【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2021年９月17日
【発行者名】	ブラックロック・ジャパン株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長　有田　浩之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番３号
【事務連絡者氏名】	猪浦　純子
【電話番号】	03-6703-7940
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー（愛称：ＢＲ　Ｗｉｎ）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
(ファンドの愛称を「ＢＲ　Ｗｉｎ」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
当初元本は、１口当り１円です。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。
ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。
基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。
ブラックロック・ジャパン株式会社
電話番号：03-6703-4300（受付時間　営業日の９：00～17：00）
ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

① 購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。
詳細は販売会社にお問い合わせください。
（販売会社につきましては、「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）
なお、購入時手数料には消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が含まれています（以下同じ。）。

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

(6)【申込単位】

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

・一般コース：１万口以上１万口単位

・累積投資コース：１万円以上１円単位

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

(7)【申込期間】

2021年９月18日から2022年３月18日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

① 購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

② 日本以外の地域における発行

行ないません。

③ 購入不可日

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

④ 振替受益権について

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

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

（参考）

◆ 投資信託振替制度とは、

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

① 「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」（ファンドの愛称を「ＢＲ　Ｗｉｎ」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行ないます。

② 当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信／海外／債券に属しています。下記は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

＜商品分類表＞

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

＜属性区分表＞

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

＜各分類および区分の定義＞

Ⅰ．商品分類

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

Ⅱ．属性区分

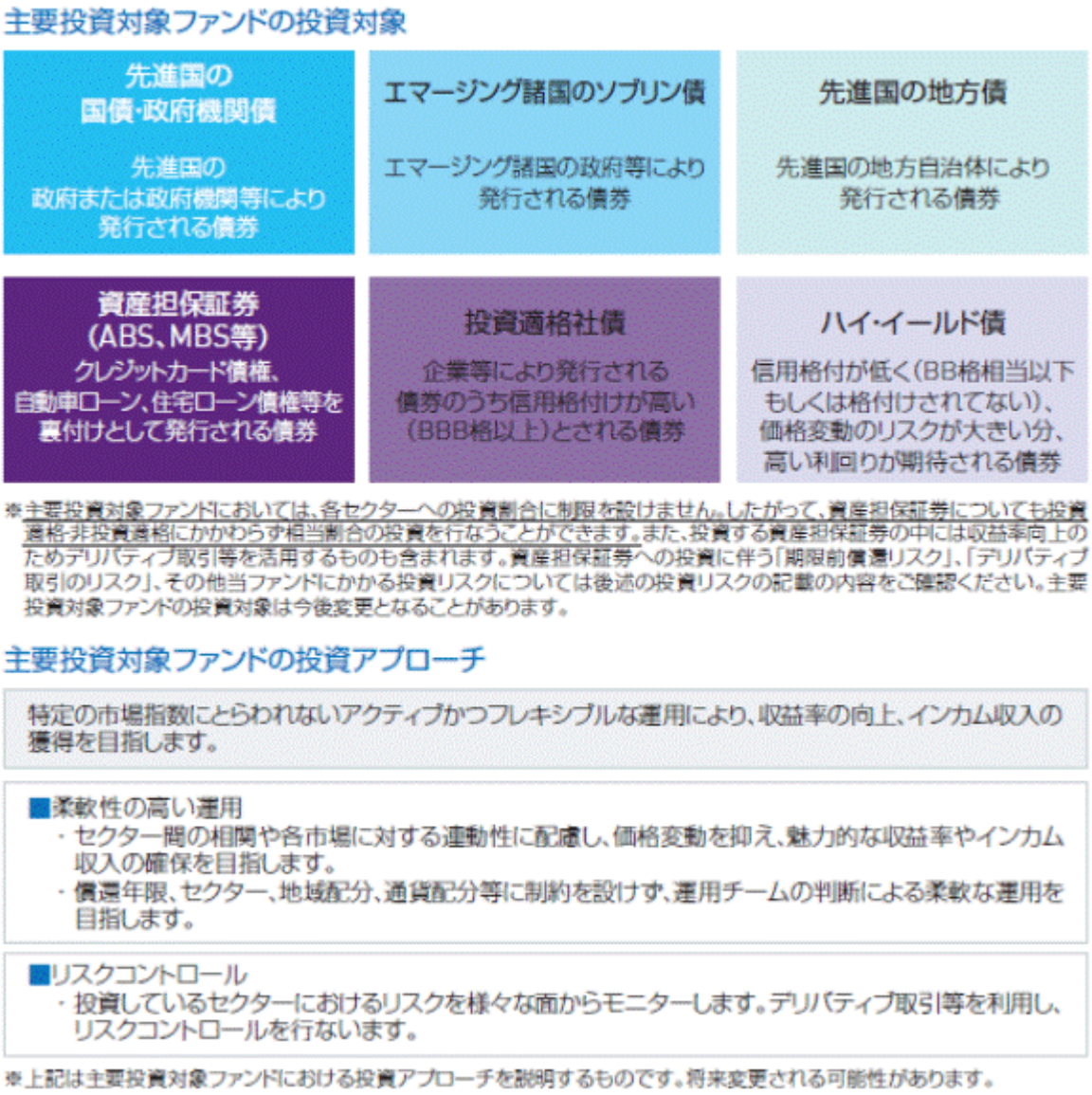
投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券（債券））	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。ただし、当ファンドは、投資信託証券を通じて主として債券に投資する。
決算頻度による属性区分	年12回（毎月）	目論見書又は投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	グローバル（日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規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

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

③　信託金の限度額は、5,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

④　ファンドの特色

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



b．投資対象とする投資信託証券（以下「投資対象ファンド」ということがあります。）は以下の通りです。

・ブラックロック・グローバル・ファンズ　フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド　クラスＪ投資証券（ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「ＢＧＦ　フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」といいます。）

・ブラックロック・グローバル・ファンズ　ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド　クラスＸ投資証券(ルクセンブルグ籍証券投資法人、以下「ＢＧＦ　ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。）

※　投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

ｃ．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

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

ｄ．原則として、毎月分配を行ないます。

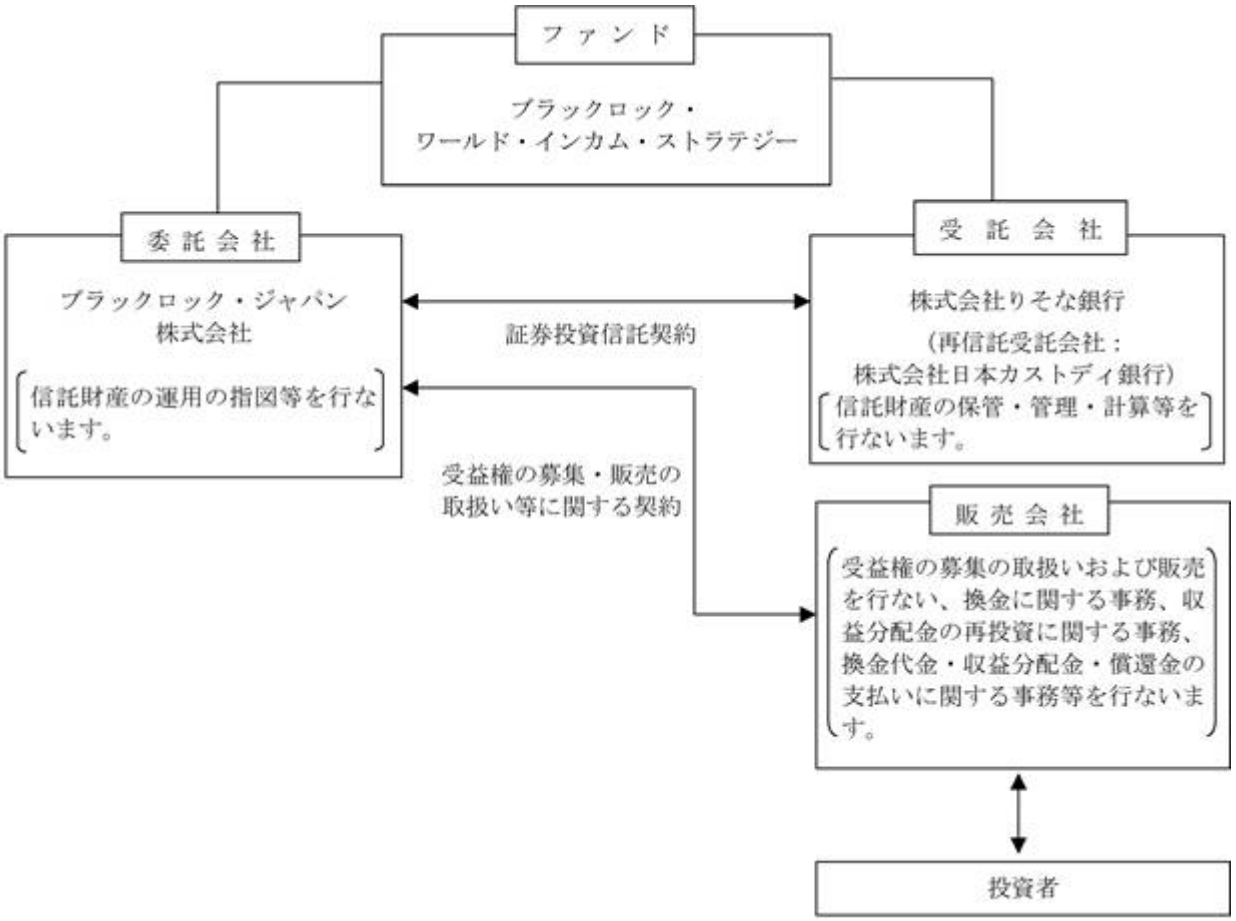
毎月20日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行ない、分配金をお支払いします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないことがあります。

ｅ．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行ないません。

(2)【ファンドの沿革】

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

(3)【ファンドの仕組み】



＜契約等の概要＞

a．「証券投資信託契約」

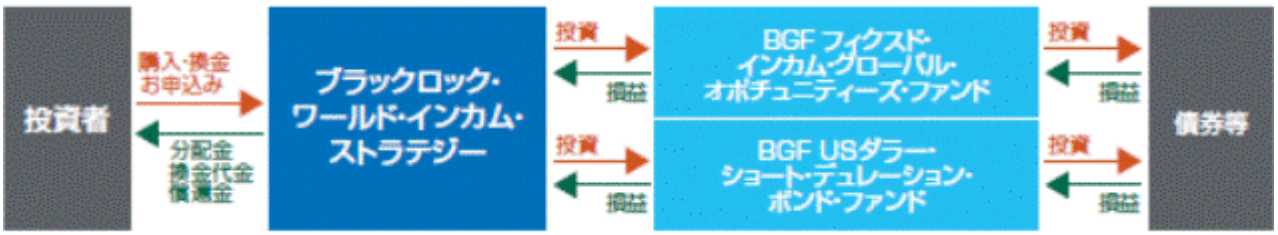
ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b．「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

＜ファンド・オブ・ファンズの仕組み＞

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



＜委託会社の概況＞

2021年６月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

ａ．資本金　　3,120百万円

ｂ．沿革

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

ｃ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

① 主として、先進国の国債および投資適格債、先進国の高利回り社債（ハイ・イールド債）、エマージング諸国の債券等、世界の公社債を主要な投資対象とし、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券に投資します。副次的な投資対象として、一部を優先証券、転換社債、株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）に投資を行なう投資信託証券を含みます。投資対象とする投資信託証券は別に定めるものとします。

② 各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、ファンド・オブ・ファンズにのみ取得される投資信託証券への投資比率を高位に保ちます。

③ 別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

④ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

⑤ 資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

⑥ 投資対象ファンドの選定にあたっては、上記の投資方針の他、当ファンドの運営上の効率性等を勘案します。

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

(2)【投資対象】

① 投資対象とする資産の種類

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

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

② 投資対象とする有価証券

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

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

③　投資対象とする金融商品

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

ａ．預金

ｂ．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

ｃ．コール・ローン

ｄ．手形割引市場において売買される手形

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

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

形態	**ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）**
投資目的および投資態度	**ファンドはトータル・リターンの最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。 また、ファンドは、投資適格、非投資適格に係わらず、資産担保証券（ＡＢＳ、ＭＢＳ）に純資産の100%を上限として投資を行なうことができます。 なお、ファンドは中国の規制により許容される方法により、中国本土に流通する債券に純資産の20%を上限として投資することができます。**
設定日	**2007年１月31日**
存続期間	**無期限**
主な投資制限	**・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の５%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。**
管理報酬	**ありません。（注）**
その他費用	**保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。**
決算日	**年１回（原則として８月末日）に決算を行ないます。**
収益分配方針	**毎月(原則として毎月末営業日)に分配を行ないます。**
申込手数料	**ありません。**
管理会社	**ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー**
投資顧問会社	**ブラックロック・インベストメント・マネジメント（ＵＫ）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド （副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド）**
保管会社	**ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ**

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

(b) ＢＧＦ　ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

形態	**ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）**
投資目的および投資態度	**純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが５年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは３年以下を原則とします。 通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。**
設定日	**2002年10月31日**
存続期間	**無期限**
主な投資制限	**・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の５%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。**
管理報酬	**ありません。（注）**
その他費用	**保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。**
決算日	**年１回（原則として８月末日）に決算を行ないます。**
収益分配方針	**分配を行ないません。**
申込手数料	**ありません。**
管理会社	**ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー**
投資顧問会社	**ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク**
保管会社	**ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ**

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

(3)【運用体制】

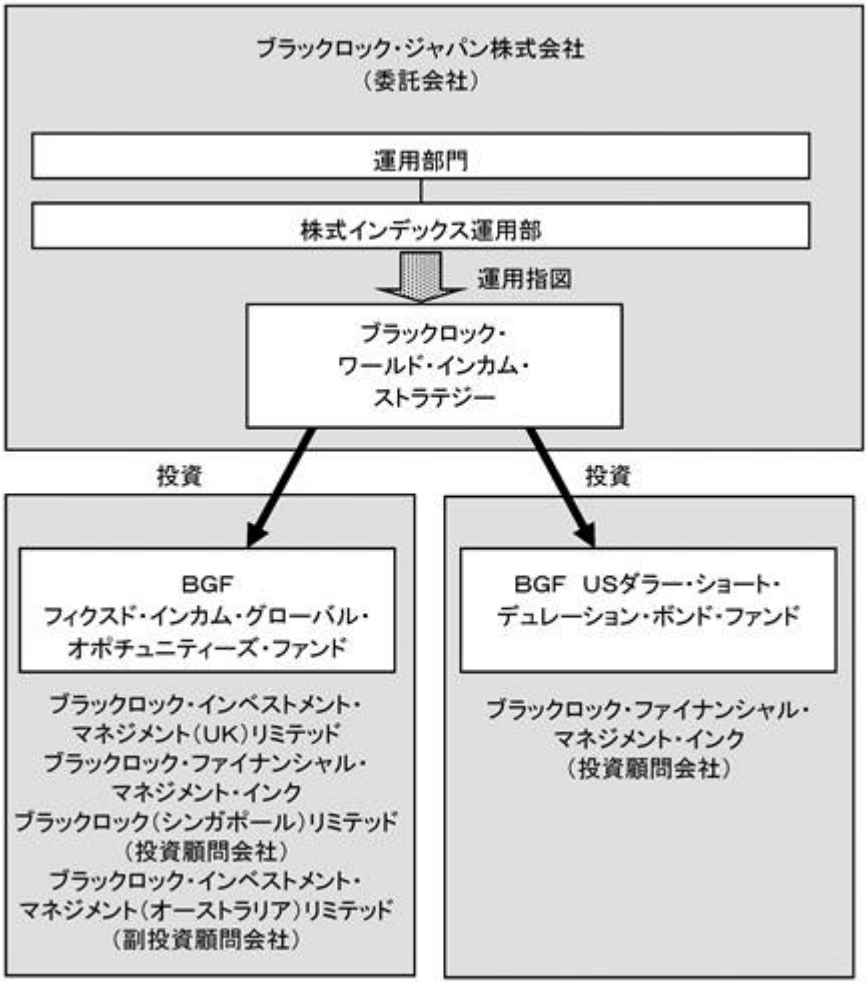
①　ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

②　ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

③　当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：８名程度）が担当いたします。

運用体制図



※　運用体制等は、変更となる場合があります。

＜参考：主要投資対象ファンドの運用体制＞

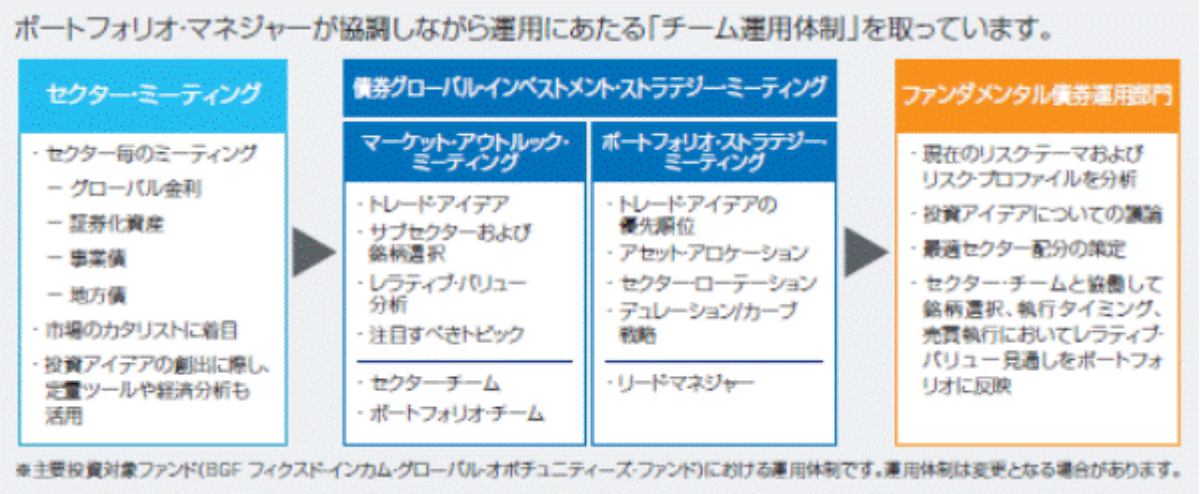
ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

① ポートフォリオ・マネジャーが協調しながら運用にあたる「チーム運用体制」を取っています。

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

③ 各ポートフォリオ・チームは、運用を担当するポートフォリオにとって適切と考える金利リスク、期限前償還リスク、利回りカーブ・リスク、信用リスク、流動性バイアス、およびセクター・アロケーションをそれぞれ独自に決定しますが、ポートフォリオ・ストラテジー・ミーティングでは各ポートフォリオ・チームの投資アイデアを共有することを主な目的とします。

④ ファンダメンタル債券運用部門は、セクター・チームと協働して、ポートフォリオの投資目的およびガイドラインを遵守しつつ、銘柄選択、タイミング、売買執行において、チームのレラティブ・バリューによる見通しをポートフォリオに反映します。ファンダメンタル債券運用部門は投資方針を策定し、その投資方針に基づいてセクター・スペシャリストが売買を執行します。投資テーマについては、週次で開催されるミーティングで定期的に議論かつ継続的に議論され、必要に応じて修正されます。



<u>ブラックロック・グループ</u>

ブラックロック・グループは、運用資産残高約9.49兆ドル（約1,054兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

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

＊ 2021年６月末現在。(円換算レートは１ドル＝110.99円を使用)

(4)【分配方針】

① 収益分配方針

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

ａ．分配対象額の範囲

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

ｂ．分配対象収益についての分配方針

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

ｃ．留保益の運用方針

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

② 収益の分配

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

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

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

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

③ 収益分配金の支払い

ａ．支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

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

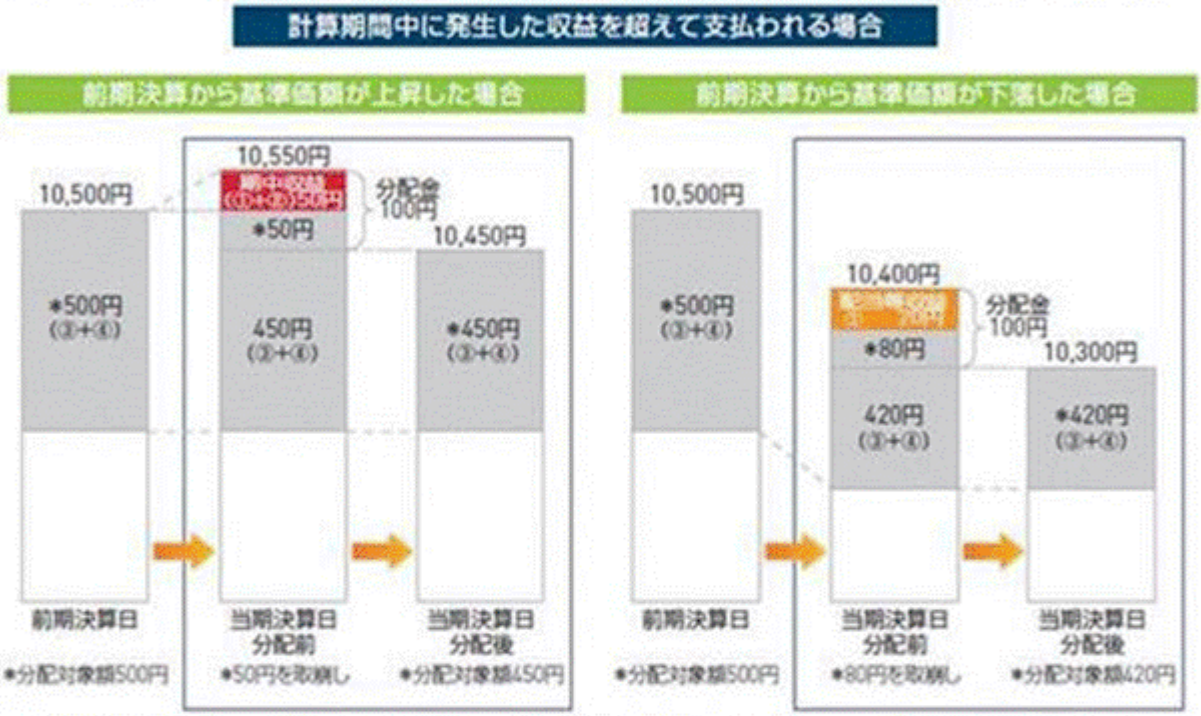
ｂ．時効

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

収益分配金に関する留意事項

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

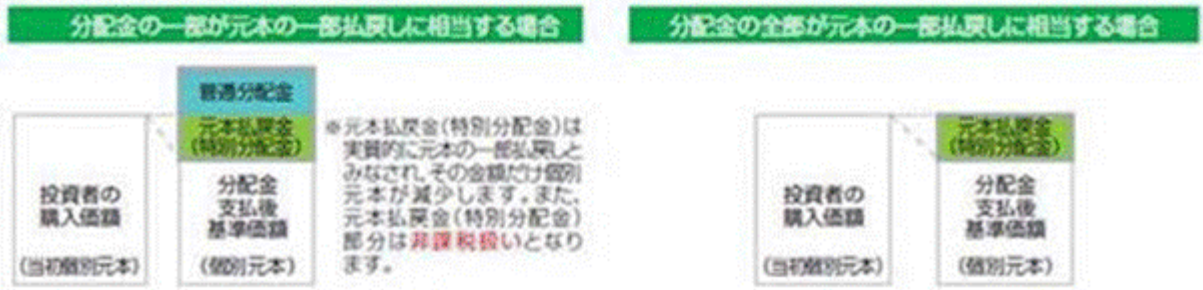
●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。



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

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

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



普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

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

(5)【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

① 投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

② 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

③ 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

⑤ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

⑥ 外国為替予約の指図および範囲

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

⑦ 資金の借入れ

ａ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ｂ．換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ｃ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ｄ．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑧ 信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

① 基準価額の変動要因

ａ．金利変動リスク

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

ｂ．信用リスク

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

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

ｃ．期限前償還リスク

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

ｄ．為替変動リスク

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

ｅ．カントリー・リスク

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

ｆ．デリバティブ取引のリスク

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

②　ファンド運営上のリスク

ａ．購入および換金の受付の中止・取消

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

ｂ．ファンドの繰上償還

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

ｃ．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

ｄ．流動性リスクに関する事項

当ファンドが保有する資産の市場環境等の状況により、保有有価証券の流動性が低下し、投資者からの換金請求に制約がかかる等のリスク（流動性リスク）があります。当ファンドにおいて流動性リスクが顕在化すると考えられる状況は以下の通りです。

- **金利の急激な変動または信用リスク不安が高まる等の影響により、債券価格の変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、債券市場動向が不安定になった場合**
- **デリバティブ市場において価格変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、デリバティブ市場動向が不安定になった場合**
- **主要投資対象とするファンドの購入・換金に制限がかかった場合**

※金融商品取引所等における取引の停止時、決済機能の停止時または大口の換金請求については、換金請求に制限がかかる場合があります。

(2) リスクの管理体制

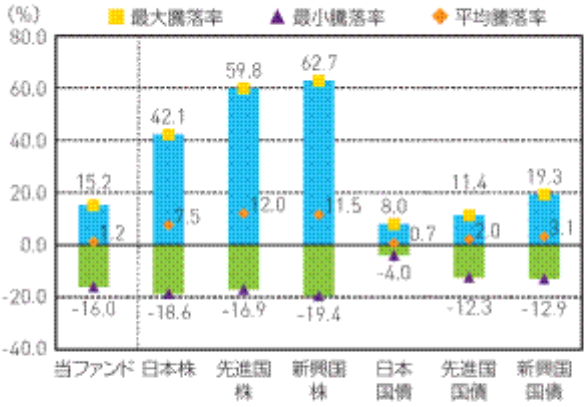
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）が運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内の関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

※　リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

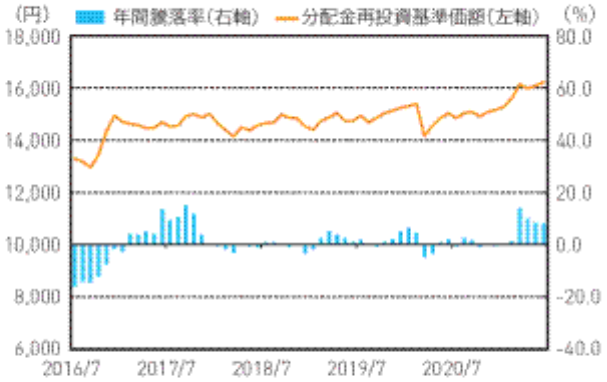
（2016年7月～2021年6月）



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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

（2016年7月～2021年6月）



※上記グラフは、過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※各資産クラスの指数
日本株……東証株価指数(配当込み)
先進国株……MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)
新興国株……MSCIエマージング・マーケッツ・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債……NOMURA-BPI国債
先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国国債…J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

<各指数について>
東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所((株)東京証券取引所)の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。
MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケッツ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発、計算した株価指数です。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は日本を除く世界の主要先進国の株式を、また、MSCIエマージング・マーケッツ・インデックス(配当込み、円ベース)は新興国の株式を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

① 購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額

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

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

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

② 信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4)【その他の手数料等】

①　信託財産において換金代金等の支払資金に不足が生じるときに資金借入れの指図を行なった場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、投資者の負担とし、その都度、信託財産中から支弁します。

③　下記の諸費用（以下「諸費用」といいます）および諸費用に係る消費税等相当額は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

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

委託会社は、年0.11%（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

④　外貨建資産の保管等に要する費用＊等は、その都度、信託財産中より支弁します。
＊海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用

⑤　投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用が別途投資対象ファンドから支払われます。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

①　個別元本方式について

ａ．追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。

ｂ．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ｃ．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行なわれる場合があります。

ｄ．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「③　収益分配金の課税について」を参照。）

②　換金時および償還時の課税について

ａ．個人の投資者の場合

換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。

ｂ．法人の投資者の場合

換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

③　収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

④　個人、法人の課税の取扱いについて

ａ．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

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

ｂ．法人の投資者に対する課税

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

※　外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※　上記は2021年６月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2021年６月末現在のものです。

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

(1)【投資状況】

資産の種類		金額(円)	投資比率(%)
投資証券		1,497,393,893	99.05
	内　ルクセンブルグ	1,497,393,893	99.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		14,401,725	0.95
純資産総額		1,511,795,618	100.00

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国／地域	種類	投資口数	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	ブラックロック・グローバル・ファンズ　フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスＪ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	1,261,533	1,172.14	1,478,703,710	1,174.35	1,481,493,717	98.00
2	ブラックロック・グローバル・ファンズ ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスＸ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	8,886	1,789.18	15,900,176	1,789.18	15,900,176	1.05

(注)　投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.05

(注)　投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

2021年６月末現在、同日前１年以内における各月末および直近20特定期間末の純資産の推移は次の通りです。

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		１口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第13特定期間	第70期(2011年７月20日)	5,194,094,232	5,201,873,380	0.6677	0.6687
	第71期(2011年８月22日)	4,982,537,926	4,990,074,175	0.6611	0.6621
	第72期(2011年９月20日)	4,825,687,355	4,833,044,388	0.6559	0.6569
	第73期(2011年10月20日)	4,726,461,704	4,733,673,067	0.6554	0.6564
	第74期(2011年11月21日)	4,597,750,464	4,604,774,306	0.6546	0.6556
	第75期(2011年12月20日)	4,628,803,830	4,635,786,108	0.6629	0.6639
第14特定期間	第76期(2012年１月20日)	4,628,516,959	4,635,490,459	0.6637	0.6647
	第77期(2012年２月20日)	4,764,021,111	4,770,915,024	0.6910	0.6920
	第78期(2012年３月21日)	4,945,408,372	4,952,229,483	0.7250	0.7260
	第79期(2012年４月20日)	4,740,779,337	4,747,487,380	0.7067	0.7077
	第80期(2012年５月21日)	4,565,667,725	4,572,339,900	0.6843	0.6853
	第81期(2012年６月20日)	4,508,864,540	4,515,457,272	0.6839	0.6849
第15特定期間	第82期(2012年７月20日)	4,530,795,123	4,537,310,005	0.6955	0.6965
	第83期(2012年８月20日)	4,554,045,114	4,560,532,884	0.7019	0.7029
	第84期(2012年９月20日)	4,533,139,157	4,539,595,130	0.7022	0.7032
	第85期(2012年10月22日)	4,545,170,896	4,551,531,577	0.7146	0.7156
	第86期(2012年11月20日)	4,600,052,086	4,606,374,386	0.7276	0.7286
	第87期(2012年12月20日)	4,846,349,125	4,852,659,951	0.7679	0.7689
第16特定期間	第88期(2013年１月21日)	5,163,561,913	5,169,840,531	0.8224	0.8234
	第89期(2013年２月20日)	4,608,502,510	4,613,908,223	0.8525	0.8535
	第90期(2013年３月21日)	4,184,944,067	4,189,773,939	0.8665	0.8675
	第91期(2013年４月22日)	4,228,972,916	4,233,613,081	0.9114	0.9124
	第92期(2013年５月20日)	4,344,332,667	4,348,918,128	0.9474	0.9484
	第93期(2013年６月20日)	3,945,101,538	3,949,642,330	0.8688	0.8698
第17特定期間	第94期(2013年７月22日)	3,776,413,408	3,780,629,135	0.8958	0.8968
	第95期(2013年８月20日)	3,675,699,022	3,679,854,311	0.8846	0.8856
	第96期(2013年９月20日)	3,572,183,774	3,576,180,836	0.8937	0.8947
	第97期(2013年10月21日)	3,495,530,548	3,499,496,967	0.8813	0.8823
	第98期(2013年11月20日)	3,535,169,009	3,539,090,680	0.9014	0.9024
	第99期(2013年12月20日)	3,534,080,557	3,537,815,885	0.9461	0.9471
第18特定期間	第100期(2014年１月20日)	3,514,700,010	3,518,420,799	0.9446	0.9456
	第101期(2014年２月20日)	3,333,120,710	3,336,709,422	0.9288	0.9298
	第102期(2014年３月20日)	3,309,975,047	3,313,526,405	0.9320	0.9330
	第103期(2014年４月21日)	3,319,759,900	3,323,292,914	0.9396	0.9406
	第104期(2014年５月20日)	3,287,975,525	3,291,503,617	0.9319	0.9329
	第105期(2014年６月20日)	3,230,793,962	3,234,230,168	0.9402	0.9412
第19特定期間	第106期(2014年７月22日)	3,091,663,347	3,094,963,055	0.9370	0.9380
	第107期(2014年８月20日)	2,922,432,284	2,925,515,852	0.9477	0.9487
	第108期(2014年９月22日)	2,906,995,848	2,912,806,105	1.0006	1.0026
	第109期(2014年10月20日)	2,835,004,527	2,840,817,697	0.9754	0.9774
	第110期(2014年11月20日)	3,047,787,148	3,053,430,342	1.0802	1.0822
	第111期(2014年12月22日)	3,058,187,286	3,063,781,248	1.0934	1.0954

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		１口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第20特定期間	第112期(2015年１月20日)	3,002,013,111	3,007,608,381	1.0731	1.0751
	第113期(2015年２月20日)	2,929,559,332	2,934,928,132	1.0913	1.0933
	第114期(2015年３月20日)	2,867,615,806	2,872,793,102	1.1078	1.1098
	第115期(2015年４月20日)	2,819,136,164	2,824,310,941	1.0896	1.0916
	第116期(2015年５月20日)	2,888,833,190	2,894,070,137	1.1033	1.1053
	第117期(2015年６月22日)	3,000,457,396	3,005,863,383	1.1100	1.1120
第21特定期間	第118期(2015年７月21日)	2,918,007,772	2,923,197,074	1.1246	1.1266
	第119期(2015年８月20日)	3,026,468,578	3,031,911,931	1.1120	1.1140
	第120期(2015年９月24日)	2,913,790,409	2,919,231,076	1.0711	1.0731
	第121期(2015年10月20日)	2,781,230,978	2,786,452,181	1.0654	1.0674
	第122期(2015年11月20日)	2,863,610,850	2,868,850,506	1.0931	1.0951
	第123期(2015年12月21日)	2,828,383,868	2,833,669,401	1.0702	1.0722
第22特定期間	第124期(2016年１月20日)	2,723,110,213	2,728,407,951	1.0280	1.0300
	第125期(2016年２月22日)	2,562,948,245	2,568,192,861	0.9774	0.9794
	第126期(2016年３月22日)	2,531,544,368	2,536,750,608	0.9725	0.9745
	第127期(2016年４月20日)	2,363,085,461	2,368,056,126	0.9508	0.9528
	第128期(2016年５月20日)	2,380,314,677	2,385,285,544	0.9577	0.9597
	第129期(2016年６月20日)	2,235,938,659	2,240,853,941	0.9098	0.9118
第23特定期間	第130期(2016年７月20日)	2,318,637,912	2,323,619,489	0.9309	0.9329
	第131期(2016年８月22日)	2,202,719,547	2,207,683,608	0.8875	0.8895
	第132期(2016年９月20日)	2,203,052,536	2,207,976,757	0.8948	0.8968
	第133期(2016年10月20日)	2,234,897,644	2,239,799,071	0.9119	0.9139
	第134期(2016年11月21日)	2,280,133,521	2,284,832,847	0.9704	0.9724
	第135期(2016年12月20日)	2,378,370,666	2,383,007,837	1.0258	1.0278
第24特定期間	第136期(2017年１月20日)	2,345,704,373	2,350,332,348	1.0137	1.0157
	第137期(2017年２月20日)	2,223,820,787	2,228,289,084	0.9954	0.9974
	第138期(2017年３月21日)	2,191,165,925	2,195,583,001	0.9921	0.9941
	第139期(2017年４月20日)	2,021,218,544	2,025,426,520	0.9607	0.9627
	第140期(2017年５月22日)	2,049,029,165	2,053,204,866	0.9814	0.9834
	第141期(2017年６月20日)	1,923,838,255	1,927,733,743	0.9877	0.9897
第25特定期間	第142期(2017年７月20日)	1,751,647,392	1,755,183,621	0.9907	0.9927
	第143期(2017年８月21日)	1,694,543,009	1,698,050,221	0.9663	0.9683
	第144期(2017年９月20日)	1,678,331,145	1,681,718,526	0.9909	0.9929
	第145期(2017年10月20日)	1,652,233,908	1,655,536,528	1.0006	1.0026
	第146期(2017年11月20日)	1,588,029,359	1,591,236,903	0.9902	0.9922
	第147期(2017年12月20日)	1,596,544,272	1,599,736,181	1.0004	1.0024
第26特定期間	第148期(2018年１月22日)	1,507,949,613	1,511,000,100	0.9887	0.9907
	第149期(2018年２月20日)	1,463,089,728	1,466,167,490	0.9507	0.9527
	第150期(2018年３月20日)	1,450,640,831	1,453,732,320	0.9385	0.9405
	第151期(2018年４月20日)	1,471,975,699	1,475,085,877	0.9466	0.9486
	第152期(2018年５月21日)	1,506,549,465	1,509,660,796	0.9684	0.9704
	第153期(2018年６月20日)	1,476,791,897	1,479,878,953	0.9568	0.9588
第27特定期間	第154期(2018年７月20日)	1,505,204,680	1,508,289,741	0.9758	0.9778
	第155期(2018年８月20日)	1,450,503,874	1,453,536,322	0.9567	0.9587
	第156期(2018年９月20日)	1,493,518,221	1,496,599,091	0.9695	0.9715
	第157期(2018年10月22日)	1,458,466,849	1,461,487,394	0.9657	0.9677
	第158期(2018年11月20日)	1,419,628,883	1,422,577,205	0.9630	0.9650
	第159期(2018年12月20日)	1,571,272,396	1,574,554,228	0.9576	0.9596

特定期間	計算期間	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第28特定期間	第160期(2019年1月21日)	1,573,860,687	1,577,219,906	0.9370	0.9390
	第161期(2019年2月20日)	1,607,828,729	1,611,202,149	0.9532	0.9552
	第162期(2019年3月20日)	1,652,695,868	1,656,126,642	0.9635	0.9655
	第163期(2019年4月22日)	1,797,871,043	1,801,571,397	0.9717	0.9737
	第164期(2019年5月20日)	1,785,780,207	1,789,524,700	0.9538	0.9558
	第165期(2019年6月20日)	1,821,290,712	1,825,152,093	0.9433	0.9453
第29特定期間	第166期(2019年7月22日)	1,836,069,064	1,839,933,710	0.9502	0.9522
	第167期(2019年8月20日)	1,805,072,782	1,808,919,672	0.9385	0.9405
	第168期(2019年9月20日)	1,827,834,682	1,831,684,936	0.9495	0.9515
	第169期(2019年10月21日)	1,756,210,870	1,759,896,442	0.9530	0.9550
	第170期(2019年11月20日)	1,778,667,655	1,782,397,419	0.9538	0.9558
	第171期(2019年12月20日)	1,761,494,563	1,765,148,656	0.9641	0.9661
第30特定期間	第172期(2020年1月20日)	1,784,825,600	1,788,480,365	0.9767	0.9787
	第173期(2020年2月20日)	1,802,381,006	1,806,010,696	0.9931	0.9951
	第174期(2020年3月23日)	1,574,240,198	1,577,749,073	0.8973	0.8993
	第175期(2020年4月20日)	1,595,635,917	1,599,094,529	0.9227	0.9247
	第176期(2020年5月20日)	1,602,094,600	1,605,555,871	0.9257	0.9277
	第177期(2020年6月22日)	1,617,172,884	1,620,637,956	0.9334	0.9354
第31特定期間	第178期(2020年7月20日)	1,642,151,355	1,645,623,123	0.9460	0.9480
	第179期(2020年8月20日)	1,618,039,078	1,621,467,601	0.9439	0.9459
	第180期(2020年9月23日)	1,587,777,596	1,591,178,078	0.9339	0.9359
	第181期(2020年10月20日)	1,574,559,931	1,577,915,086	0.9386	0.9406
	第182期(2020年11月20日)	1,564,473,101	1,567,830,925	0.9318	0.9338
	第183期(2020年12月21日)	1,566,109,052	1,569,458,866	0.9350	0.9370
第32特定期間	第184期(2021年1月20日)	1,574,812,701.00	1,578,165,535	0.9394	0.9414
	第185期(2021年2月22日)	1,509,549,594.00	1,512,712,127	0.9546	0.9566
	第186期(2021年3月22日)	1,537,277,475.00	1,540,425,713	0.9766	0.9786
	第187期(2021年4月20日)	1,504,415,492.00	1,507,509,255	0.9725	0.9745
	第188期(2021年5月20日)	1,499,662,229.00	1,502,734,989	0.9761	0.9781
	第189期(2021年6月21日)	1,547,362,977.00	1,550,498,697	0.9869	0.9889
2020年6月末現在		1,632,346,063	—	0.9415	—
2020年7月末現在		1,592,896,202	—	0.9280	—
2020年8月末現在		1,606,562,692	—	0.9378	—
2020年9月末現在		1,594,299,961	—	0.9384	—
2020年10月末現在		1,554,469,890	—	0.9259	—
2020年11月末現在		1,566,052,777	—	0.9350	—
2020年12月末現在		1,571,043,120	—	0.9372	—
2021年1月末現在		1,491,235,192	—	0.9430	—
2021年2月末現在		1,519,690,720	—	0.9603	—
2021年3月末現在		1,544,446,707	—	0.9920	—
2021年4月末現在		1,505,900,842	—	0.9796	—
2021年5月末現在		1,543,285,027	—	0.9844	—
2021年6月末現在		1,511,795,618	—	0.9912	—

②【分配の推移】

特定期間	計算期間	１口当たりの分配金(円)
第13特定期間	第70期	0.0010
	第71期	0.0010
	第72期	0.0010
	第73期	0.0010
	第74期	0.0010
	第75期	0.0010
第14特定期間	第76期	0.0010
	第77期	0.0010
	第78期	0.0010
	第79期	0.0010
	第80期	0.0010
	第81期	0.0010
第15特定期間	第82期	0.0010
	第83期	0.0010
	第84期	0.0010
	第85期	0.0010
	第86期	0.0010
	第87期	0.0010
第16特定期間	第88期	0.0010
	第89期	0.0010
	第90期	0.0010
	第91期	0.0010
	第92期	0.0010
	第93期	0.0010
第17特定期間	第94期	0.0010
	第95期	0.0010
	第96期	0.0010
	第97期	0.0010
	第98期	0.0010
	第99期	0.0010
第18特定期間	第100期	0.0010
	第101期	0.0010
	第102期	0.0010
	第103期	0.0010
	第104期	0.0010
	第105期	0.0010
第19特定期間	第106期	0.0010
	第107期	0.0010
	第108期	0.0020
	第109期	0.0020
	第110期	0.0020
	第111期	0.0020
第20特定期間	第112期	0.0020
	第113期	0.0020
	第114期	0.0020
	第115期	0.0020
	第116期	0.0020
	第117期	0.0020
第21特定期間	第118期	0.0020
	第119期	0.0020
	第120期	0.0020
	第121期	0.0020
	第122期	0.0020
	第123期	0.0020
第22特定期間	第124期	0.0020
	第125期	0.0020
	第126期	0.0020
	第127期	0.0020
	第128期	0.0020
	第129期	0.0020

特定期間	計算期間	１口当たりの分配金(円)
第23特定期間	第130期	0.0020
	第131期	0.0020
	第132期	0.0020
	第133期	0.0020
	第134期	0.0020
	第135期	0.0020
第24特定期間	第136期	0.0020
	第137期	0.0020
	第138期	0.0020
	第139期	0.0020
	第140期	0.0020
	第141期	0.0020
第25特定期間	第142期	0.0020
	第143期	0.0020
	第144期	0.0020
	第145期	0.0020
	第146期	0.0020
	第147期	0.0020
第26特定期間	第148期	0.0020
	第149期	0.0020
	第150期	0.0020
	第151期	0.0020
	第152期	0.0020
	第153期	0.0020
第27特定期間	第154期	0.0020
	第155期	0.0020
	第156期	0.0020
	第157期	0.0020
	第158期	0.0020
	第159期	0.0020
第28特定期間	第160期	0.0020
	第161期	0.0020
	第162期	0.0020
	第163期	0.0020
	第164期	0.0020
	第165期	0.0020
第29特定期間	第166期	0.0020
	第167期	0.0020
	第168期	0.0020
	第169期	0.0020
	第170期	0.0020
	第171期	0.0020
第30特定期間	第172期	0.0020
	第173期	0.0020
	第174期	0.0020
	第175期	0.0020
	第176期	0.0020
	第177期	0.0020
第31特定期間	第178期	0.0020
	第179期	0.0020
	第180期	0.0020
	第181期	0.0020
	第182期	0.0020
	第183期	0.0020
第32特定期間	第184期	0.0020
	第185期	0.0020
	第186期	0.0020
	第187期	0.0020
	第188期	0.0020
	第189期	0.0020

③【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率(%)
第13特定期間	第70期	△1.8
	第71期	△0.8
	第72期	△0.6
	第73期	0.1
	第74期	0.0
	第75期	1.4
第14特定期間	第76期	0.3
	第77期	4.3
	第78期	5.1
	第79期	△2.4
	第80期	△3.0
	第81期	0.1
第15特定期間	第82期	1.8
	第83期	1.1
	第84期	0.2
	第85期	1.9
	第86期	2.0
	第87期	5.7
第16特定期間	第88期	7.2
	第89期	3.8
	第90期	1.8
	第91期	5.3
	第92期	4.1
	第93期	△8.2
第17特定期間	第94期	3.2
	第95期	△1.1
	第96期	1.1
	第97期	△1.3
	第98期	2.4
	第99期	5.1
第18特定期間	第100期	△0.1
	第101期	△1.6
	第102期	0.5
	第103期	0.9
	第104期	△0.7
	第105期	1.0
第19特定期間	第106期	△0.2
	第107期	1.2
	第108期	5.8
	第109期	△2.3
	第110期	10.9
	第111期	1.4
第20特定期間	第112期	△1.7
	第113期	1.9
	第114期	1.7
	第115期	△1.5
	第116期	1.4
	第117期	0.8
第21特定期間	第118期	1.5
	第119期	△0.9
	第120期	△3.5
	第121期	△0.3
	第122期	2.8
	第123期	△1.9
第22特定期間	第124期	△3.8
	第125期	△4.7
	第126期	△0.3
	第127期	△2.0
	第128期	0.9
	第129期	△4.8

特定期間	計算期間	収益率(%)
第23特定期間	第130期	2.5
	第131期	△4.4
	第132期	1.0
	第133期	2.1
	第134期	6.6
	第135期	5.9
第24特定期間	第136期	△1.0
	第137期	△1.6
	第138期	△0.1
	第139期	△3.0
	第140期	2.4
	第141期	0.8
第25特定期間	第142期	0.5
	第143期	△2.3
	第144期	2.8
	第145期	1.2
	第146期	△0.8
	第147期	1.2
第26特定期間	第148期	△ 1.0
	第149期	△ 3.6
	第150期	△ 1.1
	第151期	1.1
	第152期	2.5
	第153期	△ 1.0
第27特定期間	第154期	2.2
	第155期	△ 1.8
	第156期	1.5
	第157期	△ 0.2
	第158期	△ 0.1
	第159期	△ 0.4
第28特定期間	第160期	△ 1.9
	第161期	1.9
	第162期	1.3
	第163期	1.1
	第164期	△ 1.6
	第165期	△ 0.9
第29特定期間	第166期	0.9
	第167期	△ 1.0
	第168期	1.4
	第169期	0.6
	第170期	0.3
	第171期	1.3
第30特定期間	第172期	1.5
	第173期	1.9
	第174期	△ 9.4
	第175期	3.1
	第176期	0.5
	第177期	1.0
第31特定期間	第178期	1.6
	第179期	△0.0
	第180期	△0.8
	第181期	0.7
	第182期	△0.5
	第183期	0.6
第32特定期間	第184期	0.7
	第185期	1.8
	第186期	2.5
	第187期	△0.2
	第188期	0.6
	第189期	1.3

