mapletree Logistics Trust	1,095,400	0.94	1,528,709
Mirvac Group.....	1,151,774	1.06	1,733,212
Nomura Real Estate Master Fund, Inc.	1,706	1.26	2,049,311
SBA Communications Corp.	10,094	1.84	3,007,204
Segro plc	277,429	1.88	3,072,712
VICI Properties, Inc.	279,025	3.45	5,633,515
		18.63	30,409,037
REIT—ヘルスケア			
Healthpeak Properties, Inc.	149,658	2.53	4,124,574
REIT—ホテル			
MGM Growth Properties LLC	85,352	1.42	2,322,428
REIT—プレハブ住宅			
Equity LifeStyle Properties, Inc.	52,279	2.00	3,266,392
Sun Communities., Inc.	36,360	3.02	4,933,325
		5.02	8,199,717

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
REIT－オフィス・ビル			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	32,630	3.24	5,294,218
Allied Properties Real Estate Investment Trust.....	75,841	1.41	2,288,529
Douglas Emmett, Inc.....	85,238	1.60	2,613,397
MCUBS MidCity Investment Corp.....	2,702	1.20	1,961,451
SL Green Realty Corp.	40,955	1.24	2,018,672
		8.69	14,176,267
REIT－ショッピング・センター			
Link REIT	289,800	1.45	2,364,765
REIT－シングル・テナント			
Spirit Realty Capital, Inc.	89,739	1.92	3,128,302
REIT－倉庫及び物流			
Americold Realty Trust.....	84,462	1.88	3,065,971
GLP J-REIT.....	2,432	2.16	3,532,022
Goodman Group	374,066	2.36	3,848,687
Granite Real Estate Investment Trust.....	79,222	2.50	4,088,918
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	930	0.92	1,497,655
Mapletree Industrial Trust.....	844,700	1.08	1,755,828
Nippon Prologis REIT, Inc.....	540	1.01	1,641,387
Prologis, Inc.....	103,241	5.91	9,635,483
Rexford Industrial Realty, Inc.	119,824	3.04	4,964,308
		20.86	34,030,259
保管及び倉庫			
Safestore Holdings plc.....	102,703	0.57	923,145
通信サービス			
NEXTDC, Ltd.....	302,241	1.27	2,066,395
普通株式合計.....		97.28	158,733,150
投資有価証券合計（取得原価：USD 154,330,799）.....		97.28	158,733,150