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

(4)【設定及び解約の実績】

特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第13特定期間	第70期	4,473,201	264,479,896	7,779,148,009
	第71期	4,418,716	247,316,861	7,536,249,864
	第72期	4,349,087	183,565,518	7,357,033,433
	第73期	4,368,375	150,037,906	7,211,363,902
	第74期	4,214,820	191,736,692	7,023,842,030
	第75期	78,238,723	119,801,796	6,982,278,957
第14特定期間	第76期	4,026,217	12,804,218	6,973,500,956
	第77期	4,013,535	83,600,619	6,893,913,872
	第78期	3,898,297	76,700,593	6,821,111,576
	第79期	3,582,088	116,649,681	6,708,043,983
	第80期	3,566,513	39,435,029	6,672,175,467
	第81期	3,864,403	83,307,511	6,592,732,359
第15特定期間	第82期	3,545,128	81,394,732	6,514,882,755
	第83期	3,473,000	30,585,116	6,487,770,639
	第84期	3,446,269	35,243,421	6,455,973,487
	第85期	3,452,479	98,744,853	6,360,681,113
	第86期	7,416,555	45,796,857	6,322,300,811
	第87期	3,564,657	15,038,546	6,310,826,922
第16特定期間	第88期	3,015,074	35,223,575	6,278,618,421
	第89期	2,744,790	875,649,572	5,405,713,639
	第90期	1,622,495	577,464,051	4,829,872,083
	第91期	56,914,015	246,620,601	4,640,165,497
	第92期	43,088,121	97,792,574	4,585,461,044
	第93期	35,159,285	79,827,431	4,540,792,898
第17特定期間	第94期	1,512,360	326,577,670	4,215,727,588
	第95期	1,444,530	61,882,577	4,155,289,541
	第96期	34,217,565	192,444,545	3,997,062,561
	第97期	12,535,405	43,176,041	3,966,419,925
	第98期	1,497,780	46,246,055	3,921,671,650
	第99期	94,541,717	280,884,882	3,735,328,485
第18特定期間	第100期	19,488,243	34,027,554	3,720,789,174
	第101期	16,078,535	148,155,518	3,588,712,191
	第102期	12,423,450	49,777,022	3,551,358,619
	第103期	1,221,589	19,565,482	3,533,014,726
	第104期	53,519,669	58,441,461	3,528,092,934
	第105期	1,265,383	93,152,251	3,436,206,066
第19特定期間	第106期	1,231,953	137,729,565	3,299,708,454
	第107期	1,144,037	217,283,597	3,083,568,894
	第108期	1,136,709	179,576,779	2,905,128,824
	第109期	1,940,114	483,849	2,906,585,089
	第110期	2,081,007	87,068,940	2,821,597,156
	第111期	54,873,218	79,489,321	2,796,981,053
第20特定期間	第112期	1,707,713	1,053,303	2,797,635,463
	第113期	21,387,974	134,623,116	2,684,400,321
	第114期	5,384,936	101,137,169	2,588,648,088
	第115期	11,984,979	13,244,118	2,587,388,949
	第116期	68,718,931	37,634,305	2,618,473,575
	第117期	116,507,272	31,986,995	2,702,993,852
第21特定期間	第118期	23,805,200	132,147,917	2,594,651,135
	第119期	134,631,396	7,605,751	2,721,676,780
	第120期	5,392,817	6,735,845	2,720,333,752
	第121期	2,000,769	111,732,815	2,610,601,706
	第122期	45,259,938	36,033,529	2,619,828,115
	第123期	42,455,385	19,516,849	2,642,766,651
第22特定期間	第124期	9,188,478	3,085,927	2,648,869,202
	第125期	4,148,748	30,709,801	2,622,308,149
	第126期	7,308,447	26,496,225	2,603,120,371
	第127期	2,342,690	120,130,150	2,485,332,911
	第128期	2,030,731	1,929,774	2,485,433,868
	第129期	2,023,627	29,816,402	2,457,641,093

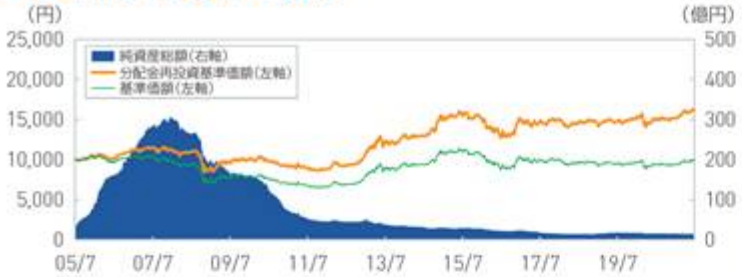
特定期間	計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第23特定期間	第130期	34,403,560	1,255,876	2,490,788,777
	第131期	2,139,407	10,897,657	2,482,030,527
	第132期	2,298,361	22,218,045	2,462,110,843
	第133期	2,269,566	13,666,830	2,450,713,579
	第134期	2,201,905	103,251,998	2,349,663,486
	第135期	2,073,542	33,151,141	2,318,585,887
第24特定期間	第136期	2,008,917	6,606,817	2,313,987,987
	第137期	12,510,213	92,349,438	2,234,148,762
	第138期	1,931,772	27,542,490	2,208,538,044
	第139期	2,003,384	106,553,410	2,103,988,018
	第140期	1,968,778	18,105,815	2,087,850,981
	第141期	2,301,229	142,407,972	1,947,744,238
第25特定期間	第142期	2,405,582	182,035,113	1,768,114,707
	第143期	2,173,034	16,681,610	1,753,606,131
	第144期	2,447,603	62,362,805	1,693,690,929
	第145期	1,720,400	44,100,907	1,651,310,422
	第146期	2,467,791	50,005,896	1,603,772,317
	第147期	1,684,895	9,502,483	1,595,954,729
第26特定期間	第148期	2,620,049	73,331,252	1,525,243,526
	第149期	20,492,766	6,854,860	1,538,881,432
	第150期	6,863,252	—	1,545,744,684
	第151期	12,600,986	3,256,338	1,555,089,332
	第152期	13,019,597	12,443,194	1,555,665,735
	第153期	6,757,660	18,895,041	1,543,528,354
第27特定期間	第154期	1,520,868	2,518,683	1,542,530,539
	第155期	2,523,420	28,829,809	1,516,224,150
	第156期	26,234,878	2,023,647	1,540,435,381
	第157期	1,583,740	31,746,269	1,510,272,852
	第158期	1,517,491	37,628,983	1,474,161,360
	第159期	198,343,463	31,588,377	1,640,916,446
第28特定期間	第160期	79,034,742	40,341,196	1,679,609,992
	第161期	7,100,270	—	1,686,710,262
	第162期	29,344,531	667,493	1,715,387,300
	第163期	159,526,725	24,736,827	1,850,177,198
	第164期	22,070,503	932	1,872,246,769
	第165期	104,913,835	46,469,726	1,930,690,878
第29特定期間	第166期	1,653,449	21,324	1,932,323,003
	第167期	1,621,547	10,499,501	1,923,445,049
	第168期	1,772,570	90,572	1,925,127,047
	第169期	1,783,314	84,124,204	1,842,786,157
	第170期	22,483,380	387,455	1,864,882,082
	第171期	1,586,403	39,421,574	1,827,046,911
第30特定期間	第172期	1,501,915	1,166,200	1,827,382,626
	第173期	1,829,400	14,366,903	1,814,845,123
	第174期	1,408,185	61,815,586	1,754,437,722
	第175期	1,373,625	26,505,312	1,729,306,035
	第176期	1,339,736	9,784	1,730,635,987
	第177期	1,910,792	10,744	1,732,536,035
第31特定期間	第178期	3,543,598	195,529	1,735,884,104
	第179期	1,375,485	22,997,979	1,714,261,610
	第180期	1,830,669	15,851,258	1,700,241,021
	第181期	1,348,777	24,012,126	1,677,577,672
	第182期	1,399,236	64,732	1,678,912,176
	第183期	1,324,009	5,329,080	1,674,907,105
第32特定期間	第184期	1,576,791	66,540	1,676,417,356
	第185期	1,406,803	96,557,247	1,581,266,912
	第186期	3,591,011	10,738,554	1,574,119,369
	第187期	1,593,571	28,831,137	1,546,881,803
	第188期	1,371,196	11,872,937	1,536,380,062
	第189期	51,965,224	20,484,808	1,567,860,478

（参考情報）

運用実績

2021年6月末現在

基準価額・純資産の推移



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

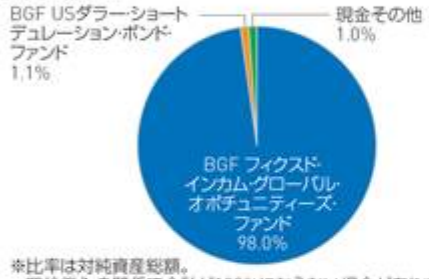
分配の推移

設定来累計		4,540円
直近1年間累計		240円
第185期	2021年2月	20円
第186期	2021年3月	20円
第187期	2021年4月	20円
第188期	2021年5月	20円
第189期	2021年6月	20円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

資産構成比率



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

組入上位10銘柄*(%)

	銘柄名	比率
1	FNMA 30YR 2018 PRODUCTION	9.0
2	GNMA2 30YR TBA(REG C)	7.6
3	TREASURY (CPI) NOTE 0.125 04/15/2026	1.6
4	CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM 1.99 04/09/2025	1.1
5	TREASURY NOTE 1.5 08/31/2021	1.0
6	TREASURY (CPI) NOTE 0.5 04/15/2024	1.0
7	CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM 2.85 06/04/2027	0.9
8	TREASURY NOTE 1.5 09/30/2021	0.9
9	ITALY (REPUBLIC OF) 2.45 09/01/2050	0.7
10	CHINA DEVELOPMENT BANK 2.89 06/22/2025	0.6

債券種別構成比率*(%)

債券	比率
派生商品合計	40.97
投資適格社債	20.35
現金等	17.74
証券化商品	17.52
新興国債	14.69
ハイ・イールド債	5.86
その他	4.18
政府系モーゲージ	4.13
地方債	1.59

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

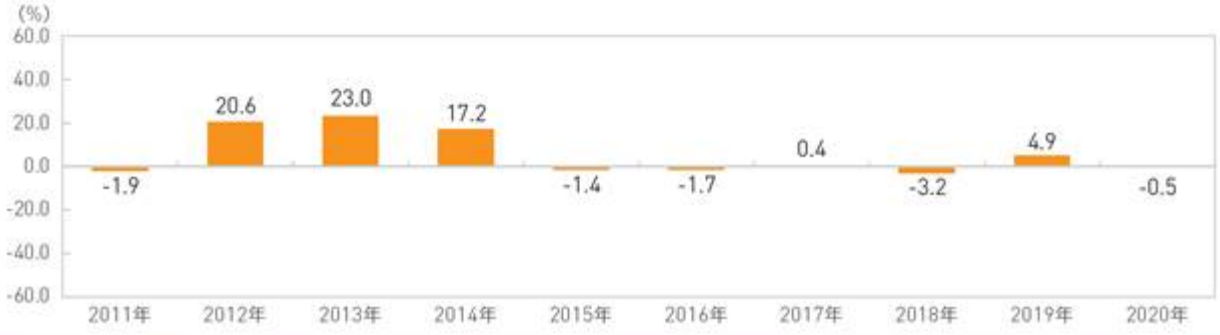
通貨構成比率*(%)

通貨	比率
米国・ドル	96.6
中国・人民元	5.1
インド・ルピー	0.7
インドネシア・ルピア	0.6
ノルウェー・クローネ	0.5
その他	1.5
スウェーデン・クローナ	-0.5
ユーロ	-0.9
オフショア・人民元	-3.7

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

年間収益率の推移

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



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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

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

(2) 申込期間

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

(3) 受付時間

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

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

・一般コース　　：１万口以上１万口単位

・累積投資コース：１万円以上１円単位

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

ａ．購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（税抜3.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

ｂ．累積投資契約に基づく収益分配金の再投資は無手数料となります。

(8) 購入代金のお支払い

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

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

・一般コース　　：１万口以上１万口単位

・累積投資コース：１口以上１口単位

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

(2) 換金不可日

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

(3) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(4) 換金受付の制限

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

(5) 換金代金の支払い

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

(6) 換金の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

ブラックロック・ジャパン株式会社
電話番号：03-6703-4300（受付時間　営業日の９：00～17：00）
ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

①　ファンドの償還条件等

ａ．委託会社は、信託期間中において、当ファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、換金により、受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、当ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｃ．ａ．およびｂ．の場合において、委託会社は、この事項について、あらかじめ償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行ないません。

ｄ．ｃ．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

ｅ．ｄ．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ａ．およびｂ．のファンドの償還を行ないません。

ｆ．委託会社は、当ファンドの償還をしないこととしたときは、償還しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

ｇ．ｄ．～ｆ．までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、ｄ．の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

ｈ．委託会社は、監督官庁より当ファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。

ｉ．委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

ｊ．ｉ．にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「②信託約款の変更ｄ．」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

ｋ．受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「②信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドを償還させます。

② 信託約款の変更

ａ．委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる投資者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

ｃ．ｂ．の公告および書面には、投資者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

ｄ．ｃ．の一定の期間内に異議を述べた投資者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託約款の変更を行ないません。

ｅ．委託会社は、この信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる投資者に対して交付します。ただし、全ての投資者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

ｆ．委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはａ．～ｅ．の規定にしたがいます。

③ 運用報告書の作成

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

④ 信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

⑤ 関係法人との契約の更改等に関する手続

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

⑥ 公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

＜一般コース＞

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

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

＜累積投資コース＞

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

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

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

(4) 反対者の買取請求権

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

(5) 帳簿書類の閲覧又は謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3)　当ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当特定期間(2020年12月22日から2021年６月21日まで)の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前特定期間末 (2020年12月21日現在)	当特定期間末 (2021年６月21日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	6	－
金銭信託	10,277,295	19,408,206
投資証券	1,517,289,516	1,533,390,245
派生商品評価勘定	3,245	－
未収入金	44,151,800	－
流動資産合計	1,571,721,862	1,552,798,451
資産合計	1,571,721,862	1,552,798,451
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,349,814	3,135,720
未払解約金	911	15,099
未払受託者報酬	58,748	59,332
未払委託者報酬	2,056,455	2,076,978
その他未払費用	146,882	148,345
流動負債合計	5,612,810	5,435,474
負債合計	5,612,810	5,435,474
純資産の部		
元本等		
元本	1,674,907,105	1,567,860,478
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△108,798,053	△20,497,501
（分配準備積立金）	172,807,104	152,285,646
元本等合計	1,566,109,052	1,547,362,977
純資産合計	1,566,109,052	1,547,362,977
負債純資産合計	1,571,721,862	1,552,798,451

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前特定期間 (自　2020年６月23日 至　2020年12月21日)	当特定期間 (自　2020年12月22日 至　2021年６月21日)
営業収益		
受取配当金	21,158,224	19,801,636
受取利息	65	30
有価証券売買等損益	66,685,112	△1,553,422
為替差損益	△50,692,799	96,574,765
営業収益合計	37,150,602	114,823,009
営業費用		
受託者報酬	350,652	336,207
委託者報酬	12,274,232	11,769,040
その他費用	1,173,903	1,142,760
営業費用合計	13,798,787	13,248,007
営業利益又は営業損失（△）	23,351,815	101,575,002
経常利益又は経常損失（△）	23,351,815	101,575,002
当期純利益又は当期純損失（△）	23,351,815	101,575,002
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△134,071	438,639
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△115,363,151	△108,798,053
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,100,149	7,834,810
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,100,149	7,834,810
剰余金減少額又は欠損金増加額	657,371	1,704,773
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	657,371	1,704,773
分配金	20,363,566	18,965,848
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△108,798,053	△20,497,501

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

１　有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

２　デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

３　外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

４　収益及び費用の計上基準

(1) 受取配当金の計上基準

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

(2) 有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

５　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 外貨建資産等の会計処理

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

(2) 特定期間末日の取扱い

当特定期間は前特定期間末及び当特定期間末が休業日であったため、2020年12月22日から2021年６月21日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当特定期間の翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前特定期間末 (2020年12月21日現在)	当特定期間末 (2021年６月21日現在)
1　当該特定期間の末日における受益権総数	1,674,907,105口	1,567,860,478口
2　投資信託財産の計算に関する規則第55条の６第10号に規定する額	元本の欠損 108,798,053円	元本の欠損 20,497,501円
3　１口当たり純資産額	0.9350円	0.9869円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前特定期間 (自　2020年６月23日 至　2020年12月21日)
分配金の計算過程	第178期計算期間(2020年６月23日～2020年７月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（3,295,962円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（194,546,101円）、分配準備積立金(188,205,445円）により、分配対象収益は386,047,508円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,471,768円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第179期計算期間(2020年７月21日～2020年８月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（1,234,888円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（192,269,807円）、分配準備積立金(185,540,382円）により、分配対象収益は379,045,077円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,428,523円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第180期計算期間(2020年８月21日～2020年９月23日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（603,454円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（190,892,186円）、分配準備積立金(181,652,827円）により、分配対象収益は373,148,467円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,400,482円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第181期計算期間(2020年９月24日～2020年10月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（3,121,133円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（188,487,756円）、分配準備積立金(176,331,789円）により、分配対象収益は367,940,678円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,355,155円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第182期計算期間(2020年10月21日～2020年11月20日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（1,140,224円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（188,784,745円）、分配準備積立金(176,090,981円）により、分配対象収益は366,015,950円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,357,824円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第183期計算期間(2020年11月21日～2020年12月21日) 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,835,015円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（188,471,069円）、分配準備積立金(173,321,903円）により、分配対象収益は364,627,987円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,349,814円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。

項目	当特定期間 （自　2020年12月22日 至　2021年６月21日）
分配金の計算過程	第184期計算期間（自2020年12月22日　至2021年１月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（3,024,699円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（188,803,700円）、分配準備積立金(172,800,239円）により、分配対象収益は364,628,638円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,352,834円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第185期計算期間（自2021年１月21日　至2021年２月22日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（3,014,856円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（178,224,897円）、分配準備積立金(162,546,088円）により、分配対象収益は343,785,841円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,162,533円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第186期計算期間（自2021年２月23日　至2021年３月22日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,895,002円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（177,790,778円）、分配準備積立金(161,297,213円）により、分配対象収益は341,982,993円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,148,238円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第187期計算期間（自2021年３月23日　至2021年４月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（1,139,166円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（174,876,655円）、分配準備積立金(158,095,388円）により、分配対象収益は334,111,209円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,093,763円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第188期計算期間（自2021年４月21日　至2021年５月20日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,553,015円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（173,827,203円）、分配準備積立金(154,943,268円）により、分配対象収益は331,323,486円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,072,760円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。 第189期計算期間（自2021年５月21日　至2021年６月21日） 当計算期末における、費用控除後の配当等収益（2,989,488円）、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）(0円）、収益調整金（その他収益調整金）（182,545,023円）、分配準備積立金(152,431,878円）により、分配対象収益は337,966,389円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,135,720円（１万口当り20円）を分配に充てる事と決定いたしました。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

１　金融商品に対する取組方針

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

２　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

３　金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

前特定期間末 (2020年12月21日現在)	当特定期間末 (2021年６月21日現在)
1　貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1　貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2　時価の算定方法 (1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	2　時価の算定方法 (1)有価証券 同左
(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3　デリバティブ取引関係」に記載しております。	(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。
(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3　金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	3　金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4　金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。	4　金銭債権の特定期間末日後の償還予定額 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1　期中元本変動額

項目	前特定期間末 (2020年12月21日現在)	当特定期間末 (2021年６月21日現在)
期首元本額	1,732,536,035円	1,674,907,105円
期中追加設定元本額	10,821,774円	61,504,596円
期中一部解約元本額	68,450,704円	168,551,223円

2　有価証券関係

前特定期間末(2020年12月21日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	14,215,942
合計	14,215,942

当特定期間末(2021年６月21日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	5,636,150
合計	5,636,150

３　デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	前特定期間末（2020年12月21日現在）			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち１年超(円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	44,150,781	－	44,147,536	3,245
合計		44,150,781	－	44,147,536	3,245

(注１)　時価の算定方法

為替予約取引

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

① 特定期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という）の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 特定期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・特定期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

(注２)　上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

当特定期間末(2021年６月21日現在)

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・グローバル・ファンズ　フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスＪ投資証券	1,298,538.930	13,764,512.650	
		ブラックロック・グローバル・ファンズ ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスＸ投資証券	8,886.830	143,788.900	
	アメリカドル　小計		1,307,425.760	13,908,301.550 (1,533,390,245)	
投資証券　合計				1,533,390,245 (1,533,390,245)	
合計				1,533,390,245 (1,533,390,245)	

（注１） 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

３　外貨建有価証券の内訳

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

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

同ファンドの状況

(1)同ファンドは、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、同ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2020年８月31日に終了する計算期間(2019年９月１日から2020年８月31日まで)に係る財務書類であります。

(2)当該財務書類は、同ファンドを含む「ブラックロック・グローバル・ファンズ」の2020年８月31日現在の財務書類のうち、同ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

純資産計算書　2020年８月31日現在

	注記	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド 米ドル	ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド 米ドル
資産			
投資有価証券－取得原価		8,646,959,773	1,547,379,139
未実現評価益		198,583,219	27,225,125
投資有価証券－時価	2 (a)	8,845,542,992	1,574,604,264
銀行預金	2 (a)	828,136,589	60,915,084
ブローカーに対する債権	15	45,122,789	1,839,759
未収利息および未収配当金	2 (a)	68,563,930	5,498,290
売却投資有価証券未収金	2 (a)	4,450,275,277*	8,417
販売投資証券未収金	2 (a)	7,481,243	3,738,110
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	－	60,239
未決済先渡為替予約	2 (c)	41,952,629	249,378
差金決済契約	2 (c)	79,266	－
買建オプション／スワップションの時価	2 (c)	139,309,013	－
その他の資産	2 (a,c)	59,460	34,602
資産合計		14,426,523,188	1,646,948,143
負債			
銀行からの借入金	2 (a)	7,066,687	－
ブローカーに対する債務	15	45,973,167	522,942
未払収益分配金	2 (a)	2,054,990	121,315
購入投資有価証券未払金	2 (a)	3,604,194,774*	1,148,482
買戻し投資証券未払金	2 (a)	2,934,208	3,043,182
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	19,477,632	－
事後通告証券契約の時価	2 (c)	873,358,769	－
スワップの時価	2 (c)	6,357,145	74,744
売建オプション／スワップションの時価	2 (c)	102,743,239	－
その他の負債	５,６,７,８	15,423,245	1,170,393
負債合計		4,679,583,856	6,081,058
純資産合計		9,746,939,332	1,640,867,085

* 事後通告証券契約を含む。詳細については、注記２を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

３会計年度末における純資産価額の概要　2020年８月31日現在

	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド			
	通貨	2020年 ８月31日現在	2019年 ８月31日現在	2018年 ８月31日現在
純資産合計	米ドル	9,746,939,332	9,742,532,405	11,829,873,767
以下の１口当たり純資産価額：				
クラスＡ毎年分配型投資証券	米ドル	10.20	9.97	9.78
クラスＡユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.37	9.38	9.50
クラスＡ毎日分配型投資証券	米ドル	10.37	10.14	9.95
クラスＡ毎月分配型投資証券	米ドル	10.36	10.13	9.94
クラスＡ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.38	10.18	9.98
クラスＡユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.89	6.93	7.00
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	シンガポール・ドル	14.78	14.60	14.43
クラスＡ豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	豪ドル	9.28	9.31	9.29
クラスＡオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア中国人民元	96.85	95.96	95.75
クラスＡ安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	12.21	12.19	12.06
クラスＡ香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	香港ドル	92.03	91.92	91.83
クラスＡ無分配投資証券	米ドル	15.22	14.61	13.95
クラスＡスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.13	9.99	9.88
クラスＡユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.15	9.98	9.83
クラスＡ日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,068	1,047	1,030
クラスＡポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	16.37	15.84	15.29
クラスＡスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	103.69	101.54	99.93
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	21.72	20.99	20.21
クラスＡ英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.72	10.47	10.19
クラスＡＩ無分配投資証券	米ドル	12.09	11.60	―
クラスＡＩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.35	10.18	―
クラスＣ毎日分配型投資証券	米ドル	10.37	10.14	9.95
クラスＣ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.32	10.12	9.92
クラスＣ無分配投資証券	米ドル	12.86	12.50	12.09
クラスＤ毎年分配型投資証券	米ドル	13.82	13.50	13.24
クラスＤカナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	カナダ・ドル	9.95	9.81	9.71
クラスＤユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.36	9.38	9.50

３会計年度末における純資産価額の概要　2020年８月31日現在（続き）

フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（続き）

	通貨	2020年 ８月31日現在	2019年 ８月31日現在	2018年 ８月31日現在
クラスＤ英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	4.75	4.72	4.72
クラスＤ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.91	10.70	10.49
クラスＤスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	スイス・フラン	9.38	9.45	9.59
クラスＤユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	6.91	6.95	7.02
クラスＤ無分配投資証券	米ドル	15.81	15.10	14.35
クラスＤスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.93	10.72	10.55
クラスＤユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.81	10.58	10.37
クラスＤ英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.66	11.32	10.96
クラスＤポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	ポーランド・ズロチ	17.02	16.39	15.75
クラスＤシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	22.59	21.72	20.81
クラスＥ無分配投資証券	米ドル	14.18	13.68	13.13
クラスＥユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	9.49	9.38	9.29
クラスＩカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.84	9.70	9.61
クラスＩ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.16	9.96	9.77
クラスＩユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.16	9.21	9.31
クラスＩ英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	10.13	10.10	－
クラスＩ日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	日本円	969	971	981
クラスＩ無分配投資証券	米ドル	12.59	12.01	11.39
クラスＩ豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	10.73	10.38	9.93
クラスＩカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.66	11.21	10.73
クラスＩスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	11.67	11.42	11.23
クラスＩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.16	10.90	10.67
クラスＩ英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.77	11.41	11.03
クラスＩ日本円ヘッジ無分配投資証券	日本円	1,117	1,087	1,063
クラスＪ毎月分配型投資証券	米ドル	10.37	10.14	9.95
クラスＳユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.08	10.10	－
クラスＳ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.45	10.25	－
クラスＳ無分配投資証券	米ドル	10.75	10.26	－
クラスＳスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	10.39	10.18	－
クラスＳユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.42	10.19	－
クラスＸ毎月分配型投資証券	米ドル	10.37	10.14	9.95
ラスＸ豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	豪ドル	10.70	10.61	10.49

会計年度末における純資産価額の概要　2020年８月31日現在（続き）

フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（続き）

	通貨	2020年 ８月31日現在	2019年 ８月31日現在	2018年 ８月31日現在
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	ユーロ	9.25	9.27	9.38
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	ユーロ	9.47	9.52	9.63
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	英ポンド	9.59	9.56	9.55
クラスX無分配投資証券	米ドル	12.29	11.67	11.02
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	12.68	12.20	11.61
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	カナダ・ドル	11.76	11.25	10.72
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	12.10	11.79	11.52
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	11.81	11.48	11.17
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.63	11.21	10.79
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	11.02	10.67	10.38

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。２種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスの場合、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

３会計年度末における純資産価額の概要　2020年８月31日現在（続き）

		ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド		
	通貨	2020年 ８月31日現在	2019年 ８月31日現在	2018年 ８月31日現在
純資産合計	米ドル	1,640,867,085	1,756,701,574	1,968,227,941
以下の１口当たり純資産価額：				
クラスＡ毎日分配型投資証券	米ドル	8.63	8.56	8.41*
クラスＡ毎月分配型投資証券	米ドル	8.63	8.55	8.40*
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	シンガポール・ドル	9.68	9.65	9.56*
クラスＡ無分配投資証券	米ドル	14.10	13.74	13.19*
クラスＡユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.07	10.03	9.92*
クラスＡＩ無分配投資証券	米ドル	10.48	10.21	－
クラスＣ毎日分配型投資証券	米ドル	8.64	8.57	8.42*
クラスＣ無分配投資証券	米ドル	11.29	11.14	10.82*
クラスＤ毎月分配型投資証券	米ドル	9.90	9.82	9.64*
クラスＤ無分配投資証券	米ドル	14.49	14.07	13.45*
クラスＤユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.04	9.96	9.82*
クラスＥ無分配投資証券	米ドル	12.81	12.54	12.09*
クラスＩ毎四半期分配型投資証券	米ドル	10.31	10.25	－
クラスＩ無分配投資証券	米ドル	11.04	10.72	10.24*
クラスＩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	10.08	10.00	9.85*
クラスＸ無分配投資証券	米ドル	15.91	15.37	14.63*

ヘッジおよび英国報告型の投資証券クラスを除き、各投資証券クラスの価格はファンドの基準通貨で設定される。２種類以上の取引通貨が入手可能な当該投資証券クラスの場合、追加の取引通貨額は評価時点の関連する直物為替レートで当該額を換算することによって算定される。

* 希薄化調整を含む。詳細については、注記２(g)を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書　2020年８月31日に終了した会計年度

	注記	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド 米ドル	ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド 米ドル
期首純資産		9,742,532,405	1,756,701,574
収益			
預金利息	2(b)	7,825,443	371,889
債券利息、源泉徴収税控除後	2(b)	306,009,214	42,985,252
スワップ利息	2(c)	73,802,704	3,189,975
短期金融商品預け入れによる利息	2(b)	8,948	661,619
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	2(b)	262,055	—
配当金、源泉徴収税控除後	2(b)	425,254	—
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	2(c)	83,763	—
有価証券貸付による収益	2(b)	973,705	33,202
投資運用報酬リベート	5	—	50,475
収益合計	2(b)	389,391,086	47,292,412
費用			
スワップ利息	2(c)	86,440,962	2,061,471
年間サービス費用	7	6,961,256	1,017,687
保管および預託報酬	2(h), 8	2,140,943	247,389
販売報酬	6	4,244,352	940,596
税金	9	2,191,858	600,708
投資運用報酬	5	38,758,965	7,906,627
費用合計		140,738,336	12,774,478
純利益		248,652,750	34,517,934
以下に係る実現純評価益／（損）：			
投資有価証券	2(a)	89,088,465	408,897
事後通告証券契約	2(c)	78,171,014	1,789,942
差金決済取引	2(c)	(5,186,874)	—
上場先物取引	2(c)	(35,782,975)	(3,758,181)
オプション／スワップション契約	2(c)	118,666,658	—
スワップ取引	2(c)	606,772	(11,756,784)
先渡為替予約	2(c)	(13,652,900)	(1,518,989)
その他の取引に係る外国通貨	2(i)	13,387,398	(1,820,376)
当期実現純評価益／（損）		245,297,558	(16,655,491)
以下に係る未実現評価益／（損）の純変動額：			
投資有価証券	2(a)	50,317,018	16,480,789
事後通告証券契約	2(c)	(1,600,712)	27,171
差金決済取引	2(c)	(77,598)	—
上場先物取引	2(c)	(12,235,226)	639,702
オプション／スワップション契約	2(c)	25,244,876	—
スワップ取引	2(c)	3,332,270	(445,252)
先渡為替予約	2(c)	46,599,374	1,873,289
その他の取引に係る外国通貨	2(i)	1,337,294	104,702
当期未実現評価益の純変動		112,917,296	18,680,401
運用成績による純資産の増加		606,867,604	36,542,844

損益および純資産変動計算書　2020年８月31日に終了した会計年度（続き）

	注記	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド 米ドル	ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド 米ドル
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		2,778,096,685	1,160,050,224
投資証券買戻しによる正味支払額		(3,344,021,415)	(1,310,032,560)
資本の変動による純資産の減少		(565,924,730)	(149,982,336)
配当金宣言額	16	(36,535,947)	(2,394,997)
期末純資産		9,746,939,332	1,640,867,085

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表　2020年８月31日に終了した会計年度

	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド			
	期首発行済投資証券口数	当期発行投資証券口数	当期買戻し投資証券口数	期末発行済投資証券口数
クラスＡ毎年分配型投資証券	77,294	7,053	11,331	73,016
クラスＡユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,042,610	73,777	230,884	885,503
クラスＡ毎日分配型投資証券	3,992,272	849,156	1,040,553	3,800,875
クラスＡ毎月分配型投資証券	423,306	359,862	218,204	564,964
クラスＡ毎四半期分配型投資証券	6,753,471	835,135	1,739,036	5,849,570
クラスＡユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,053,044	189,273	313,844	928,473
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	235,806	285,799	182,400	339,205
クラスＡ豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	154,140	114,153	61,868	206,425
クラスＡオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	47,320	52,317	―	99,637
クラスＡ安定毎月総収益分配型投資証券	194,957	1,837,602	999,841	1,032,718
クラスＡ香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	63,861	―	―	63,861
クラスＡ無分配投資証券	47,692,095	11,086,186	15,963,477	42,814,804
クラスＡスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	4,243,471	482,213	1,040,344	3,685,340
クラスＡユーロ・ヘッジ無分配投資証券	13,957,628	2,917,441	7,270,772	9,604,297
クラスＡ日本円ヘッジ無分配投資証券	566	―	―	566
クラスＡポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	9,466,147	6,880,029	8,191,133	8,155,043
クラスＡスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	683,402	8,696	334,601	357,497
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	5,351,217	1,697,725	886,894	6,162,048
クラスＡ英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	317,825	42,281	111,407	248,699
クラスＡＩ無分配投資証券	445	10,888	2,769	8,564
クラスＡＩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	445	85,421	3,018	82,848
クラスＣ毎日分配型投資証券	421,303	52,869	150,629	323,543
クラスＣ毎四半期分配型投資証券	852,353	16,059	131,078	737,334
クラスＣ無分配投資証券	7,022,337	1,267,051	2,024,220	6,265,168
クラスＤ毎年分配型投資証券	121,497	700	47,821	74,376
クラスＤカナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,102,303	99,802	207,150	994,955
クラスＤユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	508,344	122,654	173,198	457,800
クラスＤ英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	3,116,868	2,352,733	1,444,699	4,024,902
クラスＤ毎四半期分配型投資証券	15,601,415	6,145,231	7,019,263	14,727,383
クラスＤスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	879,539	699,575	73,569	1,505,545
クラスＤユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,423,143	167,679	979,587	611,235
クラスＤ無分配投資証券	44,769,426	19,331,108	19,914,519	44,186,015
クラスＤスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,748,769	479,809	2,152,734	4,075,844

発行済投資証券口数変動表　2020年８月31日に終了した会計年度（続き）

フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（続き）

	期首発行済投資証券口数	当期発行投資証券口数	当期買戻し投資証券口数	期末発行済投資証券口数
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	32,961,179	7,322,074	13,714,081	26,569,172
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	3,889,882	1,407,182	1,788,432	3,508,632
クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券	41,037	―	―	41,037
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	22,840	46,103	7,171	61,772
クラスE無分配投資証券	17,120,677	2,155,513	5,089,039	14,187,151
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45,431,212	3,901,329	15,834,265	33,498,276
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	44,930	―	―	44,930
クラスI毎四半期分配型投資証券	13,534,206	11,682,076	5,443,944	19,772,338
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	3,548,771	570,138	103,537	4,015,372
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	1,620,942	420,362	28,846	2,012,458
クラスI日本円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	21,332	31,514	1,135	51,711
クラスI無分配投資証券	81,716,644	31,942,481	55,249,081	58,410,044
クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	15,363	6,997	4,553	17,807
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	14,158,928	1,181,433	1,498,244	13,842,117
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,288,431	105,443	4,086,552	1,307,322
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	48,628,912	13,839,488	25,979,322	36,489,078
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	35,567,544	314,121	5,117,107	30,764,558
クラスI日本円ヘッジ無分配投資証券	42,610,921	3,122,597	6,619,297	39,114,221
クラスJ毎月分配型投資証券	1,646,094	143,736	346,960	1,442,870
クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	63,486	46,045	17,612	91,919
クラスS毎四半期分配型投資証券	151,575	123,626	7,309	267,892
クラスS無分配投資証券	424,919	569,279	188,065	806,133
クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	1,680,298	667,368	337,295	2,010,371
クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券	325,910	302,522	170,294	458,138
クラスX毎月分配型投資証券	35,926,051	71,611	249,650	35,748,012
クラスX豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,345,016	295,889	341,241	1,299,664
クラスXユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	336,730	10,902	73,143	274,489
クラスXユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	7,657,859	5,416,374	―	13,074,233
クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	12,779,254	3,638,711	792,546	15,625,419
クラスX無分配投資証券	79,509,027	61,360,703	37,706,303	103,163,427
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	8,346,030	204,395	1,434,762	7,115,663
クラスXカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券	117,033,313	17,577,186	19,866,577	114,743,922
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	3,849,144	805,768	4,654,899	13
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	6,035,847	527,618	5,486,264	1,077,201

発行済投資証券口数変動表　2020年８月31日に終了した会計年度（続き）

	フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（続き）			
	期首発行済投資証券口数	当期発行投資証券口数	当期買戻し投資証券口数	期末発行済投資証券口数
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	45,524,592	7,597,272	3,681,336	49,440,528
クラスXスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	108,022,672	22,650,792	16,408,682	114,264,782

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表　2020年８月31日に終了した会計年度（続き）

ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

	期首発行済投資証券口数	当期発行投資証券口数	当期買戻し投資証券口数	期末発行済投資証券口数
クラスＡ毎日分配型投資証券	3,330,677	3,139,580	1,119,238	5,351,019
クラスＡ毎月分配型投資証券	1,286,263	3,273,173	2,302,327	2,257,109
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	57,625	34,268	11,959	79,934
クラスＡ無分配投資証券	34,454,083	23,677,556	19,903,423	38,228,216
クラスＡユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,222,009	1,299,420	902,937	2,618,492
クラスＡＩ無分配投資証券	1,000	―	―	1,000
クラスＣ毎日分配型投資証券	267,527	10,878	142,913	135,492
クラスＣ無分配投資証券	844,743	4,518,788	2,184,086	3,179,445
クラスＤ毎月分配型投資証券	4,012,094	2,758,349	1,363,203	5,407,240
クラスＤ無分配投資証券	22,225,680	16,953,934	12,138,015	27,041,599
クラスＤユーロ・ヘッジ無分配投資証券	287,968	888,075	242,393	933,650
クラスＥ無分配投資証券	10,630,759	3,110,643	4,374,138	9,367,264
クラスＩ毎四半期分配型投資証券	2,949,440	72,863	―	3,022,303
クラスＩ無分配投資証券	2,136,243	6,357,516	2,240,667	6,253,092
クラスＩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	12,098,697	29,007,857	29,502,049	11,604,505
クラスＸ無分配投資証券	34,588,865	280,831	25,401,441	9,468,255

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表　2020年８月31日現在

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

保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
ファンド			
	米国		
11,100	SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	3,885,555	0.04
ファンド合計		3,885,555	0.04
普通／優先株式およびワラント			
	バミューダ		
19,600	Marvell Technology Group Ltd	747,740	0.01
	ブラジル		
296,599	JBS SA	1,215,849	0.01
57,193	Oi SA ADR	85,790	0.00
		1,301,639	0.01
	カナダ		
350,962	Largo Resources Ltd	290,308	0.00
75,340	Lions Gate Entertainment Corp*	723,264	0.01
5,883	Norbord Inc	207,905	0.00
99,749	Northern Graphite Corp (Unit)	19,482	0.00
		1,240,959	0.01
	ケイマン諸島		
300,850	Dragoneer Growth Opportunities Corp	3,745,582	0.04
4,829	KE Holdings Inc ADR	240,339	0.00
147,094	Vantage Drilling Co	518	0.00
1,826,000	WH Group Ltd	1,576,239	0.02
		5,562,678	0.06
	フランス		
18,390	Arkema SA	2,046,817	0.02
13,675	EssilorLuxottica SA	1,840,566	0.02
4,043	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1,904,927	0.02
17,300	Safran SA	2,048,474	0.02
17,482	Sanofi	1,761,647	0.02
		9,602,431	0.10
	ドイツ		
6,576	adidas AG	2,006,249	0.02
104,894	Deutsche Telekom AG	1,859,054	0.02
17,936	Infineon Technologies AG	495,649	0.01
13,112	Siemens AG	1,823,747	0.02
		6,184,699	0.07
	イタリア		
76	Enel SpA*	688	0.00
259,910	Snam SpA	1,343,180	0.01
560,285	Telecom Italia SpA/Milano	266,694	0.00

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

保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
	イタリア（続き）		
528,431	UniCredit SpA	5,252,479	0.06
		6,863,041	0.07
	ジャージー		
23,104	Aptiv Plc	1,992,258	0.02
	ルクセンブルグ		
40,058	ArcelorMittal SA (Pref)	1,309,897	0.01
	オランダ		
1,142	Adyen NV	1,921,152	0.02
19,529	Akzo Nobel NV	1,923,900	0.02
26,803	Altice Europe NV	120,037	0.00
4,698	ASML Holding NV	1,758,842	0.02
371,411	ING Groep NV	3,062,273	0.03
34,951	Koninklijke Philips NV	1,658,655	0.02
16,474	NXP Semiconductors NV	2,067,157	0.02
35,400	STMicroelectronics NV	1,062,274	0.01
38,009	Unilever NV	2,219,476	0.02
		15,793,766	0.16
	スペイン		
27,329	Banco Santander SA (Pref)	641,138	0.00
167,496	Telefonica SA	668,026	0.01
		1,309,164	0.01
	スウェーデン		
457,774	Volvo AB	8,828,819	0.09
	スイス		
5,026	Roche Holding AG	1,740,084	0.02
	台湾		
150,866	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	11,922,940	0.12
	英国		
84,303	Arrow Global Group Plc	128,247	0.00
1,946,418	New Look	38,892	0.00
		167,139	0.00
	米国		
5,008	2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust (Pref)	5,483,510	0.06
1,500	Adobe Inc	768,015	0.01
23,754	Alaska Air Group Inc	948,497	0.01
400	Alphabet Inc	657,296	0.01
37,720	Altice USA Inc	1,039,940	0.01
200	Amazon.com Inc	686,280	0.01
5,305	Amgen Inc	1,337,497	0.01
6,285	Analog Devices Inc	739,179	0.01
59,380	Apple Inc	7,605,984	0.08

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

保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
	米国（続き）		
80,136	Applied Materials Inc	4,952,405	0.05
122,852	Bank of America Corp	3,180,638	0.03
29,987	Beazer Homes USA Inc*	369,440	0.00
18,513	Bristow Group Inc	379,887	0.00
11,833	Broadcom Inc	4,091,378	0.04
23,706	Caesars Entertainment Inc	1,125,324	0.01
9,200	Capital One Financial Corp	645,748	0.01
39,940	Century Communities Inc*	1,453,816	0.01
1,100	Charter Communications Inc	681,296	0.01
81,206	Citigroup Inc	4,176,019	0.04
8,220	Deckers Outdoor Corp	1,712,555	0.02
105,606	Delta Air Lines Inc	3,317,084	0.03
66,913	East Resources Acquisition Co	666,453	0.01
2,400	Facebook Inc ‘A’	703,320	0.01
87,600	Federal Home Loan Mortgage Corp (Pref)	809,424	0.01
87,600	Federal National Mortgage Association (Pref)	810,300	0.01
29,677	Forestar Group Inc*	535,670	0.01
10,002	HCA Healthcare Inc	1,362,372	0.01
12,427	Home Depot Inc/The	3,532,375	0.04
1,400	Humana Inc	573,006	0.01
9,200	Intel Corp	465,244	0.00
2,621	Intuitive Surgical Inc	1,895,612	0.02
23,800	Johnson & Johnson	3,643,066	0.04
27,242	JPMorgan Chase & Co	2,760,840	0.03
1,900	Mastercard Inc	689,187	0.01
14,964	Microchip Technology Inc*	1,637,810	0.02
24,833	Micron Technology Inc	1,125,680	0.01
94,500	Morgan Stanley	4,954,635	0.05
7,870	Morgan Stanley (Pref)	228,230	0.00
13,996	NVIDIA Corp	7,347,060	0.07
3,800	PayPal Holdings Inc	771,438	0.01
1,500	ServiceNow Inc	731,760	0.01
135,166	Simply Good Foods Co/The*	3,381,853	0.03
50,476	Southwest Airlines Co	1,934,240	0.02
96,040	Starbucks Corp	8,124,024	0.08
91,911	Target Hospitality Corp*	138,786	0.00
6,596	Target Hospitality Corp (Wts 15/3/2024)	469	0.00
167,842	Taylor Morrison Home Corp ‘A’*	3,976,177	0.04
37,744	Texas Instruments Inc	5,369,839	0.05
16,600	Uber Technologies Inc	557,428	0.01
2,000	UnitedHealth Group Inc	631,600	0.01
17,300	US Bancorp	633,872	0.01
68,701	Verizon Communications Inc	4,079,465	0.04
20,800	Visa Inc ‘A’	4,452,240	0.05
91,273	Vistra Corp	1,767,045	0.02
11,866	Walmart Inc	1,623,269	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
	1,908	Walt Disney Co/The	255,405	0.00
	59,963	Western Digital Corp	2,278,594	0.02
	43,484	Wynn Resorts Ltd	3,898,341	0.04
	60,311	Xilinx Inc	6,274,756	0.06
			129,972,673	1.34
普通／優先株式およびワラント合計			204,539,927	2.10
債券				
		アルバニア		
EUR	6,533,000	Albania Government International Bond 3.5% 16/6/2027	8,035,440	0.08
		アルゼンチン		
USD	3,706,000	Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 5.875% 11/1/2028	1,658,435	0.02
USD	4,929,000	Argentine Republic Government International Bond (Restricted) 6.875% 22/4/2021	2,412,900	0.02
USD	5,971,000	Generacion Mediterranea SA / Generacion Frias SA / Central Termica Roca SA ‘144A’ 9.625% 27/7/2023	4,026,693	0.04
USD	794,000	Genneia SA ‘144A’ 8.75% 20/1/2022	724,773	0.01
USD	1,769,000	YPF SA 7% 15/12/2047	1,186,888	0.01
USD	683,000	YPF SA 8.5% 28/7/2025	555,471	0.01
USD	915,000	YPF SA ‘144A’ 8.75% 4/4/2024	793,477	0.01
			11,358,637	0.12
		オーストラリア		
AUD	31,380,000	Australia Government Bond 1.75% 21/6/2051	22,088,171	0.23
USD	195,000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd ‘144A’ 4.5% 15/9/2027	210,930	0.00
USD	858,000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd ‘144A’ 4.75% 15/5/2022	888,867	0.01
USD	578,000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd ‘144A’ 5.125% 15/3/2023	610,989	0.01
USD	862,000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd ‘144A’ 5.125% 15/5/2024	936,438	0.01
USD	187,500	Linc Energy Ltd (Defaulted) 10/4/2018 (Zero Coupon)	5,625	0.00
USD	3,640,000	Pacific National Finance Pty Ltd 4.75% 22/3/2028	3,848,135	0.04
USD	777,000	QBE Insurance Group Ltd FRN 17/6/2046	858,231	0.01
USD	3,800,000	Santos Finance Ltd 5.25% 13/3/2029	4,230,444	0.04
			33,677,830	0.35
		オーストリア		
EUR	600,000	ams AG 5/3/2025 (Zero Coupon)	505,439	0.01
USD	1,200,000	ams AG 0.875% 28/9/2022	1,083,816	0.01
EUR	2,311,000	ams AG 6% 31/7/2025	2,839,473	0.03
EUR	2,308,000	ams AG 6% 31/7/2025	2,835,787	0.03
USD	1,100,000	ams AG ‘144A’ 7% 31/7/2025	1,149,500	0.01
EUR	1,200,000	BAWAG Group AG FRN 14/5/2025 (Perpetual)	1,424,055	0.02
EUR	2,600,000	BAWAG Group AG FRN 26/3/2029	3,159,101	0.03
EUR	2,300,000	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 3/9/2027	2,579,979	0.03
USD	3,051,000	BRF GmbH ‘144A’ 4.35% 29/9/2026	3,139,670	0.03
USD	275,000	BRF GmbH 4.35% 29/9/2026	282,992	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		オーストリア（続き）		
EUR	1,000,000	Erste Group Bank AG FRN 15/10/2021 (Perpetual)	1,276,164	0.01
EUR	600,000	Erste Group Bank AG FRN 15/4/2024 (Perpetual)*	765,698	0.01
USD	255,000	JBS Investments II GmbH ‘144A’ 5.75% 15/1/2028	269,754	0.00
USD	1,211,000	JBS Investments II GmbH ‘144A’ 7% 15/1/2026	1,312,028	0.01
EUR	2,690,000	Mondi Finance Europe GmbH 2.375% 1/4/2028	3,561,885	0.04
EUR	1,675,000	Republic of Austria Government Bond ‘144A’ 0.85% 30/6/2120	2,187,317	0.02
USD	272,000	Suzano Austria GmbH 5.75% 14/7/2026*	310,930	0.00
			28,683,588	0.29
		バハマ		
USD	1,486,000	Intercorp Peru Ltd ‘144A’ 3.875% 15/8/2029	1,462,781	0.01
		バーレーン		
USD	1,591,000	Bahrain Government International Bond 5.625% 30/9/2031	1,664,335	0.02
USD	441,000	Bahrain Government International Bond 6.75% 20/9/2029	499,364	0.00
USD	749,000	Bahrain Government International Bond 7% 26/1/2026	857,020	0.01
USD	3,217,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/5/2030	3,761,377	0.04
USD	851,000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 6.875% 5/10/2025	964,821	0.01
			7,746,917	0.08
		ベルギー		
EUR	2,300,000	Solvay SA FRN 2/12/2025 (Perpetual)	2,736,297	0.03
		バミューダ		
USD	706,742	China Shuifa Singyes Energy Holdings Ltd 6% 19/12/2022	647,202	0.01
USD	796,000	Credicorp Ltd ‘144A’ 2.75% 17/6/2025	814,905	0.01
USD	224,851	Digicel Group 0.5 Ltd ‘144A’ 7% 17/9/2020 (Perpetual)	29,231	0.00
USD	1,357,594	Digicel Group 0.5 Ltd ‘144A’ 8% 1/4/2025*	488,734	0.01
USD	553,557	Digicel International Finance Ltd / Digicel Holdings Bermuda Ltd ‘144A’ 8% 31/12/2026	434,542	0.00
USD	1,386,646	Digicel International Finance Ltd / Digicel Holdings Bermuda Ltd ‘144A’ 8.75% 25/5/2024	1,405,712	0.01
USD	702,345	Digicel International Finance Ltd / Digicel Holdings Bermuda Ltd ‘144A’ 13% 31/12/2025	640,890	0.01
USD	369,000	Digicel Ltd ‘144A’ 6.75% 1/3/2023	243,540	0.00
USD	200,000	Geopark Ltd ‘144A’ 5.5% 17/1/2027	180,502	0.00
USD	579,000	Geopark Ltd ‘144A’ 6.5% 21/9/2024	561,178	0.01
USD	300,000	Hopson Development Holdings Ltd 7.5% 27/6/2022	304,500	0.00
USD	408,000	Inkia Energy Ltd 5.875% 9/11/2027	432,799	0.00
USD	470,000	Inkia Energy Ltd ‘144A’ 5.875% 9/11/2027	498,567	0.01
USD	4,100,000	Luye Pharma Group Ltd 1.5% 9/7/2024	3,970,850	0.04
USD	478,000	NCL Corp Ltd ‘144A’ 3.625% 15/12/2024	329,521	0.00
USD	953,000	Ooredoo International Finance Ltd 5% 19/10/2025	1,123,200	0.01
HKD	4,062,966	REXLot Holdings Ltd (Restricted) (Defaulted) 4.5% 17/4/2019	91,744	0.00
HKD	348,254	REXLot Holdings Ltd (Defaulted) 6% 28/4/2017	14,980	0.00
			12,212,597	0.12
		ブラジル		
USD	702,000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands ‘144A’ 3.2% 27/1/2025	718,673	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ブラジル（続き）		
USD	1,369,000	Banco do Brasil SA/Cayman ‘144A’ 5.375% 15/1/2021	1,386,540	0.01
USD	1,459,000	Banco do Brasil SA/Cayman ‘144A’ 5.875% 26/1/2022	1,530,582	0.02
USD	2,838,000	Banco Votorantim SA ‘144A’ 4% 24/9/2022	2,925,357	0.03
USD	4,056,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	4,484,699	0.05
USD	300,000	Brazilian Government International Bond 4.875% 22/1/2021	305,110	0.00
USD	814,000	BRF SA 4.875% 24/1/2030	847,323	0.01
USD	4,446,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA ‘144A’ 3.625% 4/2/2025	4,463,367	0.05
USD	838,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA ‘144A’ 4.625% 4/2/2030	854,105	0.01
USD	410,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA ‘144A’ 5.75% 27/10/2021	426,080	0.00
USD	1,468,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ‘144A’ FRN 12/12/2022 (Perpetual)	1,434,282	0.01
USD	5,010,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ‘144A’ 2.9% 24/1/2023	5,072,625	0.05
USD	2,967,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ‘144A’ 3.25% 24/1/2025	3,042,102	0.03
USD	426,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island ‘144A’ 5.125% 13/5/2023	453,357	0.00
USD	4,858,000	Oi SA 10% 27/7/2025	4,643,185	0.05
USD	1,556,000	Votorantim SA ‘144A’ 6.75% 5/4/2021	1,604,625	0.02
			34,192,012	0.35
		英領バージン諸島		
EUR	2,500,000	ANLLIAN Capital Ltd 5/2/2025 (Zero Coupon)	2,866,150	0.03
USD	748,000	Baoxin Auto Finance I Ltd FRN 30/10/2020 (Perpetual)	569,882	0.01
USD	2,235,000	Beijing Environment Bvi Co Ltd 5.3% 18/10/2021	2,288,305	0.02
USD	1,315,000	Bi Hai Co Ltd 6.25% 5/3/2022	1,356,164	0.01
USD	5,005,000	CCTI 2017 Ltd 3.625% 8/8/2022	5,097,280	0.05
USD	345,000	Central American Bottling Corp 5.75% 31/1/2027	366,563	0.00
USD	2,365,000	Central American Bottling Corp (Restricted) ‘144A’ 5.75% 31/1/2027	2,518,725	0.03
HKD	15,000,000	China Conch Venture Holdings International Ltd 5/9/2023 (Zero Coupon)	2,116,044	0.02
USD	4,390,000	China Huadian Overseas Development 2018 Ltd FRN 23/6/2025 (Perpetual)	4,510,725	0.05
USD	1,630,000	Chinalco Capital Holdings Ltd FRN 11/9/2024 (Perpetual)*	1,670,750	0.02
USD	3,200,000	Chinalco Capital Holdings Ltd 4.25% 21/4/2022	3,266,000	0.03
USD	2,795,000	Coastal Emerald Ltd FRN 1/8/2024 (Perpetual)*	2,877,103	0.03
USD	1,540,000	Coastal Emerald Ltd 3.95% 1/8/2022*	1,560,451	0.02
USD	1,600,000	CP Foods Capital Ltd 0.5% 18/6/2025	1,674,000	0.02
USD	1,600,000	Easy Tactic Ltd 8.625% 27/2/2024*	1,436,000	0.02
USD	200,000	Easy Tactic Ltd 9.125% 28/7/2022	190,500	0.00
USD	200,000	ENN Clean Energy International Investment Ltd 7.5% 27/2/2021	203,125	0.00
USD	2,260,000	Franshion Brilliant Ltd 4.25% 23/7/2029	2,341,058	0.02
USD	859,000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd ‘144A’ 5.125% 15/5/2024*	948,792	0.01
USD	200,000	Greenland Global Investment Ltd 7.25% 12/3/2022	205,250	0.00
USD	1,535,000	Guojing Capital BVI Ltd 3.95% 11/12/2022	1,581,549	0.02
USD	2,400,000	Hopson Capital International Group Co Ltd 6% 17/2/2021	2,397,000	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英領バージン諸島（続き）		
USD	5,190,000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.25% 13/11/2024	5,406,912	0.06
USD	3,710,000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 3.875% 13/11/2029	3,967,244	0.04
USD	4,036,000	Huarong Finance 2019 Co Ltd 4.5% 29/5/2029	4,507,852	0.05
USD	3,430,000	Huarong Finance II Co Ltd 5% 19/11/2025	3,868,611	0.04
USD	1,853,000	Knight Castle Investments Ltd 7.99% 23/1/2021	1,469,429	0.02
USD	1,545,000	New Lion Bridge Co Ltd 9.75% 10/10/2020	1,531,481	0.02
USD	2,970,000	NWD MTN Ltd 4.125% 18/7/2029	3,008,264	0.03
USD	2,218,000	Prime Bloom Holdings Ltd 6.95% 5/7/2022	746,168	0.01
USD	630,000	RKPF Overseas 2019 A Ltd 6% 4/9/2025	635,556	0.01
USD	300,000	RKPF Overseas 2019 A Ltd 7.875% 1/2/2023	317,250	0.00
USD	1,959,000	Rock International Investment Inc (Defaulted) 6.625% 27/3/2020	924,599	0.01
USD	5,365,000	Rongshi International Finance Ltd 3.75% 21/5/2029	6,045,684	0.06
USD	1,390,000	Scenery Journey Ltd 11.5% 24/10/2022	1,358,725	0.01
USD	200,000	Scenery Journey Ltd 13% 6/11/2022	201,000	0.00
USD	263,000	Shanghai Port Group BVI Holding Co Ltd 9/8/2022 (Zero Coupon)	262,156	0.00
USD	1,925,000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 4.75% 5/8/2029	1,973,968	0.02
USD	1,370,000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd 5.25% 30/4/2022*	1,424,718	0.01
USD	2,410,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd ‘144A’ 2.15% 13/5/2025	2,504,521	0.03
USD	200,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd ‘144A’ 2.7% 13/5/2030	212,331	0.00
USD	181,400	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd ‘144A’ 6.75% 24/4/2033	199,653	0.00
USD	200,000	Studio City Finance Ltd 7.25% 11/2/2024	210,250	0.00
USD	2,770,000	Sunny Express Enterprises Corp 3.125% 23/4/2030	2,982,168	0.03
			85,799,956	0.88
		カナダ		
USD	243,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ‘144A’ 3.875% 15/1/2028*	248,878	0.00
USD	5,021,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ‘144A’ 4.25% 15/5/2024	5,139,998	0.05
USD	857,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ‘144A’ 5% 15/10/2025	879,878	0.01
USD	191,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc ‘144A’ 5.75% 15/4/2025	203,715	0.00
USD	2,621,966	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust ‘144A’ 5% 15/12/2023	2,156,707	0.02
EUR	6,306,000	Bausch Health Cos Inc 4.5% 15/5/2023	7,582,237	0.08
USD	6,371,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 5.5% 1/11/2025	6,579,650	0.07
USD	521,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 5.75% 15/8/2027	562,529	0.01
USD	1,921,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 6.125% 15/4/2025	1,974,212	0.02
USD	5,176,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 7% 15/3/2024	5,388,216	0.06
USD	448,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 7% 15/1/2028	478,603	0.01
USD	890,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 7.25% 30/5/2029	969,375	0.01
USD	883,000	Bausch Health Cos Inc ‘144A’ 9% 15/12/2025	967,609	0.01
USD	5,061,000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US Corp ‘144A’ 6.25% 15/9/2027	5,148,631	0.05
USD	527,000	Canadian National Railway Co 2.45% 1/5/2050	526,968	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		カナダ（続き）		
USD	2,609,000	Canadian Pacific Railway Co 2.05% 5/3/2030	2,725,945	0.03
USD	284,000	Masonite International Corp ‘144A’ 5.375% 1/2/2028	305,070	0.00
USD	105,000	Masonite International Corp ‘144A’ 5.75% 15/9/2026	110,886	0.00
USD	2,099,000	Mattamy Group Corp ‘144A’ 4.625% 1/3/2030	2,170,828	0.02
USD	2,200,000	Mattamy Group Corp ‘144A’ 5.25% 15/12/2027	2,305,875	0.02
USD	3,115,000	MEGlobal Canada ULC ‘144A’ 5% 18/5/2025	3,407,031	0.04
USD	7,000,000	MEGlobal Canada ULC 5% 18/5/2025	7,656,250	0.08
USD	2,725,000	MEGlobal Canada ULC 5.875% 18/5/2030	3,289,586	0.03
USD	1,820,000	MEGlobal Canada ULC ‘144A’ 5.875% 18/5/2030*	2,197,081	0.02
USD	4,055,000	NOVA Chemicals Corp ‘144A’ 4.875% 1/6/2024	4,034,745	0.04
USD	5,865,000	NOVA Chemicals Corp ‘144A’ 5.25% 1/8/2023	5,883,269	0.06
EUR	1,632,000	Royal Bank of Canada 0.125% 23/7/2024*	1,953,808	0.02
USD	6,638,330	Stoneway Capital Corp (Defaulted) ‘144A’ 10% 1/3/2027	3,186,398	0.03
USD	6,152,145	Stoneway Capital Corp (Defaulted) 10% 1/3/2027	2,953,030	0.03
			80,987,008	0.83
		ケイマン諸島		
USD	1,565,000	21Vianet Group Inc 7.875% 15/10/2021	1,604,004	0.02
USD	793,000	Agile Group Holdings Ltd FRN 7/3/2023 (Perpetual)	802,913	0.01
USD	3,051,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	3,004,641	0.03
USD	3,258,709	Ambac LSNI LLC ‘144A’ FRN 12/2/2023	3,268,860	0.03
USD	3,565,000	Baidu Inc 3.075% 7/4/2025	3,804,900	0.04
USD	740,000	Baidu Inc 3.425% 7/4/2030*	824,753	0.01
USD	773,000	Baozun Inc 1.625% 1/5/2024	778,797	0.01
USD	228,539	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd 5/6/2034 (Zero Coupon)	168,476	0.00
USD	200,000	Bright Scholar Education Holdings Ltd 7.45% 31/7/2022	207,250	0.00
USD	515,000	Central China Real Estate Ltd 6.5% 5/3/2021	518,772	0.01
USD	1,055,000	Central China Real Estate Ltd 6.75% 8/11/2021	1,066,869	0.01
USD	1,405,000	Central China Real Estate Ltd 6.875% 23/10/2020	1,408,513	0.01
USD	200,000	Central China Real Estate Ltd 7.25% 24/4/2023	204,250	0.00
USD	950,000	Central China Real Estate Ltd 7.25% 13/8/2024	945,250	0.01
USD	300,000	CFLD Cayman Investment Ltd 7.125% 8/4/2022*	306,000	0.00
USD	1,824,000	CFLD Cayman Investment Ltd 8.6% 8/4/2024	1,858,200	0.02
USD	1,597,000	CFLD Cayman Investment Ltd 8.625% 28/2/2021	1,624,947	0.02
USD	2,400,000	China Aoyuan Group Ltd 4.8% 18/2/2021	2,398,500	0.03
USD	1,700,000	China Aoyuan Group Ltd 6.35% 8/2/2024	1,731,875	0.02
USD	4,632,000	China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/2/2023	4,901,235	0.05
HKD	22,000,000	China Education Group Holdings Ltd 2% 28/3/2024	3,507,239	0.04
HKD	93,000,000	China Evergrande Group 4.25% 14/2/2023	11,603,796	0.12
USD	1,264,000	China Evergrande Group 7.5% 28/6/2023	1,127,330	0.01
USD	200,000	China Evergrande Group 9.5% 11/4/2022	194,500	0.00
USD	1,413,000	China Evergrande Group 10% 11/4/2023	1,333,519	0.01
USD	200,000	China Evergrande Group 11.5% 22/1/2023	196,250	0.00
USD	3,424,000	China Evergrande Group 12% 22/1/2024	3,331,980	0.03
USD	3,240,000	China Resources Land Ltd FRN 9/12/2024 (Perpetual)	3,325,050	0.03
USD	1,900,000	China SCE Group Holdings Ltd 7.25% 19/4/2023	1,952,250	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ケイマン諸島（続き）		
USD	1,233,000	China SCE Group Holdings Ltd 7.375% 9/4/2024	1,262,284	0.01
USD	200,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 6.55% 28/3/2024	209,750	0.00
USD	300,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 7.625% 28/2/2023*	318,938	0.00
USD	416,000	Comunicaciones Celulares SA Via Comcel Trust 6.875% 6/2/2024	425,230	0.00
USD	1,621,000	Comunicaciones Celulares SA Via Comcel Trust 6.875% 6/2/2024	1,656,966	0.02
USD	1,975,000	Country Garden Holdings Co Ltd 5.4% 27/5/2025	2,103,375	0.02
USD	200,000	Country Garden Holdings Co Ltd 6.5% 8/4/2024	216,000	0.00
USD	2,213,000	DP World Crescent Ltd 3.908% 31/5/2023	2,337,827	0.02
USD	3,374,000	Embraer Overseas Ltd 5.696% 16/9/2023*	3,405,104	0.04
USD	3,635,000	Esic Sukuk Ltd 3.939% 30/7/2024	3,654,879	0.04
USD	1,781,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 7.95% 5/7/2022*	1,785,453	0.02
USD	1,580,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 8.375% 8/3/2021	1,597,281	0.02
USD	400,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.75% 17/4/2022	423,998	0.00
USD	733,000	FWD Ltd FRN 1/2/2023 (Perpetual)	699,099	0.01
USD	4,721,000	Grupo Aval Ltd ‘144A’ 4.375% 4/2/2030	4,638,382	0.05
USD	1,235,000	Grupo Aval Ltd 4.75% 26/9/2022	1,270,699	0.01
HKD	33,000,000	Harvest International Co 21/11/2022 (Zero Coupon)	4,566,741	0.05
USD	645,000	Hilong Holding Ltd (Restricted) 8.25% 26/9/2022	297,405	0.00
USD	1,920,000	Jingrui Holdings Ltd 9.45% 23/4/2021	1,890,600	0.02
USD	556,000	JOYY Inc 0.75% 15/6/2025	637,315	0.01
USD	1,655,000	Kaisa Group Holdings Ltd 6.75% 18/2/2021	1,659,138	0.02
USD	1,398,000	Kaisa Group Holdings Ltd 8.5% 30/6/2022	1,412,924	0.02
USD	200,000	Kaisa Group Holdings Ltd 11.5% 30/1/2023	211,500	0.00
USD	1,500,000	Kaisa Group Holdings Ltd 11.95% 22/10/2022	1,608,750	0.02
USD	1,206,000	King Talent Management Ltd FRN 4/12/2022 (Perpetual)	1,074,847	0.01
USD	200,000	KWG Group Holdings Ltd 7.875% 1/9/2023	210,250	0.00
USD	514,000	Latam Finance Ltd (Defaulted) ‘144A’ 6.875% 11/4/2024	180,462	0.00
USD	886,000	Latam Finance Ltd (Defaulted) 6.875% 11/4/2024	311,069	0.00
USD	200,000	Lima Metro Line 2 Finance Ltd ‘144A’ 4.35% 5/4/2036	226,500	0.00
USD	200,000	Logan Group Co Ltd 6.5% 16/7/2023	207,750	0.00
USD	1,545,000	Longfor Group Holdings Ltd 3.95% 16/9/2029	1,654,598	0.02
USD	1,544,000	MAF Global Securities Ltd FRN 7/9/2022 (Perpetual)*	1,536,280	0.02
USD	1,235,000	MAF Global Securities Ltd 4.75% 7/5/2024	1,324,538	0.01
USD	800,000	MAF Sukuk Ltd 4.638% 14/5/2029	871,875	0.01
USD	306,000	Melco Resorts Finance Ltd ‘144A’ 5.375% 4/12/2029	315,562	0.00
USD	200,000	Melco Resorts Finance Ltd 5.625% 17/7/2027	207,775	0.00
USD	255,000	MGM China Holdings Ltd ‘144A’ 5.375% 15/5/2024	265,519	0.00
USD	255,000	MGM China Holdings Ltd ‘144A’ 5.875% 15/5/2026	270,300	0.00
USD	1,250,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd FRN 15/1/2028	1,187,865	0.01
USD	774,413	Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd ‘144A’ 6.35% 1/12/2021	708,588	0.01
USD	1,294,671	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd ‘144A’ 6.72% 1/12/2022	1,152,257	0.01
USD	60,767	Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd ‘144A’ 7.72% 1/12/2026	6,988	0.00

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ケイマン諸島（続き）		
USD	289,000	Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd ‘144A’ 2/10/2020 (Perpetual) (Zero Coupon)	1,300	0.00
USD	3,176,828	OFSI Fund VI Ltd FRN 20/3/2025	3,131,719	0.03
USD	6,807,000	OZLM XIX Ltd FRN 22/11/2030	6,726,356	0.07
USD	330,000	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	314,356	0.00
USD	916,795	Parallel 2015-1 Ltd FRN 20/7/2027	906,971	0.01
USD	2,200,000	Pearl Holding III Ltd 9.5% 11/12/2022	550,005	0.01
USD	8,000,000	Poseidon Finance 1 Ltd 1/2/2025 (Zero Coupon)	7,838,560	0.08
USD	1,375,000	Powerlong Real Estate Holdings Ltd 7.125% 8/11/2022	1,431,719	0.02
USD	2,400,000	Redsun Properties Group Ltd 11.5% 4/3/2021	2,482,500	0.03
USD	1,380,000	Ronshine China Holdings Ltd 8.75% 25/10/2022	1,442,100	0.02
USD	560,000	Ronshine China Holdings Ltd 8.95% 22/1/2023	594,300	0.01
USD	760,000	Ronshine China Holdings Ltd 11.25% 22/8/2021	803,700	0.01
USD	3,819,000	Sands China Ltd 4.375% 18/6/2030	4,130,210	0.04
USD	600,000	Seazen Group Ltd 6% 12/8/2024	603,000	0.01
USD	970,000	Seazen Group Ltd 6.5% 12/9/2020	970,027	0.01
USD	1,800,000	Seazen Group Ltd 7.5% 22/1/2021	1,824,187	0.02
USD	2,480,000	Shimao Group Holdings Ltd 4.6% 13/7/2030	2,574,860	0.03
USD	300,000	Shui On Development Holding Ltd 5.75% 12/11/2023	301,875	0.00
USD	580,000	Shui On Development Holding Ltd 6.15% 24/8/2024	585,142	0.01
EUR	3,189,000	Sino Biopharmaceutical Ltd 17/2/2025 (Zero Coupon)	3,817,707	0.04
USD	299,305	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 5/12/2022 (Zero Coupon)	291,402	0.00
USD	1,800,000	Sunac China Holdings Ltd 6.65% 3/8/2024	1,815,750	0.02
USD	200,000	Sunac China Holdings Ltd 7.875% 15/2/2022	206,500	0.00
USD	200,000	Tencent Holdings Ltd ‘144A’ 2.39% 3/6/2030	207,227	0.00
USD	4,775,000	Tencent Holdings Ltd 3.24% 3/6/2050*	5,008,259	0.05
USD	1,922,000	Tencent Holdings Ltd ‘144A’ 3.24% 3/6/2050*	2,015,890	0.02
USD	1,348,000	Times China Holdings Ltd 5.75% 26/4/2022*	1,364,850	0.01
USD	200,000	Times China Holdings Ltd 6.75% 16/7/2023	207,750	0.00
GBP	800,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	861,130	0.01
USD	850,980	Transocean Guardian Ltd ‘144A’ 5.875% 15/1/2024	682,911	0.01
USD	6,457,100	Transocean Phoenix 2 Ltd ‘144A’ 7.75% 15/10/2024	6,037,388	0.06
USD	575,900	Transocean Proteus Ltd ‘144A’ 6.25% 1/12/2024	521,189	0.01
USD	350,000	Tryon Park CLO Ltd FRN 15/4/2029	348,146	0.00
EUR	830,000	UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029	1,010,957	0.01
USD	2,905,000	Vale Overseas Ltd 3.75% 8/7/2030	3,064,775	0.03
USD	177,000	Weibo Corp 1.25% 15/11/2022	169,920	0.00
USD	653,000	Wynn Macau Ltd ‘144A’ 4.875% 1/10/2024	657,081	0.01
USD	340,000	Wynn Macau Ltd ‘144A’ 5.125% 15/12/2029	335,750	0.00
USD	280,000	Wynn Macau Ltd 5.5% 15/1/2026	284,830	0.00
USD	255,000	Wynn Macau Ltd ‘144A’ 5.5% 1/10/2027	257,231	0.00
USD	200,000	Wynn Macau Ltd 5.5% 1/10/2027	201,750	0.00
USD	2,400,000	Yankuang Group Cayman Ltd 4.75% 30/11/2020	2,413,008	0.03
USD	1,560,000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6% 25/10/2023	1,563,900	0.02
USD	1,955,000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.5% 26/2/2024	2,079,631	0.02
USD	975,000	Zhenro Properties Group Ltd 5.6% 28/2/2021	973,781	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ケイマン諸島（続き）		
USD	200,000	Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 8/3/2022	208,250	0.00
USD	1,605,000	Zhenro Properties Group Ltd 9.15% 6/5/2023*	1,684,247	0.02
			183,507,677	1.88
		チリ		
USD	200,000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 4.2% 29/1/2030	213,844	0.00
USD	1,829,000	Celulosa Arauco y Constitucion SA ‘144A’ 4.25% 30/4/2029	1,959,316	0.02
USD	218,000	Chile Government International Bond 2.25% 30/10/2022	226,843	0.00
USD	425,000	Chile Government International Bond 2.45% 31/1/2031	448,375	0.01
USD	376,000	Chile Government International Bond 3.5% 25/1/2050	440,860	0.01
USD	803,000	Colbun SA ‘144A’ 3.15% 6/3/2030	872,008	0.01
USD	750,000	Corp Nacional del Cobre de Chile ‘144A’ 3.75% 15/1/2031	832,500	0.01
USD	2,545,000	Embotelladora Andina SA ‘144A’ 3.95% 21/1/2050*	2,700,086	0.03
USD	1,275,000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado ‘144A’ 3.068% 18/8/2050	1,279,781	0.01
USD	1,145,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA ‘144A’ 3.65% 7/5/2030	1,275,244	0.01
USD	261,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA ‘144A’ 5% 25/1/2047	331,715	0.00
USD	2,539,000	Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA ‘144A’ 4.75% 1/8/2026*	2,823,844	0.03
USD	200,000	Enel Americas SA 4% 25/10/2026	219,656	0.00
USD	200,000	GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	218,500	0.00
USD	953,000	Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch ‘144A’ 4.375% 15/5/2023	1,013,456	0.01
USD	404,000	VTR Comunicaciones SpA ‘144A’ 5.125% 15/1/2028	426,599	0.01
			15,282,627	0.16
		中国		
CNY	30,000,000	Central Huijin Investment Ltd 3.83% 22/5/2024	4,404,196	0.04
EUR	2,600,000	Chengdu Xingcheng Investment Group Co Ltd 2.5% 20/3/2021	3,086,787	0.03
USD	2,270,000	China Construction Bank Corp FRN 27/2/2029	2,451,347	0.02
USD	5,900,000	China Construction Bank Corp FRN 24/6/2030	5,990,676	0.06
CNY	382,830,000	China Development Bank 2.89% 22/6/2025	54,504,607	0.56
CNY	78,000,000	China Development Bank 3.3% 1/2/2024	11,340,506	0.12
CNY	53,470,000	China Development Bank 3.45% 20/9/2029	7,654,368	0.08
CNY	37,000,000	China Development Bank 3.68% 26/2/2026	5,427,208	0.06
CNY	36,800,000	China Development Bank 4.04% 6/7/2028	5,508,135	0.06
CNY	381,550,000	China Government Bond 1.99% 9/4/2025	53,466,862	0.55
CNY	294,200,000	China Government Bond 2.41% 19/6/2025	41,834,603	0.43
CNY	61,340,000	China Government Bond 2.68% 21/5/2030	8,696,376	0.09
CNY	316,500,000	China Government Bond 2.85% 4/6/2027	45,350,565	0.46
CNY	121,250,000	China Government Bond 3.13% 21/11/2029	17,751,240	0.18
CNY	48,000,000	China Government Bond 3.19% 11/4/2024	7,068,447	0.07
CNY	283,870,000	China Government Bond 3.29% 23/5/2029	41,953,029	0.43
CNH	10,000,000	China Government Bond 3.3% 4/7/2023	1,489,896	0.02
CNY	80,250,000	China Government Bond 3.86% 22/7/2049	11,948,323	0.12
CNY	97,400,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	15,076,978	0.15
USD	947,000	China Minmetals Corp FRN 13/11/2022 (Perpetual)	965,940	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		中国（続き）		
CNY	30,000,000	China National Petroleum Corp 4.16% 16/8/2025	4,483,054	0.05
CNY	30,000,000	China Southern Power Grid Co Ltd 3.76% 14/1/2024	4,395,863	0.04
CNY	20,000,000	China State Railway Group Co Ltd 4.88% 17/10/2024	3,068,321	0.03
CNY	10,000,000	China State Railway Group Co Ltd 5.42% 27/5/2024	1,555,177	0.02
USD	1,800,000	Guangxi Financial Investment Group Co Ltd 5.75% 23/1/2021	1,789,312	0.02
USD	1,032,000	Huachen Energy Co Ltd (Defaulted) 6.625% 18/5/2020	374,584	0.00
USD	687,000	Inner Mongolia High-Grade High Way Construction And Development Co Ltd 4.375% 4/12/2020	687,787	0.01
CNY	20,000,000	PetroChina Co Ltd 3.66% 22/2/2024	2,919,545	0.03
CNY	30,000,000	PetroChina Co Ltd 3.96% 23/4/2024	4,423,357	0.05
CNY	10,000,000	State Grid Corp of China 5.38% 19/8/2024	1,560,135	0.02
USD	1,157,000	Union Life Insurance Co Ltd 3% 19/9/2021	1,069,502	0.01
USD	2,240,000	Zhengzhou Real Estate Group Co Ltd 3.95% 9/10/2022	2,268,350	0.02
			374,565,076	3.84
		コロンビア		
USD	232,000	Bancolombia SA FRN 18/12/2029*	224,968	0.00
USD	3,023,000	Bancolombia SA 3% 29/1/2025	3,075,902	0.03
USD	329,000	Colombia Government International Bond 3% 30/1/2030	337,225	0.00
USD	1,045,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,137,483	0.01
USD	657,000	Colombia Government International Bond 4% 26/2/2024	702,990	0.01
USD	758,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051	804,617	0.01
USD	2,336,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	2,591,865	0.03
USD	4,349,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	4,898,061	0.05
USD	732,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	890,112	0.01
COP	12,600,800,000	Colombian TES 6.25% 26/11/2025	3,632,544	0.04
COP	35,283,400,000	Colombian TES 7.25% 18/10/2034	9,936,516	0.10
USD	1,793,000	Ecopetrol SA 5.375% 26/6/2026	1,983,226	0.02
USD	1,967,000	Ecopetrol SA 5.875% 28/5/2045	2,227,037	0.02
USD	2,262,000	Ecopetrol SA 6.875% 29/4/2030	2,730,234	0.03
USD	2,649,000	Empresas Publicas de Medellin ESP ‘144A’ 4.25% 18/7/2029	2,684,596	0.03
USD	1,428,000	Empresas Publicas de Medellin ESP ‘144A’ 4.375% 15/2/2031*	1,451,205	0.02
USD	1,765,000	Grupo Energia Bogota SA ESP ‘144A’ 4.875% 15/5/2030	1,990,037	0.02
USD	2,193,000	Oleoducto Central SA ‘144A’ 4% 14/7/2027	2,291,685	0.02
USD	211,000	SURA Asset Management SA ‘144A’ 4.875% 17/4/2024	230,452	0.00
			43,820,755	0.45
		クロアチア		
EUR	10,095,000	Croatia Government International Bond 1.5% 17/6/2031	12,506,618	0.13
		デンマーク		
EUR	2,165,000	Danske Bank A/S FRN 27/8/2025	2,570,593	0.03
EUR	880,000	DSV PANALPINA A/S 0.375% 26/2/2027	1,039,122	0.01
EUR	300,000	ISS Global A/S 1.5% 31/8/2027	365,598	0.00
			3,975,313	0.04
		ドミニカ共和国		
USD	743,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA ‘144A’ 6.75% 30/3/2029	677,987	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ドミニカ共和国（続き）		
USD	235,000	Dominican Republic International Bond ‘144A’ 4.5% 30/1/2030	232,246	0.00
USD	577,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	605,219	0.01
USD	818,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	858,005	0.01
USD	2,890,000	Dominican Republic International Bond 5.875% 30/1/2060	2,770,336	0.03
USD	706,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	757,737	0.01
USD	2,757,000	Dominican Republic International Bond 6% 19/7/2028*	2,968,514	0.03
USD	4,233,000	Dominican Republic International Bond 6.4% 5/6/2049	4,317,660	0.04
USD	162,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	179,314	0.00
			13,367,018	0.14
		エクアドル		
USD	2,353,000	Ecuador Government International Bond (Restricted) 7.875% 31/7/2040	1,200,398	0.01
		エジプト		
USD	283,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 5.577% 21/2/2023	292,659	0.00
EUR	3,981,000	Egypt Government International Bond 5.625% 16/4/2030*	4,429,777	0.05
USD	430,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 5.75% 29/5/2024	443,476	0.01
USD	1,356,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/6/2025*	1,403,884	0.01
USD	324,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 6.125% 31/1/2022	333,416	0.00
EUR	5,888,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 6.375% 11/4/2031	6,759,134	0.07
USD	454,000	Egypt Government International Bond 7.6003% 1/3/2029	478,261	0.01
USD	998,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 8.5% 31/1/2047	1,029,499	0.01
USD	4,069,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 8.875% 29/5/2050	4,255,920	0.04
			19,426,026	0.20
		フィンランド		
EUR	831,000	Citycon Oyj FRN 24/11/2024 (Perpetual)	869,653	0.01
USD	625,000	Nordea Bank Abp ‘144A’ FRN 26/3/2026 (Perpetual)*	697,397	0.01
EUR	4,300,000	OP Corporate Bank plc FRN 9/6/2030	5,243,899	0.05
			6,810,949	0.07
		フランス		
EUR	1,900,000	Accor SA FRN 30/1/2024 (Perpetual)*	2,171,816	0.02
EUR	1,668,000	Altice France SA/France 2.125% 15/2/2025	1,929,702	0.02
EUR	3,039,000	Altice France SA/France 2.5% 15/1/2025	3,549,841	0.04
EUR	7,996,000	Altice France SA/France 5.875% 1/2/2027	10,279,638	0.11
USD	3,176,000	Altice France SA/France ‘144A’ 7.375% 1/5/2026	3,374,024	0.03
USD	1,074,000	Altice France SA/France ‘144A’ 8.125% 1/2/2027	1,201,425	0.01
EUR	1,772,000	Banijay Entertainment SASU 3.5% 1/3/2025*	2,105,877	0.02
EUR	200,000	BNP Paribas SA FRN 17/6/2022 (Perpetual)	251,209	0.00
USD	1,100,000	BNP Paribas SA ‘144A’ FRN 25/3/2024 (Perpetual)*	1,182,225	0.01
USD	200,000	BNP Paribas SA FRN 25/3/2024 (Perpetual)	214,950	0.00
EUR	1,400,000	BNP Paribas SA FRN 15/7/2025	1,679,022	0.02
USD	800,000	BNP Paribas SA FRN 19/8/2025 (Perpetual)*	906,556	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		フランス（続き）		
USD	1,053,000	BNP Paribas SA ‘144A’ FRN 25/2/2030 (Perpetual)	1,016,803	0.01
USD	7,350,000	BNP Paribas SA ‘144A’ FRN 12/8/2035	7,298,360	0.08
USD	84,000	BNP Paribas SA 6.5% 6/12/2020 (Perpetual)	86,074	0.00
EUR	3,200,000	BPCE SA 0.625% 26/9/2024	3,865,969	0.04
EUR	3,900,000	Capgemini SE 1.125% 23/6/2030	4,789,561	0.05
EUR	1,400,000	Capgemini SE 2.375% 15/4/2032	1,929,384	0.02
EUR	1,000,000	Casino Guichard Perrachon SA FRN 31/1/2024 (Perpetual)	511,575	0.01
EUR	600,000	Casino Guichard Perrachon SA 3.58% 7/2/2025	571,920	0.01
EUR	900,000	Casino Guichard Perrachon SA 4.498% 7/3/2024*	896,307	0.01
EUR	600,000	Cie de Saint-Gobain 2.375% 4/10/2027	805,031	0.01
EUR	400,000	CMA CGM SA 6.5% 15/7/2022	469,807	0.01
EUR	1,600,000	Credit Agricole Assurances SA 2% 17/7/2030	1,947,554	0.02
EUR	1,534,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2021 (Perpetual)	1,903,315	0.02
USD	400,000	Credit Agricole SA ‘144A’ FRN 23/9/2024 (Perpetual)*	433,778	0.00
GBP	800,000	Credit Agricole SA FRN 23/6/2026 (Perpetual)	1,210,879	0.01
EUR	1,982,000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/2/2023	2,326,511	0.02
EUR	600,000	Crown European Holdings SA 2.25% 1/2/2023	725,381	0.01
EUR	334,000	Crown European Holdings SA ‘144A’ 2.25% 1/2/2023	407,922	0.00
EUR	227,000	Crown European Holdings SA 3.375% 15/5/2025	292,036	0.00
EUR	900,000	Danone SA 0.395% 10/6/2029	1,093,379	0.01
EUR	1,100,000	Electricite de France SA FRN 4/7/2024 (Perpetual)	1,386,462	0.01
EUR	2,700,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2025 (Perpetual)*	3,579,764	0.04
EUR	1,200,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2026 (Perpetual)	1,591,908	0.02
GBP	2,300,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2026 (Perpetual)	3,362,553	0.03
EUR	200,000	Electricite de France SA FRN 3/9/2027 (Perpetual)	240,279	0.00
GBP	100,000	Electricite de France SA FRN 22/1/2029 (Perpetual)	144,200	0.00
EUR	3,200,000	Electricite de France SA 2% 9/12/2049	3,919,993	0.04
EUR	411,000	Faurecia SE 2.625% 15/6/2025	488,406	0.01
EUR	583,000	Faurecia SE 3.75% 15/6/2028	707,519	0.01
EUR	500,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	587,215	0.01
EUR	300,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	351,198	0.00
EUR	500,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	590,205	0.01
EUR	600,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	704,817	0.01
EUR	873,585	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,024,385	0.01
EUR	873,585	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	1,032,563	0.01
EUR	4,704,914	French Republic Government Bond OAT ‘144A’ 1.5% 25/5/2050	7,051,053	0.07
EUR	400,000	Iliad SA 2.375% 17/6/2026	483,940	0.01
EUR	500,000	JCDecaux SA 2.625% 24/4/2028	631,373	0.01
EUR	206,000	Kapla Holding SAS FRN 15/12/2026	236,237	0.00
EUR	448,000	Kapla Holding SAS 3.375% 15/12/2026	512,316	0.01
EUR	800,000	Kering SA 30/9/2022 (Zero Coupon)	990,422	0.01
EUR	628,000	Loxam SAS 3.25% 14/1/2025	737,766	0.01
EUR	167,000	Loxam SAS 3.5% 15/4/2022	201,922	0.00
EUR	300,000	Loxam SAS 3.5% 3/5/2023	358,697	0.00
EUR	1,357,000	Loxam SAS 3.75% 15/7/2026	1,606,113	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		フランス（続き）		
EUR	300,000	Loxam SAS 4.25% 15/4/2024	360,010	0.00
GBP	3,600,000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 1.125% 11/2/2027	4,831,431	0.05
EUR	400,000	Novafives SAS 5% 15/6/2025	353,032	0.00
EUR	1,000,000	Orange SA FRN 1/10/2026 (Perpetual)	1,420,601	0.01
EUR	200,000	Orano SA 3.375% 23/4/2026	250,934	0.00
EUR	1,450,000	Picard Groupe SAS FRN 30/11/2023	1,707,642	0.02
EUR	300,000	Quatrim SASU 5.875% 15/1/2024	358,250	0.00
EUR	500,000	RCI Banque SA FRN 18/2/2030	564,184	0.01
EUR	280,000	Rexel SA 2.625% 15/6/2024*	341,463	0.00
EUR	812,000	Rubis Terminal Infra SAS 5.625% 15/5/2025	1,010,111	0.01
EUR	400,000	Societe Generale SA FRN 7/4/2021 (Perpetual)	487,714	0.01
USD	248,000	Societe Generale SA ‘144A’ FRN 13/9/2021 (Perpetual)	256,457	0.00
USD	1,600,000	Societe Generale SA FRN 13/9/2021 (Perpetual)	1,654,560	0.02
USD	400,000	Societe Generale SA FRN 29/9/2025 (Perpetual)	455,192	0.00
EUR	1,700,000	Societe Generale SA 0.5% 13/1/2023	2,033,462	0.02
EUR	1,400,000	Solvay Finance SACA FRN 12/11/2023 (Perpetual)	1,838,274	0.02
EUR	600,000	SPIE SA 2.625% 18/6/2026	728,114	0.01
EUR	1,900,000	Suez SA 1.25% 14/5/2035	2,356,105	0.02
EUR	1,900,000	Teleperformance 1.875% 2/7/2025	2,408,247	0.03
EUR	3,200,000	Terega SASU 0.625% 27/2/2028	3,637,548	0.04
EUR	100,000	TOTAL SE (Restricted) FRN 26/2/2021 (Perpetual)	120,778	0.00
EUR	160,000	TOTAL SE FRN 5/5/2023 (Perpetual)	198,652	0.00
EUR	200,000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.75% 1/7/2049	213,921	0.00
EUR	1,900,000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 2% 29/6/2032	2,338,996	0.02
USD	600,000	Valeo SA 16/6/2021 (Zero Coupon)	591,357	0.01
EUR	5,002	Worldline SA/France 30/7/2025 (Zero Coupon)	760,212	0.01
EUR	4,840,000	WPP Finance SA 2.375% 19/5/2027	6,180,414	0.06
			131,406,798	1.35
		ドイツ		
EUR	100,000	ADLER Real Estate AG 1.5% 17/4/2022	119,048	0.00
EUR	500,000	ADLER Real Estate AG 1.875% 27/4/2023	582,402	0.01
EUR	1,400,000	ADLER Real Estate AG 3% 27/4/2026	1,653,116	0.02
EUR	2,620,000	Amphenol Technologies Holding GmbH 0.75% 4/5/2026	3,148,107	0.03
EUR	700,000	Bayer AG FRN 12/11/2079	827,961	0.01
EUR	600,000	Bayer AG FRN 12/11/2079	726,354	0.01
EUR	4,100,000	Bayer AG 0.375% 6/7/2024	4,932,760	0.05
EUR	4,300,000	Bayer AG 1.375% 6/7/2032	5,239,283	0.05
EUR	1,559,000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.5% 11/2/2027	1,850,290	0.02
EUR	1,400,000	Commerzbank AG FRN 9/10/2025 (Perpetual)	1,665,572	0.02
EUR	400,000	Commerzbank AG FRN 5/12/2030	494,961	0.01
EUR	581,000	Consus Real Estate AG 9.625% 15/5/2024	752,420	0.01
EUR	750,000	Continental AG 2.5% 27/8/2026	967,445	0.01
EUR	4,160,000	Covestro AG (Restricted) 1.375% 12/6/2030	5,145,866	0.05
EUR	1,500,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.875% 15/10/2024	1,663,783	0.02
EUR	11,900,641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026	16,145,647	0.17

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ドイツ（続き）		
EUR	100,000	Deutsche Pfandbriefbank AG 4.6% 22/2/2027	119,616	0.00
EUR	3,330,000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2.125% 9/7/2027	4,024,057	0.04
EUR	2,380,000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 1% 29/5/2026	2,909,108	0.03
EUR	2,010,000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 1.5% 29/5/2030	2,494,393	0.03
EUR	1,676,000	Fresenius SE & Co KGaA 1.625% 8/10/2027	2,113,134	0.02
EUR	284,000	HT Troplast GmbH 9.25% 15/7/2025	366,028	0.00
EUR	779,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.625% 15/5/2025	959,290	0.01
EUR	970,715	IHO Verwaltungs GmbH 3.875% 15/5/2027	1,204,962	0.01
USD	200,000	IHO Verwaltungs GmbH ‘144A’ 6% 15/5/2027	210,587	0.00
EUR	2,500,000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 31/1/2028	2,809,557	0.03
EUR	600,000	Infineon Technologies AG FRN 1/1/2025 (Perpetual)	730,261	0.01
EUR	1,000,000	Infineon Technologies AG 1.125% 24/6/2026	1,231,864	0.01
EUR	400,000	Infineon Technologies AG 2% 24/6/2032	505,229	0.01
EUR	600,000	K+S AG 3% 20/6/2022	694,209	0.01
EUR	900,000	LEG Immobilien AG 0.4% 30/6/2028	1,124,825	0.01
EUR	300,000	Nidda BondCo GmbH 5% 30/9/2025	357,055	0.00
EUR	664,000	Nidda BondCo GmbH 7.25% 30/9/2025	821,373	0.01
EUR	742,000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	868,771	0.01
EUR	4,827,000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	5,765,568	0.06
EUR	435,000	Peach Property Finance GmbH 3.5% 15/2/2023	514,952	0.01
EUR	267,000	Platin 1426 GmbH 5.375% 15/6/2023	308,095	0.00
EUR	800,000	RAG-Stiftung 18/2/2021 (Zero Coupon)	951,956	0.01
EUR	681,000	Rebecca Bidco GmbH 5.75% 15/7/2025	830,593	0.01
EUR	626,000	RWE AG FRN 21/4/2075	746,037	0.01
USD	300,000	RWE AG FRN 30/7/2075	343,875	0.00
EUR	191,000	Schaeffler AG 1.125% 26/3/2022	226,869	0.00
EUR	22,000	Symrise AG 1.375% 1/7/2027	26,763	0.00
EUR	1,932,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	2,418,587	0.02
EUR	665,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	774,467	0.01
EUR	3,100,000	Tele Columbus AG 3.875% 2/5/2025	3,569,739	0.04
EUR	1,095,000	thyssenkrupp AG 1.875% 6/3/2023	1,253,349	0.01
EUR	95,000	thyssenkrupp AG 2.5% 25/2/2025	108,044	0.00
EUR	4,978,000	thyssenkrupp AG 2.875% 22/2/2024	5,738,248	0.06
EUR	2,641,000	Vertical Midco GmbH FRN 15/7/2027	3,195,578	0.03
EUR	1,919,000	Vertical Midco GmbH 4.375% 15/7/2027	2,352,739	0.02
EUR	1,880,000	Volkswagen Financial Services AG 1.5% 1/10/2024	2,292,917	0.02
EUR	265,000	WEPA Hygieneprodukte GmbH FRN 15/12/2026*	315,269	0.00
			101,192,979	1.04
		ギリシャ		
EUR	49,313,000	Hellenic Republic Government Bond ‘144A’ 1.5% 18/6/2030*	61,095,263	0.63
EUR	7,666,000	Hellenic Republic Government Bond ‘144A’ 1.875% 23/7/2026	9,856,991	0.10
EUR	4,859,000	Hellenic Republic Government Bond ‘144A’ 2% 22/4/2027*	6,259,410	0.06
EUR	8,912,000	Hellenic Republic Government Bond ‘144A’ 3.45% 2/4/2024	11,832,826	0.12
EUR	1,396,703	Hellenic Republic Government Bond 3.5% 30/1/2023	1,798,913	0.02

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ギリシャ（続き）		
EUR	2,850,734	Hellenic Republic Government Bond 3.75% 30/1/2028	4,098,516	0.04
EUR	18,982,000	Hellenic Republic Government Bond ‘144A’ 3.875% 12/3/2029*	28,039,663	0.29
EUR	396,332	Hellenic Republic Government Bond 3.9% 30/1/2033	618,390	0.01
EUR	315,963	Hellenic Republic Government Bond 4% 30/1/2037*	514,276	0.00
EUR	930,261	Hellenic Republic Government Bond 4.2% 30/1/2042	1,632,357	0.02
			125,746,605	1.29
		ガーンジー		
USD	321,457	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust ‘144A’ 5.25% 30/5/2023	286,265	0.00
EUR	636,000	Summit Properties Ltd 2% 31/1/2025*	709,696	0.01
			995,961	0.01
		香港		
USD	250,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 19/9/2024 (Perpetual)	249,531	0.00
USD	4,400,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 29/5/2030	4,598,519	0.05
CNH	917,253	China City Construction International Co Ltd (Restricted) (Defaulted) 5.35% 3/7/2017	8,036	0.00
USD	250,000	Chong Hing Bank Ltd FRN 15/7/2024 (Perpetual)	251,250	0.00
USD	2,495,000	CITIC Ltd 2.85% 25/2/2030	2,614,153	0.03
USD	2,450,000	CMB International Leasing Management Ltd 2.75% 12/8/2030	2,479,841	0.03
USD	220,000	Hongkong & Shanghai Banking Corp Ltd/The FRN 27/10/2020 (Perpetual)*	172,597	0.00
USD	2,300,000	Leader Goal International Ltd FRN 19/1/2023 (Perpetual)	2,360,375	0.02
USD	200,000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN 2/6/2022 (Perpetual)	200,875	0.00
USD	3,068,000	Nanyang Commercial Bank Ltd FRN 20/11/2029	3,137,284	0.03
USD	3,615,000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd 3.15% 12/5/2025	3,804,981	0.04
USD	300,000	Viva Incubator Investment Management Ltd 2.5% 11/2/2025	470,625	0.01
USD	1,405,000	Wanda Group Overseas Ltd 7.5% 24/7/2022	1,396,219	0.01
USD	1,646,000	Weichai International Hong Kong Energy Group Co Ltd FRN 14/9/2022 (Perpetual)*	1,668,632	0.02
USD	2,380,000	Yango Justice International Ltd 6.8% 11/3/2021	2,385,950	0.02
USD	200,000	Yanlord Land HK Co Ltd 6.75% 23/4/2023	207,500	0.00
USD	1,590,000	Yanlord Land HK Co Ltd 6.8% 27/2/2024	1,659,563	0.02
			27,665,931	0.28
		ハンガリー		
EUR	1,109,000	Hungary Government International Bond 1.625% 28/4/2032	1,406,159	0.01
EUR	6,706,000	Hungary Government International Bond 1.75% 5/6/2035	8,449,218	0.09
			9,855,377	0.10
		インド		
USD	3,230,000	Adani Electricity Mumbai Ltd ‘144A’ 3.949% 12/2/2030	3,246,150	0.03
USD	4,028,000	Adani Electricity Mumbai Ltd 3.949% 12/2/2030	4,048,140	0.04
USD	200,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 4% 30/7/2027	202,135	0.00
USD	2,167,000	Adani Transmission Ltd 4% 3/8/2026	2,257,219	0.02
USD	4,481,480	Adani Transmission Ltd 4.25% 21/5/2036	4,484,281	0.05
USD	902,000	Bharat Petroleum Corp Ltd 4% 8/5/2025	952,348	0.01
USD	6,500,000	Bharti Airtel Ltd 1.5% 17/2/2025	7,202,780	0.08
USD	200,000	HPCL-Mittal Energy Ltd 5.45% 22/10/2026	202,500	0.00