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエスレート・ファンド

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0.05%; USD 84,413)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)	
Citibank						
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,980 USD	3,416	3,436	2020年7月8日	—	20
AUD ⁽²⁾ _{CA}	276,648 USD	180,568	190,866	2020年7月8日	0.01	10,298
AUD ⁽²⁾ _{CA}	9,232 USD	6,150	6,369	2020年7月8日	—	219
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,484 USD	987	1,024	2020年7月8日	—	37
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,023 USD	1,348	1,395	2020年7月8日	—	47
AUD ⁽²⁾ _{CA}	4,782 USD	3,288	3,299	2020年7月8日	—	11
AUD ⁽²⁾ _{CA}	2,638 USD	1,796	1,820	2020年7月8日	—	24
AUD ⁽²⁾ _{CA}	1,265 USD	871	873	2020年7月8日	—	2
AUD ⁽²⁾ _{CA}	623 USD	429	430	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾ _{CA}	4,000 USD	4,402	4,494	2020年7月8日	—	92
EUR ⁽²⁾ _{CA}	10,000 USD	11,228	11,236	2020年7月8日	—	8
EUR ⁽²⁾ _{CA}	300 USD	335	337	2020年7月8日	—	2
EUR ⁽²⁾ _{CA}	100 USD	111	113	2020年7月8日	—	2
EUR ⁽²⁾ _{CA}	200 USD	223	224	2020年7月8日	—	1
EUR ⁽²⁾ _{CA}	765,561 USD	834,749	860,167	2020年7月8日	0.02	25,418
EUR ⁽²⁾ _{CA}	4,106,023 USD	4,477,105	4,613,433	2020年7月8日	0.08	136,328
EUR ⁽²⁾ _{CA}	781,913 USD	852,578	878,539	2020年7月8日	0.02	25,961
EUR ⁽²⁾ _{CA}	590,111 USD	643,442	663,035	2020年7月8日	0.01	19,593
EUR ⁽²⁾ _{CA}	290 USD	318	326	2020年7月8日	—	8
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,723 USD	1,880	1,936	2020年7月8日	—	56
EUR ⁽²⁾ _{CA}	25,870 USD	28,452	29,067	2020年7月8日	—	615
EUR ⁽²⁾ _{CA}	26,303 USD	28,928	29,554	2020年7月8日	—	626
EUR ⁽²⁾ _{CA}	19,843 USD	21,824	22,296	2020年7月8日	—	472
EUR ⁽²⁾ _{CA}	138,356 USD	152,163	155,453	2020年7月8日	—	3,290
EUR ⁽²⁾ _{CA}	4,135 USD	4,546	4,646	2020年7月8日	—	100
EUR ⁽²⁾ _{CA}	2,988 USD	3,288	3,357	2020年7月8日	—	69
EUR ⁽²⁾ _{CA}	5,636 USD	6,283	6,332	2020年7月8日	—	49
EUR ⁽²⁾ _{CA}	4,307 USD	4,802	4,840	2020年7月8日	—	38
EUR ⁽²⁾ _{CA}	29,954 USD	33,394	33,656	2020年7月8日	—	262
EUR ⁽²⁾ _{CA}	5,720 USD	6,377	6,426	2020年7月8日	—	49
EUR ⁽²⁾ _{CA}	8,749 USD	9,745	9,830	2020年7月8日	—	85
EUR ⁽²⁾ _{CA}	1,489 USD	1,658	1,672	2020年7月8日	—	14
EUR ⁽²⁾ _{CA}	14,183 USD	15,878	15,937	2020年7月8日	—	59
EUR ⁽²⁾ _{CA}	10,722 USD	12,002	12,046	2020年7月8日	—	44
EUR ⁽²⁾ _{CA}	13,954 USD	15,622	15,678	2020年7月8日	—	56
EUR ⁽²⁾ _{CA}	74,283 USD	83,163	83,463	2020年7月8日	—	300
EUR ⁽²⁾ _{CA}	13,397 USD	15,012	15,052	2020年7月8日	—	40
EUR ⁽²⁾ _{CA}	13,693 USD	15,344	15,385	2020年7月8日	—	41
EUR ⁽²⁾ _{CA}	10,499 USD	11,765	11,797	2020年7月8日	—	32
EUR ⁽²⁾ _{CA}	71,563 USD	80,191	80,407	2020年7月8日	—	216
EUR ⁽²⁾ _{CA}	20,884 USD	23,421	23,464	2020年7月8日	—	43
EUR ⁽²⁾ _{CA}	16,003 USD	17,947	17,980	2020年7月8日	—	33
EUR ⁽²⁾ _{CA}	109,115 USD	122,373	122,599	2020年7月8日	—	226
EUR ⁽²⁾ _{CA}	20,386 USD	22,863	22,905	2020年7月8日	—	42
EUR ⁽²⁾ _{CA}	12,250 USD	13,747	13,764	2020年7月8日	—	17

EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	17,804	USD	19,990	20,004	2020年7月8日	—	14
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	605,468	USD	737,625	750,142	2020年7月8日	0.01	12,517
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	20,349	USD	25,034	25,211	2020年7月8日	—	177
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	4,586	USD	5,655	5,682	2020年7月8日	—	27
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	335	EUR	297	333	2020年7月8日	—	2
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	218	EUR	194	218	2020年7月8日	—	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	668	EUR	594	668	2020年7月8日	—	—
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	669	AUD	958	661	2020年7月8日	—	8
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	432	AUD	620	428	2020年7月8日	—	4
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	55,865	EUR	49,166	55,242	2020年7月8日	—	623
USD ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	150,930	AUD	217,947	150,366	2020年7月8日	—	564