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		インド（続き）		
INR	4,202,160,000	India Government Bond 7.26% 14/1/2029	60,602,561	0.62
USD	3,108,000	Muthoot Finance Ltd ‘144A’ 6.125% 31/10/2022	3,197,355	0.03
USD	2,510,000	Oil India Ltd 5.125% 4/2/2029	2,737,469	0.03
USD	2,540,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 18/6/2024	2,640,442	0.03
USD	3,793,000	Power Finance Corp Ltd 3.75% 6/12/2027	3,794,198	0.04
USD	1,475,000	REC Ltd 4.75% 19/5/2023	1,560,242	0.02
USD	2,200,000	ReNew Power Synthetic 6.67% 12/3/2024	2,310,000	0.02
USD	200,000	ReNew Power Synthetic ‘144A’ 6.67% 12/3/2024	210,000	0.00
USD	482,000	Shriram Transport Finance Co Ltd 5.1% 16/7/2023	458,201	0.01
USD	218,000	Shriram Transport Finance Co Ltd 5.95% 24/10/2022	213,640	0.00
USD	480,000	Suzlon Energy Ltd 1.25% 17/8/2032	1,587,250	0.02
USD	116,049	Videocon Industries Ltd (Restricted) (Step-up coupon) 2.8% 31/12/2020	36,211	0.00
			101,943,122	1.05
		インドネシア		
EUR	461,000	Indonesia Government International Bond 0.9% 14/2/2027*	538,134	0.01
USD	639,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028	704,098	0.01
USD	304,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	317,110	0.00
USD	928,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	1,059,228	0.01
USD	716,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	832,350	0.01
USD	1,798,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026	2,090,175	0.02
USD	4,670,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	5,595,400	0.06
IDR	18,255,000,000	Indonesia Treasury Bond 5.5% 15/4/2026	1,253,312	0.01
IDR	670,556,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.5% 15/6/2025	47,957,703	0.49
IDR	32,129,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.625% 15/5/2033	2,090,453	0.02
IDR	91,223,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	6,489,753	0.07
IDR	109,218,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/9/2030	7,586,198	0.08
IDR	70,993,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.375% 15/5/2048	4,850,680	0.05
IDR	196,506,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/6/2035	13,662,649	0.14
IDR	33,575,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	2,491,179	0.03
IDR	134,170,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/4/2039	9,959,675	0.10
USD	6,650,000	Pertamina Persero PT 4.175% 21/1/2050	6,803,781	0.07
USD	925,000	Pertamina Persero PT 4.3% 20/5/2023	994,953	0.01
USD	3,053,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.8% 23/6/2050	3,316,321	0.03
IDR	28,140,000,000	Wijaya Karya Persero Tbk PT 7.7% 31/1/2021	1,845,269	0.02
			120,438,421	1.24
		アイルランド		
EUR	200,000	AIB Group Plc FRN 9/10/2024 (Perpetual)	233,822	0.00
EUR	2,750,000	AIB Group Plc FRN 23/6/2025 (Perpetual)	3,390,227	0.04
EUR	3,552,000	Allied Irish Banks Plc FRN 3/12/2020 (Perpetual)*	4,320,393	0.04
EUR	180,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031	203,039	0.00
EUR	250,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 DAC FRN 15/5/2031	297,433	0.00
EUR	2,250,000	Aqueduct European CLO 2020- 5A DAC 20/4/2032 (Zero Coupon)	2,683,521	0.03
EUR	750,000	Aqueduct European CLO 2020- 5A DAC 20/4/2032 (Zero Coupon)	894,507	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		アイルランド（続き）		
EUR	2,250,000	Aqueduct European CLO 2020- 5A DAC 20/4/2032 (Zero Coupon)	2,683,521	0.03
EUR	1,000,000	Aqueduct European CLO 4-2019 DAC FRN 15/7/2032	1,192,926	0.01
EUR	750,000	Aqueduct European CLO 4-2019 DAC FRN 15/7/2032	894,694	0.01
EUR	800,000	Arbour CLO II DAC ‘Series 2014-2X B2R’ FRN 15/5/2030	947,052	0.01
EUR	525,000	Arbour CLO VIII DAC FRN 15/7/2033	626,155	0.01
EUR	1,600,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 2.125% 15/8/2026	1,907,528	0.02
USD	209,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘144A’ 4.125% 15/8/2026	218,464	0.00
GBP	2,292,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 4.75% 15/7/2027*	3,072,622	0.03
USD	335,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘144A’ 5.25% 15/8/2027	349,572	0.00
USD	287,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc ‘144A’ 6% 15/2/2025	299,484	0.00
USD	5,423,000	ASG Finance Designated Activity Co ‘144A’ 7.875% 3/12/2024	3,755,427	0.04
EUR	275,000	AVOCA CLO XII Ltd FRN 15/4/2030	321,005	0.00
EUR	150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	160,485	0.00
EUR	150,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	150,946	0.00
EUR	550,000	Avoca CLO XIV Designated Activity Co FRN 12/1/2031	351,321	0.00
EUR	380,000	Avoca CLO XV DAC FRN 15/4/2031	391,284	0.00
EUR	350,000	Avoca CLO XVII Designated Activity Co FRN 15/10/2032	417,639	0.00
EUR	669,000	Avoca CLO XVII Designated Activity Co FRN 15/10/2032	799,584	0.01
EUR	1,400,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	1,631,678	0.02
EUR	350,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	408,583	0.00
EUR	600,000	Avoca CLO XVIII DAC FRN 15/4/2031	630,141	0.01
USD	1,950,000	Bank of Ireland Group Plc FRN 19/9/2027*	1,959,126	0.02
EUR	350,000	BlueMountain Fuji Eur CLO IV DAC FRN 30/3/2032	414,863	0.00
EUR	500,000	BlueMountain Fuji Eur CLO V DAC FRN 15/1/2033	586,577	0.01
EUR	350,000	Cairn CLO XII DAC FRN 15/4/2033	417,437	0.00
EUR	838,000	Cairn CLO XII DAC FRN 15/4/2033	999,463	0.01
EUR	1,000,000	CIFC European Funding CLO FRN 15/4/2033	1,177,274	0.01
EUR	400,000	CIFC European Funding CLO I DAC FRN 15/7/2032	431,157	0.00
EUR	400,000	CIFC European Funding CLO II DAC FRN 15/4/2033	465,875	0.01
EUR	360,000	Contego CLO 7X BV DAC FRN 14/5/2032	425,064	0.00
EUR	375,000	Contego CLO 8A BV DAC 25/1/2032 (Zero Coupon)	447,254	0.01
EUR	205,000	Contego CLO II BV FRN 15/11/2026	240,942	0.00
EUR	2,625,000	Contego CLO VIII DAC FRN 25/1/2032	3,130,775	0.03
EUR	310,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	357,162	0.00
EUR	730,000	CVC Cordatus Loan Fund VI DAC FRN 15/4/2032	356,507	0.00
EUR	700,000	Halcyon Loan Advisors European Funding FRN 18/10/2031	813,572	0.01
EUR	700,000	Harvest CLO XVIII DAC FRN 15/10/2030	816,955	0.01
EUR	500,000	Harvest CLO XXII DAC FRN 15/1/2032	549,221	0.01
EUR	126,000	Harvest CLO XXIII DAC FRN 20/10/2032	127,839	0.00
EUR	710,000	Invesco Euro CLO I DAC FRN 15/7/2031	847,379	0.01
EUR	3,000,000	Invesco Euro CLO II DAC FRN 15/8/2032	3,560,758	0.04
EUR	293,515	Invesco Euro Clo III DAC FRN 15/7/2032	318,986	0.00

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		アイルランド（続き）		
EUR	685,000	Invesco Euro Clo III DAC 15/7/2032 (Zero Coupon)	523,194	0.01
EUR	700,000	Invesco Euro CLO IV DAC FRN 15/4/2033	827,540	0.01
EUR	460,000	Madison Park Euro Funding X DAC FRN 25/10/2030	534,372	0.01
EUR	340,000	Madison Park Euro Funding XI DAC FRN 15/2/2031	394,946	0.00
USD	1,378,000	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC ‘144A’ 4.7% 30/5/2026	1,530,657	0.02
EUR	450,000	OAK Hill European Credit Partners VI DAC FRN 20/1/2032	525,915	0.01
EUR	800,000	OCP Euro CLO 2017-2 DAC FRN 15/1/2032	941,780	0.01
EUR	720,000	OZLME IV DAC FRN 27/7/2032	840,752	0.01
EUR	2,620,000	Providus Clo 3X DAC FRN 20/7/2032	3,119,482	0.03
EUR	400,000	Providus Clo III DAC FRN 20/7/2032	439,089	0.01
EUR	328,350	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	384,843	0.00
EUR	452,725	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	531,905	0.01
EUR	350,000	Rockford Tower Europe 2018- 1X FRN 20/12/2031	411,823	0.00
EUR	3,750,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 DAC FRN 20/12/2031	4,471,778	0.05
EUR	280,000	RRE Loan Management 1X DAC FRN 15/4/2032	330,333	0.00
EUR	1,900,000	RRE Loan Management 1X DAC FRN 15/4/2032	2,268,027	0.02
EUR	350,000	RRE Loan Management 2A DAC FRN 15/1/2032	416,082	0.00
EUR	2,210,000	RRE Loan Management 4A DAC 15/4/2032 (Zero Coupon)	2,635,814	0.03
EUR	6,530,000	RRE Loan Management 4A DAC 15/4/2032 (Zero Coupon)	7,788,175	0.08
EUR	100,000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC 2.375% 1/2/2024	123,533	0.00
EUR	452,000	Smurfit Kappa Treasury ULC 1.5% 15/9/2027	543,569	0.01
EUR	350,000	Sound Point Euro CLO I Funding DAC FRN 25/4/2032	420,064	0.00
EUR	1,940,000	Sound Point Euro CLO II Funding DAC FRN 26/10/2032	2,295,745	0.02
EUR	800,000	Sound Point Euro CLO II Funding DAC FRN 26/10/2032	953,210	0.01
EUR	1,350,000	St Paul’s CLO XII DAC FRN 15/4/2033	1,580,926	0.02
EUR	479,856	Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	540,972	0.01
EUR	448,645	Taurus 2019-1 FR DAC FRN 2/2/2031	515,863	0.01
GBP	1,985,000	Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	2,474,818	0.03
GBP	3,372,000	Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	4,314,874	0.04
GBP	2,057,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 4.875% 15/7/2028	2,793,001	0.03
EUR	900,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	1,065,677	0.01
EUR	200,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	233,170	0.00
EUR	400,000	Voya Euro CLO II DAC FRN 15/7/2032	477,613	0.01
EUR	200,000	Voya Euro CLO II DAC FRN 15/7/2032	236,755	0.00
EUR	600,000	Voya Euro CLO III DAC FRN 15/4/2033	709,028	0.01
			99,872,564	1.02
		マン島		
EUR	400,000	Playtech Plc 4.25% 7/3/2026 Israel	486,612	0.00
		イスラエル		
USD	885,000	Bank Leumi Le-Israel BM ‘144A’ FRN 29/1/2031	896,616	0.01
USD	260,000	Israel Government International Bond 2.75% 3/7/2030	286,650	0.00
USD	3,189,056	Leviathan Bond Ltd ‘144A’ 5.75% 30/6/2023*	3,312,632	0.04
			4,495,898	0.05

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		イタリア		
EUR	400,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 21/11/2025 (Perpetual)	520,603	0.01
EUR	536,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 27/10/2047	762,844	0.01
EUR	400,000	Assicurazioni Generali SpA FRN 8/6/2048	558,172	0.01
EUR	300,000	Atlantia SpA 1.625% 3/2/2025	352,829	0.00
EUR	100,000	Atlantia SpA 1.875% 13/7/2027	116,532	0.00
EUR	200,000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 1/2/2027	232,465	0.00
EUR	200,000	Autostrade per l'Italia SpA 1.875% 4/11/2025	237,250	0.00
EUR	2,600,000	Autostrade per l'Italia SpA 1.875% 26/9/2029	3,011,030	0.03
EUR	200,000	Autostrade per l'Italia SpA 4.375% 16/9/2025*	267,186	0.00
EUR	3,300,000	Autostrade per l'Italia SpA 5.875% 9/6/2024	4,525,812	0.05
GBP	200,000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 9/6/2022	283,724	0.00
EUR	1,100,000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.625% 28/4/2025	1,297,184	0.01
EUR	300,000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.625% 24/9/2024	366,748	0.00
EUR	442,000	Banco BPM SpA 2.5% 21/6/2024	537,574	0.01
EUR	225,000	Brignole Co 2019-1 SRL FRN 24/7/2034	265,287	0.00
EUR	900,000	Buzzi Unicem SpA 2.125% 28/4/2023	1,121,572	0.01
EUR	661,596	Diocle Spa FRN 30/6/2026	788,083	0.01
EUR	2,175,000	Gamma Bidco SpA 6.25% 15/7/2025	2,591,710	0.03
EUR	2,365,000	Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.875% 8/7/2026	2,878,658	0.03
EUR	2,810,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 11/1/2027 (Perpetual)	3,879,269	0.04
EUR	900,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 27/2/2030 (Perpetual)	931,182	0.01
EUR	2,850,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 1/9/2031 (Perpetual)	3,409,324	0.04
EUR	2,000,000	Intesa Sanpaolo SpA 1% 19/11/2026	2,385,054	0.03
EUR	1,890,000	Intesa Sanpaolo SpA 1.75% 4/7/2029	2,341,011	0.02
GBP	1,550,000	Intesa Sanpaolo SpA 5.148% 10/6/2030	2,246,918	0.02
EUR	37,557,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.45% 1/9/2050	49,482,834	0.51
EUR	8,592,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	11,900,327	0.12
EUR	1,746,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.8% 1/3/2067	2,422,484	0.03
EUR	16,206,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.45% 1/3/2048	25,515,698	0.26
EUR	1,570,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.85% 1/9/2049*	2,644,133	0.03
EUR	7,571,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4.75% 1/9/2044	13,975,323	0.14
EUR	5,812,000	Leonardo SpA 2.375% 8/1/2026	6,994,879	0.07
EUR	1,244,375	Sisal Group SpA 7% 31/7/2023	1,519,563	0.02
EUR	1,051,557	Taurus 2018-1 IT SRL 'Series 2018-IT1 A' FRN 18/5/2030	1,202,207	0.01
EUR	4,700,000	Telecom Italia SpA/Milano 1.125% 26/3/2022	5,597,170	0.06
EUR	1,599,000	Telecom Italia SpA/Milano 2.75% 15/4/2025	1,983,573	0.02
EUR	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 3% 30/9/2025	249,489	0.00
EUR	200,000	Telecom Italia SpA/Milano 3.25% 16/1/2023	251,062	0.00
EUR	1,354,000	Telecom Italia SpA/Milano 4% 11/4/2024	1,740,021	0.02
EUR	280,000	Telecom Italia SpA/Milano 4.875% 25/9/2020	334,871	0.00
EUR	950,000	UniCredit SpA FRN 10/9/2021 (Perpetual)	1,155,703	0.01
EUR	675,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2022 (Perpetual)	883,549	0.01
EUR	2,500,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2023 (Perpetual)*	3,067,414	0.03
USD	1,500,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2024 (Perpetual)	1,630,125	0.02
EUR	2,200,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2026 (Perpetual)	2,915,795	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		イタリア（続き）		
EUR	2,200,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2027 (Perpetual)*	2,095,830	0.02
EUR	4,885,000	UniCredit SpA FRN 22/7/2027	5,808,453	0.06
EUR	1,700,000	UniCredit SpA FRN 20/2/2029	2,178,189	0.02
EUR	200,000	UniCredit SpA FRN 23/9/2029	229,158	0.00
EUR	900,000	UniCredit SpA FRN 15/1/2032	1,033,156	0.01
USD	1,012,000	UniCredit SpA ‘144A’ FRN 30/6/2035	1,047,241	0.01
EUR	200,000	Unione di Banche Italiane SpA FRN 20/1/2025 (Perpetual)	245,691	0.00
EUR	500,000	Unione di Banche Italiane SpA FRN 4/3/2029	668,644	0.01
			184,680,603	1.89
		日本		
JPY	150,000,000	HIS Co Ltd 15/11/2024 (Zero Coupon)	1,154,308	0.01
JPY	2,861,950,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.4% 20/12/2049	25,564,226	0.26
JPY	47,300,000,000	Japan Treasury Discount Bill 14/9/2020 (Zero Coupon)	445,942,848	4.58
JPY	1,921,200,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2028	18,374,363	0.19
JPY	1,467,400,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/3/2029	13,961,316	0.14
JPY	90,000,000	LINE Corp 19/9/2025 (Zero Coupon)	849,993	0.01
JPY	490,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 30/3/2022 (Zero Coupon)	4,578,014	0.05
JPY	140,000,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp 29/3/2024 (Zero Coupon)	1,293,974	0.01
EUR	1,145,000	Mizuho Financial Group Inc 0.118% 6/9/2024*	1,361,306	0.01
JPY	100,000,000	Rohm Co Ltd 5/12/2024 (Zero Coupon)	951,023	0.01
JPY	180,000,000	SBI Holdings Inc/Japan 13/9/2023 (Zero Coupon)	1,692,954	0.02
USD	600,000	Shizuoka Bank Ltd/The FRN 25/1/2023	566,892	0.01
USD	3,900,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)	3,793,604	0.04
USD	800,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2027 (Perpetual)	793,000	0.01
EUR	1,300,000	SoftBank Group Corp 3.125% 19/9/2025	1,599,893	0.02
EUR	3,886,000	SoftBank Group Corp 4% 20/4/2023	4,874,078	0.05
EUR	885,000	SoftBank Group Corp 4% 19/9/2029	1,126,956	0.01
EUR	300,000	SoftBank Group Corp 4.5% 20/4/2025	387,764	0.00
USD	800,000	SoftBank Group Corp 4.75% 19/9/2024	844,000	0.01
EUR	1,381,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	1,799,886	0.02
EUR	3,130,000	SoftBank Group Corp 5% 15/4/2028	4,207,700	0.04
USD	200,000	SoftBank Group Corp 5.375% 30/7/2022*	209,250	0.00
USD	400,000	SoftBank Group Corp 6% 30/7/2025*	437,500	0.00
EUR	1,920,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2% 9/7/2040	2,414,030	0.03
USD	1,105,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.05% 31/3/2030	1,122,101	0.01
USD	1,723,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.175% 9/7/2050	1,756,362	0.02
USD	2,560,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 5% 26/11/2028	3,169,134	0.03
JPY	320,000,000	Tohoku Electric Power Co Inc 3/12/2020 (Zero Coupon)	3,003,300	0.03
JPY	120,000,000	Transcosmos Inc 22/12/2020 (Zero Coupon)	1,126,384	0.01
			548,956,159	5.63
		ジャージー		
EUR	209,000	Avis Budget Finance Plc 4.125% 15/11/2024	229,315	0.00
EUR	1,300,000	Avis Budget Finance Plc 4.75% 30/1/2026	1,418,688	0.02
GBP	5,897,000	CPUK Finance Ltd 4.25% 28/8/2022	7,725,623	0.08
GBP	157,000	CPUK Finance Ltd 4.875% 28/8/2025	197,637	0.00
GBP	500,000	Derwent London Capital No 3 Jersey Ltd 1.5% 12/6/2025	641,500	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ジャージー（続き）		
GBP	581,000	Galaxy Bidco Ltd 6.5% 31/7/2026*	790,977	0.01
USD	2,098,000	Hbos Capital Funding NO 1 LP 6.85% 23/12/2020 (Perpetual)	2,145,205	0.02
GBP	1,900,000	Intu Jersey 2 Ltd 2.875% 1/11/2022	413,387	0.00
EUR	5,916,179	LHC3 Plc 4.125% 15/8/2024	7,021,440	0.07
USD	1,200,000	Tullow Oil Jersey Ltd 6.625% 12/7/2021	972,000	0.01
			21,555,772	0.22
		クウェート		
USD	200,000	Burgan Bank SAK FRN 9/7/2024 (Perpetual)	196,844	0.00
		リトアニア		
EUR	7,390,000	Lithuania Government International Bond 0.5% 28/7/2050	8,424,321	0.09
		ルクセンブルグ		
EUR	2,800,000	ADO Properties SA 3.25% 5/8/2025	3,376,512	0.04
EUR	3,510,000	Altice Financing SA 2.25% 15/1/2025*	4,081,636	0.04
EUR	744,000	Altice Financing SA 3% 15/1/2028	858,512	0.01
USD	5,530,000	Altice Financing SA ‘144A’ 7.5% 15/5/2026	5,901,616	0.06
EUR	665,000	Altice Finco SA 4.75% 15/1/2028	751,490	0.01
EUR	3,201,000	Altice France Holding SA 8% 15/5/2027	4,173,991	0.04
EUR	1,800,000	ArcelorMittal SA 1.75% 19/11/2025	2,125,145	0.02
USD	342,000	ArcelorMittal SA 4.25% 16/7/2029	364,567	0.00
EUR	700,000	Aroundtown SA FRN 23/9/2024 (Perpetual)	829,255	0.01
EUR	100,000	Aroundtown SA 2% 2/11/2026	126,289	0.00
GBP	284,000	B&M European Value Retail SA 3.625% 15/7/2025	383,127	0.00
EUR	3,409,000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 4/6/2026	4,147,455	0.04
EUR	300,000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 2.2% 24/7/2025	374,320	0.00
EUR	694,000	Cabot Financial Luxembourg II SA FRN 14/6/2024	829,915	0.01
GBP	1,500,000	Cabot Financial Luxembourg SA 7.5% 1/10/2023	2,036,794	0.02
EUR	2,865,000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/5/2025*	2,978,511	0.03
EUR	1,031,000	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1,117,124	0.01
USD	2,800,000	Cirsa Finance International Sarl ‘144A’ 7.875% 20/12/2023	2,548,000	0.03
EUR	2,150,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 6.75% 1/11/2021	1,576,913	0.02
USD	200,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA ‘144A’ 7.625% 1/11/2021	122,650	0.00
EUR	587,000	Codere Finance 2 Luxembourg SA 12.75% 30/9/2023	701,554	0.01
EUR	1,641,000	ContourGlobal Power Holdings SA 3.375% 1/8/2023	1,980,687	0.02
EUR	3,312,000	ContourGlobal Power Holdings SA 4.125% 1/8/2025	4,108,149	0.04
EUR	3,615,000	DH Europe Finance II Sarl 0.2% 18/3/2026	4,297,086	0.04
EUR	1,300,000	DH Europe Finance II Sarl 1.8% 18/9/2049	1,569,860	0.02
USD	2,367,897	Dragon Aviation Finance Luxembourg SA 4% 28/11/2022	2,448,796	0.03
EUR	300,000	E-Carat SA FRN 20/12/2028	352,231	0.00
EUR	200,000	E-Carat SA FRN 20/12/2028	234,745	0.00
EUR	2,200,000	European TopSoho Sarl 4% 21/9/2021	1,287,017	0.01
EUR	479,000	Garfunkelux Holdco 3 SA FRN 1/9/2023	523,029	0.01
EUR	2,163,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.5% 1/8/2022	2,467,539	0.03
GBP	300,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 8.5% 1/11/2022	383,515	0.00

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ルクセンブルグ（続き）		
USD	4,339,000	Gol Finance SA ‘144A’ 7% 31/1/2025*	2,258,314	0.02
EUR	200,000	Hanesbrands Finance Luxembourg SCA 3.5% 15/6/2024	248,077	0.00
EUR	1,300,000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.125% 1/12/2027	1,560,542	0.02
EUR	2,212,000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 1.75% 24/4/2028	2,767,960	0.03
EUR	800,000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 2.5% 9/10/2024	1,025,496	0.01
USD	425,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc ‘144A’ 5.5% 15/1/2030	471,856	0.01
USD	1,721,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc ‘144A’ 6.5% 15/4/2029	1,961,613	0.02
USD	4,039,000	Kenbourne Invest SA ‘144A’ 6.875% 26/11/2024	4,206,871	0.04
EUR	842,920	LHMC Finco 2 Sarl 7.25% 2/10/2025*	718,811	0.01
EUR	100,000	Matterhorn Telecom SA 2.625% 15/9/2024	118,093	0.00
EUR	974,000	Matterhorn Telecom SA 3.125% 15/9/2026	1,130,546	0.01
EUR	898,000	Matterhorn Telecom SA 4% 15/11/2027*	1,077,806	0.01
EUR	780,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 7/3/2027	984,128	0.01
EUR	2,960,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.75% 2/7/2049	3,709,027	0.04
EUR	1,100,000	Medtronic Global Holdings SCA 2.25% 7/3/2039	1,541,901	0.02
USD	551,000	MHP Lux SA ‘144A’ 6.25% 19/9/2029	537,225	0.01
USD	321,000	MHP Lux SA 6.25% 19/9/2029	312,975	0.00
USD	815,000	Millicom International Cellular SA 5.125% 15/1/2028	857,278	0.01
USD	1,800,000	Millicom International Cellular SA ‘144A’ 6.625% 15/10/2026	1,960,313	0.02
USD	433,000	Minerva Luxembourg SA ‘144A’ 6.5% 20/9/2026	458,574	0.01
EUR	300,000	Monitchem HoldCo 2 SA 9.5% 15/9/2026	372,115	0.00
EUR	2,248,000	Monitchem HoldCo 3 SA 5.25% 15/3/2025	2,781,679	0.03
USD	1,057,000	Nexa Resources SA ‘144A’ 5.375% 4/5/2027	1,121,081	0.01
USD	288,000	Nielsen Co Luxembourg SARL/ The ‘144A’ 5% 1/2/2025	293,760	0.00
USD	445,000	Puma International Financing SA 5% 24/1/2026	389,097	0.00
USD	1,887,000	Puma International Financing SA ‘144A’ 5% 24/1/2026*	1,649,946	0.02
USD	3,227,000	Puma International Financing SA ‘144A’ 5.125% 6/10/2024*	2,863,963	0.03
EUR	500,000	Rossini Sarl FRN 30/10/2025	593,040	0.01
EUR	2,188,000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	2,805,294	0.03
USD	1,174,000	Rumo Luxembourg Sarl ‘144A’ 5.875% 18/1/2025	1,247,742	0.01
EUR	500,000	SES SA FRN 2/1/2022 (Perpetual)*	612,248	0.01
EUR	4,021,000	SES SA FRN 29/1/2024 (Perpetual)*	5,131,453	0.05
EUR	2,346,000	SES SA 1.625% 22/3/2026*	2,848,159	0.03
EUR	2,030,000	SES SA 2% 2/7/2028	2,455,694	0.03
USD	429,000	SES SA ‘144A’ 5.3% 4/4/2043	437,047	0.01
EUR	300,000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	352,552	0.00
EUR	300,000	Silver Arrow S.A. Compartment 10 FRN 15/3/2027	349,775	0.00
EUR	1,621,895	Summer BC Holdco A Sarl 9.25% 31/10/2027*	1,862,087	0.02
EUR	5,050,000	Summer BC Holdco B SARL 5.75% 31/10/2026*	5,968,386	0.06
USD	973,000	Telecom Italia Capital SA 6.375% 15/11/2033*	1,216,430	0.01
USD	1,426,000	Telecom Italia Capital SA 7.721% 4/6/2038	1,983,210	0.02
EUR	1,336,000	Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/1/2033	2,365,234	0.02
USD	450,000	Ultrapar International SA ‘144A’ 5.25% 6/6/2029	466,664	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ルクセンブルグ（続き）		
USD	273,000	Usiminas International Sarl ‘144A’ 5.875% 18/7/2026	278,503	0.00
EUR	300,000	Vivion Investments Sarl 3% 8/8/2024	322,810	0.00
EUR	1,525,000	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.1% 9/11/2027	1,824,259	0.02
EUR	2,139,000	Whirlpool Finance Luxembourg Sarl 1.25% 2/11/2026	2,600,999	0.03
			132,158,663	1.36
		マレーシア		
USD	4,600,000	1MDB Energy Ltd 5.99% 11/5/2022	4,864,500	0.05
USD	8,874,000	Cindai Capital Ltd 8/2/2023 (Zero Coupon)	9,195,683	0.09
USD	2,794,000	Petronas Capital Ltd ‘144A’ 3.5% 21/4/2030	3,173,795	0.03
USD	1,216,000	Petronas Capital Ltd ‘144A’ 4.55% 21/4/2050	1,605,880	0.02
USD	1,276,000	Petronas Capital Ltd ‘144A’ 4.8% 21/4/2060	1,824,680	0.02
USD	450,000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.851% 1/11/2028	529,087	0.01
			21,193,625	0.22
		モルディブ		
USD	2,280,000	Republic of Maldives Ministry of Finance and Treasury Bond 7% 7/6/2022	1,738,500	0.02
		モーリシャス		
USD	200,000	Greenko Solar Mauritius Ltd 5.55% 29/1/2025*	204,500	0.00
USD	2,310,000	HTA Group Ltd/Mauritius ‘144A’ 7% 18/12/2025*	2,477,475	0.03
USD	200,000	Network i2i Ltd FRN 15/1/2025 (Perpetual)	201,625	0.00
			2,883,600	0.03
		メキシコ		
USD	3,723,000	Alpha Holding SA de CV ‘144A’ 9% 10/2/2025	2,981,309	0.03
USD	5,892,000	America Movil SAB de CV 2.875% 7/5/2030	6,367,308	0.07
USD	3,392,000	Axtel SAB de CV ‘144A’ 6.375% 14/11/2024	3,563,190	0.04
USD	272,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman ‘144A’ FRN 27/9/2024 (Perpetual)	272,000	0.00
USD	3,342,000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ‘144A’ 5.375% 17/4/2025	3,780,637	0.04
USD	1,814,000	BBVA Bancomer SA/Texas ‘144A’ FRN 13/9/2034	1,823,415	0.02
USD	3,382,000	BBVA Bancomer SA/Texas ‘144A’ 6.75% 30/9/2022	3,677,397	0.04
USD	200,000	Braskem Idesa SAPI ‘144A’ 7.45% 15/11/2029	185,500	0.00
EUR	1,198,000	Cemex SAB de CV 3.125% 19/3/2026	1,398,321	0.01
USD	460,000	Controladora Mabe SA de CV ‘144A’ 5.6% 23/10/2028	506,000	0.01
USD	222,000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER ‘144A’ 7.25% 20/7/2023*	216,415	0.00
USD	2,832,000	Cydsa SAB de CV ‘144A’ 6.25% 4/10/2027	2,955,900	0.03
USD	2,722,000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 3.5% 16/1/2050	2,894,382	0.03
USD	614,000	Grupo Bimbo SAB de CV ‘144A’ FRN 17/4/2023 (Perpetual)	649,152	0.01
USD	221,000	Grupo Bimbo SAB de CV 4.5% 25/1/2022	232,223	0.00
USD	2,531,000	Grupo KUO SAB De CV ‘144A’ 5.75% 7/7/2027*	2,399,704	0.03
USD	3,577,000	Industrias Penoles SAB de CV ‘144A’ 4.15% 12/9/2029*	3,884,398	0.04
USD	1,251,000	Industrias Penoles SAB de CV ‘144A’ 4.75% 6/8/2050*	1,321,369	0.01
USD	1,904,000	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV ‘144A’ 2.431% 1/7/2031*	1,945,068	0.02
USD	248,000	Mexico City Airport Trust ‘144A’ 4.25% 31/10/2026	233,507	0.00
USD	550,000	Mexico City Airport Trust ‘144A’ 5.5% 31/7/2047	475,492	0.01
USD	3,385,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	3,660,560	0.04

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		メキシコ（続き）		
USD	361,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	402,695	0.00
USD	436,000	Mexico Government International Bond 4.15% 28/3/2027	484,614	0.01
USD	7,646,000	Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	8,592,193	0.09
USD	11,107,000	Mexico Government International Bond 4.75% 27/4/2032	12,684,541	0.13
USD	1,698,000	Minera Mexico SA de CV ‘144A’ 4.5% 26/1/2050	1,870,453	0.02
USD	450,000	Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER ‘144A’ 8.25% 11/2/2025	397,406	0.00
USD	376,000	Orbia Advance Corp SAB de CV ‘144A’ 5.5% 15/1/2048	423,294	0.00
USD	2,345,000	Petroleos Mexicanos FRN 11/3/2022*	2,315,688	0.02
USD	3,660,000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/1/2025	3,522,750	0.04
USD	7,525,000	Petroleos Mexicanos 4.5% 23/1/2026	7,024,587	0.07
USD	34,000	Petroleos Mexicanos 5.35% 12/2/2028	30,966	0.00
USD	695,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 21/1/2021	704,773	0.01
USD	1,040,000	Petroleos Mexicanos ‘144A’ 5.95% 28/1/2031	932,100	0.01
USD	136,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 23/1/2029	130,858	0.00
USD	386,000	Petroleos Mexicanos ‘144A’ 6.84% 23/1/2030	370,560	0.00
USD	1,632,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	1,660,560	0.02
USD	10,778,000	Petroleos Mexicanos 6.95% 28/1/2060	8,978,074	0.09
USD	231,000	Trust Fibra Uno ‘144A’ 4.869% 15/1/2030	233,688	0.00
USD	3,002,000	Trust Fibra Uno ‘144A’ 5.25% 15/12/2024*	3,259,046	0.03
USD	2,251,000	Trust Fibra Uno ‘144A’ 6.95% 30/1/2044	2,447,962	0.03
			101,890,055	1.05
		モンゴル		
USD	2,272,000	Mongolian Mortgage Corp Hfc LLC 9.75% 29/1/2022	2,210,426	0.02
		モロッコ		
USD	1,193,000	OCP SA 4.5% 22/10/2025	1,267,935	0.01
		オランダ		
EUR	600,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2020 (Perpetual)	718,289	0.01
EUR	400,000	ABN AMRO Bank NV FRN 22/9/2025 (Perpetual)	483,034	0.01
EUR	800,000	Airbus Finance BV 2.125% 29/10/2029	1,054,368	0.01
EUR	1,000,000	Airbus SE 14/6/2021 (Zero Coupon)	1,189,384	0.01
EUR	1,015,000	Airbus SE 1.375% 9/6/2026*	1,256,041	0.01
EUR	1,105,000	Airbus SE 2% 7/4/2028	1,424,829	0.01
EUR	2,130,000	Airbus SE 2.375% 7/4/2032	2,770,116	0.03
EUR	5,170,000	Airbus SE 2.375% 9/6/2040	6,282,891	0.06
USD	20,420,180	Ajax Mortgage Loan Trust 30/12/2049 (Zero Coupon)	20,352,166	0.21
USD	211,000	Alcoa Nederland Holding BV ‘144A’ 6.125% 15/5/2028	228,468	0.00
USD	310,000	Alcoa Nederland Holding BV ‘144A’ 6.75% 30/9/2024	322,016	0.00
USD	208,000	Alcoa Nederland Holding BV ‘144A’ 7% 30/9/2026	223,561	0.00
EUR	700,000	ALME Loan Funding V BV FRN 15/7/2031	830,564	0.01
EUR	300,000	Ares European CLO X BV FRN 15/10/2031	354,448	0.00
EUR	400,000	Ares European CLO XI BV FRN 15/4/2032	474,045	0.00
EUR	645,000	Ares European CLO XII BV FRN 20/4/2032	766,844	0.01
USD	2,800,000	ARI Investments LLC 6/1/2025 (Zero Coupon)	2,716,000	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		オランダ（続き）		
EUR	1,519,000	Ashland Services BV 2% 30/1/2028	1,765,903	0.02
USD	1,250,000	AT Securities BV FRN 21/7/2023 (Perpetual)	1,267,187	0.01
EUR	4,500,000	ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)	5,454,257	0.06
EUR	600,000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	729,918	0.01
USD	545,000	Bharti Airtel International Netherlands BV 5.125% 11/3/2023*	581,423	0.01
USD	1,805,000	Bharti Airtel International Netherlands BV 5.35% 20/5/2024	1,964,852	0.02
EUR	1,108,000	BMW Finance NV 14/4/2023 (Zero Coupon)	1,319,252	0.01
USD	6,741,000	Braskem Netherlands Finance BV ‘144A’ FRN 23/1/2081*	7,086,476	0.07
EUR	600,000	Cairn CLO IX BV FRN 25/4/2032	697,467	0.01
EUR	1,150,000	Conti-Gummi Finance BV 1.125% 25/9/2024	1,396,764	0.01
EUR	725,000	Conti-Gummi Finance BV 2.125% 27/11/2023	907,873	0.01
EUR	2,070,000	CRH Funding BV 1.625% 5/5/2030*	2,659,804	0.03
EUR	2,000,000	de Volksbank NV FRN 22/10/2030	2,453,931	0.03
EUR	2,593,000	Digital Dutch Finco BV 0.625% 15/7/2025*	3,125,082	0.03
EUR	1,131,000	Dufry One BV 2% 15/2/2027	1,095,159	0.01
EUR	1,337,000	Dufry One BV 2.5% 15/10/2024*	1,363,358	0.01
EUR	470,000	EDP Finance BV 1.875% 13/10/2025	606,986	0.01
USD	1,600,000	ELM BV for Swiss Re Ltd 3.25% 13/6/2024	1,696,320	0.02
USD	971,000	Embraer Netherlands Finance BV 5.4% 1/2/2027	903,030	0.01
USD	902,000	Equate Petrochemical BV 4.25% 3/11/2026	968,945	0.01
USD	1,037,000	Equate Petrochemical BV ‘144A’ 4.25% 3/11/2026	1,113,965	0.01
EUR	2,330,000	Ferrovial Netherlands BV FRN 14/2/2023 (Perpetual)	2,702,440	0.03
EUR	1,170,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.375% 7/7/2023	1,449,406	0.01
EUR	2,130,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.875% 5/1/2026	2,747,811	0.03
EUR	2,358,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 4.5% 7/7/2028*	3,170,565	0.03
EUR	1,880,000	Givaudan Finance Europe BV 1.625% 22/4/2032	2,448,180	0.03
EUR	300,000	Hema Bondco II BV 8.5% 15/1/2023	9,267	0.00
EUR	3,800,000	Iberdrola International BV FRN 12/11/2024 (Perpetual)	4,910,923	0.05
USD	1,895,000	ING Groep NV FRN 16/4/2024 (Perpetual)	2,019,246	0.02
USD	200,000	ING Groep NV FRN 16/4/2025 (Perpetual)	212,350	0.00
USD	800,000	ING Groep NV FRN 16/11/2026 (Perpetual)	846,332	0.01
EUR	1,600,000	ING Groep NV FRN 15/2/2029	2,019,406	0.02
EUR	7,500,000	ING Groep NV FRN 26/5/2031	9,414,687	0.10
EUR	3,010,000	Intertrust Group BV 3.375% 15/11/2025	3,710,865	0.04
EUR	800,000	JAB Holdings BV 3.375% 17/4/2035	1,120,018	0.01
EUR	1,400,000	Koninklijke KPN NV FRN 8/11/2024 (Perpetual)*	1,661,231	0.02
EUR	1,000,000	LKQ European Holdings BV 3.625% 1/4/2026	1,234,336	0.01
USD	905,000	Lukoil Securities BV ‘144A’ 3.875% 6/5/2030	966,087	0.01
EUR	100,000	Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	118,612	0.00
EUR	200,000	Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	237,502	0.00
EUR	100,000	Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	118,477	0.00
USD	3,163,000	MDGH - GMTN BV ‘144A’ 2.5% 7/11/2024	3,338,784	0.03
USD	2,215,000	MDGH - GMTN BV ‘144A’ 2.875% 7/11/2029	2,394,623	0.02
USD	2,430,000	MDGH - GMTN BV 3.7% 7/11/2049	2,673,000	0.03
USD	1,965,000	MDGH - GMTN BV 3.95% 21/5/2050	2,253,609	0.02

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		オランダ（続き）		
USD	1,681,000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 7/5/2029	1,698,861	0.02
EUR	1,900,000	Naturgy Finance BV FRN 18/11/2022 (Perpetual)	2,363,254	0.02
EUR	500,000	Naturgy Finance BV FRN 24/4/2024 (Perpetual)*	617,472	0.01
USD	1,256,000	NXP BV / NXP Funding LLC ‘144A’ 4.125% 1/6/2021	1,288,569	0.01
USD	354,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ‘144A’ 3.15% 1/5/2027	386,886	0.00
USD	469,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ‘144A’ 3.4% 1/5/2030	518,692	0.01
EUR	400,000	OCI NV 3.125% 1/11/2024	483,034	0.01
EUR	1,985,000	OCI NV 5% 15/4/2023*	2,450,323	0.03
EUR	858,000	OI European Group BV 2.875% 15/2/2025	1,032,485	0.01
EUR	620,000	OI European Group BV 3.125% 15/11/2024	766,265	0.01
USD	182,000	Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/5/2023	190,417	0.00
USD	1,516,000	Petrobras Global Finance BV ‘144A’ 5.093% 15/1/2030*	1,571,429	0.02
USD	2,947,000	Petrobras Global Finance BV 5.093% 15/1/2030*	3,054,750	0.03
USD	1,161,000	Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025	1,270,025	0.01
USD	642,000	Petrobras Global Finance BV 5.6% 3/1/2031	684,934	0.01
USD	115,000	Petrobras Global Finance BV 5.999% 27/1/2028	128,024	0.00
USD	17,000	Petrobras Global Finance BV 6.125% 17/1/2022	17,991	0.00
USD	1,082,000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 3/6/2050	1,207,837	0.01
USD	4,845,000	Petrobras Global Finance BV 7.25% 17/3/2044*	5,701,202	0.06
USD	144,000	Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	170,784	0.00
EUR	1,300,000	Phoenix PIB Dutch Finance BV 2.375% 5/8/2025*	1,574,915	0.02
EUR	752,000	Q-Park Holding I BV FRN 1/3/2026	836,352	0.01
EUR	764,000	Q-Park Holding I BV 1.5% 1/3/2025*	855,393	0.01
EUR	447,000	Q-Park Holding I BV 2% 1/3/2027	495,807	0.01
EUR	800,000	Redexis Gas Finance BV 1.875% 28/5/2025*	995,241	0.01
EUR	2,127,000	Redexis Gas Finance BV 1.875% 27/4/2027	2,669,333	0.03
EUR	490,000	RELX Finance BV 0.875% 10/3/2032	586,883	0.01
EUR	2,207,000	Repsol International Finance BV FRN 11/3/2026 (Perpetual)	2,707,913	0.03
EUR	1,730,000	Repsol International Finance BV FRN 11/9/2028 (Perpetual)	2,165,506	0.02
USD	2,751,000	SABIC Capital II BV ‘144A’ 4% 10/10/2023	2,961,451	0.03
USD	2,194,000	Sigma Finance Netherlands BV ‘144A’ 4.875% 27/3/2028	2,422,656	0.02
EUR	2,807,175	Stichting AK Rabobank Certificaten 29/12/2049 (Perpetual) (Zero Coupon)	3,925,589	0.04
EUR	574,715	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	714,964	0.01
EUR	554,479	Summer BidCo BV 9.75% 15/11/2025	675,433	0.01
EUR	572,000	Syngenta Finance NV 3.375% 16/4/2026	738,756	0.01
EUR	2,700,000	Telefonica Europe BV FRN 15/3/2022 (Perpetual)	3,278,898	0.03
EUR	1,800,000	Telefonica Europe BV FRN 31/3/2024 (Perpetual)	2,380,970	0.02
EUR	6,800,000	Telefonica Europe BV FRN 14/12/2024 (Perpetual)	8,606,947	0.09
EUR	6,600,000	Telefonica Europe BV FRN 22/6/2026 (Perpetual)	8,088,133	0.08
EUR	7,290,000	TenneT Holding BV FRN 22/7/2025 (Perpetual)	8,904,497	0.09
EUR	300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.625% 15/10/2028	300,390	0.00
EUR	1,300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.875% 31/3/2027	1,369,994	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		オランダ（続き）		
EUR	100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6% 31/1/2025	127,393	0.00
USD	1,538,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV ‘144A’ 7.125% 31/1/2025	1,669,932	0.02
EUR	2,123,000	Trivium Packaging Finance BV 3.75% 15/8/2026	2,621,053	0.03
EUR	1,167,000	United Group BV FRN 15/2/2026	1,359,548	0.01
EUR	762,000	United Group BV 3.625% 15/2/2028	881,337	0.01
EUR	4,857,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024*	5,888,352	0.06
EUR	100,000	UPC Holding BV 3.875% 15/6/2029	119,696	0.00
EUR	1,200,000	Upjohn Finance BV 0.816% 23/6/2022*	1,446,998	0.01
USD	702,000	VEON Holdings BV ‘144A’ 4% 9/4/2025	733,590	0.01
EUR	1,400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 14/12/2022 (Perpetual)	1,673,186	0.02
EUR	2,900,000	Volkswagen International Finance NV FRN 17/6/2025 (Perpetual)	3,525,861	0.04
EUR	400,000	Volkswagen International Finance NV FRN 24/3/2026 (Perpetual)	512,364	0.01
EUR	6,000,000	Volkswagen International Finance NV FRN 17/6/2029 (Perpetual)*	7,282,147	0.07
EUR	1,100,000	Volkswagen International Finance NV 1.125% 2/10/2023	1,336,753	0.01
EUR	1,600,000	Vonovia Finance BV 1.25% 6/12/2024	2,000,948	0.02
EUR	1,600,000	Vonovia Finance BV 1.8% 29/6/2025	2,048,149	0.02
EUR	2,274,000	VZ Vendor Financing BV 2.5% 31/1/2024	2,715,048	0.03
EUR	500,000	ZF Europe Finance BV 2% 23/2/2026	564,831	0.01
EUR	600,000	ZF Europe Finance BV 2.5% 23/10/2027	673,160	0.01
EUR	351,000	Ziggo BV 2.875% 15/1/2030	414,127	0.00
EUR	3,447,000	Ziggo BV 4.25% 15/1/2027	4,300,227	0.04
USD	5,135,000	Ziggo BV ‘144A’ 5.5% 15/1/2027	5,388,387	0.06
			262,525,115	2.69
		ノルウェー		
EUR	1,400,000	Nassa Topco AS 2.875% 6/4/2024*	1,673,904	0.02
		パナマ		
USD	991,000	AES Panama Generation Holdings SRL ‘144A’ 4.375% 31/5/2030	1,032,188	0.01
USD	499,000	Avianca Holdings SA (Defaulted) ‘144A’ 9% 10/5/2023	122,255	0.00
USD	1,133,000	Avianca Holdings SA (Defaulted) ‘144A’ 9% 10/5/2023	296,173	0.00
USD	1,584,000	Banco Nacional de Panama ‘144A’ 2.5% 11/8/2030	1,603,879	0.02
USD	624,000	Banistmo SA 3.65% 19/9/2022	634,335	0.01
USD	809,000	Cable Onda SA 4.5% 30/1/2030	867,905	0.01
USD	200,000	Cable Onda SA ‘144A’ 4.5% 30/1/2030	214,563	0.00
EUR	1,272,000	Carnival Corp 10.125% 1/2/2026	1,532,392	0.02
USD	2,083,000	Carnival Corp ‘144A’ 11.5% 1/4/2023	2,320,368	0.02
USD	912,000	Panama Government International Bond 3.16% 23/1/2030	995,790	0.01
USD	648,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	738,315	0.01
USD	704,000	Panama Government International Bond 4% 22/9/2024	776,160	0.01
USD	866,000	Panama Government International Bond 4.5% 16/4/2050	1,113,893	0.01
			12,248,216	0.13

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		パラグアイ		
USD	200,000	Paraguay Government International Bond ‘144A’ 4.95% 28/4/2031	234,000	0.00
USD	2,114,000	Paraguay Government International Bond ‘144A’ 5.4% 30/3/2050	2,671,568	0.03
			2,905,568	0.03
		ペルー		
USD	3,443,000	Banco de Credito del Peru ‘144A’ FRN 1/7/2030	3,473,126	0.04
USD	2,228,000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank ‘144A’ 3.25% 4/10/2026	2,328,956	0.02
USD	993,000	Orazul Energy Egenor SCA ‘144A’ 5.625% 28/4/2027	1,040,013	0.01
USD	1,162,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/1/2026	1,224,748	0.01
USD	686,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	748,769	0.01
USD	5,576,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	6,510,851	0.07
USD	693,000	Peruvian Government International Bond 5.625% 18/11/2050	1,142,692	0.01
			16,469,155	0.17
		フィリピン		
USD	3,000,000	Globe Telecom Inc 2.5% 23/7/2030	2,945,625	0.03
USD	1,795,000	Globe Telecom Inc 3% 23/7/2035	1,747,881	0.02
USD	206,000	Philippine Government International Bond 2.95% 5/5/2045	218,875	0.00
USD	3,536,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	4,088,500	0.04
USD	400,000	Rizal Commercial Banking Corp FRN 27/8/2025 (Perpetual)	400,260	0.01
			9,401,141	0.10
		ポーランド		
USD	203,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	229,612	0.00
		ポルトガル		
EUR	200,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 8/5/2017 (Zero Coupon)	36,973	0.00
EUR	2,000,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 15/1/2018 (Zero Coupon)	369,730	0.00
EUR	20,500,000	Banco Espirito Santo SA (Restricted) (Defaulted) 4% 21/1/2019	3,789,728	0.04
EUR	700,000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/4/2079	902,749	0.01
EUR	500,000	SAGRES Socidade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	595,435	0.01
EUR	900,000	SAGRES Socidade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033	1,107,767	0.01
EUR	1,683,321	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta IV 2.423% 12/2/2021	2,016,089	0.02
EUR	6,056,707	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII 0.7% 12/2/2024	7,178,911	0.07
EUR	6,753,048	TAGUS-Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta V 0.85% 12/2/2022	8,094,092	0.08
EUR	500,000	Transportes Aereos Portugueses SA ‘144A’ 5.625% 2/12/2024	390,603	0.01
			24,482,077	0.25
		カタール		
USD	290,000	Qatar Government International Bond ‘144A’ 3.4% 16/4/2025	317,840	0.00
USD	1,655,000	Qatar Government International Bond ‘144A’ 4% 14/3/2029	1,941,108	0.02
USD	726,000	Qatar Government International Bond 4.4% 16/4/2050	940,170	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		カタール（続き）		
USD	2,109,000	Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	2,532,118	0.03
			5,731,236	0.06
		ルーマニア		
EUR	3,869,000	Romanian Government International Bond 2% 28/1/2032*	4,358,854	0.04
EUR	3,646,000	Romanian Government International Bond 2.75% 26/2/2026	4,609,407	0.05
EUR	930,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029	1,180,939	0.01
USD	1,210,000	Romanian Government International Bond ‘144A’ 3% 14/2/2031*	1,225,125	0.01
EUR	560,000	Romanian Government International Bond 3.375% 28/1/2050	661,324	0.01
EUR	14,230,000	Romanian Government International Bond 3.624% 26/5/2030	18,647,745	0.19
			30,683,394	0.31
		ロシア連邦		
RUB	322,740,000	Russian Federal Bond - OFZ 6% 6/10/2027	4,427,460	0.04
RUB	1,335,075,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.9% 23/5/2029	19,185,721	0.20
RUB	139,297,000	Russian Federal Bond - OFZ 7.05% 19/1/2028	2,026,394	0.02
RUB	580,536,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.15% 3/2/2027	8,932,480	0.09
RUB	1,461,033,000	Russian Federal Bond - OFZ 8.5% 17/9/2031	23,482,952	0.24
USD	1,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	1,812,000	0.02
USD	5,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/3/2029	5,757,500	0.06
USD	3,200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	3,691,200	0.04
			69,315,707	0.71
		サウジアラビア		
USD	420,000	Saudi Arabian Oil Co ‘144A’ 3.5% 16/4/2029	460,622	0.00
USD	934,000	Saudi Arabian Oil Co 3.5% 16/4/2029	1,024,336	0.01
USD	129,000	Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	140,126	0.00
USD	200,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028	222,125	0.00
USD	509,000	Saudi Government International Bond 4% 17/4/2025	565,499	0.01
USD	809,000	Saudi Government International Bond ‘144A’ 4.375% 16/4/2029	952,850	0.01
USD	2,244,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	2,682,281	0.03
			6,047,839	0.06
		シンガポール		
USD	200,000	ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/7/2024	208,750	0.00
USD	4,450,000	BOC Aviation Ltd 3% 11/9/2029	4,647,469	0.05
USD	3,023,000	BOC Aviation Ltd ‘144A’ 3.25% 29/4/2025	3,184,413	0.04
USD	1,878,000	LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 4/2/2039	2,166,743	0.02
USD	200,000	Medco Platinum Road Pte Ltd 6.75% 30/1/2025	202,250	0.00
			10,409,625	0.11
		南アフリカ		
USD	4,309,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 27/9/2027	4,346,704	0.04
USD	919,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 30/5/2022	972,991	0.01
			5,319,695	0.05
		韓国		
USD	2,852,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2022 (Perpetual)*	2,855,565	0.03
USD	2,610,000	KDB Life Insurance Co Ltd FRN 21/5/2023 (Perpetual)	2,508,210	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		韓国（続き）		
USD	4,260,000	Kookmin Bank FRN 2/7/2024 (Perpetual)	4,454,362	0.04
USD	200,000	LG Display Co Ltd 1.5% 22/8/2024	205,475	0.00
USD	2,285,000	Mirae Asset Daewoo Co Ltd 2.625% 30/7/2025	2,327,599	0.02
USD	2,690,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 13/8/2023 (Perpetual)*	2,886,706	0.03
USD	2,425,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 5/2/2030	2,557,249	0.03
USD	200,000	Woori Bank FRN 4/10/2024 (Perpetual)	204,625	0.00
			17,999,791	0.18
		スペイン		
EUR	6,300,000	Amadeus IT Group SA 2.875% 20/5/2027	8,018,265	0.08
EUR	800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 14/4/2021 (Perpetual)	999,091	0.01
USD	200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 16/11/2027 (Perpetual)	190,339	0.00
EUR	600,000	Banco de Sabadell SA FRN 18/5/2022 (Perpetual)	626,155	0.01
EUR	2,600,000	Banco de Sabadell SA FRN 29/6/2023	3,162,977	0.03
EUR	1,400,000	Banco de Sabadell SA FRN 17/1/2030	1,440,157	0.02
EUR	1,800,000	Banco Santander SA FRN 25/4/2022 (Perpetual)*	2,254,158	0.02
EUR	600,000	Banco Santander SA FRN 29/9/2023 (Perpetual)	698,610	0.01
EUR	2,200,000	Banco Santander SA FRN 14/1/2026 (Perpetual)	2,404,137	0.02
USD	2,000,000	Banco Santander SA 2.746% 28/5/2025	2,124,553	0.02
EUR	600,000	Bankia SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	698,073	0.01
EUR	3,200,000	Bankia SA FRN 19/9/2023 (Perpetual)	3,754,430	0.04
EUR	1,100,000	Bilbao CLO I DAC FRN 20/7/2031	1,287,051	0.01
EUR	800,000	CaixaBank SA FRN 13/6/2024 (Perpetual)*	992,068	0.01
EUR	800,000	CaixaBank SA FRN 23/3/2026 (Perpetual)	892,122	0.01
EUR	900,000	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA (Restricted) 0.875% 6/4/2023	696,483	0.01
EUR	300,000	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA (Restricted) 1% 28/4/2021	331,415	0.00
EUR	902,000	El Corte Ingles SA 3% 15/3/2024	1,080,108	0.01
EUR	400,000	Grifols SA 1.625% 15/2/2025	474,921	0.01
EUR	2,800,000	Hipercor SA 3.875% 19/1/2022*	3,390,070	0.04
EUR	800,000	International Consolidated Airlines Group SA 0.5% 4/7/2023	801,889	0.01
EUR	188,833	NH Hotel Group SA 3.75% 1/10/2023*	204,828	0.00
EUR	27,837,000	Spain Government Bond ‘144A’ 1% 31/10/2050	31,412,014	0.32
EUR	10,760,000	Spain Government Bond ‘144A’ 1.2% 31/10/2040	13,389,450	0.14
EUR	15,023,000	Spain Government Bond ‘144A’ 1.25% 31/10/2030	19,486,705	0.20
EUR	29,462,000	Spain Government Bond ‘144A’ 2.7% 31/10/2048	48,016,546	0.49
EUR	350,000	Tendam Brands SAU FRN 15/9/2024	347,785	0.00
EUR	850,000	Tendam Brands SAU 5% 15/9/2024	855,048	0.01
			150,029,448	1.54
		スリランカ		
USD	300,000	Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	268,025	0.00
USD	1,475,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	1,316,529	0.01
USD	2,200,000	Sri Lanka Government International Bond 7.55% 28/3/2030	1,812,250	0.02
			3,396,804	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		スウェーデン		
EUR	565,000	Heimstaden Bostad AB FRN 19/11/2024 (Perpetual)	675,432	0.00
EUR	40,000	Intrum AB 2.75% 15/7/2022	48,232	0.00
EUR	834,000	Intrum AB 3.5% 15/7/2026	971,525	0.01
EUR	2,293,000	Verisure Holding AB FRN 15/4/2025*	2,797,310	0.03
EUR	2,437,000	Verisure Holding AB 3.5% 15/5/2023*	2,965,293	0.03
EUR	4,125,000	Verisure Holding AB 3.875% 15/7/2026*	4,975,014	0.05
EUR	3,871,000	Verisure Midholding AB 5.75% 1/12/2023	4,692,843	0.05
EUR	3,141,000	Volvo Treasury AB 11/2/2023 (Zero Coupon)	3,724,974	0.04
			20,850,623	0.21
		スイス		
USD	200,000	Credit Suisse Group AG FRN 17/7/2023 (Perpetual)	216,249	0.00
USD	950,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 17/7/2023 (Perpetual)*	1,027,183	0.01
USD	200,000	Credit Suisse Group AG FRN 11/12/2023 (Perpetual)	222,963	0.00
USD	700,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 11/12/2023 (Perpetual)	780,370	0.01
USD	600,000	Credit Suisse Group AG FRN 18/12/2024 (Perpetual)	655,455	0.01
USD	3,183,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 18/12/2024 (Perpetual)	3,477,189	0.03
EUR	2,895,000	Credit Suisse Group AG FRN 17/7/2025	3,562,415	0.04
USD	4,396,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 11/9/2025	4,608,031	0.05
USD	800,000	Credit Suisse Group AG FRN 12/9/2025 (Perpetual)	886,644	0.01
USD	600,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 12/9/2025 (Perpetual)	664,983	0.01
EUR	6,416,000	Credit Suisse Group AG FRN 2/4/2026	8,571,815	0.09
USD	1,134,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 11/2/2027 (Perpetual)*	1,159,799	0.01
USD	295,000	Credit Suisse Group AG ‘144A’ FRN 24/1/2030 (Perpetual)	294,077	0.00
EUR	600,000	UBS Group AG FRN 19/2/2022 (Perpetual)	750,491	0.01
USD	5,445,000	UBS Group AG ‘144A’ FRN 31/1/2024 (Perpetual)	5,911,609	0.06
EUR	2,170,000	UBS Group AG FRN 17/4/2025	2,687,335	0.03
USD	2,040,000	UBS Group AG FRN 29/7/2026 (Perpetual)	2,119,560	0.02
			37,596,168	0.39
		台湾		
USD	2,400,000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd 6/11/2022 (Zero Coupon)	2,479,500	0.02
USD	2,600,000	Innolux Corp 22/1/2025 (Zero Coupon)	2,769,000	0.03
			5,248,500	0.05
		タイ		
USD	4,755,000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong FRN 25/9/2034	4,769,860	0.05
USD	3,990,000	Kasikornbank PCL/Hong Kong FRN 2/10/2031	4,009,950	0.04
USD	495,000	PTTEP Treasury Center Co Ltd ‘144A’ 2.587% 10/6/2027	514,181	0.01
USD	5,040,000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 3.75% 18/6/2050	5,014,800	0.05
			14,308,791	0.15
		トルコ		
USD	5,872,000	Turkey Government International Bond 5.125% 17/2/2028	5,404,075	0.06
USD	1,358,833	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust ‘144A’ 4.2% 15/3/2027	1,048,958	0.01
			6,453,033	0.07

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ウクライナ		
EUR	2,950,000	Ukraine Government International Bond 6.75% 20/6/2026	3,572,050	0.04
USD	816,000	Ukraine Government International Bond ‘144A’ 7.253% 15/3/2033*	819,060	0.01
USD	6,923,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2032	7,026,845	0.07
USD	123,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2022	129,642	0.00
USD	235,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2023	250,804	0.00
USD	254,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2024	269,875	0.00
USD	271,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	287,057	0.00
USD	1,308,000	Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2024	1,430,298	0.02
USD	14,033,000	Ukraine Government International Bond 9.75% 1/11/2028	16,099,359	0.17
			29,884,990	0.31
		アラブ首長国連邦		
USD	2,780,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4.6% 2/11/2047	3,399,419	0.03
USD	2,490,000	Emirates NBD Bank PJSC FRN 20/3/2025 (Perpetual)	2,576,372	0.03
USD	1,450,000	Emirates NBD Bank PJSC FRN 26/4/2026 (Perpetual)	1,524,312	0.02
			7,500,103	0.08
		英国		
EUR	1,600,000	Amcor UK Finance Plc 1.125% 23/6/2027	1,965,721	0.02
GBP	3,039,000	Arrow Global Finance Plc 5.125% 15/9/2024*	3,920,044	0.04
GBP	555,000	Azure Finance No 2 Plc FRN 20/7/2030	730,550	0.01
USD	830,000	Barclays Plc FRN 15/3/2022 (Perpetual)	871,500	0.01
EUR	2,270,000	Barclays Plc FRN 2/4/2025	2,953,177	0.03
GBP	200,000	Barclays Plc FRN 15/6/2025 (Perpetual)	287,251	0.00
EUR	3,975,000	Barclays Plc FRN 11/11/2025	4,763,881	0.05
USD	4,525,000	Barclays Plc FRN 15/12/2025 (Perpetual)	4,677,719	0.05
EUR	900,000	Barclays Plc FRN 7/2/2028	1,080,490	0.01
USD	4,920,000	Barclays Plc FRN 24/6/2031	5,012,274	0.05
EUR	1,045,000	Barclays Plc 1.875% 8/12/2023	1,307,573	0.01
EUR	5,310,000	BP Capital Markets Plc (Restricted) FRN 22/3/2026 (Perpetual)	6,564,960	0.07
GBP	465,000	BP Capital Markets Plc FRN 22/3/2027 (Perpetual)	658,528	0.01
EUR	4,040,000	BP Capital Markets Plc FRN 22/3/2029 (Perpetual)	5,064,729	0.05
EUR	2,575,000	British Telecommunications Plc FRN 18/8/2080*	2,933,493	0.03
GBP	1,000,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	1,053,539	0.01
GBP	4,190,000	Canary Wharf Finance II Plc FRN 22/10/2037	4,386,174	0.05
EUR	3,744,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	4,457,297	0.05
EUR	2,404,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,957,424	0.03
GBP	1,850,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	2,523,604	0.03
GBP	220,000	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	287,324	0.00
GBP	105,000	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	133,300	0.00
EUR	500,000	CVC Cordatus Loan Fund XV DAC FRN 26/8/2032	527,101	0.01
GBP	1,238,019	Dignity Finance Plc 3.546% 31/12/2034	1,740,116	0.02
GBP	350,000	Dignity Finance Plc 4.696% 31/12/2049	363,018	0.00
GBP	200,000	Drax Finco Plc 4.25% 1/5/2022	268,019	0.00
EUR	100,000	DS Smith Plc 0.875% 12/9/2026	118,540	0.00
EUR	300,000	easyJet Plc 0.875% 11/6/2025	302,791	0.00
EUR	1,000,000	easyJet Plc 1.75% 9/2/2023*	1,059,991	0.01

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英国（続き）		
EUR	2,031,000	eG Global Finance Plc 3.625% 7/2/2024	2,367,968	0.02
EUR	1,663,000	eG Global Finance Plc 4.375% 7/2/2025	1,905,651	0.02
EUR	4,389,000	eG Global Finance Plc 6.25% 30/10/2025*	5,274,046	0.05
USD	865,940	EnQuest Plc ‘144A’ 7% 15/4/2022	497,915	0.01
GBP	414,000	EnQuest Plc 7% 15/4/2022	319,864	0.00
EUR	600,000	FCE Bank Plc 1.615% 11/5/2023	705,129	0.01
GBP	887,981	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,140,375	0.01
GBP	1,297,972	Finsbury Square 2018-1 Plc FRN 12/9/2065	1,710,481	0.02
GBP	1,385,970	Finsbury Square 2018-1 Plc ‘Series 2018-1 B’ FRN 12/9/2065	1,832,913	0.02
GBP	950,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	1,202,861	0.01
GBP	5,706,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	7,241,487	0.07
GBP	235,000	Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/9/2069	312,213	0.00
GBP	215,000	Finsbury Square 2019-2 Plc FRN 16/9/2069	282,410	0.00
GBP	205,952	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	264,401	0.00
GBP	884,793	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	1,143,722	0.01
EUR	700,000	GlaxoSmithKline Capital Plc 1.75% 21/5/2030	947,844	0.01
GBP	1,880,000	Great Hall Mortgages No 1 Plc ‘Series 2007-2X BA’ FRN 18/6/2039	2,282,689	0.02
GBP	8,752,246	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	10,074,934	0.10
GBP	300,000	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2034	349,004	0.00
GBP	300,000	Greene King Finance Plc FRN 15/3/2036	338,182	0.00
GBP	2,723,000	Greene King Finance Plc 3.593% 15/3/2035	3,598,441	0.04
GBP	1,193,350	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	1,631,711	0.02
GBP	817,000	Heathrow Finance Plc 4.125% 1/9/2029	1,023,853	0.01
GBP	300,000	Heathrow Finance Plc 4.75% 1/3/2024	404,585	0.00
GBP	321,000	Hurricane Finance Plc 8% 15/10/2025	454,986	0.00
GBP	2,000,000	Iceland Bondco Plc 4.625% 15/3/2025	2,526,274	0.03
EUR	1,031,000	International Game Technology Plc 3.5% 15/7/2024	1,260,538	0.01
EUR	800,000	International Game Technology Plc 4.75% 15/2/2023	991,281	0.01
USD	200,000	International Game Technology Plc ‘144A’ 5.25% 15/1/2029	205,821	0.00
USD	1,345,000	International Game Technology Plc ‘144A’ 6.25% 15/2/2022	1,389,943	0.01
USD	601,000	International Game Technology Plc ‘144A’ 6.25% 15/1/2027	658,080	0.01
USD	1,230,000	International Game Technology Plc ‘144A’ 6.5% 15/2/2025	1,341,456	0.01
GBP	200,000	Intu Metrocentre Finance Plc 4.125% 6/12/2028	138,434	0.00
GBP	790,000	Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	1,062,230	0.01
USD	2,523,000	Ithaca Energy North Sea Plc ‘144A’ 9.375% 15/7/2024	2,441,028	0.03
EUR	300,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 4.5% 15/1/2026	304,945	0.00
USD	2,400,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc ‘144A’ 4.5% 1/10/2027*	1,974,972	0.02
EUR	1,701,105	Kensington Mortgage Securities Plc ‘Series 2007-1X A3B’ FRN 14/6/2040	2,029,413	0.02
GBP	313,800	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 16/9/2022	429,759	0.00
GBP	350,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023	479,481	0.01
GBP	1,475,000	Legal & General Group Plc FRN 24/3/2031 (Perpetual)*	2,061,714	0.02
USD	300,000	Lloyds Banking Group Plc ‘144A’ FRN 1/10/2035 (Perpetual)*	342,538	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英国（続き）		
USD	489,000	Lloyds Banking Group Plc ‘144A’ FRN 21/5/2037 (Perpetual)	571,785	0.01
USD	83,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 21/5/2037 (Perpetual)	97,051	0.00
GBP	500,000	Marks & Spencer Plc 3% 8/12/2023	675,291	0.01
GBP	1,850,000	Marks & Spencer Plc 4.5% 10/7/2027	2,450,227	0.03
GBP	400,000	Marks & Spencer Plc 6% 12/6/2025	576,930	0.01
GBP	592,000	Matalan Finance Plc 6.75% 31/1/2023	565,846	0.01
GBP	1,483,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	1,318,649	0.01
EUR	2,072,000	Motability Operations Group Plc 0.375% 3/1/2026	2,510,468	0.03
GBP	2,037,000	Motor 2016-1 Plc 3.75% 25/11/2025	2,741,822	0.03
GBP	426,000	Motor 2016-1 Plc 4.25% 25/11/2025	561,256	0.01
GBP	355,000	Motor 2016-1 Plc 5.25% 25/11/2025	465,479	0.01
USD	2,080,000	National Westminster Bank Plc FRN 28/11/2020 (Perpetual)	1,846,780	0.02
USD	10,000	National Westminster Bank Plc FRN 11/1/2021 (Perpetual)	8,900	0.00
USD	500,000	National Westminster Bank Plc FRN 14/2/2021 (Perpetual)	445,000	0.00
USD	968,000	Natwest Group Plc FRN 22/5/2024	1,001,742	0.01
USD	3,165,000	Natwest Group Plc FRN 28/11/2035	3,143,889	0.03
EUR	4,385,000	Natwest Group Plc 2.5% 22/3/2023	5,516,346	0.06
EUR	3,151,000	NatWest Markets Plc 2.75% 2/4/2025	4,111,875	0.04
USD	3,692,000	Neptune Energy Bondco Plc ‘144A’ 6.625% 15/5/2025*	3,389,681	0.04
EUR	817,849	Newgate Funding Plc ‘Series 2006-1 BB’ FRN 1/12/2050	873,076	0.01
EUR	92,475	Paragon Mortgages No 10 Plc FRN 15/6/2041	103,080	0.00
EUR	330,047	Paragon Mortgages No 11 Plc FRN 15/10/2041	378,983	0.00
EUR	401,428	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	441,276	0.00
EUR	990,968	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	1,097,824	0.01
EUR	2,666,000	Paragon Mortgages No 14 Plc FRN 15/9/2039	2,722,306	0.03
GBP	2,405,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	3,162,655	0.03
GBP	2,100,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	2,720,511	0.03
GBP	1,062,000	PCL Funding III Plc FRN 15/6/2023	1,409,142	0.01
GBP	470,000	PCL Funding III Plc ‘Series 2017-2 C’ FRN 15/6/2023	624,587	0.01
GBP	4,048,000	Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30/9/2025	5,452,385	0.06
GBP	115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	148,485	0.00
GBP	100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	126,195	0.00
GBP	1,200,000	Premier Foods Finance Plc 6.25% 15/10/2023	1,650,600	0.02
GBP	2,681,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	3,564,291	0.04
GBP	799,000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 20/12/2046	1,062,813	0.01
GBP	180,000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 20/3/2050	237,045	0.00
GBP	1,070,000	Residential Mortgage Securities 31 Plc FRN 20/9/2065	1,428,442	0.01
GBP	525,000	Residential Mortgage Securities 32 Plc FRN 20/6/2070	702,500	0.01
GBP	1,480,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	1,946,798	0.02
GBP	10,732,000	Ripon Mortgages Plc FRN 20/8/2056	14,085,195	0.14
GBP	420,000	RMAC NO 2 Plc ‘Series 2018-2 C’ FRN 12/6/2046	556,390	0.01
EUR	56,126	RMAC Securities No 1 Plc ‘Series 2006-NS1X M1C’ FRN 12/6/2044	60,385	0.00
EUR	826,357	RMAC Securities No 1 Plc ‘Series 2007-NS1X M1C’ FRN 12/6/2044	912,838	0.01
EUR	1,900,000	Rolls-Royce Plc 0.875% 9/5/2024	2,034,661	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英国（続き）		
EUR	2,065,000	Rolls-Royce Plc 1.625% 9/5/2028	2,101,979	0.02
USD	1,601,000	Royalty Pharma Plc ‘144A’ 1.2% 2/9/2025	1,595,425	0.02
USD	2,970,000	Royalty Pharma Plc ‘144A’ 3.55% 2/9/2050	2,831,853	0.03
GBP	2,833,538	Scorpio European Loan Conduit No. 34 DAC ‘144A’ FRN 17/5/2029	3,554,599	0.04
GBP	453,000	Spirit Issuer Plc FRN 28/12/2028	610,528	0.01
EUR	1,400,000	SSE Plc FRN 1/4/2021 (Perpetual)	1,679,281	0.02
GBP	209,000	Stanlington No 1 Plc ‘Series 2017-1 E’ FRN 12/6/2046	274,351	0.00
EUR	1,100,000	Stonegate Pub Co FRN 31/7/2025	1,188,136	0.01
GBP	3,530,000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 8% 13/7/2025	4,340,964	0.04
GBP	3,700,000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 8.25% 31/7/2025*	4,741,871	0.05
EUR	3,800,000	Swiss Re Finance UK Plc FRN 4/6/2052	4,798,729	0.05
EUR	3,047,000	Synlab Bondco Plc FRN 1/7/2025*	3,675,585	0.04
EUR	283,000	Synlab Unsecured Bondco Plc 8.25% 1/7/2023	344,465	0.00
EUR	2,467,000	Synthomer Plc 3.875% 1/7/2025	3,084,947	0.03
EUR	100,000	Tesco Plc 5.125% 10/4/2047	170,119	0.00
GBP	890,260	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	1,771,550	0.02
GBP	2,136,830	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	3,814,144	0.04
GBP	969,909	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	1,741,752	0.02
GBP	115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc FRN 20/9/2063	154,282	0.00
GBP	145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc FRN 20/9/2063	194,512	0.00
GBP	360,000	Trinity Square 2015-1 Plc ‘Series 2015-1X B’ FRN 15/7/2051	472,478	0.01
USD	200,000	Tullow Oil Plc 6.25% 15/4/2022	127,000	0.00
GBP	1,170,000	Turbo Finance 8 Plc FRN 20/2/2026	1,533,161	0.02
GBP	488,000	Twin Bridges 2018-1 Plc ‘Series 2018-1 D’ FRN 12/9/2050	645,850	0.01
GBP	545,000	Twin Bridges 2019-1 Plc FRN 12/12/2052	720,173	0.01
GBP	225,000	Twin Bridges 2020-1 Plc FRN 14/12/2054	295,856	0.00
GBP	390,000	Twin Bridges 2020-1 Plc FRN 14/12/2054	515,649	0.01
GBP	2,408,088	Unique Pub Finance Co Plc/ The 5.659% 30/6/2027	3,357,670	0.03
GBP	2,297,000	Unique Pub Finance Co Plc/ The 6.464% 30/3/2032	3,144,914	0.03
GBP	984,000	Unique Pub Finance Co Plc/ The 7.395% 28/3/2024	1,366,494	0.01
USD	1,414,000	Vedanta Resources Finance II Plc (Restricted) 8% 23/4/2023*	1,183,871	0.01
USD	1,811,000	Vedanta Resources Ltd 6.125% 9/8/2024	1,402,846	0.01
GBP	200,000	Very Group Funding Plc/The 7.75% 15/11/2022*	258,526	0.00
EUR	3,742,000	Virgin Media Finance Plc 3.75% 15/7/2030*	4,407,207	0.05
GBP	1,325,000	Virgin Media Secured Finance Plc 4.25% 15/1/2030*	1,802,098	0.02
USD	475,000	Virgin Media Secured Finance Plc ‘144A’ 4.5% 15/8/2030	498,037	0.01
GBP	532,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5% 15/4/2027	745,883	0.01
GBP	100,000	Virgin Media Secured Finance Plc 5.25% 15/5/2029	142,535	0.00
USD	510,000	Virgin Media Secured Finance Plc ‘144A’ 5.5% 15/8/2026	538,687	0.01
USD	2,800,000	Virgin Media Secured Finance Plc ‘144A’ 5.5% 15/5/2029	3,031,952	0.03
EUR	600,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	800,584	0.01
USD	4,800,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078*	5,287,627	0.05
GBP	350,000	Vodafone Group Plc FRN 3/10/2078	502,834	0.01
EUR	3,600,000	Vodafone Group Plc FRN 3/1/2079	4,433,177	0.05

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英国（続き）		
EUR	750,000	Vodafone Group Plc FRN 27/8/2080	897,074	0.01
EUR	1,075,000	Vodafone Group Plc FRN 27/8/2080	1,281,576	0.01
USD	2,160,000	Vodafone Group Plc 4.375% 30/5/2028	2,587,847	0.03
GBP	600,000	Wagamama Finance Plc 4.125% 1/7/2022*	745,310	0.01
GBP	3,825,023	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	5,106,536	0.05
GBP	5,915,000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 21/9/2049	7,893,732	0.08
GBP	700,000	William Hill Plc 4.75% 1/5/2026	953,954	0.01
EUR	2,355,000	WPP Finance 2016 1.375% 20/3/2025	2,898,520	0.03
			311,665,910	3.20
		米国		
USD	460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ‘Series 2015-1211 D’ ‘144A’ FRN 10/8/2035	480,613	0.01
USD	1,500,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ‘Series 2015-1211 E’ ‘144A’ FRN 10/8/2035	1,447,298	0.02
USD	5,868,260	225 Liberty Street Trust 2016- 225L ‘Series 2016-225L E’ ‘144A’ FRN 10/2/2036	5,823,032	0.06
USD	320,000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P ‘Series 2017-245P D’ ‘144A’ FRN 5/6/2037	326,042	0.00
USD	1,412,000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P ‘Series 2017-245P E’ ‘144A’ FRN 5/6/2037	1,354,024	0.01
USD	7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017- 245P ‘Series 2017-245P XA’ ‘144A’ FRN 5/6/2037	81,270	0.00
USD	1,070,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ‘Series 2017-280P D’ ‘144A’ FRN 15/9/2034	1,051,511	0.01
USD	4,871,133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ‘Series 2017-280P E’ ‘144A’ FRN 15/9/2034	4,757,120	0.05
USD	1,040,000	522 Funding Clo I Ltd ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	1,015,276	0.01
USD	120,000	522 Funding Clo I Ltd ‘Series 2018-3A C’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	116,573	0.00
EUR	2,270,000	AbbVie Inc ‘144A’ 1.25% 1/6/2024	2,808,901	0.03
USD	2,248,669	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 ‘Series 2007-HE4 A2A’ FRN 25/5/2037	573,102	0.01
USD	739,435	ACIS CLO 2014-4 Ltd ‘Series 2014-4A A’ ‘144A’ FRN 1/5/2026	738,921	0.01
USD	973,640	Adams Mill CLO Ltd ‘Series 2014-1A A2R’ ‘144A’ FRN 15/7/2026	968,632	0.01
USD	1,250,000	Adams Mill CLO Ltd ‘Series 2014-1A C1R’ ‘144A’ FRN 15/7/2026	1,241,623	0.01
USD	9,604,000	Advanced Micro Devices Inc 7.5% 15/8/2022	10,746,732	0.11
USD	250,000	AGL CLO 2020-7A Ltd 15/7/2031 (Zero Coupon)	242,500	0.00
USD	825,000	AGL CLO 7 Ltd ‘Series 2020-7A D’ ‘144A’ FRN 15/7/2031	825,000	0.01
USD	4,700,000	AGL Core CLO 5 Ltd ‘Series 2020-5A B’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	4,732,126	0.05
USD	860,000	AGL Core CLO 5 Ltd ‘Series 2020-5A D’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	872,942	0.01
USD	438,000	AGL Core CLO 5 Ltd ‘Series 2020-5A E’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	400,433	0.00
USD	250,000	AIMCO CLO Series 2015-A ‘Series 2015-AA BR’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	242,232	0.00
USD	220,000	Air Products and Chemicals Inc 2.8% 15/5/2050	232,359	0.00
USD	7,666,179	Ajax Mortgage Loan Trust 2017- D ‘Series 2017-D A’ ‘144A’ FRN 25/12/2057	7,684,345	0.08