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、
(2019年：0.05%；USD 84,413)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)	
USD ^{(2)(A)}	504 EUR	448	503	2020年7月8日	—	1
USD ^{(2)(A)}	6,936 EUR	6,126	6,882	2020年7月8日	—	54
USD ^{(2)(A)}	7,157 EUR	6,320	7,101	2020年7月8日	—	56
USD ^{(2)(A)}	5,484 EUR	4,843	5,441	2020年7月8日	—	43
USD ^{(2)(A)}	37,302 EUR	32,941	37,012	2020年7月8日	—	290
USD ^{(2)(A)}	8,794 EUR	7,757	8,716	2020年7月8日	—	78
USD ^{(2)(A)}	7,184 EUR	6,337	7,120	2020年7月8日	—	64
USD ^{(2)(A)}	6,187 GBP	4,901	6,072	2020年7月8日	—	115
USD ^{(2)(A)}	369 EUR	327	367	2020年7月8日	—	2
USD ^{(2)(A)}	266 EUR	235	264	2020年7月8日	—	2
USD ^{(2)(A)}	10,297 EUR	9,063	10,182	2020年7月8日	—	115
USD ^{(2)(A)}	10,711 EUR	9,427	10,592	2020年7月8日	—	119
USD ^{(2)(A)}	9,620 EUR	8,466	9,513	2020年7月8日	—	107
USD ^{(2)(A)}	9,221 GBP	7,231	8,959	2020年7月8日	—	262
USD ^{(2)(A)}	899 AUD	1,295	893	2020年7月8日	—	6
USD ^{(2)(A)}	14,126 EUR	12,407	13,941	2020年7月8日	—	185
USD ^{(2)(A)}	14,676 EUR	12,891	14,484	2020年7月8日	—	192
USD ^{(2)(A)}	13,224 EUR	11,615	13,051	2020年7月8日	—	173
USD ^{(2)(A)}	76,620 EUR	67,301	75,617	2020年7月8日	—	1,003
USD ^{(2)(A)}	12,549 GBP	9,888	12,250	2020年7月8日	—	299
USD ^{(2)(A)}	48,629 EUR	42,970	48,281	2020年7月8日	—	348
USD ^{(2)(A)}	50,421 EUR	44,554	50,060	2020年7月8日	—	361
USD ^{(2)(A)}	45,430 EUR	40,145	45,105	2020年7月8日	—	325
USD ^{(2)(A)}	263,916 EUR	233,209	262,028	2020年7月8日	—	1,888
USD ^{(2)(A)}	43,589 GBP	34,514	42,761	2020年7月8日	—	828
USD ^{(2)(A)}	1,254 EUR	1,114	1,251	2020年7月8日	—	3
USD ^{(2)(A)}	1,769 EUR	1,563	1,756	2020年7月8日	—	13
USD ^{(2)(A)}	982 EUR	868	975	2020年7月8日	—	7
USD ^{(2)(A)}	1,202 EUR	1,061	1,193	2020年7月8日	—	9
USD ^{(2)(A)}	3,393 EUR	3,015	3,388	2020年7月8日	—	5
USD ^{(2)(A)}	3,520 EUR	3,129	3,515	2020年7月8日	—	5
USD ^{(2)(A)}	3,161 EUR	2,809	3,157	2020年7月8日	—	4
USD ^{(2)(A)}	18,354 EUR	16,312	18,328	2020年7月8日	—	26
USD ^{(2)(A)}	2,991 GBP	2,394	2,967	2020年7月8日	—	24
USD ^{(2)(A)}	13,097 GBP	10,564	13,088	2020年7月8日	—	9
USD ^{(2)(A)}	4,035 EUR	3,569	4,010	2020年7月8日	—	25
USD ^{(2)(A)}	15,578 GBP	12,526	15,519	2020年7月8日	—	59
USD ^{(2)(A)}	10,171 EUR	9,024	10,140	2020年7月8日	—	31
USD ^{(2)(A)}	11,292 EUR	10,020	11,257	2020年7月8日	—	35
USD ^{(2)(A)}	10,182 EUR	9,034	10,151	2020年7月8日	—	31
USD ^{(2)(A)}	59,652 EUR	52,934	59,475	2020年7月8日	—	177
USD ^{(2)(A)}	580 EUR	516	580	2020年7月8日	—	—
合計					0.15	246,261
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計						158,979,411