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,625,683	Ajax Mortgage Loan Trust 2017- D ‘Series 2017-D B’ ‘144A’ FRN 25/12/2057	910,383	0.01
USD	2,538,580	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- A ‘Series 2018-A B’ ‘144A’ FRN 25/4/2058	1,289,574	0.01
USD	6,010,308	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- A ‘Series 2018-A A’ ‘144A’ 3.85% 25/4/2058	6,016,678	0.06
USD	582,991	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- B ‘Series 2018-B B’ ‘144A’ 26/2/2057 (Zero Coupon)	163,516	0.00
USD	3,099,997	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- B ‘Series 2018-B A’ ‘144A’ 3.75% 26/2/2057	3,107,371	0.03
USD	4,414,409	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-E FRN 25/6/2058	4,516,544	0.05
USD	12,513,494	Ajax Mortgage Loan Trust 2018- F ‘Series 2018-F A’ ‘144A’ FRN 25/11/2058	12,541,619	0.13
USD	17,018,261	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- C ‘Series 2019-C A’ ‘144A’ FRN 25/10/2058	17,082,447	0.18
USD	16,447,379	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- G (Step-up coupon) ‘Series 2019-G A’ ‘144A’ 3% 25/9/2059	16,168,450	0.17
USD	8,542,280	Ajax Mortgage Loan Trust 2019- H (Step-up coupon) ‘Series 2019-H A’ ‘144A’ 3% 25/11/2059	8,395,241	0.09
USD	3,686,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 3.25% 15/3/2026	3,758,983	0.04
USD	1,338,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 3.5% 15/2/2023	1,366,767	0.01
USD	6,445,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 3.5% 15/3/2029	6,493,337	0.07
USD	438,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 4.625% 15/1/2027	463,253	0.01
USD	324,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 4.875% 15/2/2030	350,244	0.00
USD	706,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 5.75% 15/3/2025	728,341	0.01
USD	634,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 5.875% 15/2/2028	688,961	0.01
USD	298,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 6.625% 15/6/2024	308,519	0.00
USD	351,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC ‘144A’ 7.5% 15/3/2026	394,278	0.00
USD	330,000	Allegro CLO I Ltd ‘Series 2013- 1A C’ ‘144A’ FRN 30/1/2026	319,651	0.00
USD	1,560,000	Allegro CLO II-S Ltd ‘Series 2014-1RA B’ ‘144A’ FRN 21/10/2028	1,527,383	0.02
USD	2,270,000	Allegro CLO II-S Ltd ‘Series 2014-1RA C’ ‘144A’ FRN 21/10/2028	2,147,160	0.02
USD	1,790,000	Allegro CLO IV Ltd ‘Series 2016-1A BR’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	1,765,334	0.02
USD	2,300,000	Allegro CLO IV Ltd ‘Series 2016-1A CR’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	2,264,849	0.02
USD	250,000	Allegro CLO VI Ltd ‘Series 2017-2A A’ ‘144A’ FRN 17/1/2031	247,801	0.00
USD	4,065,000	ALM VII Ltd ‘Series 2012-7A SUB’ ‘144A’ FRN 15/10/2116	1,190,358	0.01
USD	1,190,000	ALM VII R Ltd ‘Series 2013- 7RA A1R’ ‘144A’ FRN 15/10/2028	1,193,255	0.01
USD	90,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC FRN 15/7/2027	80,412	0.00
USD	2,250,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ‘144A’ FRN 15/7/2027	2,132,501	0.02
USD	1,309,000	ALM XVI Ltd/ALM XVI LLC ‘Series 2015-16A BR2’ ‘144A’ FRN 15/7/2027	1,270,565	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	800,000	ALM XVII Ltd‘Series 2015-17A BR’‘144A’FRN 15/1/2028	784,092	0.01
USD	720,000	ALM XVII Ltd ‘Series 2015-17A CR’‘144A’FRN 15/1/2028	678,849	0.01
USD	870,000	ALM XVIII Ltd‘Series 2016-18A A2R’‘144A’FRN 15/1/2028	852,394	0.01
USD	2,658,824	Alternative Loan Trust 2005- 22T1‘Series 2005-22T1 A1’ FRN 25/6/2035	2,082,832	0.02
USD	2,511,507	Alternative Loan Trust 2005-72‘Series 2005-72 A3’FRN 25/1/2036	2,302,107	0.02
USD	871,449	Alternative Loan Trust 2005-76‘Series 2005-76 2A1’FRN 25/2/2036	796,619	0.01
USD	3,223,500	Alternative Loan Trust 2005-J4‘Series 2005-J4 B1’FRN 25/7/2035	3,126,380	0.03
USD	4,085,179	Alternative Loan Trust 2006- 11CB‘Series 2006-11CB 3A1’ 6.5% 25/5/2036	3,036,811	0.03
USD	1,186,483	Alternative Loan Trust 2006- 15CB‘Series 2006-15CB A1’ 6.5% 25/6/2036	918,287	0.01
USD	1,755,857	Alternative Loan Trust 2006- 23CB‘Series 2006-23CB 2A5’ FRN 25/8/2036	359,529	0.00
USD	966,494	Alternative Loan Trust 2006-J7‘Series 2006-J7 2A1’FRN 20/11/2046	648,253	0.01
USD	612,556	Alternative Loan Trust 2006- OA11‘Series 2006-OA11 A4’ FRN 25/9/2046	552,076	0.01
USD	4,087,233	Alternative Loan Trust 2006- OA14‘Series 2006-OA14 1A1’ FRN 25/11/2046	3,388,750	0.04
USD	3,219,906	Alternative Loan Trust 2006- OA16‘Series 2006-OA16 A4C’ FRN 25/10/2046	2,300,955	0.02
USD	537,692	Alternative Loan Trust 2006- OA8‘Series 2006-OA8 1A1’ FRN 25/7/2046	469,649	0.01
USD	1,410,699	Alternative Loan Trust 2006- OC10‘Series 2006-OC10 2A3’ FRN 25/11/2036	1,120,242	0.01
USD	5,524,726	Alternative Loan Trust 2006- OC7‘Series 2006-OC7 2A3’ FRN 25/7/2046	4,852,720	0.05
USD	4,011,507	Alternative Loan Trust 2007-25‘Series 2007-25 1A3’6.5% 25/11/2037	2,846,217	0.03
USD	5,788,103	Alternative Loan Trust 2007-3T1‘Series 2007-3T1 1A1’6% 25/4/2037	3,823,414	0.04
USD	3,563,641	Alternative Loan Trust 2007-9T1‘Series 2007-9T1 1A1’6% 25/5/2037	2,125,845	0.02
USD	5,127	Alternative Loan Trust 2007- OA3‘Series 2007-OA3 2A2’ FRN 25/4/2047	845	0.00
USD	296,786	Alternative Loan Trust 2007- OA8‘Series 2007-OA8 2A1’ FRN 25/6/2047	225,633	0.00
USD	367,538	Alternative Loan Trust 2007- OH2‘Series 2007-OH2 A2A’ FRN 25/8/2047	330,967	0.00
USD	4,391,000	Amazon.com Inc 2.7% 3/6/2060	4,441,033	0.05
USD	2,053,000	Amazon.com Inc 4.05% 22/8/2047	2,641,555	0.03
USD	671,973	Ambac Assurance Corp‘144A’5.1% 0 (Perpetual)	918,924	0.01
USD	1,000,000	AMC Entertainment Holdings Inc‘144A’10.5% 15/4/2025	862,500	0.01
USD	865,000	AMC Networks Inc 4.75% 1/8/2025	898,142	0.01
USD	560,000	AMC Networks Inc 5% 1/4/2024	571,550	0.01
USD	636,000	American Builders & Contractors Supply Co Inc‘144A’4% 15/1/2028	651,385	0.01
USD	357,000	American Builders & Contractors Supply Co Inc ‘144A’ 5.875% 15/5/2026	374,784	0.00
USD	3,452,000	American Energy- Permian Basin LLC (Defaulted)‘144A’12% 1/10/2024	103,560	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,018,647	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 ‘Series 2006-3 2A11’ FRN 25/10/2046	823,217	0.01
USD	2,201,195	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 ‘Series 2006-4 1A12’ FRN 25/10/2046	1,417,000	0.01
USD	3,798,024	American Home Mortgage Assets Trust 2006-5 ‘Series 2006-5 A1’ FRN 25/11/2046	1,650,702	0.02
USD	700,800	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 ‘Series 2007-1 A1’ FRN 25/2/2047	385,169	0.00
USD	1,876,000	American Homes 4 Rent 2014- SFR2 Trust ‘Series 2014-SFR2 E’ ‘144A’ 6.231% 17/10/2036	2,091,094	0.02
USD	4,860,660	American Homes 4 Rent 2015- SFR1 ‘Series 2015-SFR1 XS’ ‘144A’ FRN 17/4/2052	49	0.00
USD	1,285,000	American Municipal Power Inc 7.834% 15/2/2041	2,138,670	0.02
EUR	2,548,000	American Tower Corp 1.95% 22/5/2026*	3,289,809	0.03
USD	1,380,000	American Tower Corp 2.1% 15/6/2030	1,408,639	0.01
USD	2,739,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	3,050,612	0.03
USD	530,000	AMMC CLO 21 Ltd ‘Series 2017-21A A’ ‘144A’ FRN 2/11/2030	527,278	0.01
USD	3,066,483	AMMC CLO XIII Ltd ‘Series 2013-13A A1LR’ ‘144A’ FRN 24/7/2029	3,058,662	0.03
USD	959,000	AMN Healthcare Inc ‘144A’ 4.625% 1/10/2027	1,002,572	0.01
USD	2,644,000	AMN Healthcare Inc ‘144A’ 5.125% 1/10/2024	2,726,347	0.03
USD	2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd ‘Series 2018-1RA A1’ ‘144A’ FRN 13/4/2031	2,324,393	0.02
USD	840,000	Anchorage Capital CLO 2013- 1 Ltd ‘Series 2013-1A A1R’ ‘144A’ FRN 13/10/2030	836,951	0.01
USD	1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013- 1 Ltd ‘Series 2013-1A A2R’ ‘144A’ FRN 13/10/2030	1,054,296	0.01
USD	340,000	Anchorage Capital CLO 2013- 1 Ltd ‘Series 2013-1A BR’ ‘144A’ FRN 13/10/2030	329,545	0.00
USD	417,000	Anchorage Capital CLO 2013- 1 Ltd ‘Series 2013-1A CR’ ‘144A’ FRN 13/10/2030	404,229	0.00
USD	800,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd ‘Series 2014-3RA A’ ‘144A’ FRN 28/1/2031	794,314	0.01
USD	1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd ‘Series 2014-3RA B’ ‘144A’ FRN 28/1/2031	1,602,830	0.02
USD	1,420,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd ‘Series 2014-4RA A’ ‘144A’ FRN 28/1/2031	1,403,671	0.01
USD	1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R Ltd ‘Series 2014-4RA C’ ‘144A’ FRN 28/1/2031	1,427,280	0.01
USD	5,223,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd ‘Series 2014-5RA B’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	5,110,946	0.05
USD	1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R Ltd ‘Series 2014-5RA C’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	1,235,076	0.01
USD	1,320,000	Anchorage Capital CLO 6 Ltd ‘Series 2015-6A AR’ ‘144A’ FRN 15/7/2030	1,312,531	0.01
USD	1,150,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ‘Series 2016-8A AR’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	1,147,898	0.01
USD	3,645,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ‘Series 2016-8A BR’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	3,583,991	0.04
USD	5,543,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ‘Series 2016-8A CR’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	5,330,369	0.06
USD	1,850,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ‘Series 2016-8A DR’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	1,767,709	0.02
USD	3,020,000	Anchorage Capital CLO 8 Ltd ‘Series 2016-8A ER’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	2,541,890	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,438,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.5% 1/6/2030	2,786,961	0.03
USD	700,000	Apidos CLO XII ‘Series 2013- 12A AR’ ‘144A’ FRN 15/4/2031	693,139	0.01
USD	1,040,000	Apidos CLO XV ‘Series 2013- 15A A1RR’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	1,024,898	0.01
USD	500,000	Apidos CLO XXI ‘Series 2015- 21A CR’ ‘144A’ FRN 18/7/2027	465,356	0.01
USD	640,000	Apidos CLO XXIX ‘Series 2018- 29A D’ ‘144A’ FRN 25/7/2030	532,012	0.01
USD	1,000,000	Apidos CLO XXXI ‘Series 2019- 31A B’ ‘144A’ FRN 15/4/2031	1,000,750	0.01
USD	632,000	Applied Materials Inc 2.75% 1/6/2050	664,862	0.01
USD	6,574,130	APS Resecuritization Trust 2016-1 ‘Series 2016-1 1MZ’ ‘144A’ FRN 31/7/2057	2,350,120	0.02
USD	4,033,422	APS Resecuritization Trust 2016-3 ‘Series 2016-3 3A’ ‘144A’ FRN 27/9/2046	4,107,688	0.04
USD	710,275	APS Resecuritization Trust 2016-3 ‘Series 2016-3 4A’ ‘144A’ FRN 27/4/2047	715,435	0.01
USD	281,000	Aramark Services Inc 4.75% 1/6/2026	279,006	0.00
USD	651,000	Aramark Services Inc ‘144A’ 5% 1/2/2028	649,115	0.01
USD	3,301,500	Arbor Realty Collateralized Loan Obligation 2017-FL3 Ltd ‘Series 2017-FL3 A’ ‘144A’ FRN 15/12/2027	3,258,960	0.03
USD	400,000	Ares XLI Clo Ltd ‘Series 2016- 41A D’ ‘144A’ FRN 15/1/2029	392,579	0.00
USD	375,000	ARES XLV CLO Ltd ‘Series 2017-45A C’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	360,142	0.00
USD	26,325	Ares XXIX CLO Ltd ‘Series 2014-1A A1R’ ‘144A’ FRN 17/4/2026	26,304	0.00
USD	1,500,000	Ares XXXVII CLO Ltd ‘Series 2015-4A A1R’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	1,488,884	0.02
USD	4,302,838	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 ‘Series 2005-W1 A2’ FRN 25/5/2035	3,879,184	0.04
USD	1,820,000	Arizona Health Facilities Authority FRN 1/1/2037	1,698,005	0.02
USD	4,852,000	Arrow Bidco LLC ‘144A’ 9.5% 15/3/2024	3,996,326	0.04
USD	657,000	Ashford Hospitality Trust 2018- ASHF ‘Series 2018-ASHF D’ ‘144A’ FRN 15/4/2035	583,491	0.01
USD	3,604,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ‘144A’ 6.625% 15/1/2028	3,613,010	0.04
USD	784,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ‘144A’ 6.75% 1/8/2025	802,538	0.01
USD	5,253,000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co ‘144A’ 9.875% 1/4/2027	5,757,498	0.06
USD	13,005,000	AT&T Inc 2.75% 1/6/2031	13,759,314	0.14
USD	4,330,000	AT&T Inc 3.65% 1/6/2051	4,488,968	0.05
USD	4,207,972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ‘Series 2017-ATRM D’ ‘144A’ FRN 15/12/2036	3,563,753	0.04
USD	514,447	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM ‘Series 2017-ATRM E’ ‘144A’ FRN 15/12/2036	428,236	0.00
USD	726,701	Atrium XII ‘144A’ FRN 22/4/2027	724,170	0.01
USD	1,385,000	Atrium XII ‘144A’ FRN 22/4/2027	1,313,393	0.01
USD	380,000	Avaya Holdings Corp 2.25% 15/6/2023	356,764	0.00
USD	2,435,581	Avery Point IV CLO Ltd ‘Series 2014-1A AR’ ‘144A’ FRN 25/4/2026	2,432,059	0.03
USD	801,882	Avery Point V CLO Ltd ‘Series 2014-5A AR’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	800,899	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	270,000	Avery Point V CLO Ltd ‘Series 2014-5A BR’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	268,156	0.00
USD	4,380,000	Avery Point VI CLO Ltd ‘Series 2015-6A BR’ ‘144A’ FRN 5/8/2027	4,302,236	0.04
EUR	200,000	Axalta Coating Systems LLC 4.25% 15/8/2024	244,134	0.00
USD	389,000	Azul Investments LLP ‘144A’ 5.875% 26/10/2024*	231,455	0.00
USD	801,645	B2R Mortgage Trust 2015-2 ‘Series 2015-2 XA’ ‘144A’ FRN 15/11/2048	1,699	0.00
USD	66,918	B2R Mortgage Trust 2015-2 ‘Series 2015-2 A’ ‘144A’ 3.336% 15/11/2048	66,891	0.00
USD	1,000,000	Babson CLO Ltd 2015-II ‘Series 2015-2A AR’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	986,006	0.01
USD	3,739,108	Bain Capital Credit Clo 2016- 2 Ltd ‘Series 2016-2A AR’ ‘144A’ FRN 15/1/2029	3,731,553	0.04
USD	2,650,000	Bain Capital Credit Clo 2016- 2 Ltd ‘Series 2016-2A BR’ ‘144A’ FRN 15/1/2029	2,629,187	0.03
USD	1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 ‘Series 2018-2A A1’ ‘144A’ FRN 19/7/2031	1,773,493	0.02
USD	875,000	Bain Capital Credit CLO 2020-2 Ltd ‘Series 2020-2A D’ ‘144A’ FRN 19/7/2031	884,212	0.01
EUR	1,796,000	Ball Corp 0.875% 15/3/2024	2,148,301	0.02
USD	243,000	Ball Corp 4.875% 15/3/2026	274,347	0.00
USD	324,000	Ball Corp 5.25% 1/7/2025	368,417	0.00
USD	1,147,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P ‘Series 2015-200P F’ ‘144A’ FRN 14/4/2033	1,163,993	0.01
USD	230,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ ‘Series 2016-ISQ C’ ‘144A’ FRN 14/8/2034	239,299	0.00
USD	4,108,736	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2016-ISQ ‘Series 2016-ISQ E’ ‘144A’ FRN 14/8/2034	4,134,234	0.04
USD	5,860,000	Baml1 Commercial Mortgage Securities Trust 2016-SS1 ‘Series 2016-SS1 XA’ ‘144A’ FRN 15/12/2035	163,142	0.00
USD	3,645,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ‘Series 2017-SCH CL’ ‘144A’ FRN 15/11/2032	3,312,240	0.03
USD	1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ‘Series 2017-SCH DL’ ‘144A’ FRN 15/11/2032	1,643,399	0.02
USD	3,273,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2017-SCH ‘Series 2017-SCH BF’ ‘144A’ FRN 15/11/2033	3,030,516	0.03
USD	2,553,409	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DSNY ‘Series 2018-DSNY D’ ‘144A’ FRN 15/9/2034	2,335,947	0.02
USD	1,500,000	BAMLL Trust 2011-FSHN ‘Series 2011-FSHN B’ ‘144A’ 4.769% 11/7/2033	1,497,846	0.02
USD	3,415,995	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 ‘Series 2016-UB10 C’ FRN 15/7/2049	3,395,730	0.04
USD	9,780,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ‘Series 2017-BNK3 XB’ FRN 15/2/2050	358,693	0.00
USD	4,000,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 ‘Series 2017-BNK3 XD’ ‘144A’ FRN 15/2/2050	274,560	0.00
USD	412,395	Banc of America Funding 2006- A Trust ‘Series 2006-A 3A2’ FRN 20/2/2036	388,258	0.00
USD	14,741,165	Banc of America Funding 2014- R2 Trust ‘Series 2014-R2 1C’ ‘144A’ FRN 26/11/2036	3,490,357	0.04
EUR	725,000	Banff Merger Sub Inc 8.375% 1/9/2026	893,908	0.01
USD	5,530,000	BANK 2017-BNK9 ‘Series 2017-BNK9 A4’ 3.538% 15/11/2054	6,292,497	0.06
USD	1,229,000	Bank of America Corp FRN 5/9/2024 (Perpetual)	1,345,866	0.01
USD	2,793,000	Bank of America Corp FRN 23/10/2024 (Perpetual)	3,157,278	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	714,000	Bank of America Corp FRN 10/3/2026 (Perpetual)	819,718	0.01
USD	5,968,000	Bank of America Corp FRN 5/3/2029	6,851,761	0.07
USD	5,553,000	Bank of America Corp FRN 22/10/2030	6,027,561	0.06
USD	12,162,000	Bank of America Corp FRN 29/4/2031	12,912,659	0.13
USD	6,498,000	Bank of America Corp FRN 19/6/2041	6,593,655	0.07
USD	5,339,000	Bank of America Corp FRN 20/3/2051	6,640,946	0.07
USD	1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ‘Series 1997-2 B1’ FRN 10/2/2022	908,948	0.01
USD	2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust ‘Series 1998-2 B1’ FRN 10/12/2025	1,152,304	0.01
USD	790,000	Barings CLO Ltd 2018-III FRN 20/7/2029	787,229	0.01
USD	630,000	Battalion CLO VII Ltd ‘Series 2014-7A A1RR’ ‘144A’ FRN 17/7/2028	627,021	0.01
USD	4,438,000	Battalion CLO VII Ltd ‘Series 2014-7A BRR’ ‘144A’ FRN 17/7/2028	4,374,493	0.05
USD	1,080,000	Battalion CLO XI Ltd ‘Series 2017-11A E’ ‘144A’ FRN 24/10/2029	957,223	0.01
USD	1,027,000	Bausch Health Americas Inc ‘144A’ 8.5% 31/1/2027	1,131,153	0.01
USD	885,000	Bausch Health Americas Inc ‘144A’ 9.25% 1/4/2026	985,881	0.01
USD	4,275,000	Bay Area Toll Authority 2.425% 1/4/2026	4,603,213	0.05
USD	3,375,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	5,446,119	0.06
USD	1,830,000	Bay Area Toll Authority 7.043% 1/4/2050	3,347,601	0.03
USD	1,400,769	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 ‘Series 2005-3A A1’ ‘144A’ FRN 25/11/2035	1,325,940	0.01
USD	2,629,724	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ‘Series 2005-4A A1’ ‘144A’ FRN 25/1/2036	2,476,639	0.03
USD	63,861	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ‘Series 2005-4A A2’ ‘144A’ FRN 25/1/2036	60,495	0.00
USD	168,777	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 ‘Series 2005-4A M1’ ‘144A’ FRN 25/1/2036	158,848	0.00
USD	234,323	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ‘Series 2006-1A A2’ ‘144A’ FRN 25/4/2036	217,492	0.00
USD	673,678	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ‘Series 2006-1A M2’ ‘144A’ FRN 25/4/2036	601,411	0.01
USD	162,107	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ‘Series 2006-1A M3’ ‘144A’ FRN 25/4/2036	143,969	0.00
USD	886,099	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 ‘Series 2006-1A M4’ ‘144A’ FRN 25/4/2036	782,478	0.01
USD	883,740	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 ‘Series 2006-3A A1’ ‘144A’ FRN 25/10/2036	826,297	0.01
USD	4,733,958	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 ‘Series 2006-4A A1’ ‘144A’ FRN 25/12/2036	4,392,482	0.05
USD	16,729,057	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 ‘Series 2007-4A A1’ ‘144A’ FRN 25/9/2037	15,502,224	0.16
USD	3,077,156	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 ‘Series 2008-2 A4A’ ‘144A’ FRN 25/4/2038	3,074,637	0.03
USD	5,811,538	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ‘Series 2004-B A1’ ‘144A’ FRN 28/5/2039	4,870,192	0.05
USD	1,690,496	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B ‘Series 2004-B A2’ ‘144A’ FRN 28/5/2039	1,534,752	0.02
USD	6,750,306	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A ‘Series 2005-A A1’ ‘144A’ FRN 28/2/2040	6,334,978	0.07
USD	762,594	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E ‘Series 2005-E A1’ ‘144A’ FRN 28/12/2040	735,461	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	286,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust ‘Series 2017-DELC E’ ‘144A’ FRN 15/8/2036	259,234	0.00
USD	840,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust ‘Series 2018-CHRS E’ ‘144A’ FRN 5/8/2038	592,801	0.01
USD	877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust ‘Series 2018-TALL A’ ‘144A’ FRN 15/3/2037	847,320	0.01
USD	1,060,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust ‘Series 2018-TALL D’ ‘144A’ FRN 15/3/2037	997,419	0.01
USD	20,840,000	BBCMS Trust 2015-SRCH ‘Series 2015-SRCH XA’ ‘144A’ FRN 10/8/2035	1,065,341	0.01
USD	11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH ‘Series 2015-SRCH XB’ ‘144A’ FRN 10/8/2035	156,563	0.00
USD	2,247,064	BCAP LLC 2011-RR5-I Trust ‘Series 2011-RR5 11A5’ ‘144A’ FRN 28/5/2036	2,051,894	0.02
USD	1,627,547	BCMSC Trust 2000-A ‘Series 2000-A A2’ FRN 15/6/2030	494,355	0.01
USD	1,510,989	BCMSC Trust 2000-A ‘Series 2000-A A3’ FRN 15/6/2030	474,145	0.01
USD	1,089,739	BCMSC Trust 2000-A ‘Series 2000-A A4’ FRN 15/6/2030	361,725	0.00
USD	766,000	Beacon Roofing Supply Inc ‘144A’ 4.875% 1/11/2025	761,645	0.01
USD	30,000	Bean Creek CLO Ltd ‘Series 2015-1A ER’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	23,803	0.00
USD	632,268	Bear Stearns ALT-A Trust 2006- 6 ‘Series 2006-6 1A1’ FRN 25/11/2036	548,645	0.01
USD	2,560,494	Bear Stearns ALT-A Trust 2007- 1 ‘Series 2007-1 1A1’ FRN 25/1/2047	2,213,362	0.02
USD	89,689	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 ‘Series 2004-5 2A’ FRN 25/7/2034	89,923	0.00
USD	148,982	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-HE7 ‘Series 2004-HE7 M2’ FRN 25/8/2034	148,739	0.00
USD	2,629,586	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-AC9 (Step-up coupon) ‘Series 2005-AC9 A5’ 6.25% 25/12/2035	2,415,613	0.03
USD	3,633,675	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-AC1 (Step-up coupon) ‘Series 2006-AC1 1A2’ 6.25% 25/2/2036	3,130,948	0.03
USD	1,350,579	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE1 ‘Series 2006-HE1 1M4’ FRN 25/12/2035	1,735,042	0.02
USD	3,387,238	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE7 ‘Series 2006-HE7 1A2’ FRN 25/9/2036	4,174,857	0.04
USD	720,000	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE8 ‘Series 2006-HE8 1A3’ FRN 25/10/2036	634,425	0.01
USD	563,616	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE1 ‘Series 2007-HE1 21A2’ FRN 25/1/2037	555,755	0.01
USD	812,379	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ‘Series 2007-HE2 1A4’ FRN 25/3/2037	634,548	0.01
USD	896,967	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ‘Series 2007-HE2 22A’ FRN 25/3/2037	880,979	0.01
USD	1,941,551	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE2 ‘Series 2007-HE2 23A’ FRN 25/3/2037	2,024,352	0.02
USD	869,798	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ‘Series 2007-HE3 1A3’ FRN 25/4/2037	951,690	0.01
USD	5,205,227	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE3 ‘Series 2007-HE3 1A4’ FRN 25/4/2037	4,599,241	0.05
USD	37,417	Bear Stearns Asset Backed Securities Trust 2005-4 ‘Series 2005-4 M2’ FRN 25/1/2036	37,435	0.00
USD	254,538	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2005-PWR7 ‘Series 2005- PWR7 B’ FRN 11/2/2041	253,052	0.00
USD	606,437	Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust 2007-TOP26 ‘Series 2007- T26 AM’ FRN 12/1/2045	607,182	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	685,382	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 'Series 2006- SL1 A1' FRN 25/8/2036	673,506	0.01
USD	400,446	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 'Series 2007- AR2 A1' FRN 25/3/2037	358,189	0.00
USD	671,335	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 'Series 2007- AR3 1A1' FRN 25/3/2037	601,470	0.01
USD	501,892	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 'Series 2007- AR4 2A1' FRN 25/6/2037	467,543	0.01
USD	3,142,000	Beazer Homes USA Inc 7.25% 15/10/2029	3,371,853	0.03
USD	3,180,000	Becton Dickinson and Co 3.794% 20/5/2050	3,555,872	0.04
EUR	320,000	Belden Inc 2.875% 15/9/2025	375,932	0.00
EUR	400,000	Belden Inc 3.875% 15/3/2028*	478,859	0.01
EUR	1,260,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	1,533,804	0.02
USD	200,000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 'Series 2018-B3 D' '144A' FRN 10/4/2051	156,660	0.00
USD	10,642,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd 'Series 2013-IIA A2R' '144A' FRN 15/7/2029	10,645,474	0.11
USD	499,193	Benefit Street Partners CLO III Ltd 'Series 2013-IIIA A1R' '144A' FRN 20/7/2029	497,795	0.01
USD	750,000	Benefit Street Partners CLO V-B Ltd 'Series 2018-5BA A1A' '144A' FRN 20/4/2031	731,580	0.01
USD	5,697,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A1R' '144A' FRN 18/10/2029	5,686,865	0.06
USD	1,190,000	Benefit Street Partners CLO VI Ltd 'Series 2015-VIA A2R' '144A' FRN 18/10/2029	1,174,721	0.01
USD	1,036,484	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA A1AR' '144A' FRN 18/7/2027	1,027,597	0.01
USD	300,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA CR' '144A' FRN 18/7/2027	272,812	0.00
USD	2,120,000	Benefit Street Partners CLO VII Ltd 'Series 2015-VIIA D' '144A' FRN 18/7/2027	1,809,369	0.02
USD	2,010,000	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd 'Series 2015-8A A1AR' '144A' FRN 20/1/2031	1,995,876	0.02
EUR	2,018,000	Berry Global Inc 1% 15/1/2025	2,350,862	0.02
USD	292,000	Berry Global Inc '144A' 4.5% 15/2/2026	297,056	0.00
USD	744,000	Berry Global Inc '144A' 4.875% 15/7/2026	789,879	0.01
USD	299,000	Berry Global Inc '144A' 5.625% 15/7/2027	317,136	0.00
USD	2,323,090	BHMS 2018-ATLS 'Series 2018-ATLS A' '144A' FRN 15/7/2035	2,230,737	0.02
USD	1,379,212	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd 'Series 2013-1A A2R' '144A' FRN 6/2/2026	1,373,369	0.01
USD	22,855	Black Diamond CLO 2014-1 Ltd 'Series 2014-1A A1R' '144A' FRN 17/10/2026	22,847	0.00
EUR	2,200,000	Blackstone Holdings Finance Co LLC 2% 19/5/2025*	2,814,277	0.03
USD	2,699,240	BlueMountain CLO 2013-2 Ltd 'Series 2013-2A A1R' '144A' FRN 22/10/2030	2,663,195	0.03
USD	480,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A C' '144A' FRN 13/4/2027	461,340	0.01
USD	889,000	BlueMountain CLO 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A D' '144A' FRN 13/4/2027	765,984	0.01
USD	530,000	BlueMountain CLO 2015-3 Ltd 'Series 2015-3A A1R' '144A' FRN 20/4/2031	520,482	0.01
USD	2,250,000	Boeing Co/The 4.508% 1/5/2023	2,370,974	0.02
USD	3,020,000	Boeing Co/The 4.875% 1/5/2025	3,275,070	0.03
USD	842,000	BorgWarner Inc 2.65% 1/7/2027	891,014	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
EUR	3,294,000	Boxer Parent Co Inc 6.5% 2/10/2025	4,105,859	0.04
USD	359,000	Boxer Parent Co Inc ‘144A’ 7.125% 2/10/2025	390,929	0.00
USD	4,109,000	Boyd Gaming Corp 4.75% 1/12/2027	4,105,672	0.04
USD	834,000	Boyd Gaming Corp ‘144A’ 8.625% 1/6/2025	922,621	0.01
USD	1,159,000	BP Capital Markets America Inc 1.749% 10/8/2030	1,147,870	0.01
USD	1,134,000	Broadcom Inc 3.15% 15/11/2025	1,229,861	0.01
USD	2,160,000	Broadcom Inc 4.15% 15/11/2030	2,428,949	0.03
USD	7,296,000	Broadcom Inc 4.7% 15/4/2025	8,336,972	0.09
USD	2,090,000	Broadcom Inc 5% 15/4/2030	2,477,753	0.03
USD	597,000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSI Sellco LL ‘144A’ 5.75% 15/5/2026	493,970	0.01
USD	1,000,000	Brookside Mill CLO Ltd 2013-1 ‘Series 2013-1A BR’ ‘144A’ FRN 17/1/2028	985,868	0.01
USD	500,000	Brookside Mill CLO Ltd 2013-1 ‘Series 2013-1A DR’ ‘144A’ FRN 17/1/2028	464,470	0.01
USD	5,498,000	Bruin E&P Partners LLC (Defaulted) ‘144A’ 8.875% 1/8/2023	10,886	0.00
USD	204,000	Buckeye Partners LP 3.95% 1/12/2026	202,597	0.00
USD	2,594,000	Buckeye Partners LP ‘144A’ 4.125% 1/3/2025	2,613,403	0.03
USD	1,178,000	Buckeye Partners LP 4.15% 1/7/2023	1,181,681	0.01
USD	1,500,000	Buckeye Partners LP 4.35% 15/10/2024	1,497,187	0.02
USD	2,210,000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.05% 15/2/2051	2,425,117	0.03
USD	2,681,270	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ‘Series 2013-1515 A2’ ‘144A’ 3.454% 10/3/2033	2,887,736	0.03
USD	2,604,935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ‘Series 2013-1515 D’ ‘144A’ 3.633% 10/3/2033	2,645,710	0.03
USD	13,358,641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust ‘Series 2013-1515 E’ ‘144A’ 3.717% 10/3/2033	13,356,506	0.14
USD	1,357,904	BWAY 2015-1740 Mortgage Trust ‘Series 2015-1740 E’ ‘144A’ FRN 10/1/2035	1,275,031	0.01
USD	1,110,000	BX Commercial Mortgage Trust 2018-BIOA ‘Series 2018-BIOA E’ ‘144A’ FRN 15/3/2037	1,076,035	0.01
USD	9,110,594	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND ‘Series 2018-IND H’ ‘144A’ FRN 15/11/2035	8,913,591	0.09
USD	573,000	BXP Trust 2017-CC ‘Series 2017-CC D’ ‘144A’ FRN 13/8/2037	576,466	0.01
USD	2,156,000	BXP Trust 2017-CC ‘Series 2017-CC E’ ‘144A’ FRN 13/8/2037	2,142,997	0.02
USD	470,000	BXP Trust 2017-GM ‘Series 2017-GM D’ ‘144A’ FRN 13/6/2039	496,948	0.01
USD	945,000	BXP Trust 2017-GM ‘Series 2017-GM E’ ‘144A’ FRN 13/6/2039	954,069	0.01
USD	11,578,000	Caesars Entertainment Inc ‘144A’ 6.25% 1/7/2025	12,229,205	0.13
USD	5,160,000	Caesars Entertainment Inc ‘144A’ 8.125% 1/7/2027	5,462,866	0.06
USD	1,030,000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc ‘144A’ 5.25% 15/10/2025	985,210	0.01
USD	1,303,000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc ‘144A’ 5.75% 1/7/2025	1,360,006	0.01
USD	1,970,000	California Pollution Control Financing Authority ‘144A’ 5% 21/11/2045	2,047,569	0.02
USD	1,655,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,748,351	0.03
USD	3,130,000	California State University 2.975% 1/11/2051	3,291,743	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,905,644	California Street CLO XII Ltd ‘Series 2013-12A AR’ ‘144A’ FRN 15/10/2025	1,894,092	0.02
USD	9,175,000	Calpine Corp ‘144A’ 4.5% 15/2/2028	9,534,476	0.10
USD	3,233,000	Calpine Corp ‘144A’ 5.125% 15/3/2028	3,407,307	0.04
USD	5,328,000	Calpine Corp ‘144A’ 5.25% 1/6/2026	5,561,873	0.06
USD	887,000	Capital One Financial Corp FRN 1/12/2020 (Perpetual)	804,492	0.01
EUR	2,237,000	Capital One Financial Corp 0.8% 12/6/2024	2,672,765	0.03
USD	3,792,000	Capitol Investment Merger Sub 2 LLC ‘144A’ 10% 1/8/2024	3,981,600	0.04
USD	2,959,000	Carlson Travel Inc ‘144A’ 6.75% 15/12/2023*	2,289,216	0.02
USD	2,257,039	Carlyle Global Market Strategies CLO 2013-2 Ltd ‘Series 2013-2A AR’ ‘144A’ FRN 18/1/2029	2,226,292	0.02
USD	2,013,877	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 Ltd ‘Series 2014-1A A1R2’ ‘144A’ FRN 17/4/2031	1,980,969	0.02
USD	250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ‘Series 2015-2A CR’ ‘144A’ FRN 27/4/2027	233,626	0.00
USD	250,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-2 Ltd ‘Series 2015-2A DR’ ‘144A’ FRN 27/4/2027	203,364	0.00
USD	2,380,000	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-3 Ltd ‘Series 2015-3A A2R’ ‘144A’ FRN 28/7/2028	2,343,718	0.02
USD	254,871	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 Ltd ‘Series 2015-4A SBB1’ ‘144A’ FRN 20/7/2032	231,250	0.00
USD	4,500,000	CARLYLE US CLO 2017-4 Ltd ‘Series 2017-4A A1’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	4,473,999	0.05
USD	4,568,000	Carpenter Technology Corp 4.45% 1/3/2023	4,709,605	0.05
USD	490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 ‘Series 2006-NC1 M2’ FRN 25/1/2036	396,398	0.00
USD	1,786,793	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 ‘Series 2006-NC3 A3’ FRN 25/8/2036	1,676,933	0.02
USD	718,640	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 ‘Series 2006-NC4 A3’ FRN 25/10/2036	684,238	0.01
USD	1,442,589	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC5 ‘Series 2006-NC5 A3’ FRN 25/1/2037	1,214,272	0.01
USD	750,000	CarVal CLO I Ltd ‘Series 2018- 1A D’ ‘144A’ FRN 16/7/2031	725,123	0.01
USD	790,000	CarVal CLO I Ltd ‘Series 2018- 1A E’ ‘144A’ FRN 16/7/2031	694,821	0.01
EUR	2,353,000	Catalent Pharma Solutions Inc 2.375% 1/3/2028	2,755,516	0.03
USD	7,155,000	CBAM 2017-1 Ltd ‘Series 2017- 1A A1’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	7,117,399	0.07
USD	530,000	CBAM 2017-2 Ltd ‘Series 2017- 2A B1’ ‘144A’ FRN 17/10/2029	523,221	0.01
USD	250,000	CBAM 2017-3 Ltd ‘Series 2017- 3A B1’ ‘144A’ FRN 17/10/2029	246,062	0.00
USD	969,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ‘144A’ 4.5% 15/8/2030	1,030,982	0.01
USD	2,736,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ‘144A’ 5% 1/2/2028	2,902,896	0.03
USD	1,926,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ‘144A’ 5.125% 1/5/2027	2,054,166	0.02
USD	880,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ‘144A’ 5.375% 1/6/2029	964,603	0.01
USD	890,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ‘144A’ 5.5% 1/5/2026	932,137	0.01
USD	16,000,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT ‘Series 2016-HEAT X’ ‘144A’ FRN 10/4/2029	40,755	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	908,864	CD 2006-CD3 Mortgage Trust ‘Series 2006-CD3 AM’ 5.648% 15/10/2048	931,683	0.01
USD	632,000	CDK Global Inc 5% 15/10/2024	716,675	0.01
USD	408,858	CDO Repack SPC Ltd ‘Series 2006-CLF1 D1’ ‘144A’ 20/5/2030 (Zero Coupon)	430,837	0.00
USD	543,000	Cedar Fair LP 5.25% 15/7/2029	528,985	0.01
USD	284,000	Cedar Fair LP / Canada’s Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15/4/2027	284,000	0.00
USD	2,072,000	Cedar Fair LP / Canada’s Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op ‘144A’ 5.5% 1/5/2025	2,147,628	0.02
USD	266,000	Cedar Funding II CLO Ltd ‘Series 2013-1A A1R’ ‘144A’ FRN 9/6/2030	264,040	0.00
USD	1,070,000	Cedar Funding II CLO Ltd ‘Series 2013-1A BR’ ‘144A’ FRN 9/6/2030	1,063,874	0.01
USD	1,000,000	Cedar Funding II CLO Ltd ‘Series 2013-1A DR’ ‘144A’ FRN 9/6/2030	972,312	0.01
USD	580,000	Cedar Funding IX CLO Ltd ‘Series 2018-9A E’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	496,863	0.01
USD	5,361,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ‘Series 2016-6A AR’ ‘144A’ FRN 20/10/2028	5,343,471	0.06
USD	950,000	Cedar Funding VI CLO Ltd ‘Series 2016-6A DR’ ‘144A’ FRN 20/10/2028	891,842	0.01
USD	9,044,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ‘Series 2017-8A A1’ ‘144A’ FRN 17/10/2030	8,963,215	0.09
USD	580,000	Cedar Funding VIII Clo Ltd ‘Series 2017-8A B’ ‘144A’ FRN 17/10/2030	570,018	0.01
EUR	200,000	CEMEX Finance LLC 4.625% 15/6/2024	244,760	0.00
USD	450,000	Cent CLO 19 Ltd ‘Series 2013- 19A C’ ‘144A’ FRN 29/10/2025	431,512	0.00
USD	4,786,611	Cent CLO 24 Ltd ‘Series 2015- 24A A1R’ ‘144A’ FRN 15/10/2026	4,760,340	0.05
USD	3,801,000	Centene Corp 3.375% 15/2/2030	3,977,994	0.04
USD	6,678,000	Centene Corp 4.25% 15/12/2027	7,027,360	0.07
USD	3,206,000	Centene Corp 4.625% 15/12/2029	3,523,378	0.04
USD	710,000	Centene Corp ‘144A’ 5.25% 1/4/2025	736,803	0.01
USD	4,333,000	Centene Corp ‘144A’ 5.375% 1/6/2026	4,582,148	0.05
USD	870,000	Centene Corp ‘144A’ 5.375% 15/8/2026	921,926	0.01
USD	10,172,000	Centennial Resource Production LLC ‘144A’ 5.375% 15/1/2026	4,308,452	0.04
USD	1,448,000	Centennial Resource Production LLC ‘144A’ 6.875% 1/4/2027	597,886	0.01
USD	1,575,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2050	1,872,730	0.02
USD	9,849,000	Century Communities Inc 6.75% 1/6/2027	10,640,909	0.11
USD	734,000	CenturyLink Inc ‘144A’ 4% 15/2/2027	749,368	0.01
USD	735,000	CenturyLink Inc ‘144A’ 5.125% 15/12/2026	766,008	0.01
USD	298,000	CenturyLink Inc 5.625% 1/4/2025	322,212	0.00
USD	586,000	CenturyLink Inc 7.5% 1/4/2024	666,399	0.01
USD	5,181,244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 ‘Series 2016- C3 XD’ ‘144A’ FRN 10/1/2048	418,156	0.00
USD	2,382,609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 ‘Series 2016- C4 C’ FRN 10/5/2058	2,353,097	0.02
USD	5,189,832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 ‘Series 2016- C4 XB’ FRN 10/5/2058	198,511	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	470,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN ‘Series 2018-TAN B’ ‘144A’ 4.69% 15/2/2033	476,111	0.01
USD	1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN ‘Series 2018-TAN C’ ‘144A’ 5.295% 15/2/2033	1,051,749	0.01
USD	1,631,106	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ‘Series 2017-BIOC A’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	1,628,840	0.02
USD	2,305,023	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ‘Series 2017-BIOC D’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	2,303,879	0.02
USD	5,674,720	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC ‘Series 2017-BIOC E’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	5,561,690	0.06
USD	423,000	Charles River Laboratories International Inc ‘144A’ 4.25% 1/5/2028	444,336	0.00
USD	123,000	Charles River Laboratories International Inc ‘144A’ 5.5% 1/4/2026	130,122	0.00
USD	179,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital FRN 1/2/2024	183,992	0.00
USD	7,741,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.8% 1/4/2031	8,148,589	0.08
USD	2,614,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.7% 1/4/2051	2,577,026	0.03
USD	11,611,128	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 ‘Series 2007- S6 1A1’ 6% 25/12/2037	7,931,056	0.08
USD	15,188,704	Cheniere Energy Inc ‘144A’ 4.875% 28/5/2021	15,487,030	0.16
USD	2,252,000	Cheniere Energy Partners LP 4.5% 1/10/2029	2,351,606	0.02
USD	7,203,000	Cheniere Energy Partners LP 5.25% 1/10/2025	7,372,270	0.08
USD	2,371,000	Cheniere Energy Partners LP 5.625% 1/10/2026	2,482,224	0.03
USD	250,000	Chesapeake Energy Corp (Defaulted) 5.375% 15/6/2021	11,875	0.00
USD	5,581,000	Chesapeake Energy Corp (Defaulted) 6.125% 15/2/2021	265,098	0.00
USD	546,000	Chesapeake Energy Corp (Defaulted) 6.625% 15/8/2020	19,110	0.00
USD	2,489,252	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A4 ‘Series 2006-0A4 A1’ FRN 25/4/2046	1,074,754	0.01
USD	566,862	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-0A5 ‘Series 2006-0A5 3A1’ FRN 25/4/2046	514,983	0.01
USD	6,270,883	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 ‘Series 2007- 15 2A2’ 6.5% 25/9/2037	3,906,620	0.04
USD	170,000	Churchill Downs Inc ‘144A’ 4.75% 15/1/2028	173,794	0.00
USD	356,000	Churchill Downs Inc ‘144A’ 5.5% 1/4/2027	373,734	0.00
USD	750,000	CIFC Funding 2012-II-R Ltd ‘Series 2012-2RA A2’ ‘144A’ FRN 20/1/2028	727,162	0.01
USD	10,655,000	CIFC Funding 2013-II Ltd ‘Series 2013-2A A1LR’ ‘144A’ FRN 18/10/2030	10,615,924	0.11
USD	250,000	CIFC Funding 2014 Ltd ‘Series 2014-1A A1R2’ ‘144A’ FRN 18/1/2031	247,822	0.00
USD	12,068,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ‘Series 2014-4RA A1A’ ‘144A’ FRN 17/10/2030	11,995,438	0.12
USD	395,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd ‘Series 2014-4RA A2’ ‘144A’ FRN 17/10/2030	389,553	0.00
USD	3,530,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 23/4/2029	3,497,946	0.04
USD	2,730,000	CIFC Funding 2017-I Ltd ‘Series 2017-1A C’ ‘144A’ FRN 23/4/2029	2,693,207	0.03
USD	1,000,000	CIFC Funding 2017-II Ltd ‘Series 2017-2A A’ ‘144A’ FRN 20/4/2030	993,124	0.01
USD	600,000	CIFC Funding 2017-V Ltd ‘Series 2017-5A C’ ‘144A’ FRN 16/11/2030	564,360	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	250,000	Cincinnati Bell Inc ‘144A’ 7% 15/7/2024	259,216	0.00
USD	1,280,000	Cinemark Holdings Inc ‘144A’ 4.5% 15/8/2025	1,659,602	0.02
USD	2,702,000	Citgo Holding Inc ‘144A’ 9.25% 1/8/2024	2,681,735	0.03
USD	1,521,483	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-9 ‘Series 2007-9 1A1’ 6.25% 25/12/2037	1,365,998	0.01
USD	2,018,283	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2008-2 ‘Series 2008-2 1A1’ 6.5% 25/6/2038	1,778,357	0.02
USD	1,622,121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ‘Series 2014-GC19 C’ FRN 10/3/2047	1,702,219	0.02
USD	1,991,302	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 ‘Series 2015-GC27 C’ FRN 10/2/2048	1,958,081	0.02
USD	100,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ‘Series 2016- P3 C’ FRN 15/4/2049	97,306	0.00
USD	294,828	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 ‘Series 2016- P3 D’ ‘144A’ FRN 15/4/2049	182,745	0.00
USD	292,000	Citigroup Inc FRN 30/1/2025 (Perpetual)	290,722	0.00
EUR	2,165,000	Citigroup Inc FRN 8/10/2027	2,562,287	0.03
USD	4,351,000	Citigroup Inc FRN 31/3/2031	5,277,316	0.05
USD	9,545,000	Citigroup Inc FRN 3/6/2031	10,044,177	0.10
USD	4,785,000	Citigroup Inc FRN 26/3/2041	6,669,476	0.07
USD	5,130,317	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 ‘Series 2007-AHL2 A3B’ FRN 25/5/2037	4,034,865	0.04
USD	2,777,454	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 ‘Series 2007-AMC1 A1’ ‘144A’ FRN 25/12/2036	1,915,010	0.02
USD	2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 ‘Series 2007-WFH2 M3’ FRN 25/3/2037	2,487,770	0.03
USD	429,117	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 ‘Series 2007-A6 1A11’ 6% 25/6/2037	423,382	0.00
USD	460,000	City of New York NY 2.85% 1/8/2031	492,458	0.01
USD	3,845,000	City of New York NY 2.9% 1/8/2032	4,114,919	0.04
USD	475,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	549,981	0.01
USD	1,055,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,755,314	0.02
USD	1,675,000	Claremont Mckenna College 3.378% 1/1/2050	1,805,409	0.02
EUR	4,131,000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 4.375% 15/5/2026*	5,093,230	0.05
USD	399,000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co ‘144A’ 6.25% 15/5/2026	423,937	0.00
USD	589,000	Clean Harbors Inc ‘144A’ 4.875% 15/7/2027	617,455	0.01
USD	206,000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc ‘144A’ 5.125% 15/8/2027	207,415	0.00
USD	1,400,000	Clear Creek CLO ‘Series 2015- 1A DR’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	1,313,247	0.01
USD	1,375,000	Clear Creek CLO ‘Series 2015- 1A ER’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	1,210,639	0.01
USD	2,200,000	Coca-Cola Co/The 2.6% 1/6/2050	2,210,354	0.02
EUR	481,000	Colfax Corp 3.25% 15/5/2025	585,151	0.01
USD	343,000	Colfax Corp ‘144A’ 6% 15/2/2024	357,614	0.00
USD	270,000	COLT 2018-3 Mortgage Loan Trust ‘Series 2018-3 M1’ ‘144A’ FRN 26/10/2048	271,599	0.00
USD	3,061,000	Comcast Corp 1.95% 15/1/2031	3,144,891	0.03
USD	3,265,000	Comcast Corp 3.75% 1/4/2040	3,831,210	0.04
USD	2,155,000	Comcast Corp 4% 1/3/2048	2,578,585	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	3,478,000	Comcast Corp 4.95% 15/10/2058	4,960,113	0.05
USD	100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust ‘Series 2013-300P D’ ‘144A’ FRN 10/8/2030	102,194	0.00
USD	640,000	COMM 2013-GAM ‘Series 2013-GAM A2’ ‘144A’ 3.367% 10/2/2028	609,489	0.01
USD	1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust ‘Series 2013-WWP D’ ‘144A’ 3.898% 10/3/2031	1,862,263	0.02
USD	1,431,283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust ‘Series 2014- CR15 C’ FRN 10/2/2047	1,521,349	0.02
USD	342,804	COMM 2014-UBS4 Mortgage Trust ‘Series 2014-UBS4 C’ FRN 10/8/2047	340,365	0.00
USD	4,439,088	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust ‘Series 2015- CR25 XA’ FRN 10/8/2048	153,842	0.00
USD	216,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ‘Series 2015-LC19 D’ ‘144A’ FRN 10/2/2048	191,202	0.00
USD	1,431,283	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ‘Series 2015-LC21 C’ FRN 10/7/2048	1,387,542	0.01
USD	1,316,780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust ‘Series 2015-LC23 A4’ 3.774% 10/10/2048	1,479,150	0.02
USD	1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust ‘Series 2016-667M D’ ‘144A’ FRN 10/10/2036	1,078,028	0.01
USD	111,320,422	COMM 2016-667M Mortgage Trust ‘Series 2016-667M XA’ ‘144A’ FRN 10/10/2036	478,678	0.01
USD	311,100	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust ‘Series 2017-COR2 D’ ‘144A’ 3% 10/9/2050	230,757	0.00
USD	2,910,275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust ‘Series 2018-COR3 XD’ ‘144A’ FRN 10/5/2051	316,836	0.00
USD	3,575,000	Commercial Metals Co 4.875% 15/5/2023	3,731,031	0.04
USD	5,168,000	Commercial Metals Co 5.375% 15/7/2027	5,444,798	0.06
USD	1,559,000	Commercial Metals Co 5.75% 15/4/2026	1,625,982	0.02
USD	10,465,000	Commonwealth Financing Authority 3.807% 1/6/2041	11,946,478	0.12
USD	1,020,000	Commonwealth Financing Authority 3.864% 1/6/2038	1,193,823	0.01
USD	425,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	516,116	0.01
USD	2,580,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	2,810,962	0.03
USD	235,000	Commonwealth of Massachusetts 5.456% 1/12/2039	335,579	0.00
USD	3,822,000	CommScope Inc ‘144A’ 6% 1/3/2026	4,074,711	0.04
USD	1,438,000	CommScope Inc ‘144A’ 7.125% 1/7/2028*	1,535,166	0.02
USD	2,917,000	CommScope Inc ‘144A’ 8.25% 1/3/2027	3,153,992	0.03
USD	433,000	Concho Resources Inc 2.4% 15/2/2031	423,843	0.00
USD	398,000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC ‘144A’ 6.75% 1/10/2026	411,054	0.00
USD	1,980,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,193,880	0.02
USD	1,335,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	1,512,281	0.02
USD	1,304,010	Conseco Finance Corp ‘Series 1997-3 M1’ FRN 15/3/2028	1,302,294	0.01
USD	771,335	Conseco Finance Corp ‘Series 1997-6 M1’ FRN 15/1/2029	787,328	0.01
USD	865,526	Conseco Finance Corp ‘Series 1999-5 A5’ FRN 1/3/2030	533,506	0.01
USD	928,278	Conseco Finance Corp ‘Series 1999-5 A6’ FRN 1/3/2030	551,637	0.01
USD	275,141	Conseco Finance Corp ‘Series 1998-4 M1’ FRN 1/4/2030	250,661	0.00
USD	680,084	Conseco Finance Corp ‘Series 1998-6 M1’ FRN 1/6/2030	663,255	0.01
USD	2,022,035	Conseco Finance Corp ‘Series 1998-8 M1’ FRN 1/9/2030	1,865,404	0.02

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	651,078	Conseco Finance Corp ‘Series 1998-8 A1’ 6.28% 1/9/2030	677,243	0.01
USD	1,320,104	Conseco Finance Securitizations Corp ‘Series 2000-1 A5’ FRN 1/9/2029	485,803	0.01
USD	1,650,638	Conseco Finance Securitizations Corp ‘Series 2000-4 A6’ FRN 1/5/2032	600,802	0.01
USD	1,872,729	Conseco Finance Securitizations Corp ‘Series 2000-5 A6’ 7.96% 1/5/2031	960,521	0.01
USD	3,408,392	Conseco Finance Securitizations Corp ‘Series 2000-5 A7’ 8.2% 1/5/2031	1,798,567	0.02
USD	598,000	Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3.474% 15/12/2029	645,071	0.01
USD	137	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	131	0.00
USD	850,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	1,224,187	0.01
USD	291,000	Cottage Health Obligated Group 3.304% 1/11/2049	319,773	0.00
EUR	400,000	Coty Inc 4% 15/4/2023	412,618	0.00
EUR	400,000	Coty Inc 4.75% 15/4/2026*	404,317	0.00
USD	4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates ‘Series 2006-BC4 M1’ FRN 25/11/2036	3,872,095	0.04
USD	896,518	Countrywide Asset-Backed Certificates (Step-up coupon) ‘Series 2006-S3 A4’ 6.501% 25/1/2029	945,170	0.01
USD	955,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.814% 1/10/2031	972,739	0.01
USD	850,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	868,322	0.01
USD	3,395,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	3,364,581	0.03
USD	435,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 1/10/2029	455,021	0.01
USD	795,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	830,755	0.01
USD	745,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.504% 1/10/2031	778,808	0.01
USD	1,475,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,626,401	0.02
USD	1,725,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	1,970,071	0.02
USD	728,789	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A ‘Series 2013-A B’ ‘144A’ 2.5% 25/1/2030	726,782	0.01
USD	7,040	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp ‘Series 2005-C2 AMFX’ 4.877% 15/4/2037	7,201	0.00
USD	7,509,583	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates ‘Series 2009-12R 3A1’ ‘144A’ 6.5% 27/10/2037	4,173,530	0.04
USD	1,979,168	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC ‘Series 2007-CB6 A4’ ‘144A’ FRN 25/7/2037	1,575,193	0.02
USD	357,082	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC (Stepup coupon) ‘Series 2006-CB2 AF4’ 3.181% 25/12/2036	349,456	0.00
USD	3,693,097	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC (Stepup coupon) ‘Series 2006-SL1 A2’ ‘144A’ 6.056% 25/9/2036	538,494	0.01
USD	705,000	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC (Stepup coupon) ‘Series 2006-MH1 B1’ ‘144A’ 6.25% 25/10/2036	734,708	0.01
USD	515,000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.75% 1/2/2026	538,695	0.01
USD	1,808,000	Crown Castle International Corp 3.1% 15/11/2029	1,986,529	0.02
USD	4,844,000	Crown Castle International Corp 4.15% 1/7/2050	5,682,196	0.06
USD	1,031,000	Crown Castle International Corp 4.3% 15/2/2029	1,211,809	0.01
USD	4,124,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ‘144A’ 5.625% 15/10/2025	4,103,380	0.04

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,164,110	Csail 2015-C2 Commercial Mortgage Trust ‘Series 2015- C2 B’ FRN 15/6/2057	1,201,228	0.01
USD	19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust FRN 15/11/2050	288,467	0.00
USD	887,395	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust ‘Series 2018-C14 C’ FRN 15/11/2051	957,300	0.01
USD	742,000	CSC Holdings LLC ‘144A’ 5.375% 1/2/2028	797,951	0.01
USD	3,312,000	CSC Holdings LLC ‘144A’ 5.5% 15/5/2026	3,477,600	0.04
USD	553,000	CSC Holdings LLC ‘144A’ 5.5% 15/4/2027	586,733	0.01
USD	2,542,000	CSC Holdings LLC ‘144A’ 5.75% 15/1/2030	2,773,163	0.03
USD	675,000	CSC Holdings LLC ‘144A’ 6.5% 1/2/2029	761,275	0.01
USD	116,659,107	CSMC 2014-USA OA LLC ‘Series 2014-USA X2’ ‘144A’ FRN 15/9/2037	452,637	0.00
USD	770,000	CSMC 2017-TIME ‘Series 2017-TIME A’ ‘144A’ 3.646% 13/11/2039	786,428	0.01
USD	8,112,092	CSMC 2018-RPL8 Trust ‘Series 2018-RPL8 A1’ ‘144A’ FRN 25/7/2058	8,161,110	0.08
USD	1,505,845	CSMC Series 2009-5R ‘Series 2009-5R 4A4’ ‘144A’ FRN 25/6/2036	1,151,672	0.01
USD	1,786,255	CSMC Series 2014-11R ‘Series 2014-11R 16A1’ ‘144A’ FRN 27/9/2047	1,825,169	0.02
USD	761,617	CSMC Series 2014-4R ‘Series 2014-4R 16A3’ ‘144A’ FRN 27/2/2036	722,158	0.01
USD	1,650,000	CSMC Series 2015-4R ‘Series 2015-4R 1A4’ ‘144A’ FRN 27/10/2036	1,210,038	0.01
USD	456,158	CSMC Series 2015-4R ‘Series 2015-4R 1A2’ ‘144A’ FRN 27/11/2036	451,587	0.00
USD	790,000	CSMC Trust 2017-PFHP ‘Series2017-PFHP A’ ‘144A’ FRN 15/12/2030	764,567	0.01
USD	530,000	Cumberland Park CLO Ltd ‘Series 2015-2A CR’ ‘144A’ FRN20/7/2028	509,576	0.01
USD	500,000	Cumberland Park CLO Ltd ‘Series 2015-2A DR’ ‘144A’FRN 20/7/2028	477,273	0.01
USD	401,300	Cutwater 2014-I Ltd ‘Series 2014-1A A1AR’ ‘144A’ FRN 15/7/2026	400,678	0.00
USD	34,294	CVP Cascade CLO-1 Ltd ‘Series 2013-CLO1 A1R’ ‘144A’ FRN 16/1/2026	34,281	0.00
USD	694,000	CVS Health Corp 2.7% 21/8/2040	671,814	0.01
USD	5,783,148	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 ‘Series 2005-16 1AF’ FRN 25/4/2036	5,721,685	0.06
USD	3,041,228	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 (Step-up coupon) ‘Series 2005-17 1AF4’ 6.047% 25/5/2036	3,097,783	0.03
USD	170,552	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 ‘Series 2006-11 3AV2’ FRN 25/9/2046	166,645	0.00
USD	5,828,994	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 ‘Series 2006-18 M1’ FRN 25/3/2037	4,307,262	0.04
USD	623,851	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U ‘Series 2004-U 2A’ FRN 15/3/2034	590,993	0.01
USD	389,781	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 ‘Series 2006-S5 A5’ 6.155% 25/6/2035	431,954	0.00
USD	4,194,874	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES ‘Series 2006-RES 5B1A’ ‘144A’ FRN 15/5/2035	4,030,365	0.04
USD	146,507	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES ‘Series 2006-RES 5B1B’ ‘144A’ FRN 15/5/2035	139,290	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	487,011	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B ‘Series 2005-B 2A’ FRN 15/5/2035	474,897	0.01
USD	2,174,536	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C ‘Series 2006-C 2A’ FRN 15/5/2036	2,099,197	0.02
USD	1,224,033	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H ‘Series 2006-H 1A’ FRN 15/11/2036	1,022,391	0.01
USD	2,100,000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 3.45% 15/11/2029	2,296,297	0.02
USD	1,880,000	Dallas Area Rapid Transit 5% 1/12/2046	2,245,068	0.02
USD	1,460,000	Dallas/Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	1,528,569	0.02
USD	284,000	Darling Ingredients Inc ‘144A’ 5.25% 15/4/2027	302,220	0.00
USD	3,323,000	DaVita Inc ‘144A’ 4.625% 1/6/2030	3,508,839	0.04
USD	4,389,268	DBJPM 17-C6 Mortgage Trust ‘Series 2017-C6 XD’ FRN 10/6/2050	237,416	0.00
USD	900,000	DBUBS 2011-LC1 Mortgage Trust ‘Series 2011-LC1A E’ ‘144A’ FRN 10/11/2046	900,553	0.01
USD	1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ‘Series 2017-BRBK D’ ‘144A’ FRN 10/10/2034	1,117,399	0.01
USD	7,978,260	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ‘Series 2017-BRBK E’ ‘144A’ FRN 10/10/2034	8,092,750	0.08
USD	1,792,265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ‘Series 2017-BRBK F’ ‘144A’ FRN 10/10/2034	1,783,482	0.02
USD	195,000	DCP Midstream Operating LP 5.125% 15/5/2029	205,567	0.00
USD	267,000	DCP Midstream Operating LP 5.375% 15/7/2025	287,025	0.00
USD	4,500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A A’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	4,452,158	0.05
USD	500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A E’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	440,251	0.00
USD	1,400,000	Del Amo Fashion Center Trust 2017-AMO ‘Series 2017-AMO D’ ‘144A’ FRN 5/6/2035	1,031,821	0.01
USD	10,249,000	Dell International LLC / EMC Corp ‘144A’ 5.85% 15/7/2025	12,030,746	0.12
USD	192,519	Delta Air Lines 2015-1 Class B Pass Through Trust 4.25% 30/7/2023	170,237	0.00
USD	38,342	Deutsche ALT-A Securities Inc ALT ‘Series 2007-RS1 A2’ ‘144A’ FRN 27/1/2037	36,641	0.00
USD	6,813,883	Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE ‘Series 2007- OA4 A2A’ FRN 25/8/2047	4,660,423	0.05
USD	368,199	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 ‘Series 2006-AB3 A3’ FRN 25/7/2036	359,205	0.00
USD	235,027	Deutsche Alt-B Securities Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 ‘Series 2006-AB3 A8’ FRN 25/7/2036	229,308	0.00
USD	3,314,000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co ‘144A’ 5.375% 15/8/2026	2,585,202	0.03
USD	865,000	Discovery Communications LLC 3.95% 20/3/2028	978,021	0.01
USD	1,750,000	DISH DBS Corp 6.75% 1/6/2021	1,805,125	0.02
USD	900,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	1,048,572	0.01
USD	900,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	1,045,769	0.01
USD	343,833	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC ‘Series 2018-1 B’ ‘144A’ 4.29% 20/7/2038	344,535	0.00
USD	1,507,000	Dorchester Park CLO DAC ‘Series 2015-1A BR’ ‘144A’ FRN 20/4/2028	1,479,063	0.02
USD	640,000	Dorchester Park CLO DAC ‘Series 2015-1A CR’ ‘144A’ FRN 20/4/2028	614,379	0.01
EUR	1,580,000	Dow Chemical Co/The 0.5% 15/3/2027	1,809,711	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	10,667,000	Dryden 53 CLO Ltd ‘Series 2017-53A A’ ‘144A’ FRN 15/1/2031	10,607,988	0.11
USD	250,000	Dryden XXV Senior Loan Fund ‘Series 2012-25A CRR’ ‘144A’ FRN 15/10/2027	238,806	0.00
USD	530,000	Dryden XXVI Senior Loan Fund ‘Series 2013-26A AR’ ‘144A’ FRN 15/4/2029	527,345	0.01
USD	6,206,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund ‘Series 2013-28A A1LR’ ‘144A’ FRN 15/8/2030	6,175,393	0.06
USD	1,695,000	Dun & Bradstreet Corp/The ‘144A’ 6.875% 15/8/2026	1,850,330	0.02
USD	3,139,000	Dun & Bradstreet Corp/The ‘144A’ 10.25% 15/2/2027	3,570,032	0.04
USD	2,554,000	DuPont de Nemours Inc 2.169% 1/5/2023	2,605,070	0.03
USD	1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd ‘Series 2018-1A C’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	977,739	0.01
USD	3,509,000	Elanco Animal Health Inc 4.912% 27/8/2021	3,620,849	0.04
USD	5,752,000	Elanco Animal Health Inc 5.272% 28/8/2023	6,373,935	0.07
USD	1,733,000	Elanco Animal Health Inc 5.9% 28/8/2028	2,046,023	0.02
USD	1,577,000	Elevation CLO 2018-10 Ltd ‘Series 2018-10A B’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	1,568,583	0.02
USD	960,000	Eleven Madison Trust 2015- 11MD Mortgage Trust ‘Series 2015-11MD A’ ‘144A’ FRN 10/9/2035	1,051,572	0.01
USD	560,000	Emerson Park CLO Ltd ‘Series 2013-1A DR’ ‘144A’ FRN 15/7/2025	557,539	0.01
USD	2,023,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ‘144A’ 5.5% 30/1/2026	2,022,140	0.02
USD	1,795,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc ‘144A’ 5.75% 30/1/2028	1,832,812	0.02
USD	908,000	Enterprise Products Operating LLC 2.8% 31/1/2030	969,486	0.01
USD	2,285,000	ESH Hospitality Inc ‘144A’ 5.25% 1/5/2025	2,319,789	0.02
USD	245,268	Exantas Capital Corp 2018- RS06 Ltd ‘Series 2018-RS06 A’ ‘144A’ FRN 15/6/2035	245,497	0.00
EUR	3,770,000	Exxon Mobil Corp 1.408% 26/6/2039	4,454,460	0.05
USD	7,694,000	Exxon Mobil Corp 3.452% 15/4/2051	8,555,885	0.09
USD	84,561	Fannie Mae Interest Strip FRN 25/10/2037	12,940	0.00
USD	83,464	Fannie Mae Interest Strip 5% 25/2/2036	12,404	0.00
USD	258,052	Fannie Mae Interest Strip 5% 25/4/2036	40,575	0.00
USD	305,570	Fannie Mae Interest Strip 5% 25/7/2036	47,196	0.00
USD	142,666	Fannie Mae Interest Strip 5% 25/8/2037	18,471	0.00
USD	614,620	Fannie Mae Interest Strip 5% 25/1/2038	103,137	0.00
USD	1,562,942	Fannie Mae Interest Strip 5.5% 25/1/2039	285,006	0.00
USD	35,238,937	Fannie Mae Pool ‘BK8922’ 4.5% 1/8/2048	38,081,179	0.39
USD	944,624	Fannie Mae Pool ‘BN4334’ 4.5% 1/2/2049	1,020,462	0.01
USD	37,439,686	Fannie Mae Pool ‘BN5278’ 4.5% 1/2/2049	40,463,544	0.42
USD	212,797	Fannie Mae Pool ‘BP0588’ 4.5% 1/12/2049	229,991	0.00
USD	219,554	Fannie Mae Pool ‘CA1564’ 4.5% 1/4/2048	237,597	0.00
USD	30,849,797	Fannie Mae Pool ‘CA1907’ 4.5% 1/6/2048	33,364,521	0.34
USD	16,476,797	Fannie Mae Pool ‘CA2057’ 4.5% 1/7/2048	17,798,999	0.18
USD	7,851,742	Fannie Mae Pool ‘CA2209’ 4.5% 1/8/2048	8,488,021	0.09
USD	10,221,901	Fannie Mae Pool ‘CA2489’ 4.5% 1/10/2048	11,048,320	0.11
USD	4,000,000	Fannie Mae Pool ‘CA2641’ 4.5% 1/11/2048	4,323,186	0.04
USD	2,534,640	Fannie Mae Pool ‘CA2855’ 4.5% 1/12/2048	2,739,431	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	824,895	Fannie Mae Pool ‘CA2963’ 4.5% 1/1/2049	891,594	0.01
USD	32,724,107	Fannie Mae Pool ‘FM1389’ 4.5% 1/6/2049	35,326,338	0.36
USD	301,241	Fannie Mae Pool ‘FM1582’ 4.5% 1/8/2049	325,556	0.00
USD	6,457,999	Fannie Mae Pool ‘FM1977’ 4.5% 1/1/2049	6,989,742	0.07
USD	62,375,164	Fannie Mae Pool ‘FM2214’ 4.5% 1/4/2049	67,364,903	0.69
USD	194,098,497	Fannie Mae Pool ‘FM3619’ 4.5% 1/1/2050	209,421,312	2.15
USD	495,422	Fannie Mae Pool ‘FM3834’ 4.5% 1/2/2050	535,376	0.01
USD	379,287	Fannie Mae Pool ‘MA3416’ 4.5% 1/7/2048	409,943	0.00
USD	467,842	Fannie Mae Pool ‘MA3564’ 4.5% 1/1/2049	505,078	0.01
USD	32,525	Fannie Mae Pool ‘MA3593’ 4.5% 1/2/2049	35,122	0.00
USD	455,184	Fannie Mae Pool ‘MA3616’ 4.5% 1/3/2049	491,628	0.01
USD	965,806	Fannie Mae Pool ‘MA3694’ 4.5% 1/7/2049	1,043,325	0.01
USD	28,385,139	Fannie Mae Pool ‘MA3747’ 4.5% 1/8/2049	30,663,876	0.31
USD	12,998,704	Fannie Mae Pool ‘MA3879’ 4.5% 1/12/2049	14,042,244	0.14
USD	2,209,131	Fannie Mae REMICS ‘Series 2015-34 GI’ 6% 25/6/2045	481,472	0.01
USD	2,810,000	FedEx Corp 4.25% 15/5/2030	3,365,213	0.03
EUR	1,560,000	Fidelity National Information Services Inc 0.625% 3/12/2025	1,896,298	0.02
EUR	345,000	Fidelity National Information Services Inc 2.95% 21/5/2039	494,488	0.01
GBP	960,000	Fidelity National Information Services Inc 3.36% 21/5/2031	1,482,981	0.02
USD	799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 ‘Series 2004-FFH3 M3’ FRN 25/10/2034	735,956	0.01
USD	1,637,117	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 ‘Series 2006-FF13 A1’ FRN 25/10/2036	1,261,737	0.01
USD	3,815,000	FirstEnergy Transmission LLC ‘144A’ 4.35% 15/1/2025	4,248,349	0.04
USD	3,195,000	Fiserv Inc 2.65% 1/6/2030	3,421,667	0.04
GBP	820,000	Fiserv Inc 3% 1/7/2031	1,230,582	0.01
USD	3,978,000	Fiserv Inc 3.5% 1/7/2029	4,519,560	0.05
USD	870,000	Fiserv Inc 4.4% 1/7/2049	1,087,139	0.01
USD	7,341,000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp ‘144A’ 7.875% 15/11/2025	7,433,533	0.08
USD	710,262	Flatiron CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A AR’ ‘144A’ FRN 15/4/2027	705,569	0.01
USD	3,025,000	Flatiron CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A CR’ ‘144A’ FRN 15/4/2027	2,959,710	0.03
USD	135,000	Ford Foundation/The 2.415% 1/6/2050	137,981	0.00
USD	1,750,000	Ford Motor Co 8.5% 21/4/2023	1,935,334	0.02
EUR	2,797,000	Ford Motor Credit Co LLC 2.33% 25/11/2025	3,236,038	0.03
USD	200,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16/6/2025	210,302	0.00
USD	4,572,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18/3/2024	4,880,610	0.05
USD	3,663,000	Forestar Group Inc ‘144A’ 5% 1/3/2028	3,726,535	0.04
USD	8,077,000	Forestar Group Inc ‘144A’ 8% 15/4/2024	8,601,157	0.09
USD	786,251	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/1/2025	876,912	0.01
USD	601,139	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/11/2026	691,099	0.01
USD	877,854	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.241% 25/9/2024	967,064	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	178,668	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.413% 25/12/2026	205,773	0.00
USD	601,139	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.444% 25/12/2027	701,799	0.01
USD	69,478	Freddie Mac Pool ‘SD8019’ 4.5% 1/10/2049	75,052	0.00
USD	5,000,004	Freddie Mac Pool ‘SD8059’ 4.5% 1/4/2050	5,411,580	0.06
USD	6,499,969	Freddie Mac Pool ‘ZA5568’ 4.5% 1/7/2048	7,047,114	0.07
USD	39,655,642	Freddie Mac Pool ‘ZA5638’ 4.5% 1/8/2048	42,849,452	0.44
USD	89,293	Freddie Mac Pool ‘ZA6266’ 4.5% 1/1/2049	96,510	0.00
USD	38,763	Freddie Mac Pool ‘ZA6368’ 4.5% 1/2/2049	41,873	0.00
USD	9,765,899	Freddie Mac Pool ‘ZN3245’ 4.5% 1/2/2049	10,555,251	0.11
USD	101,484	Freddie Mac Pool ‘ZN4957’ 4.5% 1/4/2049	109,672	0.00
USD	910,807	Freddie Mac Pool ‘ZS4773’ 4.5% 1/6/2048	984,460	0.01
USD	12,998,703	Freddie Mac Pool ‘ZS4786’ 4.5% 1/8/2048	14,066,224	0.14
USD	17,998,704	Freddie Mac Pool ‘ZS4791’ 4.5% 1/9/2048	19,465,833	0.20
USD	13,098,691	Freddie Mac Pool ‘ZT2088’ 4.5% 1/6/2049	14,149,797	0.15
USD	3,417,428	Freddie Mac REMICS ‘Series 4999 QI’ 4% 25/5/2050	540,114	0.01
USD	2,400,000	Freddie Mac REMICS ‘Series 5014 DI’ 4% 25/9/2050	311,250	0.00
USD	3,444,131	Freddie Mac REMICS ‘Series 4995 BI’ 4.5% 25/6/2050	450,063	0.00
USD	384,713	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2015-DN1 B’ FRN 25/1/2025	432,546	0.00
USD	409,928	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2015-HQ2 B’ FRN 25/5/2025	414,772	0.00
USD	1,165,455	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2017-DNA2 B1’ FRN 25/10/2029	1,198,421	0.01
USD	1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2017-DNA3 B1’ FRN 25/3/2030	1,556,285	0.02
USD	464,907	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2017-HRP1 M2’ FRN 25/12/2042	451,195	0.00
USD	954,000	Freeport-McMoRan Inc 5% 1/9/2027	1,012,652	0.01
USD	204,000	Freeport-McMoRan Inc 5.25% 1/9/2029	224,235	0.00
USD	782,435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust ‘Series 2017-KGX1 BFX’ ‘144A’ FRN 25/10/2027	822,562	0.01
USD	1,262,121	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust FRN 25/5/2025	1,401,086	0.01
USD	4,061,286	Fremont Home Loan Trust 2006-3 ‘Series 2006-3 1A1’ FRN 25/2/2037	3,184,697	0.03
USD	1,934,123	FRESB 2018-SB52 Mortgage Trust ‘Series 2018-SB52 A10F’ FRN 25/6/2028	2,073,349	0.02
USD	1,196,152	FRESB 2018-SB53 Mortgage Trust ‘Series 2018-SB53 A10F’ FRN 25/6/2028	1,350,342	0.01
USD	1,900,000	Frontier Communications Corp (Defaulted) ‘144A’ 8.5% 1/4/2026	1,930,400	0.02
USD	250,000	Galaxy XXIII CLO Ltd ‘Series 2017-23A A’ ‘144A’ FRN 24/4/2029	247,675	0.00
USD	250,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ‘Series 2018-29A B’ ‘144A’ FRN 15/11/2026	244,665	0.00
USD	850,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ‘Series 2018-29A C’ ‘144A’ FRN 15/11/2026	806,848	0.01
USD	2,130,000	Galaxy XXIX CLO Ltd ‘Series 2018-29A D’ ‘144A’ FRN 15/11/2026	2,003,743	0.02
USD	3,838,642	GAM Resecuritization Trust 2018-B FRN 27/8/2051	3,609,228	0.04
USD	10,460,000	GE Capital Funding LLC ‘144A’ 3.45% 15/5/2025	11,091,913	0.11