^{(2)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年: 0%; USD (6,159))

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
BNP							
SGD	601,633	USD	432,157	431,835	2020年7月2日	—	(322)
Citibank							
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	671	USD	465	464	2020年7月8日	—	(1)
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	7,416	USD	5,117	5,116	2020年7月8日	—	(1)
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	2,344	USD	1,638	1,617	2020年7月8日	—	(21)
AUD ^{(2)(S)} _(CA)	983	USD	681	678	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	10,000	USD	11,303	11,236	2020年7月8日	—	(67)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,500	USD	2,836	2,809	2020年7月8日	—	(27)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	3,800	USD	4,294	4,270	2020年7月8日	—	(24)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	9,780	USD	11,039	10,989	2020年7月8日	—	(50)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	142	USD	161	159	2020年7月8日	—	(2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	142	USD	161	160	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	5,482	USD	6,160	6,159	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	21,629	USD	24,355	24,302	2020年7月8日	—	(53)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	200	USD	227	225	2020年7月8日	—	(2)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	564	USD	639	633	2020年7月8日	—	(6)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	99,965	USD	113,324	112,318	2020年7月8日	—	(1,006)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	7,903	USD	8,930	8,880	2020年7月8日	—	(50)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	22,426	USD	25,349	25,197	2020年7月8日	—	(152)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	23,196	USD	26,220	26,063	2020年7月8日	—	(157)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	20,484	USD	23,154	23,015	2020年7月8日	—	(139)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	120,995	USD	136,768	135,947	2020年7月8日	—	(821)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	9,542	USD	10,771	10,722	2020年7月8日	—	(49)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	8,674	USD	9,791	9,746	2020年7月8日	—	(45)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	51,266	USD	57,865	57,600	2020年7月8日	—	(265)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,606	USD	2,956	2,928	2020年7月8日	—	(28)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	8,655	USD	9,862	9,724	2020年7月8日	—	(138)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	4,041	USD	4,569	4,540	2020年7月8日	—	(29)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	1,322	USD	1,488	1,485	2020年7月8日	—	(3)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	23,330	USD	26,266	26,214	2020年7月8日	—	(52)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	25,153	USD	28,320	28,261	2020年7月8日	—	(59)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	25,893	USD	29,153	29,093	2020年7月8日	—	(60)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	135,630	USD	152,706	152,390	2020年7月8日	—	(316)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,291	USD	7,121	7,069	2020年7月8日	—	(52)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,370	USD	7,210	7,157	2020年7月8日	—	(53)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	5,733	USD	6,489	6,441	2020年7月8日	—	(48)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	33,533	USD	37,955	37,677	2020年7月8日	—	(278)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	12,127	USD	13,629	13,625	2020年7月8日	—	(4)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	12,442	USD	13,984	13,980	2020年7月8日	—	(4)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	11,172	USD	12,556	12,552	2020年7月8日	—	(4)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	65,178	USD	73,254	73,232	2020年7月8日	—	(22)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	2,515	USD	2,832	2,825	2020年7月8日	—	(7)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	6,031	USD	6,777	6,776	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	5,438	USD	6,111	6,110	2020年7月8日	—	(1)
EUR ^{(2)(S)} _(CA)	31,872	USD	35,815	35,810	2020年7月8日	—	(5)