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,933,000	GE Capital Funding LLC ‘144A’ 4.4% 15/5/2030	3,083,240	0.03
USD	1,215,000	General Electric Co 4.35% 1/5/2050	1,228,184	0.01
USD	2,450,000	General Mills Inc 2.875% 15/4/2030	2,700,767	0.03
USD	6,869,000	General Motors Co 6.125% 1/10/2025	8,056,675	0.08
USD	5,000,000	General Motors Financial Co Inc 2.7% 20/8/2027	4,992,929	0.05
USD	4,039,000	General Motors Financial Co Inc 2.75% 20/6/2025	4,162,641	0.04
USD	210,000	General Motors Financial Co Inc 2.9% 26/2/2025	218,154	0.00
USD	750,000	General Motors Financial Co Inc 3.45% 10/4/2022	772,141	0.01
USD	3,364,000	General Motors Financial Co Inc 5.2% 20/3/2023	3,665,298	0.04
USD	2,165,000	George Washington University/ The 4.126% 15/9/2048	2,802,715	0.03
USD	3,692,000	Georgia-Pacific LLC ‘144A’ 2.3% 30/4/2030	3,912,125	0.04
USD	227,946	GE-WMC Asset-Backed Pass- Through Certificates Series 2005-2 ‘Series 2005-2 A2C’ FRN 25/12/2035	224,861	0.00
USD	2,090,000	Gilbert Park CLO Ltd ‘Series 2017-1A C’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	2,017,297	0.02
USD	4,077,000	Gilbert Park CLO Ltd ‘Series 2017-1A D’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	3,892,960	0.04
USD	2,124,000	Gilead Sciences Inc 4.15% 1/3/2047	2,709,332	0.03
USD	800,000	Glencore Funding LLC 27/3/2025 (Zero Coupon)	704,608	0.01
USD	2,970,000	Glencore Funding LLC ‘144A’ 1.625% 1/9/2025	2,965,138	0.03
USD	5,674,000	Global Payments Inc 2.9% 15/5/2030	6,090,884	0.06
USD	2,890,000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4% 15/1/2031	3,003,895	0.03
USD	904,000	Golden Entertainment Inc ‘144A’ 7.625% 15/4/2026	860,278	0.01
USD	1,985,000	Golden Nugget Inc ‘144A’ 6.75% 15/10/2024	1,679,806	0.02
USD	1,000,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd ‘Series 2019- 5A A’ ‘144A’ FRN 20/10/2032	993,968	0.01
USD	2,500,000	Goldentree Loan Management US Clo 7 Ltd ‘Series 2020-7A D’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	2,487,076	0.03
USD	720,000	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd ‘Series 2014-9A AR2’ ‘144A’ FRN 29/10/2029	715,472	0.01
USD	1,166,000	Goldentree Loan Opportunities X Ltd ‘Series 2015-10A AR’ ‘144A’ FRN 20/7/2031	1,156,636	0.01
USD	1,255,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd ‘Series 2015-11A AR2’ ‘144A’ FRN 18/1/2031	1,244,377	0.01
USD	2,330,000	GoldentTree Loan Management US CLO 1 Ltd ‘Series 2017-1A CR’ ‘144A’ FRN 20/4/2029	2,239,806	0.02
USD	3,000,000	GoldentTree Loan Management US CLO 1 Ltd ‘Series 2017-1A DR’ ‘144A’ FRN 20/4/2029	2,786,297	0.03
USD	716,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	839,276	0.01
EUR	3,265,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27/3/2025	4,403,610	0.05
USD	359,000	Goodyear Tire & Rubber Co/ The 5% 31/5/2026	360,795	0.00
USD	250,000	Goodyear Tire & Rubber Co/ The 9.5% 31/5/2025	281,094	0.00
USD	4,349,661	Government National Mortgage Association ‘Series 2015-48 IO’ FRN 16/2/2050	161,343	0.00
USD	12,649,889	Government National Mortgage Association ‘Series 2013-63 IO’ FRN 16/9/2051	332,955	0.00
USD	1,788,737	Government National Mortgage Association ‘Series 2012-23 IO’ FRN 16/6/2053	18,400	0.00
USD	9,613,683	Government National Mortgage Association ‘Series 2013-30 IO’ FRN 16/9/2053	307,294	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,066,313	Government National Mortgage Association ‘Series 2013-191 IO’ FRN 16/11/2053	54,702	0.00
USD	10,542,975	Government National Mortgage Association ‘Series 2013-78 IO’ FRN 16/10/2054	359,728	0.00
USD	11,648,748	Government National Mortgage Association ‘Series 2015-22 IO’ FRN 16/3/2055	399,004	0.00
USD	4,676,784	Government National Mortgage Association ‘Series 2015-173 IO’ FRN 16/9/2055	236,997	0.00
USD	10,005,207	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-128 IO’ FRN 16/9/2056	625,158	0.01
USD	1,749,662	Government National Mortgage Association ‘Series 2015-37 IO’ FRN 16/10/2056	79,478	0.00
USD	2,393,797	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-67 IO’ FRN 16/7/2057	137,252	0.00
USD	2,431,240	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-36 IO’ FRN 16/8/2057	131,795	0.00
USD	5,519,341	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-125 IO’ FRN 16/12/2057	331,971	0.00
USD	5,858,500	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-165 IO’ FRN 16/12/2057	370,786	0.00
USD	13,094,730	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-96 IO’ FRN 16/12/2057	728,358	0.01
USD	5,806,603	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-113 IO’ FRN 16/2/2058	437,222	0.00
USD	13,359,810	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-26 IO’ FRN 16/2/2058	672,992	0.01
USD	4,204,473	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-110 IO’ FRN 16/5/2058	258,189	0.00
USD	5,767,899	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-152 IO’ FRN 15/8/2058	346,427	0.00
USD	18,538,231	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-162 IO’ FRN 16/9/2058	1,202,398	0.01
USD	543,954	Government National Mortgage Association ‘Series 2016-158 VA’ 2% 16/3/2035	556,508	0.01
USD	860,463	Government National Mortgage Association ‘Series 2015-97 VA’ 2.25% 16/12/2038	897,879	0.01
USD	551,788	GPMT 2018-FL1 Ltd ‘Series 2018-FL1 A’ ‘144A’ FRN 21/11/2035	542,173	0.01
USD	8,902,580	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ‘Series 2014-GRCE E’ ‘144A’ FRN 10/6/2028	8,866,066	0.09
USD	8,438,845	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ‘Series 2014-GRCE F’ ‘144A’ FRN 10/6/2028	8,349,281	0.09
USD	267,000	Gran Tierra Energy Inc ‘144A’ 7.75% 23/5/2027	118,782	0.00
USD	695,000	Grant County Public Utility District No 2 Priest Rapids Hydroelectric Project 4.584% 1/1/2040	931,394	0.01
USD	663,000	Gray Television Inc ‘144A’ 5.875% 15/7/2026	691,675	0.01
USD	1,075,000	Great Lakes Water Authority Sewage Disposal System Revenue 3.056% 1/7/2039	1,179,060	0.01
USD	475,000	Great Lakes Water Authority Water Supply System Revenue 5.25% 1/7/2033	582,414	0.01
USD	4,515,000	Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp ‘144A’ 9% 30/9/2021	2,596,125	0.03
USD	1,020,000	Greenpoint Manufactured Housing ‘Series 1999-5 M1B’ FRN 15/12/2029	1,071,324	0.01
USD	1,487,239	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 ‘Series 2006-AR2 4A1’ FRN 25/3/2036	1,421,572	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	370,000	Grippen Park CLO Ltd ‘Series 2017-1A A’ ‘144A’ FRN 20/1/2030	370,380	0.00
USD	750,000	GS Mortgage Securities Corp II ‘Series 2012-TMSQ D’ ‘144A’ FRN 10/12/2030	659,917	0.01
USD	440,000	GS Mortgage Securities Corp II ‘Series 2017-375H A’ ‘144A’ FRN 10/9/2037	487,374	0.01
USD	25,000,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ‘Series 2005-ROCK X1’ ‘144A’ FRN 3/5/2032	305,886	0.00
USD	2,452,265	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005-ROCK ‘Series 2005-ROCK A’ ‘144A’ 5.366% 3/5/2032	2,797,193	0.03
USD	1,055,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2016-RENT ‘Series 2016-RENT C’ ‘144A’ FRN 10/2/2029	1,049,731	0.01
USD	1,450,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ‘Series 2017-500K D’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	1,440,062	0.02
USD	2,000,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ‘Series 2017-500K E’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	1,969,074	0.02
USD	1,119,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ‘Series 2017-500K F’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	1,099,123	0.01
USD	675,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ‘Series 2017-500K G’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	611,604	0.01
USD	2,170,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-GPTX ‘Series 2017-GPTX A’ ‘144A’ 2.856% 10/5/2034	2,142,148	0.02
USD	618,000	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ9 ‘Series 2012-GCJ9 C’ ‘144A’ FRN 10/11/2045	628,652	0.01
USD	110,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ‘Series 2014-GC20 B’ FRN 10/4/2047	115,048	0.00
USD	1,097,180	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20 ‘Series 2014-GC20 XA’ FRN 10/4/2047	27,129	0.00
USD	1,200,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-590M ‘Series 2015-590M E’ ‘144A’ FRN 10/10/2035	1,155,510	0.01
USD	1,077,279	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ‘Series 2017-GS7 D’ ‘144A’ 3% 10/8/2050	843,187	0.01
USD	744,267	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 ‘Series 2017-GS7 E’ ‘144A’ 3% 10/8/2050	534,027	0.01
USD	11,968,620	GSAA Home Equity Trust 2006- 5 ‘Series 2006-5 1A1’ FRN 25/3/2036	5,358,090	0.06
USD	463,828	GSAA Home Equity Trust 2007- 2 ‘Series 2007-2 AF3’ FRN 25/3/2037	135,911	0.00
USD	1,145,613	GSAMP Trust 2007-H1 ‘Series 2007-H1 A1B’ FRN 25/1/2047	760,094	0.01
USD	2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 ‘Series 2007-HS1 M6’ FRN 25/2/2047	1,993,656	0.02
USD	1,095,462	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 ‘Series 2005-RP1 1AF’ ‘144A’ FRN 25/1/2035	954,434	0.01
USD	1,309,023	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP2 ‘Series 2005-RP2 1AF’ ‘144A’ FRN 25/3/2035	1,182,390	0.01
USD	1,025,904	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1 ‘Series 2006-RP1 1AF1’ ‘144A’ FRN 25/1/2036	832,805	0.01
USD	2,066,762	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F ‘Series 2006-7F 4A2’ 6.5% 25/8/2036	1,183,654	0.01
USD	1,643,328	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F ‘Series 2007-1F 2A4’ 5.5% 25/1/2037	1,854,225	0.02
USD	4,981,092	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 ‘Series 2007-OA2 2A1’ FRN 25/6/2047	3,630,213	0.04
USD	852,000	H&E Equipment Services Inc 5.625% 1/9/2025	886,617	0.01
USD	250,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2013-2 Ltd ‘Series 2013-2A C’ ‘144A’ FRN 1/8/2025	250,696	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	680,000	Halcyon Loan Advisors Funding 2014-3 Ltd ‘Series 2014-3A B1R’ ‘144A’ FRN 22/10/2025	676,795	0.01
USD	1,124,038	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd ‘Series 2015-2A AR’ ‘144A’ FRN 25/7/2027	1,113,945	0.01
USD	977,000	Hanesbrands Inc ‘144A’ 4.625% 15/5/2024	1,033,075	0.01
USD	292,000	Hanesbrands Inc ‘144A’ 4.875% 15/5/2026*	318,903	0.00
USD	500,000	Hanesbrands Inc ‘144A’ 5.375% 15/5/2025	534,625	0.01
USD	17,678,567	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 ‘Series 2006- 12 1A1A’ FRN 19/12/2036	15,418,128	0.16
USD	634,119	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 ‘Series 2007-4 2A2’ FRN 19/7/2047	545,443	0.01
USD	1,580,000	HCA Inc 5.25% 15/4/2025	1,842,390	0.02
USD	2,751,000	HCA Inc 5.25% 15/6/2026	3,248,975	0.03
USD	1,702,000	HCA Inc 5.375% 1/2/2025	1,921,532	0.02
USD	1,020,000	HCA Inc 5.375% 1/9/2026	1,160,199	0.01
USD	487,000	HCA Inc 5.625% 1/9/2028	579,786	0.01
USD	983,000	HCA Inc 5.875% 15/2/2026	1,126,764	0.01
USD	923,000	HCA Inc 5.875% 1/2/2029	1,127,214	0.01
USD	431,000	HD Supply Inc ‘144A’ 5.375% 15/10/2026	454,880	0.00
USD	320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd ‘Series 12A-18 A1B’ ‘144A’ FRN 18/7/2031	314,143	0.00
USD	650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 Ltd ‘Series 12A-18 D’ ‘144A’ FRN 18/7/2031	528,897	0.01
USD	2,810,790	Highbridge Loan Management 6-2015 Ltd ‘Series 6A-2015 A1R’ ‘144A’ FRN 5/2/2031	2,772,856	0.03
USD	80,000	Highbridge Loan Management 7-2015 Ltd ‘Series 7A-2015 CR’ ‘144A’ FRN 15/3/2027	77,403	0.00
USD	329,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.25% 1/9/2024	331,022	0.00
USD	913,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15/1/2030	942,380	0.01
USD	360,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 5.125% 1/5/2026	373,075	0.00
USD	3,576,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.625% 1/4/2025	3,638,205	0.04
USD	850,000	Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 1/4/2027	877,468	0.01
USD	314,000	Hologic Inc ‘144A’ 4.375% 15/10/2025	320,178	0.00
USD	1,980,000	Home Equity Asset Trust 2007- 1 ‘Series 2007-1 2A3’ FRN 25/5/2037	1,682,123	0.02
USD	8,731,637	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E ‘Series 2006- E 2A3’ FRN 25/4/2037	6,737,413	0.07
USD	1,790,350	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ‘Series 2007-A 2A2’ FRN 25/4/2037	1,298,476	0.01
USD	8,756,015	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A ‘Series 2007-A 2A3’ FRN 25/4/2037	6,398,566	0.07
USD	481,919	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A ‘Series 2004-A M2’ FRN 25/7/2034	476,105	0.01
USD	1,017,761	Home Loan Mortgage Loan Trust 2005-1 ‘Series 2005-1 A3’ FRN 15/4/2036	956,738	0.01
EUR	650,000	Honeywell International Inc 0.75% 10/3/2032	772,515	0.01
USD	204,000	Horizon Therapeutics USA Inc ‘144A’ 5.5% 1/8/2027	221,685	0.00
USD	563,000	Howard Hughes Corp/The ‘144A’ 5.375% 15/3/2025	573,109	0.01
USD	845,000	Howard Hughes Corp/The ‘144A’ 5.375% 1/8/2028	857,147	0.01
USD	413,000	Howmet Aerospace Inc 5.125% 1/10/2024	443,543	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	5,115,000	Howmet Aerospace Inc 5.9% 1/2/2027	5,791,352	0.06
USD	1,630,000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust ‘Series 2016- 10HY A’ ‘144A’ 2.835% 10/8/2038	1,755,344	0.02
USD	1,090,000	Hyatt Hotels Corp 5.375% 23/4/2025	1,192,519	0.01
USD	6,638,000	Hyundai Capital America ‘144A’ 3.4% 20/6/2024	7,058,061	0.07
USD	925,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	1,109,241	0.01
USD	162,000	iHeartCommunications Inc ‘144A’ 4.75% 15/1/2028	155,382	0.00
USD	816,000	iHeartCommunications Inc ‘144A’ 5.25% 15/8/2027	816,661	0.01
USD	882,617	iHeartCommunications Inc 6.375% 1/5/2026	928,725	0.01
USD	1,210,000	IMT Trust 2017-APTS ‘Series 2017-APTS AFX’ ‘144A’ FRN 15/6/2034	1,290,271	0.01
USD	2,669,820	IMT Trust 2017-APTS ‘Series 2017-APTS BFX’ ‘144A’ FRN 15/6/2034	2,752,156	0.03
USD	5,620,171	IMT Trust 2017-APTS ‘Series 2017-APTS DFX’ ‘144A’ FRN 15/6/2034	5,413,286	0.06
USD	2,000,000	IMT Trust 2017-APTS ‘Series 2017-APTS EFX’ ‘144A’ FRN 15/6/2034	1,879,204	0.02
USD	410,000	Indiana Housing & Community Development Authority 3.8% 1/7/2038	451,031	0.00
USD	3,943,284	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 ‘Series 2007-HOA1 AXPP’ FRN 25/7/2047	256,009	0.00
USD	743,888	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 ‘Series 2006-AR15 A1’ FRN 25/7/2036	667,270	0.01
USD	7,142,887	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 ‘Series 2007-AR19 3A1’ FRN 25/9/2037	4,919,400	0.05
USD	848,524	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 ‘Series 2007-FLX5 2A2’ FRN 25/8/2037	715,658	0.01
USD	918,000	International Business Machines Corp 2.95% 15/5/2050	942,059	0.01
USD	7,443,000	International Business Machines Corp 4.25% 15/5/2049	9,361,523	0.10
USD	1,915,882	Invitation Homes 2018-SFR1 Trust ‘Series 2018-SFR1 E’ ‘144A’ FRN 17/3/2037	1,915,063	0.02
USD	2,383,203	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ‘Series 2018-SFR3 A’ ‘144A’ FRN 17/7/2037	2,386,568	0.02
USD	2,152,771	Invitation Homes 2018-SFR3 Trust ‘Series 2018-SFR3 E’ ‘144A’ FRN 17/7/2037	2,139,627	0.02
EUR	1,198,000	IQVIA Inc (Restricted) 2.875% 15/6/2028	1,468,676	0.02
EUR	750,000	IQVIA Inc 3.25% 15/3/2025	913,650	0.01
USD	872,000	IQVIA Inc ‘144A’ 5% 15/10/2026	912,330	0.01
USD	654,000	IQVIA Inc ‘144A’ 5% 15/5/2027	690,183	0.01
USD	867,000	IRB Holding Corp ‘144A’ 7% 15/6/2025	929,576	0.01
USD	1,820,000	Iron Mountain Inc ‘144A’ 5% 15/7/2028	1,897,368	0.02
USD	1,317,000	Iron Mountain Inc ‘144A’ 5.25% 15/7/2030	1,393,287	0.01
USD	749,611	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 (Step-up coupon) ‘Series 2006-3 2A3’ ‘144A’ 6.53% 25/9/2037	746,180	0.01
USD	203,002	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 ‘Series 2006-P1 1A’ ‘144A’ FRN 25/12/2036	188,665	0.00
USD	11,051,932	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 ‘Series 2007-HE1 A4’ FRN 25/5/2037	4,006,529	0.04
USD	1,012,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE ‘Series 2016- NINE A’ ‘144A’ FRN 6/9/2038	1,094,182	0.01
USD	2,553,000	Jagged Peak Energy LLC 5.875% 1/5/2026	2,609,255	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	275,000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP ‘144A’ 4.625% 15/6/2025	287,557	0.00
USD	451,000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP ‘144A’ 5% 15/6/2028	478,060	0.01
USD	624,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ‘144A’ 5.75% 15/6/2025	646,620	0.01
USD	327,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ‘144A’ 5.875% 15/7/2024	333,949	0.00
USD	1,352,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc ‘144A’ 6.75% 15/2/2028	1,507,057	0.02
USD	765,000	JobsOhio Beverage System 2.833% 1/1/2038	824,027	0.01
USD	2,485,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,798,122	0.03
USD	327,091	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 ‘Series 2007-A2 2A1’ FRN 25/5/2037	290,813	0.00
USD	1,500,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp ‘Series 2017-FL10 E’ ‘144A’ FRN 15/6/2032	1,381,703	0.01
USD	1,455,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp ‘Series 2018-AON A’ ‘144A’ 4.128% 5/7/2031	1,546,379	0.02
USD	1,421,741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 ‘Series 2015-JP1 C’ FRN 15/1/2049	1,425,266	0.01
USD	2,127,841	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 ‘Series 2015-JP1 D’ FRN 15/1/2049	1,738,160	0.02
USD	2,399,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES ‘Series 2015-UES D’ ‘144A’ FRN 5/9/2032	2,389,701	0.02
USD	2,504,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-UES ‘Series 2015-UES E’ ‘144A’ FRN 5/9/2032	2,489,406	0.03
USD	10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP3 ‘Series 2016-JP3 XC’ ‘144A’ FRN 15/8/2049	413,755	0.00
USD	2,420,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT ‘Series 2018-WPT DFX’ ‘144A’ 5.35% 5/7/2033	2,397,788	0.02
USD	244,066	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT ‘Series 2018-WPT FFX’ ‘144A’ 5.542% 5/7/2033	232,265	0.00
USD	657,950	JP Morgan Madison Avenue Securities Trust Series 2014- 1 ‘Series 2014-CH1 M2’ ‘144A’ FRN 25/11/2024	597,109	0.01
USD	960,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 ‘Series 2006-CW1 M1’ FRN 25/5/2036	914,350	0.01
USD	4,655,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 (Step-up coupon) ‘Series 2007-CH1 MF1’ 4.85% 25/11/2036	5,403,327	0.06
USD	4,631,584	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 ‘Series 2017-3 1A6’ ‘144A’ FRN 25/8/2047	4,658,480	0.05
USD	1,279,388	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C22 ‘Series 2014-C22 XA’ FRN 15/9/2047	35,670	0.00
USD	1,035,628	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ‘Series 2014-C23 XA’ FRN 15/9/2047	21,807	0.00
USD	7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C27 ‘Series 2015-C27 XD’ ‘144A’ FRN 15/2/2048	134,375	0.00
USD	1,751,213	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C29 ‘Series 2015-C29 XA’ FRN 15/5/2048	42,799	0.00
USD	1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 ‘Series 2015-C33 D1’ ‘144A’ FRN 15/12/2048	1,172,255	0.01
USD	887,395	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 ‘Series 2017-JP5 C’ FRN 15/3/2050	821,720	0.01
USD	1,340,000	JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust 2017-JP5 ‘Series 2017-JP5 D’ ‘144A’ FRN 15/3/2050	1,002,741	0.01
USD	4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C4 ‘Series 2016-C4 XC’ ‘144A’ FRN 15/12/2049	160,238	0.00
USD	884,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/11/2020 (Perpetual)	878,665	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,059,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/5/2023 (Perpetual)*	1,074,394	0.01
USD	1,212,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/8/2024 (Perpetual)	1,241,009	0.01
USD	506,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2025 (Perpetual)	505,368	0.01
USD	9,318,000	JPMorgan Chase & Co FRN 24/3/2031	11,460,464	0.12
USD	3,321,000	JPMorgan Chase & Co FRN 22/4/2041	3,630,107	0.04
USD	1,578,000	JPMorgan Chase & Co FRN 22/4/2051	1,692,196	0.02
USD	373,000	KAR Auction Services Inc ‘144A’ 5.125% 1/6/2025	378,129	0.00
USD	1,300,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	1,437,813	0.02
USD	1,611,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC ‘144A’ 5% 1/6/2024	1,651,444	0.02
USD	1,895,000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC ‘144A’ 5.25% 1/6/2026	1,984,643	0.02
USD	2,311,000	Kimberly-Clark Corp 3.1% 26/3/2030	2,632,265	0.03
EUR	300,000	Kraft Heinz Foods Co 2.25% 25/5/2028	366,478	0.00
USD	747,000	Kronos Acquisition Holdings Inc ‘144A’ 9% 15/8/2023	760,072	0.01
USD	2,241,000	Lam Research Corp 2.875% 5/6/2050	2,352,055	0.02
USD	195,000	Lamar Media Corp ‘144A’ 3.75% 15/2/2028	194,147	0.00
USD	370,000	Lamar Media Corp 5.75% 1/2/2026	387,307	0.00
USD	995,000	Lamb Weston Holdings Inc ‘144A’ 4.625% 1/11/2024	1,038,427	0.01
USD	746,000	Lamb Weston Holdings Inc ‘144A’ 4.875% 1/11/2026	784,020	0.01
USD	3,845,380	LCCM 2014-909 Mortgage Trust ‘Series 2014-909 E’ ‘144A’ FRN 15/5/2031	3,794,893	0.04
USD	1,050,000	LCCM 2014-909 Mortgage Trust ‘Series 2014-909 A’ ‘144A’ 3.388% 15/5/2031	1,055,737	0.01
USD	750,000	LCM XIV LP ‘144A’ FRN 20/7/2031	739,910	0.01
USD	1,330,000	LCM XXI LP ‘144A’ FRN 20/4/2028	1,321,039	0.01
USD	400,000	LCM XXIV Ltd ‘144A’ FRN 20/3/2030	398,864	0.00
USD	293,957	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A ‘Series 2002-A C’ 15/6/2033 (Zero Coupon)	259,504	0.00
USD	354,446	Lehman ABS Mortgage Loan Trust ‘Series 2007-1 2A1’ ‘144A’ FRN 25/6/2037	277,390	0.00
USD	269,451	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 ‘Series 2006-2A M2’ ‘144A’ FRN 25/9/2036	260,781	0.00
USD	649,945	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 ‘Series 2007-1A 1A’ ‘144A’ FRN 25/3/2037	635,591	0.01
USD	866,260	Lehman XS Trust Series 2007- 20N ‘Series 2007-20N A1’ FRN 25/12/2037	802,491	0.01
USD	7,036,000	Lendmark Funding Trust 2018- 1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 3.81% 21/12/2026	7,135,849	0.07
USD	2,576,000	Lendmark Funding Trust 2018- 1 ‘Series 2018-1A C’ ‘144A’ 5.03% 21/12/2026	2,649,668	0.03
USD	15,267,000	Lendmark Funding Trust 2018- 2 ‘Series 2018-2A A’ ‘144A’ 4.23% 20/4/2027	15,445,598	0.16
USD	2,000,000	Lendmark Funding Trust 2018- 2 ‘Series 2018-2A C’ ‘144A’ 5.26% 20/4/2027	1,981,178	0.02
USD	18,000	Lennar Corp 2.95% 29/11/2020	18,063	0.00
USD	854,000	Lennar Corp 4.125% 15/1/2022	879,129	0.01
USD	215,000	Lennar Corp 4.5% 30/4/2024	232,244	0.00
USD	1,037,000	Lennar Corp 4.75% 1/4/2021	1,052,322	0.01
USD	9,287,000	Lennar Corp 4.75% 15/11/2022	9,818,449	0.10
USD	327,000	Lennar Corp 4.75% 30/5/2025	360,143	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	589,000	Lennar Corp 4.75% 29/11/2027	674,405	0.01
USD	983,000	Lennar Corp 4.875% 15/12/2023	1,061,640	0.01
USD	57,000	Lennar Corp 5.25% 1/6/2026	64,464	0.00
USD	3,780,000	Lennar Corp 5.875% 15/11/2024	4,233,997	0.04
USD	3,092,000	Level 3 Financing Inc ‘144A’ 3.625% 15/1/2029	3,104,878	0.03
USD	4,467,000	Level 3 Financing Inc ‘144A’ 4.25% 1/7/2028	4,599,893	0.05
USD	324,000	Level 3 Financing Inc ‘144A’ 4.625% 15/9/2027	339,162	0.00
USD	162,000	Level 3 Financing Inc 5.125% 1/5/2023	162,487	0.00
USD	1,148,000	Level 3 Financing Inc 5.25% 15/3/2026	1,202,036	0.01
USD	1,967,000	Level 3 Financing Inc 5.375% 15/1/2024	2,001,216	0.02
USD	250,000	Levi Strauss & Co 5% 1/5/2025	256,344	0.00
USD	800,000	Lexington County Health Services District Inc 5% 1/11/2041	923,636	0.01
USD	2,070,955	LFRF ‘2015-1’ ‘144A’ 4% 30/10/2027	2,068,469	0.02
USD	784,000	LGI Homes Inc ‘144A’ 6.875% 15/7/2026	828,931	0.01
USD	568,594	Limerock CLO III LLC ‘Series 2014-3A A1R’ ‘144A’ FRN 20/10/2026	567,295	0.01
USD	1,915,000	Limerock CLO III LLC ‘Series 2014-3A C’ ‘144A’ FRN 20/10/2026	1,840,220	0.02
USD	2,014,350	LoanCore 2018-CRE1 Issuer Ltd ‘Series 2018-CRE1 A’ ‘144A’ FRN 15/5/2028	2,001,761	0.02
USD	2,958,000	Logan Merger Sub Inc ‘144A’ 5.5% 1/9/2027	3,063,379	0.03
USD	3,345,348	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 ‘Series 2006-5 2A3’ FRN 25/6/2036	2,085,886	0.02
USD	870,362	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 ‘Series 2006-6 2A3’ FRN 25/7/2036	437,066	0.00
USD	5,412,196	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 ‘Series 2006-7 2A3’ FRN 25/8/2036	2,852,266	0.03
USD	1,265,147	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-9 ‘Series 2006-9 2A2’ FRN 25/10/2036	588,882	0.01
USD	4,770,000	Los Angeles Department of Water 5% 1/7/2043	5,145,399	0.05
USD	6,460,000	Lowe’s Cos Inc 5.125% 15/4/2050	8,827,638	0.09
USD	1,942,117	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 ‘Series 2015-3 AS’ ‘144A’ FRN 20/4/2048	1,966,855	0.02
USD	2,433,302	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 ‘Series 2017-5 X’ ‘144A’ FRN 10/3/2050	82,254	0.00
USD	3,192,000	M/I Homes Inc 4.95% 1/2/2028	3,344,625	0.03
USD	1,395,000	Macy’s Inc ‘144A’ 8.375% 15/6/2025	1,463,271	0.02
USD	637,000	Macy’s Retail Holdings LLC 3.45% 15/1/2021	635,407	0.01
USD	4,008,000	MAD Mortgage Trust 2017- 330M ‘Series 2017-330M D’ ‘144A’ FRN 15/8/2034	4,091,664	0.04
USD	3,529,000	MAD Mortgage Trust 2017- 330M ‘Series 2017-330M E’ ‘144A’ FRN 15/8/2034	3,417,748	0.04
USD	986,897	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A ‘Series 2002-A B2’ FRN 25/3/2032	988,005	0.01
USD	4,225,000	Madison Park Funding XI Ltd ‘Series 2013-11A AR’ ‘144A’ FRN 23/7/2029	4,189,051	0.04
USD	600,000	Madison Park Funding XIII Ltd ‘Series 2014-13A CR2’ ‘144A’ FRN 19/4/2030	572,931	0.01
USD	340,000	Madison Park Funding XV Ltd ‘Series 2014-15A CR’ ‘144A’ FRN 27/1/2026	332,814	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	798,180	Madison Park Funding XVI Ltd ‘Series 2015-16A A1R’ ‘144A’ FRN 20/4/2026	798,507	0.01
USD	500,000	Madison Park Funding XVI Ltd ‘Series 2015-16A A2R’ ‘144A’ FRN 20/4/2026	498,108	0.01
USD	550,000	Madison Park Funding XVI Ltd ‘Series 2015-16A C’ ‘144A’ FRN 20/4/2026	544,334	0.01
USD	1,220,000	Madison Park Funding XVI Ltd ‘Series 2015-16A D’ ‘144A’ FRN 20/4/2026	1,062,874	0.01
USD	1,000,000	Madison Park Funding XVII Ltd ‘Series 2015-17A B1R’ ‘144A’ FRN 21/7/2030	992,886	0.01
USD	6,180,000	Madison Park Funding XVIII Ltd ‘Series 2015-18A A1R’ ‘144A’ FRN 21/10/2030	6,163,536	0.06
USD	700,000	Madison Park Funding XXX Ltd ‘Series 2018-30A E’ ‘144A’ FRN 15/4/2029	572,243	0.01
USD	74,213	Marathon CLO VII Ltd ‘Series 2014-7A A1R’ ‘144A’ FRN 28/10/2025	74,191	0.00
USD	690,000	Mariner Clo 2017-4 Ltd ‘Series 2017-4A A’ ‘144A’ FRN 26/10/2029	688,704	0.01
USD	2,860,000	Mariner Finance Issuance Trust 2018-A ‘Series 2018-AA C’ ‘144A’ 5.11% 20/11/2030	2,891,308	0.03
USD	988,000	Marriott International Inc/MD 3.125% 15/10/2021	1,010,283	0.01
USD	13,131,000	Marriott International Inc/MD 3.5% 15/10/2032	13,190,778	0.14
USD	777,000	Marriott International Inc/MD 4.625% 15/6/2030	848,648	0.01
USD	1,952,000	Marriott Ownership Resorts Inc ‘144A’ 6.125% 15/9/2025	2,082,540	0.02
USD	1,890,000	Marriott Ownership Resorts Inc / ILG LLC 6.5% 15/9/2026	1,959,401	0.02
EUR	2,010,000	Marsh & McLennan Cos Inc 1.349% 21/9/2026*	2,528,878	0.03
USD	998,000	Marsh & McLennan Cos Inc 2.25% 15/11/2030	1,045,871	0.01
USD	2,655,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	3,020,262	0.03
USD	990,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,160,666	0.01
USD	1,005,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	1,199,488	0.01
USD	800,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	847,404	0.01
USD	1,010,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	1,086,952	0.01
USD	845,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	896,925	0.01
USD	3,520,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	3,857,427	0.04
USD	2,545,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,785,070	0.03
USD	1,401,845	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE1 ‘Series 2007- HE1 A4’ FRN 25/5/2037	1,064,029	0.01
USD	516,021	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 ‘Series 2008-3 A1’ ‘144A’ FRN 25/8/2037	330,069	0.00
USD	474,789	Mastr Specialized Loan Trust ‘Series 2006-3 A’ ‘144A’ FRN 25/6/2046	451,241	0.00
USD	357,000	Matador Resources Co 5.875% 15/9/2026	314,745	0.00
EUR	700,000	Mauser Packaging Solutions Holding Co 4.75% 15/4/2024	839,883	0.01
USD	4,343,000	Mauser Packaging Solutions Holding Co ‘144A’ 5.5% 15/4/2024	4,445,799	0.05
USD	2,457,000	McDonald’s Corp 4.45% 1/9/2048	3,044,390	0.03
USD	1,085,000	McLaren Health Care Corp 4.386% 15/5/2048	1,348,710	0.01
USD	2,134,645	MCM Trust 2018-NPL1 ‘Series 2018-NPL1 A’ ‘144A’ 4% 28/5/2058	2,135,464	0.02
USD	3,111,419	MCM Trust 2018-NPL2 (Stepup coupon) ‘Series 2018- NPL2 A’ ‘144A’ 4% 25/10/2028	3,044,959	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,851,481	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 ‘Series 2007-OAR2 A2’ FRN 25/4/2037	1,661,491	0.02
USD	5,631,931	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 ‘Series 2007-2 A2C’ FRN 25/5/2037	2,741,771	0.03
USD	890,741	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006- RM3 ‘Series 2006-RM3 A2B’ FRN 25/6/2037	263,172	0.00
USD	2,815,000	Metropolitan Washington Airports Authority 5% 1/10/2048	3,374,805	0.03
USD	646,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.5% 1/9/2026	681,792	0.01
USD	399,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc ‘144A’ 4.625% 15/6/2025	419,349	0.00
USD	9,272,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 1/5/2024	9,991,554	0.10
USD	973,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.75% 1/2/2027	1,076,785	0.01
USD	380,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	386,496	0.00
USD	222,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	235,077	0.00
USD	696,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	747,688	0.01
USD	820,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2028	995,837	0.01
USD	840,000	Michigan Finance Authority 5% 1/6/2039	933,190	0.01
USD	670,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	783,565	0.01
USD	2,317,000	Microchip Technology Inc 3.922% 1/6/2021	2,370,256	0.02
USD	6,718,000	Microchip Technology Inc ‘144A’ 4.25% 1/9/2025	7,004,526	0.07
EUR	2,600,000	MMS USA Investments Inc 0.625% 13/6/2025*	3,094,834	0.03
EUR	2,700,000	MMS USA Investments Inc 1.25% 13/6/2028	3,248,467	0.03
EUR	100,000	MMS USA Investments Inc 1.75% 13/6/2031	122,742	0.00
USD	398,000	Molina Healthcare Inc 5.375% 15/11/2022	416,258	0.00
USD	6,092,000	Mondelez International Inc 2.75% 13/4/2030	6,653,057	0.07
USD	706,000	Morgan Stanley FRN 15/10/2020 (Perpetual)*	698,753	0.01
USD	2,843,000	Morgan Stanley FRN 23/1/2030	3,422,955	0.04
USD	6,176,000	Morgan Stanley FRN 1/4/2031	7,129,789	0.07
USD	1,212,000	Morgan Stanley FRN 24/3/2051	1,853,816	0.02
USD	3,019,374	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-HE5 ‘Series 2005- HE5 M4’ FRN 25/9/2035	1,770,926	0.02
USD	10,520,884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 ‘Series 2014-C19 XD’ ‘144A’ FRN 15/12/2047	486,423	0.01
USD	3,654,543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 ‘Series 2014-C19 XF’ ‘144A’ FRN 15/12/2047	163,797	0.00
USD	3,349,202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 ‘Series 2015-C21 XB’ ‘144A’ FRN 15/3/2048	45,641	0.00
USD	428,938	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 ‘Series 2015-C23 D’ ‘144A’ FRN 15/7/2050	370,790	0.00
USD	209,922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 ‘Series 2015-C25 C’ FRN 15/10/2048	223,094	0.00
USD	5,104,909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 ‘Series 2015-C26 XD’ ‘144A’ FRN 15/10/2048	320,588	0.00
USD	479,957	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 ‘Series 2015-C26 D’ ‘144A’ 3.06% 15/10/2048	387,009	0.00
USD	629,765	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 ‘Series 2017-C33 C’ FRN 15/5/2050	616,264	0.01
USD	744,000	Morgan Stanley Capital Barclays Bank Trust 2016- MART ‘Series 2016-MART A’ ‘144A’ 2.2% 13/9/2031	741,152	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	362,592	Morgan Stanley Capital I 2017- HR2 ‘Series 2017-HR2 D’ 2.73% 15/12/2050	270,271	0.00
USD	1,460,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2006-IQ11 ‘Series 2006-IQ11 C’ FRN 15/10/2042	1,447,332	0.02
USD	364,446	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 ‘Series 2007-T27 AJ’ FRN 11/6/2042	366,165	0.00
USD	943,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E ‘Series 2014-150E F’ ‘144A’ FRN 9/9/2032	888,202	0.01
USD	200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-CPT ‘Series 2014-CPT E’ ‘144A’ FRN 13/7/2029	203,256	0.00
USD	343,508	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ‘Series 2015-MS1 C’ FRN 15/5/2048	318,049	0.00
USD	250,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 ‘Series 2015-MS1 D’ ‘144A’ FRN 15/5/2048	207,620	0.00
USD	5,229,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS ‘Series 2017-CLS F’ ‘144A’ FRN 15/11/2034	5,098,210	0.05
USD	616,406	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ‘Series 2017-H1 C’ FRN 15/6/2050	596,795	0.01
USD	2,519,058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ‘Series 2017-H1 XD’ ‘144A’ FRN 15/6/2050	301,733	0.00
USD	365,563	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ‘Series 2018-H3 C’ FRN 15/7/2051	379,861	0.00
USD	839,686	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ‘Series 2018-H3 D’ ‘144A’ 3% 15/7/2051	606,257	0.01
USD	1,200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 ‘Series 2018-L1 A3’ 4.139% 15/10/2051	1,391,875	0.01
USD	3,821,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP ‘Series 2018-MP E’ ‘144A’ FRN 11/7/2040	2,955,098	0.03
USD	690,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN ‘Series 2018-SUN A’ ‘144A’ FRN 15/7/2035	667,393	0.01
USD	1,213,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN ‘Series 2018-SUN B’ ‘144A’ FRN 15/7/2035	1,171,332	0.01
USD	357,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN ‘Series 2018-SUN F’ ‘144A’ FRN 15/7/2035	334,855	0.00
USD	834,649	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2007-9SL ‘Series 2007- 9SL A’ FRN 25/7/2037	801,651	0.01
USD	6,770,115	Mortgage Loan Resecuritization Trust ‘Series 2009-RS1 A85’ ‘144A’ FRN 16/4/2036	5,986,030	0.06
USD	2,714,211	Mosaic Solar Loan Trust 2018- 1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 4.01% 22/6/2043	2,858,813	0.03
USD	6,631,184	Mosaic Solar Loan Trust 2018- 2-GS ‘Series 2018-2GS A’ ‘144A’ 4.2% 22/2/2044	7,034,055	0.07
USD	1,152,189	Mosaic Solar Loan Trust 2018- 2-GS ‘Series 2018-2GS C’ ‘144A’ 5.97% 22/2/2044	1,122,300	0.01
USD	8,585,674	Mosaic Solar Loan Trust 2019- 1 ‘Series 2019-1A A’ ‘144A’ 4.37% 21/12/2043	9,171,480	0.09
USD	987,357	Mosaic Solar Loan Trust 2020- 1 ‘Series 2020-1A B’ ‘144A’ 3.1% 20/4/2046	1,007,829	0.01
USD	1,398,391	Mountain Hawk II CLO Ltd ‘Series 2013-2A BR’ ‘144A’ FRN 20/7/2024	1,394,307	0.01
USD	823,317	Mountain Hawk III CLO Ltd ‘Series 2014-3A AR’ ‘144A’ FRN 18/4/2025	822,436	0.01
USD	500,000	MP CLO VII Ltd ‘Series 2015- 1A BRR’ ‘144A’ FRN 18/10/2028	489,276	0.01
USD	2,004,000	MPLX LP 2.65% 15/8/2030	1,984,328	0.02
USD	3,376,000	MPLX LP 6.25% 15/10/2022	3,382,989	0.04