EUR ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	238	USD	267	267	2020年7月8日	—	—
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	10,996	USD	13,821	13,624	2020年7月8日	—	(197)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	10,561	USD	13,283	13,085	2020年7月8日	—	(198)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	16,231	USD	20,358	20,110	2020年7月8日	—	(248)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	17,763	USD	22,521	22,007	2020年7月8日	—	(514)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	7,616	USD	9,633	9,436	2020年7月8日	—	(197)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	20,078	USD	25,169	24,876	2020年7月8日	—	(293)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	5,021	USD	6,351	6,220	2020年7月8日	—	(131)
GBP ⁽²⁾⁽⁵⁾ _{(C)(A)}	9,598	USD	12,048	11,892	2020年7月8日	—	(156)

⁽²⁾⁽⁵⁾_{(C)(A)} 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2020年6月30日現在の建玉、

(2019年：0%；USD（6,159））

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
GBP ^{(2)(S)} _(CA)	4,784 USD	5,940	5,927	2020年7月8日	— (13)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	237 EUR	215	242	2020年7月8日	— (5)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	207 AUD	317	219	2020年7月8日	— (12)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	465 AUD	712	491	2020年7月8日	— (26)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	702 AUD	1,022	705	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	484 EUR	437	491	2020年7月8日	— (7)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	842 GBP	692	857	2020年7月8日	— (15)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	234 EUR	213	239	2020年7月8日	— (5)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,046 EUR	959	1,078	2020年7月8日	— (32)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	216 AUD	313	217	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,900 GBP	1,559	1,932	2020年7月8日	— (32)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	235 EUR	212	238	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	989 EUR	907	1,019	2020年7月8日	— (30)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2,249 EUR	2,061	2,316	2020年7月8日	— (67)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,697 EUR	1,556	1,748	2020年7月8日	— (51)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2,155 EUR	1,975	2,219	2020年7月8日	— (64)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	11,749 EUR	10,768	12,099	2020年7月8日	— (350)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	789 EUR	723	813	2020年7月8日	— (24)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	5,426 EUR	4,975	5,590	2020年7月8日	— (164)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	9,202 EUR	8,370	9,405	2020年7月8日	— (203)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,166 AUD	4,595	3,170	2020年7月8日	— (4)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	16,999 EUR	15,174	17,049	2020年7月8日	— (50)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	201 AUD	293	202	2020年7月8日	— (1)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2,721 GBP	2,198	2,724	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,141 EUR	2,804	3,150	2020年7月8日	— (9)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	3,262 EUR	2,912	3,272	2020年7月8日	— (10)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	2,929 EUR	2,614	2,938	2020年7月8日	— (9)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	950 AUD	1,381	953	2020年7月8日	— (3)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	71,449 EUR	63,846	71,736	2020年7月8日	— (287)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	6,226 EUR	5,564	6,251	2020年7月8日	— (25)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	14,911 EUR	13,296	14,939	2020年7月8日	— (28)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	15,334 EUR	13,674	15,363	2020年7月8日	— (29)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	13,769 EUR	12,277	13,795	2020年7月8日	— (26)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	80,176 EUR	71,494	80,328	2020年7月8日	— (152)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	1,141 AUD	1,661	1,146	2020年7月8日	— (5)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	16,431 EUR	14,663	16,475	2020年7月8日	— (44)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	18,375 EUR	16,397	18,424	2020年7月8日	— (49)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	16,580 EUR	14,795	16,624	2020年7月8日	— (44)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	96,755 EUR	86,342	97,012	2020年7月8日	— (257)
USD ^{(2)(S)} _(CA)	9,549 GBP	7,750	9,601	2020年7月8日	— (52)
合計					— (8,557)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計					(8,557)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:		資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券		96.43
OTC金融デリバティブ商品		0.15
その他の資産		3.42
資産合計		100.00

【注】 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)