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
GBP	250,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.55% 5/12/2023	332,958	0.00
EUR	750,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.325% 24/3/2025	942,622	0.01
GBP	150,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 5/6/2028	200,954	0.00
USD	292,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 1/8/2029	309,657	0.00
USD	793,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5% 15/10/2027	840,497	0.01
USD	162,000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.25% 1/8/2026	171,381	0.00
USD	649,102	Multi Security Asset Trust LP Commercial Mortgage- Backed Securities Pass- Through ‘Series 2005-RR4A N’ ‘144A’ FRN 28/11/2035	595,064	0.01
USD	43,932	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-C ‘Series 2007-C 2AV3’ FRN 25/6/2037	43,913	0.00
USD	635,000	Nationstar Mortgage Holdings Inc ‘144A’ 6% 15/1/2027	672,605	0.01
USD	2,359,000	Nationstar Mortgage Holdings Inc ‘144A’ 9.125% 15/7/2026	2,575,002	0.03
USD	691,040	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ‘Series 2018-FL1 A’ ‘144A’ FRN 15/6/2035	671,738	0.01
USD	1,195,978	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2018-FL1 ‘Series 2018-FL1 MCR1’ ‘144A’ FRN 15/6/2035	1,121,465	0.01
USD	295,000	Navient Corp 6.75% 25/6/2025	309,654	0.00
USD	292,000	Navient Corp 6.75% 15/6/2026	305,323	0.00
USD	299,000	Navient Corp 7.25% 25/9/2023	316,753	0.00
USD	2,882,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A ‘Series 2014-AA B’ ‘144A’ 3.5% 15/8/2044	2,944,566	0.03
USD	2,174,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A ‘Series 2015-AA B’ ‘144A’ 3.5% 15/12/2044	2,233,693	0.02
USD	6,326,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2018-D ‘Series 2018-DA A2A’ ‘144A’ 4% 15/12/2059	6,738,548	0.07
USD	1,425,000	NBCUniversal Enterprise Inc ‘144A’ 5.25% 19/3/2021 (Perpetual)	1,448,156	0.02
USD	2,061,000	NBCUniversal Media LLC 4.45% 15/1/2043	2,596,731	0.03
USD	1,068,000	NCR Corp 5% 15/7/2022	1,071,807	0.01
USD	403,000	NCR Corp ‘144A’ 5% 1/10/2028	406,426	0.00
USD	250,000	NCR Corp ‘144A’ 6.125% 1/9/2029	269,578	0.00
USD	400,000	NCR Corp ‘144A’ 8.125% 15/4/2025	448,484	0.00
EUR	1,317,000	Netflix Inc 3% 15/6/2025	1,655,340	0.02
USD	350,000	Netflix Inc ‘144A’ 3.625% 15/6/2025	370,965	0.00
EUR	2,583,000	Netflix Inc 3.625% 15/6/2030	3,397,993	0.04
EUR	785,000	Netflix Inc 3.875% 15/11/2029	1,052,205	0.01
USD	913,000	Netflix Inc 4.375% 15/11/2026	1,017,730	0.01
USD	519,000	Netflix Inc 4.875% 15/4/2028	601,588	0.01
USD	324,000	Netflix Inc ‘144A’ 4.875% 15/6/2030	375,678	0.00
USD	292,000	Netflix Inc ‘144A’ 5.375% 15/11/2029	352,867	0.00
USD	260,000	Netflix Inc 5.875% 15/2/2025	300,273	0.00
USD	616,000	Netflix Inc 5.875% 15/11/2028	759,192	0.01
USD	727,000	Netflix Inc 6.375% 15/5/2029	920,418	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	719,218	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd ‘Series 2017-16SA A’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	717,157	0.01
USD	350,000	Neuberger Berman CLO XVI-S Ltd ‘Series 2017-16SA D’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	337,870	0.00
USD	415,846	Neuberger Berman CLO XX Ltd ‘Series 2015-20A AR’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	412,249	0.00
USD	1,100,000	Neuberger Berman CLO XX Ltd ‘Series 2015-20A ER’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	935,186	0.01
USD	250,000	Neuberger Berman CLO XXIII Ltd ‘Series 2016-23A BR’ ‘144A’ FRN 17/10/2027	243,286	0.00
USD	6,773,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd ‘Series 2017-26A A’ ‘144A’ FRN 18/10/2030	6,714,076	0.07
USD	625,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 Ltd ‘Series 2020-37A E’ ‘144A’ FRN 20/7/2031	612,411	0.01
USD	7,240,000	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B ‘Series 2005-B M1’ FRN 25/10/2035	7,010,657	0.07
USD	1,180,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	1,332,073	0.01
USD	1,300,000	New Orleans Aviation Board 5% 1/1/2040	1,457,619	0.02
USD	3,525,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.05% 1/5/2027	4,008,859	0.04
USD	4,115,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.35% 1/11/2030	4,584,110	0.05
USD	1,870,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.55% 1/5/2025	2,127,658	0.02
USD	2,530,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.75% 1/11/2025	2,784,429	0.03
USD	3,490,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	4,036,080	0.04
USD	1,515,000	New York City Water & Sewer System 5.44% 15/6/2043	2,366,021	0.02
USD	435,000	New York City Water & Sewer System 5.75% 15/6/2041	702,747	0.01
USD	2,000,000	New York Liberty Development Corp ‘144A’ 5% 15/11/2044	2,122,700	0.02
USD	310,000	New York State Dormitory Authority 2.985% 1/7/2040	313,680	0.00
USD	1,790,000	New York State Dormitory Authority 3.142% 1/7/2043	1,879,312	0.02
USD	2,430,000	New York State Dormitory Authority 3.19% 15/2/2043	2,702,670	0.03
USD	3,475,000	New York State Urban Development Corp 2.35% 15/3/2027	3,714,705	0.04
USD	1,545,000	New York State Urban Development Corp 3.12% 15/3/2025	1,703,409	0.02
USD	3,490,000	New York State Urban Development Corp 3.32% 15/3/2029	3,922,777	0.04
USD	590,000	New York Transportation Development Corp 5% 1/7/2046	632,743	0.01
USD	4,715,000	New York Transportation Development Corp 5.25% 1/1/2050	5,099,320	0.05
USD	242,000	Newfield Exploration Co 5.375% 1/1/2026	240,453	0.00
USD	650,000	Nexstar Broadcasting Inc ‘144A’ 5.625% 1/8/2024	667,066	0.01
USD	1,835,000	Nexstar Broadcasting Inc ‘144A’ 5.625% 15/7/2027	1,942,233	0.02
USD	5,800,000	NGPL PipeCo LLC ‘144A’ 7.768% 15/12/2037	7,057,467	0.07
USD	290,444	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2001-R1A ‘Series 2001-R1A A’ ‘144A’ FRN 19/2/2030	297,302	0.00
USD	492,666	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 (Step-up coupon) ‘Series 2006-AF1 1A4’ 6.634% 25/5/2036	168,305	0.00
USD	246,816	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2006-S5 ‘Series 2006-S5 A1’ ‘144A’ FRN 25/10/2036	237,702	0.00

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,984,648	Nomura Asset Acceptance Corp Alternative Loan Trust Series 2007-2 ‘Series 2007-2 A4’ FRN 25/6/2037	1,614,828	0.02
USD	847,000	Norfolk Southern Corp 3.05% 15/5/2050	890,689	0.01
USD	19,669	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	19,673	0.00
USD	2,734,000	NRG Energy Inc 2.75% 1/6/2048	2,912,113	0.03
USD	1,293,000	NRG Energy Inc ‘144A’ 5.25% 15/6/2029	1,412,363	0.01
USD	774,000	NRG Energy Inc 5.75% 15/1/2028	843,517	0.01
USD	1,828,000	NRG Energy Inc 6.625% 15/1/2027	1,954,059	0.02
USD	4,268,000	NRG Energy Inc 7.25% 15/5/2026	4,579,116	0.05
USD	222,000	Nucor Corp 2.7% 1/6/2030	238,548	0.00
USD	2,891,000	NuStar Logistics LP 4.8% 1/9/2020	2,891,000	0.03
USD	1,935,000	NVIDIA Corp 2.85% 1/4/2030	2,147,402	0.02
USD	1,116,000	NVIDIA Corp 3.5% 1/4/2050	1,258,064	0.01
EUR	1,400,000	Oak Hill Credit Partners 2018- 7X Ltd FRN 20/10/2031	1,655,047	0.02
EUR	1,100,000	Oak Hill Credit Partners 2018- 7X Ltd FRN 20/10/2031	1,286,738	0.01
EUR	425,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity Co ‘Series 2016-5X B1’ FRN 21/2/2030	503,504	0.01
USD	250,000	Oaktree CLO 2014-1 ‘Series 2014-1A A2R’ ‘144A’ FRN 13/5/2029	247,986	0.00
USD	2,836,912	Oaktree CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A A1R’ ‘144A’ FRN 20/10/2027	2,835,550	0.03
USD	1,750,000	Oaktree CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A DR’ ‘144A’ FRN 20/10/2027	1,370,961	0.01
USD	624,704	Oakwood Mortgage Investors Inc (Defaulted) ‘Series 2001-D A2’ FRN 15/1/2019	408,103	0.00
USD	519,491	Oakwood Mortgage Investors Inc ‘Series 2001-D A4’ FRN 15/9/2031	426,522	0.00
USD	1,050,000	Occidental Petroleum Corp 5.875% 1/9/2025	1,055,250	0.01
USD	1,050,000	Occidental Petroleum Corp 6.375% 1/9/2028	1,060,500	0.01
USD	1,250,000	Occidental Petroleum Corp 8% 15/7/2025	1,359,375	0.01
USD	848,000	Ochsner Clinic Foundation 5.897% 15/5/2045	1,117,258	0.01
USD	460,000	OCP CLO 2014-5 Ltd ‘Series 2014-5A A1R’ ‘144A’ FRN 26/4/2031	452,112	0.00
USD	1,100,000	OCP CLO 2014-7 Ltd ‘Series 2014-7A A2RR’ ‘144A’ FRN 20/7/2029	1,084,352	0.01
USD	1,170,000	OCP CLO 2014-7 Ltd ‘Series 2014-7A B2RR’ ‘144A’ 5.106% 20/7/2029	1,201,052	0.01
USD	1,750,000	OCP CLO 2015-10 Ltd ‘Series 2015-10A BR’ ‘144A’ FRN 26/10/2027	1,735,934	0.02
USD	1,340,000	OCP CLO 2015-8 Ltd ‘Series 2015-8A BR’ ‘144A’ FRN 17/4/2027	1,337,258	0.01
USD	2,330,000	OCP CLO 2015-9 Ltd ‘Series 2015-9A BR’ ‘144A’ FRN 15/7/2027	2,283,437	0.02
USD	440,000	OCP CLO 2016-12 Ltd FRN 18/10/2028	420,978	0.00
USD	6,824,000	OCP CLO 2016-12 Ltd ‘Series 2016-12A A1R’ ‘144A’ FRN 18/10/2028	6,806,812	0.07
USD	750,000	OCP CLO 2017-13 Ltd ‘Series 2017-13A A2A’ ‘144A’ FRN 15/7/2030	744,797	0.01
USD	920,000	OCP CLO 2017-13 Ltd ‘Series 2017-13A D’ ‘144A’ FRN 15/7/2030	852,331	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	360,000	OCP CLO 2017-14 Ltd ‘Series 2017-14A B’ ‘144A’ FRN 20/11/2030	344,227	0.00
USD	3,000,000	OCP CLO 2020-18 Ltd ‘Series 2020-18A D’ ‘144A’ FRN 20/4/2030	3,011,253	0.03
USD	1,875,000	OCP CLO 2020-18 Ltd ‘Series 2020-18A E’ ‘144A’ FRN 20/4/2030	1,879,543	0.02
USD	650,000	OCP CLO 2020-19 Ltd ‘Series 2020-19A C’ ‘144A’ FRN 20/7/2031	652,478	0.01
USD	525,000	OCP CLO 2020-19 Ltd ‘Series 2020-19A D’ ‘144A’ FRN 20/7/2031	528,147	0.01
USD	250,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd ‘Series 2018-18A A1A’ ‘144A’ FRN 16/4/2031	246,346	0.00
USD	250,000	Octagon Investment Partners 30 Ltd ‘Series 2017-1A D’ ‘144A’ FRN 17/3/2030	221,201	0.00
USD	1,230,000	Octagon Investment Partners XXIII Ltd ‘Series 2015-1A CR’ ‘144A’ FRN 15/7/2027	1,207,723	0.01
USD	670,000	OFSI Fund VI Ltd ‘Series 2014- 6A CR’ ‘144A’ FRN 20/3/2025	649,003	0.01
USD	93,470	OFSI Fund VII Ltd ‘Series 2014- 7A AR’ ‘144A’ FRN 18/10/2026	93,355	0.00
USD	1,304,945	OHA Credit Partners IX Ltd ‘Series 2013-9A E’ ‘144A’ FRN 20/10/2025	1,250,937	0.01
USD	730,000	OHA Credit Partners VII Ltd ‘Series 2012-7A DR’ ‘144A’ FRN 20/11/2027	737,432	0.01
USD	260,000	OHA Credit Partners XIII Ltd ‘Series 2016-13A E’ ‘144A’ FRN 21/1/2030	243,198	0.00
USD	1,433,000	OHA Loan Funding 2013-2 Ltd ‘Series 2013-2A AR’ ‘144A’ FRN 23/5/2031	1,415,862	0.01
USD	2,232,801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ‘Series 2017- OT E’ ‘144A’ FRN 10/5/2039	1,948,081	0.02
USD	28,148,566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ‘Series 2017- OT XA’ ‘144A’ FRN 10/5/2039	678,662	0.01
USD	41,869,799	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT ‘Series 2017-1MKT XCP’ ‘144A’ FRN 10/2/2032	86,670	0.00
USD	8,776,000	One Market Plaza Trust 2017- 1MKT ‘Series 2017-1MKT XNCP’ ‘144A’ FRN 10/2/2032	88	0.00
USD	6,584,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A B’ ‘144A’ 3.61% 14/3/2029	6,780,708	0.07
USD	4,500,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A E’ ‘144A’ 5.52% 14/3/2029	4,629,958	0.05
USD	3,870,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 ‘Series 2019-2A D’ ‘144A’ 4.05% 14/10/2036	4,074,949	0.04
USD	1,270,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 ‘Series 2020-2A C’ ‘144A’ 2.76% 14/9/2035	1,283,071	0.01
USD	3,210,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 ‘Series 2020-2A D’ ‘144A’ 3.45% 14/9/2035	3,252,459	0.03
USD	1,250,650	Option One Mortgage Loan Trust 2006-3 ‘Series 2006-3 1A1’ FRN 25/2/2037	959,445	0.01
USD	1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 ‘Series 2007-CP1 2A3’ FRN 25/3/2037	1,333,514	0.01
USD	6,275,499	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) ‘Series 2007-FXD1 1A1’ 5.866% 25/1/2037	6,118,486	0.06
USD	6,887,304	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 (Step-up coupon) ‘Series 2007-FXD1 2A1’ 5.866% 25/1/2037	6,729,176	0.07
USD	2,861,618	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 (Step-up coupon) ‘Series 2007-FXD2 1A1’ 5.82% 25/3/2037	2,944,926	0.03
USD	1,143,000	Oracle Corp 2.95% 1/4/2030	1,275,230	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	6,837,000	Oracle Corp 3.6% 1/4/2050	7,590,954	0.08
USD	3,105,000	Orange County Local Transportation Authority 6.908% 15/2/2041	4,767,960	0.05
USD	4,195,000	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	4,797,423	0.05
USD	4,775,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	5,869,836	0.06
USD	3,410,000	Oregon School Boards Association 5.68% 30/6/2028	4,276,379	0.04
USD	613,697	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A ‘Series 2001-A M1’ FRN 15/3/2032	598,588	0.01
USD	162,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ‘144A’ 4.625% 15/3/2030	156,532	0.00
USD	709,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ‘144A’ 5% 15/8/2027	697,791	0.01
USD	414,000	Owens-Brockway Glass Container Inc ‘144A’ 5.875% 15/8/2023	440,953	0.00
USD	1,590,000	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 (Step-up coupon) ‘Series 2006-2 A2C’ 6% 25/1/2037	1,542,348	0.02
USD	290,000	OZLM Funding IV Ltd ‘Series 2013-4A A2R’ ‘144A’ FRN 22/10/2030	287,907	0.00
USD	250,000	OZLM Funding Ltd ‘Series 2012-1A A2R2’ ‘144A’ FRN 22/7/2029	249,317	0.00
USD	300,000	OZLM VI Ltd ‘Series 2014-6A A2AS’ ‘144A’ FRN 17/4/2031	298,762	0.00
USD	3,200,000	OZLM VI Ltd ‘Series 2014-6A SUB’ ‘144A’ FRN 17/4/2031	144,000	0.00
USD	500,000	OZLM VII Ltd ‘Series 2014-7RA A2R’ ‘144A’ FRN 17/7/2029	490,950	0.01
USD	1,185,000	OZLM VIII Ltd ‘Series 2014-8A A2RR’ ‘144A’ FRN 17/10/2029	1,178,980	0.01
USD	1,000,000	OZLM VIII Ltd ‘Series 2014-8A BRR’ ‘144A’ FRN 17/10/2029	964,019	0.01
USD	815,000	OZLM VIII Ltd ‘Series 2014-8A CRR’ ‘144A’ FRN 17/10/2029	778,896	0.01
USD	250,000	OZLM XII Ltd ‘Series 2015-12A A2R’ ‘144A’ FRN 30/4/2027	246,010	0.00
USD	1,380,000	OZLM XIV Ltd ‘Series 2015-14A B1R’ ‘144A’ FRN 15/1/2029	1,340,296	0.01
USD	2,190,000	OZLM XIV Ltd ‘Series 2015-14A CR’ ‘144A’ FRN 15/1/2029	2,065,933	0.02
USD	2,000,000	OZLM XIX Ltd ‘Series 2017-19A A1’ ‘144A’ FRN 22/11/2030	1,987,052	0.02
USD	893,000	OZLM XVIII Ltd ‘Series 2018- 18A A’ ‘144A’ FRN 15/4/2031	878,377	0.01
USD	250,000	OZLM XX Ltd ‘Series 2018-20A A2’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	245,850	0.00
USD	580,000	Palmer Square CLO 2014-1 Ltd ‘Series 2014-1A A1R2’ ‘144A’ FRN 17/1/2031	572,126	0.01
USD	1,840,000	Palmer Square CLO 2018-1 Ltd ‘Series 2018-1A A1’ ‘144A’ FRN 18/4/2031	1,811,932	0.02
USD	500,000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd ‘Series 2018-2A A2’ ‘144A’ FRN 16/7/2031	494,516	0.01
USD	3,502,000	Palmer Square CLO 2018-3 Ltd ‘Series 2018-3A A2’ ‘144A’ FRN 15/8/2026	3,458,302	0.04
USD	1,530,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd ‘Series 2018-4A B’ ‘144A’ FRN 15/11/2026	1,475,744	0.02
USD	1,300,000	Palmer Square Loan Funding 2018-4 Ltd ‘Series 2018-4A C’ ‘144A’ FRN 15/11/2026	1,185,954	0.01
USD	3,512,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	3,429,086	0.04

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,995,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd FRN 20/1/2027	1,861,442	0.02
USD	350,000	Palmer Square Loan Funding 2018-5 Ltd ‘Series 2018-5A D’ ‘144A’ FRN 20/1/2027	303,536	0.00
USD	90,351	Paragon Mortgages No 13 Plc FRN 15/1/2039	85,837	0.00
USD	1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2016-1 ‘Series 2016-1A DR’ ‘144A’ FRN 23/8/2031	1,165,267	0.01
USD	2,275,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A A1’ ‘144A’ FRN 14/11/2029	2,262,669	0.02
USD	2,070,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A A2’ ‘144A’ FRN 14/11/2029	2,041,908	0.02
USD	3,100,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 14/11/2029	3,028,996	0.03
USD	2,830,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO Ltd 2017-1 ‘Series 2017-1A D’ ‘144A’ FRN 14/11/2029	2,571,969	0.03
USD	6,003,000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp ‘144A’ 5.375% 15/1/2025	6,135,006	0.06
USD	2,696,000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp ‘144A’ 9.25% 15/5/2025	2,949,222	0.03
USD	195,000	PDC Energy Inc 5.75% 15/5/2026	198,607	0.00
USD	2,355,000	Pennsylvania Turnpike Commission 5% 1/12/2048	2,821,608	0.03
USD	1,050,000	Pfizer Inc 2.7% 28/5/2050	1,080,586	0.01
USD	3,193,000	PG&E Corp 5% 1/7/2028	3,191,851	0.03
EUR	1,725,000	Philip Morris International Inc 2.875% 3/3/2026	2,337,699	0.02
USD	515,000	Pierce County School District No 10 Tacoma 1.653% 1/12/2030	523,389	0.01
USD	484,000	Pilgrim’s Pride Corp ‘144A’ 5.875% 30/9/2027	513,645	0.01
USD	5,290,000	Pioneer Natural Resources Co 1.9% 15/8/2030	5,142,159	0.05
USD	2,255,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	2,938,344	0.03
USD	250,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.926% 1/10/2051	342,078	0.00
USD	790,000	Port of Seattle WA 5% 1/5/2043	913,702	0.01
USD	1,002,000	Post Holdings Inc ‘144A’ 5% 15/8/2026	1,041,313	0.01
USD	445,000	Post Holdings Inc ‘144A’ 5.5% 15/12/2029	487,842	0.01
USD	1,290,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV Ltd ‘Series 2015-4A C’ ‘144A’ 4% 24/8/2049	1,255,557	0.01
USD	9,064,792	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI Ltd ‘Series 2016-6A C’ ‘144A’ 4% 24/8/2040	9,082,922	0.09
USD	265,500	Prime Mortgage Trust 2006- DR1 ‘Series 2006-DR1 2A1’ ‘144A’ 5.5% 25/5/2035	221,175	0.00
USD	2,078,676	Progress Residential 2017- SFR1 Trust ‘Series 2017- SFR1 A’ ‘144A’ 2.768% 17/8/2034	2,118,504	0.02
USD	1,480,000	Progress Residential 2018- SFR1 Trust ‘Series 2018- SFR1 F’ ‘144A’ 4.778% 17/3/2035	1,516,582	0.02
USD	920,000	Progress Residential 2018- SFR2 Trust ‘Series 2018- SFR2 F’ ‘144A’ 4.953% 17/8/2035	927,474	0.01
EUR	1,655,000	Prologis Euro Finance LLC 0.25% 10/9/2027	1,962,204	0.02
USD	1,499,000	Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC 3.75% 16/10/2029	1,485,415	0.02
USD	128,000	PulteGroup Inc 4.25% 1/3/2021	129,744	0.00
USD	378,000	PulteGroup Inc 5% 15/1/2027	432,810	0.00
USD	3,902,000	PulteGroup Inc 5.5% 1/3/2026	4,479,125	0.05
USD	43,000	PulteGroup Inc 6% 15/2/2035	52,778	0.00
USD	3,106,000	PulteGroup Inc 7.875% 15/6/2032	4,219,144	0.04
USD	1,349,000	Qorvo Inc 4.375% 15/10/2029	1,449,123	0.02

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	4,608,000	Qorvo Inc 5.5% 15/7/2026	4,906,691	0.05
USD	2,420,000	QUALCOMM Inc 3.25% 20/5/2050	2,705,163	0.03
USD	898,000	Quicken Loans LLC ‘144A’ 5.25% 15/1/2028	960,680	0.01
USD	11,577,000	Quicken Loans LLC ‘144A’ 5.75% 1/5/2025	11,917,074	0.12
USD	626,678	Race Point IX CLO Ltd ‘Series 2015-9A A1AR’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	621,835	0.01
USD	907,735	RALI Series 2007-QH9 Trust ‘Series 2007-QH9 A1’ FRN 25/11/2037	815,295	0.01
USD	1,178,913	RAMP Series 2004-RS7 Trust ‘Series 2004-RS7 A2A’ FRN 25/7/2034	989,489	0.01
USD	2,720,218	RASC Series 2006-EMX9 Trust ‘Series 2006-EMX9 1A4’ FRN 25/11/2036	2,059,586	0.02
USD	301,000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp ‘144A’ 9.375% 1/4/2027	313,010	0.00
EUR	2,423,000	Refinitiv US Holdings Inc 4.5% 15/5/2026	3,057,596	0.03
USD	9,058,000	Refinitiv US Holdings Inc ‘144A’ 6.25% 15/5/2026	9,709,044	0.10
USD	1,000,000	Regatta IX Funding Ltd ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 17/4/2030	981,831	0.01
USD	250,000	Regatta VII Funding Ltd ‘Series 2016-1A BR’ ‘144A’ FRN 20/12/2028	244,060	0.00
USD	2,485,000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue 6.583% 15/5/2049	4,027,924	0.04
USD	888,000	Reliance Steel & Aluminum Co 1.3% 15/8/2025	890,210	0.01
USD	121,265	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 ‘Series 2005- R3 AF’ ‘144A’ FRN 25/9/2035	106,119	0.00
USD	1,274,613	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 ‘Series 2005- A5 A5’ FRN 25/5/2035	942,964	0.01
USD	113,000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu ‘144A’ 7% 15/7/2024	115,401	0.00
USD	227,000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.75% 15/10/2027	208,089	0.00
USD	2,200,000	Rockford Tower CLO 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A E’ ‘144A’ FRN 15/4/2029	1,752,933	0.02
USD	10,872,992	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd ‘Series 2017-3A A’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	10,803,190	0.11
USD	3,015,000	Rockford Tower CLO 2017-3 Ltd ‘Series 2017-3A E’ ‘144A’ FRN 20/10/2030	2,496,728	0.03
USD	1,000,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ FRN 20/5/2031	989,391	0.01
USD	1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd ‘Series 2018-1A B’ ‘144A’ FRN 20/5/2031	1,234,747	0.01
USD	341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd ‘Series 2018-2A A’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	335,910	0.00
USD	813,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd ‘Series 2018-2A B’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	806,640	0.01
USD	560,000	Rockford Tower CLO 2018-2 Ltd ‘Series 2018-2A E’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	463,832	0.01
USD	421,020	Romark WM-R Ltd ‘Series 2018-1A A1’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	414,286	0.00
USD	1,791,788	Rosslyn Portfolio Trust 2017- ROSS ‘Series 2017-ROSS E’ ‘144A’ FRN 15/6/2033	1,713,152	0.02
USD	915,000	Royal Oak Hospital Finance Authority 5% 1/9/2039	1,015,915	0.01
USD	9,000,000	RR 10 Ltd ‘Series 2020-10A A1FL’ ‘144A’ FRN 15/7/2033	8,955,000	0.09
USD	4,000,000	RR 10 Ltd ‘Series 2020-10A A2B’ ‘144A’ FRN 15/7/2033	4,012,573	0.04
USD	1,110,000	RR 10 Ltd ‘Series 2020-10A C’ ‘144A’ FRN 15/7/2033	1,117,533	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,375,000	RR 11 Ltd ‘Series 2020-11A A2’ ‘144A’ FRN 15/10/2031	1,375,000	0.01
USD	550,000	RR 2 Ltd ‘Series 2017-2A A2’ ‘144A’ FRN 15/10/2029	541,048	0.01
USD	1,407,000	RR 2 Ltd ‘Series 2017-2A B’ ‘144A’ FRN 15/10/2029	1,353,213	0.01
USD	410,000	RR 2 Ltd ‘Series 2017-2A D’ ‘144A’ FRN 15/10/2029	364,983	0.00
USD	250,000	RR 3 Ltd ‘Series 2018-3A A1R2’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	246,055	0.00
USD	2,000,000	RR 4 Ltd ‘Series 2018-4A A2’ ‘144A’ FRN 15/4/2030	1,958,044	0.02
USD	2,550,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	2,822,429	0.03
USD	835,000	RWJ Barnabas Health Inc 3.477% 1/7/2049	876,454	0.01
USD	2,143,000	Sabre GLBL Inc ‘144A’ 5.25% 15/11/2023	2,144,104	0.02
USD	1,114,000	Sabre GLBL Inc ‘144A’ 5.375% 15/4/2023	1,133,389	0.01
USD	772,000	Sabre GLBL Inc ‘144A’ 7.375% 1/9/2025	813,495	0.01
USD	1,632,000	Sabre GLBL Inc ‘144A’ 9.25% 15/4/2025	1,812,540	0.02
USD	249,451	SACO I Trust 2006-9 ‘Series 2006-9 A1’ FRN 25/8/2036	246,536	0.00
USD	6,125,000	Sacramento County Sanitation Districts Financing Authority FRN 1/12/2035	5,299,809	0.05
USD	1,265,000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.176% 1/8/2026	1,420,753	0.01
USD	1,578,000	Sasol Financing USA LLC 5.875% 27/3/2024	1,570,603	0.02
USD	1,127,000	Scientific Games International Inc ‘144A’ 5% 15/10/2025	1,116,885	0.01
USD	3,746,809	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 ‘Series 2017-3 B’ ‘144A’ 25/7/2056 (Zero Coupon)	362,614	0.00
USD	5,146,106	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 ‘Series 2017-3 BIO’ ‘144A’ FRN 25/7/2056	639,475	0.01
USD	505,123	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 ‘Series 2018-1 BX’ FRN 25/5/2057	228,907	0.00
USD	2,192,000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc ‘144A’ 8.75% 1/5/2025	2,349,550	0.02
USD	750,000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc ‘144A’ 9.5% 1/8/2025	795,938	0.01
USD	327,371	Security National Mortgage Loan Trust 2007-1 ‘Series 2007-1A 2A’ ‘144A’ FRN 25/4/2037	325,446	0.00
USD	7,110,000	Select Medical Corp ‘144A’ 6.25% 15/8/2026	7,609,762	0.08
USD	21,844	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ‘Series 2014-1A AR’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	21,845	0.00
USD	1,500,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ‘Series 2014-1A CR’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	1,475,213	0.02
USD	1,490,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ‘Series 2014-1A D’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	1,491,715	0.02
USD	250,000	Seneca Park CLO Ltd 2014-1 ‘Series 2014-1A SUB’ ‘144A’ FRN 17/7/2026	4,600	0.00
USD	493,000	Sensata Technologies Inc ‘144A’ 3.75% 15/2/2031	499,163	0.01
USD	4,604,000	Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023	4,543,573	0.05
USD	2,001,000	Service Properties Trust 5% 15/8/2022	2,011,005	0.02
USD	739,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	803,993	0.01
USD	949,000	SES GLOBAL Americas Holdings GP ‘144A’ 5.3% 25/3/2044	986,808	0.01
USD	5,337,090	Sesac Finance LLC ‘Series 2019-1 A2’ ‘144A’ 5.216% 25/7/2049	5,632,245	0.06
USD	1,357,719	SG Mortgage Securities Trust 2006-FRE2 ‘Series 2006-FRE2 A2C’ FRN 25/7/2036	435,678	0.00
USD	3,103,015	Shackleton 2013-III CLO Ltd ‘Series 2013-3A AR’ ‘144A’ FRN 15/7/2030	3,068,004	0.03
USD	1,000,000	Shackleton 2019-XV CLO Ltd ‘Series 2019-15A B’ ‘144A’ FRN 15/1/2030	996,139	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,631,000	Sherwin-Williams Co/The 2.3% 15/5/2030	2,728,419	0.03
EUR	1,393,000	Silgan Holdings Inc 2.25% 1/6/2028	1,653,755	0.02
EUR	1,400,000	Silgan Holdings Inc 3.25% 15/3/2025	1,701,405	0.02
USD	3,750,000	Silver Creek CLO Ltd ‘Series 2014-1A AR’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	3,714,149	0.04
USD	750,000	Silver Creek CLO Ltd ‘Series 2014-1A DR’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	722,578	0.01
USD	350,000	Sirius XM Radio Inc ‘144A’ 4.125% 1/7/2030	368,812	0.00
USD	5,308,000	Sirius XM Radio Inc ‘144A’ 4.625% 15/7/2024	5,531,931	0.06
USD	3,018,000	Sirius XM Radio Inc ‘144A’ 5% 1/8/2027	3,206,700	0.03
USD	572,000	Sirius XM Radio Inc ‘144A’ 5.375% 15/7/2026	602,199	0.01
USD	2,992,000	Sirius XM Radio Inc ‘144A’ 5.5% 1/7/2029	3,298,889	0.03
USD	583,000	Six Flags Entertainment Corp ‘144A’ 4.875% 31/7/2024	566,460	0.01
USD	3,072,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-B ‘Series 2004-B A4’ FRN 15/9/2033	2,870,182	0.03
USD	11,422,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A ‘Series 2005-A A4’ FRN 15/12/2038	10,920,560	0.11
USD	9,616,679	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ‘Series 2005-B A4’ FRN 15/6/2039	9,095,870	0.09
USD	3,314,422	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ‘Series 2005-B B’ FRN 15/6/2039	3,259,072	0.03
USD	9,659,052	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ‘Series 2006-A A5’ FRN 15/6/2039	9,128,309	0.09
USD	10,688,695	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ‘Series 2006-B A5’ FRN 15/12/2039	9,950,248	0.10
USD	5,634,566	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A ‘Series 2007-A A4A’ FRN 16/12/2041	5,381,739	0.06
USD	7,843,000	SLM Private Education Loan Trust 2010-C ‘Series 2010-C A5’ ‘144A’ FRN 15/10/2041	8,526,163	0.09
USD	4,523,000	SLM Private Education Loan Trust 2014-A ‘Series 2014-A B’ ‘144A’ 3.5% 15/11/2044	4,594,833	0.05
USD	3,817,000	SM Energy Co 1.5% 1/7/2021	3,610,790	0.04
USD	1,525,000	SM Energy Co 6.125% 15/11/2022	1,179,610	0.01
USD	2,334,000	SM Energy Co ‘144A’ 10% 15/1/2025*	2,310,660	0.02
USD	6,689,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B ‘Series 2015-B B’ ‘144A’ 3.5% 17/12/2040	6,875,456	0.07
USD	1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ‘Series 2015-C B’ ‘144A’ 3.5% 15/9/2043	2,001,969	0.02
USD	1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ‘Series 2020-A B’ ‘144A’ 3% 15/8/2045	1,820,905	0.02
USD	4,690,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-B ‘Series 2020-BA B’ ‘144A’ 2.76% 15/7/2053	4,650,145	0.05
USD	3,410,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A ‘Series 2020-PTA B’ ‘144A’ 2.5% 15/9/2054	3,427,442	0.04
USD	1,390,000	Sound Point CLO XI Ltd ‘Series 2016-1A CR’ ‘144A’ FRN 20/7/2028	1,351,689	0.01
USD	440,000	Sound Point Clo XIV Ltd ‘Series 2016-3A C’ ‘144A’ FRN 23/1/2029	435,792	0.00
USD	3,350,000	Sound Point Clo XV Ltd ‘Series 2017-1A C’ ‘144A’ FRN 23/1/2029	3,330,823	0.03
USD	36,825	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 ‘Series 2004- WMC1 M2’ FRN 25/1/2035	34,812	0.00
USD	2,839,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,942,822	0.03
USD	1,620,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	1,755,432	0.02

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	3,404,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	5,385,724	0.06
USD	545,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	685,130	0.01
USD	5,341,544	Springleaf Funding Trust 2017- A ‘Series 2017-AA A’ ‘144A’ 2.68% 15/7/2030	5,350,383	0.06
USD	1,794,000	Sprint Communications Inc 6% 15/11/2022	1,951,424	0.02
USD	4,558,000	Sprint Corp 7.125% 15/6/2024	5,286,551	0.05
USD	3,216,000	Sprint Corp 7.25% 15/9/2021	3,400,727	0.04
USD	2,135,000	Sprint Corp 7.625% 15/2/2025	2,560,666	0.03
USD	5,938,000	Sprint Corp 7.875% 15/9/2023	6,928,904	0.07
USD	722,500	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ‘144A’ 3.36% 20/9/2021	732,084	0.01
EUR	734,000	Standard Industries Inc/NJ 2.25% 21/11/2026	867,646	0.01
USD	1,604,000	Standard Industries Inc/NJ ‘144A’ 4.75% 15/1/2028	1,700,240	0.02
USD	447,000	Standard Industries Inc/NJ ‘144A’ 5% 15/2/2027	468,284	0.01
USD	9,686,000	Standard Industries Inc/NJ ‘144A’ 6% 15/10/2025	10,056,974	0.10
USD	2,605,000	Staples Inc ‘144A’ 7.5% 15/4/2026	2,320,612	0.02
USD	2,420,000	Starbucks Corp 3.5% 15/11/2050	2,545,698	0.03
USD	4,010,000	State of California 2.65% 1/4/2026	4,407,972	0.05
USD	2,285,000	State of California 7.3% 1/10/2039	3,787,627	0.04
USD	630,000	State of California 7.35% 1/11/2039	1,057,968	0.01
USD	1,500,000	State of California 7.5% 1/4/2034	2,504,752	0.03
USD	1,300,000	State of California 7.55% 1/4/2039	2,308,657	0.02
USD	1,650,000	State of California Department of Water Resources 1.16% 1/12/2027	1,677,340	0.02
USD	760,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	847,187	0.01
USD	475,000	State of Connecticut 5.85% 15/3/2032	657,576	0.01
USD	200,000	State of Hawaii 1.695% 1/8/2032	202,010	0.00
USD	4,225,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	5,448,518	0.06
USD	75,000	State of Mississippi 1.632% 1/11/2031	76,368	0.00
USD	230,000	State of Mississippi 1.732% 1/11/2032	234,344	0.00
USD	3,080,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	3,387,415	0.04
USD	3,095,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	3,919,276	0.04
USD	2,290,000	State of Washington 5% 1/8/2040	2,737,500	0.03
USD	330,000	Steele Creek Clo 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A A’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	324,521	0.00
USD	367,000	Stericycle Inc ‘144A’ 5.375% 15/7/2024	384,433	0.00
USD	410,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2031	337,083	0.00
USD	2,213,000	Strata CLO I Ltd FRN 15/1/2118	993,042	0.01
USD	575,000	Stratus CLO 2020-2 Ltd ‘Series 2020-2A D’ ‘144A’ FRN 15/10/2028	575,000	0.01
USD	1,324,484	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust ‘Series 2006-3 4A’ FRN 25/4/2036	1,128,642	0.01
USD	1,531,104	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006- AR2 ‘Series 2006-AR2 A1’ FRN 25/2/2036	1,339,411	0.01
USD	480,282	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006- AR5 ‘Series 2006-AR5 2A1’ FRN 25/5/2046	385,414	0.00
USD	10,966,876	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 ‘Series 2006-RF3 1A2’ ‘144A’ 6% 25/10/2036	7,337,337	0.08

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
EUR	1,560,000	Stryker Corp 0.25% 3/12/2024	1,862,538	0.02
EUR	2,483,000	Stryker Corp 1% 3/12/2031	2,997,485	0.03
USD	68,173	Sudbury Mill CLO Ltd ‘Series 2013-1A A1R’ ‘144A’ FRN 17/1/2026	67,995	0.00
USD	40,904	Sudbury Mill CLO Ltd ‘Series 2013-1A A2R’ ‘144A’ FRN 17/1/2026	40,730	0.00
USD	760,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	861,737	0.01
USD	557,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.875% 15/1/2023	566,722	0.01
USD	874,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.5% 15/2/2026	903,664	0.01
USD	3,011,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15/3/2028	3,164,742	0.03
USD	537,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6% 15/4/2027	566,417	0.01
USD	7,384,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	8,333,971	0.09
EUR	750,000	Sutton Park CLO 1X Ltd FRN 15/11/2031	876,840	0.01
USD	300,000	Symphony CLO XVIII Ltd ‘Series 2016-18A B’ ‘144A’ FRN 23/1/2028	297,309	0.00
USD	250,000	Symphony CLO XVIII Ltd ‘Series 2016-18A D’ ‘144A’ FRN 23/1/2028	235,456	0.00
USD	4,023,000	Talen Energy Supply LLC 6.5% 1/6/2025	2,815,678	0.03
USD	12,509,000	Talen Energy Supply LLC ‘144A’ 7.25% 15/5/2027	12,842,865	0.13
USD	2,966,000	Talen Energy Supply LLC ‘144A’ 10.5% 15/1/2026	2,388,831	0.02
USD	4,312,933	Talos Production LLC / Talos Production Finance Inc 11% 3/4/2022	4,011,028	0.04
USD	255,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5% 15/1/2028	261,797	0.00
USD	426,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.125% 1/2/2025	436,388	0.00
USD	297,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 1/2/2027	307,340	0.00
USD	340,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp ‘144A’ 5.5% 1/3/2030	357,320	0.00
USD	4,085,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15/4/2026	4,327,098	0.04
USD	870,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.5% 15/7/2027	945,255	0.01
USD	146,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.75% 15/3/2024	149,097	0.00
USD	463,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15/1/2029	511,326	0.01
USD	4,898,000	Taylor Morrison Communities Inc ‘144A’ 5.875% 15/6/2027	5,517,842	0.06
USD	3,820,000	TEGNA Inc ‘144A’ 4.625% 15/3/2028	3,858,200	0.04
USD	357,000	TEGNA Inc ‘144A’ 5% 15/9/2029	358,228	0.00
USD	281,000	Teleflex Inc 4.625% 15/11/2027	299,564	0.00
USD	534,000	Tempur Sealy International Inc 5.5% 15/6/2026	560,441	0.01
USD	1,053,000	Tenet Healthcare Corp 4.625% 15/7/2024	1,078,251	0.01
USD	5,189,000	Tenet Healthcare Corp ‘144A’ 4.625% 1/9/2024	5,359,926	0.06
USD	255,000	Tenet Healthcare Corp ‘144A’ 4.625% 15/6/2028	264,517	0.00
USD	7,551,000	Tenet Healthcare Corp ‘144A’ 4.875% 1/1/2026	7,879,922	0.08
USD	1,610,000	Tenet Healthcare Corp 5.125% 1/5/2025	1,656,288	0.02
USD	487,000	Tenet Healthcare Corp ‘144A’ 5.125% 1/11/2027	513,785	0.01
USD	1,740,000	Tenet Healthcare Corp ‘144A’ 6.25% 1/2/2027	1,833,777	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	820,000	Tennessee Housing Development Agency 3.75% 1/7/2038	904,952	0.01
USD	395,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	429,711	0.00
USD	310,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	335,113	0.00
USD	652,000	Terex Corp ‘144A’ 5.625% 1/2/2025	663,736	0.01
USD	1,700,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,896,460	0.02
USD	585,000	Texas Municipal Gas Acquisition and Supply Corp I 6.25% 15/12/2026	692,523	0.01
USD	1,125,000	Texas Transportation Commission 5% 1/4/2032	1,534,449	0.02
USD	592,866	Thacher Park CLO Ltd ‘Series 2014-1A AR’ ‘144A’ FRN 20/10/2026	591,890	0.01
USD	1,000,000	Thacher Park CLO Ltd ‘Series 2014-1A CR’ ‘144A’ FRN 20/10/2026	987,849	0.01
USD	1,410,000	Thacher Park CLO Ltd ‘Series 2014-1A D1R’ ‘144A’ FRN 20/10/2026	1,342,014	0.01
EUR	1,200,000	Thermo Fisher Scientific Inc 1.875% 1/10/2049	1,466,781	0.02
EUR	1,809,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2% 15/4/2025	2,343,779	0.02
USD	349,757	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-3 ‘Series 2007-3 4A1’ FRN 25/6/2047	326,972	0.00
USD	250,000	TIAA CLO II Ltd ‘Series 2017- 1A A’ ‘144A’ FRN 20/4/2029	249,984	0.00
USD	263,000	Tiaa Clo III Ltd ‘Series 2017-2A A’ ‘144A’ FRN 16/1/2031	260,824	0.00
USD	750,000	Tiaa Clo III Ltd ‘Series 2017-2A B’ ‘144A’ FRN 16/1/2031	734,677	0.01
USD	2,750,000	TICP CLO IX Ltd ‘Series 2017- 9A A’ ‘144A’ FRN 20/1/2031	2,743,244	0.03
USD	500,000	TICP CLO V 2016-1 Ltd ‘Series 2016-5A ER’ ‘144A’ FRN 17/7/2031	444,826	0.00
USD	500,000	TICP CLO XI Ltd ‘Series 2018- 11A A’ ‘144A’ FRN 20/10/2031	494,109	0.01
USD	750,000	TICP CLO XII Ltd ‘Series 2018- 12A A’ ‘144A’ FRN 15/1/2031	742,002	0.01
USD	115,000	T-Mobile USA Inc ‘144A’ 3.75% 15/4/2027	129,643	0.00
USD	10,853,000	T-Mobile USA Inc ‘144A’ 3.875% 15/4/2030	12,445,352	0.13
USD	1,765,000	T-Mobile USA Inc ‘144A’ 4.5% 15/4/2050	2,146,011	0.02
USD	3,495,000	Tobacco Settlement Finance Authority 7.467% 1/6/2047	3,690,021	0.04
USD	3,500,000	Tobacco Settlement Financing Corp/VA 6.706% 1/6/2046	3,625,352	0.04
USD	3,267,000	Toll Brothers Finance Corp 3.8% 1/11/2029	3,473,572	0.04
USD	3,924,000	Toll Brothers Finance Corp 4.375% 15/4/2023	4,154,123	0.04
USD	1,239,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025	1,373,611	0.01
USD	2,783,000	Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15/3/2027	3,134,883	0.03
USD	1,840,000	Treman Park CLO Ltd FRN 20/10/2028	1,717,192	0.02
USD	250,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A A1A’ ‘144A’ FRN 25/7/2029	249,922	0.00
USD	2,173,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 25/7/2029	2,167,649	0.02
USD	750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A C’ ‘144A’ FRN 25/7/2029	735,772	0.01
USD	351,000	TRESTLES CLO II Ltd ‘Series 2018-2A A2’ ‘144A’ FRN 25/7/2031	344,787	0.00
USD	390,000	TRESTLES CLO II Ltd ‘Series 2018-2A D’ ‘144A’ FRN 25/7/2031	345,729	0.00
USD	3,195,000	TRI Pointe Group Inc 5.25% 1/6/2027	3,449,003	0.04

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	167,000	TRI Pointe Group Inc 5.7% 15/6/2028	184,953	0.00
USD	11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 Ltd ‘Series 2006-1A A2’ ‘144A’ FRN 3/3/2039	714,762	0.01
USD	850,000	Tricon American Homes 2018- SFR1 Trust ‘Series 2018-SFR1 E’ ‘144A’ 4.564% 17/5/2037	903,288	0.01
USD	580,000	Tricon American Homes 2018- SFR1 Trust ‘Series 2018-SFR1 F’ ‘144A’ 4.96% 17/5/2037	615,513	0.01
USD	1,910,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,352,585	0.02
USD	56,781	Trinitas CLO II Ltd ‘Series 2014- 2A A1R’ ‘144A’ FRN 15/7/2026	56,740	0.00
USD	118,360	UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 2/7/2022	108,339	0.00
EUR	1,737,000	UGI International LLC 3.25% 1/11/2025	2,123,470	0.02
USD	195,000	Under Armour Inc 3.25% 15/6/2026	181,837	0.00
USD	1,541,100	United Airlines 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/8/2021	1,478,484	0.02
USD	1,309,000	United Airlines 2019-2 Class B Pass Through Trust 3.5% 1/5/2028	946,966	0.01
USD	2,468,000	United Rentals North America Inc 3.875% 15/11/2027	2,575,975	0.03
USD	667,000	United Rentals North America Inc 4.625% 15/10/2025	683,258	0.01
USD	3,342,000	United Rentals North America Inc 4.875% 15/1/2028	3,538,342	0.04
USD	243,000	United Rentals North America Inc 5.25% 15/1/2030	270,186	0.00
USD	1,493,000	United Rentals North America Inc 5.5% 15/5/2027	1,600,309	0.02
USD	1,493,000	United Rentals North America Inc 5.875% 15/9/2026	1,590,247	0.02
USD	48,520,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2024	52,168,324	0.54
USD	62,008,200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2025	66,507,164	0.68
USD	54,396,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2030	60,783,883	0.62
USD	277,210,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024	303,267,749	3.11
USD	56,341,300	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023*	61,561,018	0.63
USD	52,705,000	United States Treasury Note/ Bond 0.625% 15/5/2030*	52,289,125	0.54
USD	48,700,600	United States Treasury Note/ Bond 0.625% 15/8/2030	48,247,836	0.50
USD	15,484,500	United States Treasury Note/ Bond 1.125% 15/5/2040†	15,168,761	0.16
USD	143,414,600	United States Treasury Note/ Bond 1.5% 31/8/2021*	145,366,943	1.49
USD	95,418,900	United States Treasury Note/ Bond 1.5% 30/9/2021*	96,825,957	0.99
USD	39,031,800	United States Treasury Note/ Bond 1.625% 15/8/2029*	42,349,503	0.43
USD	43,511,000	United States Treasury Note/ Bond 1.75% 15/11/2029*	47,749,923	0.49
USD	10,043,200	United States Treasury Note/ Bond 2.25% 15/8/2049†	11,847,837	0.12
USD	31,898,500	United States Treasury Note/ Bond 2.375% 15/5/2029*	36,606,021	0.38
USD	14,761,300	United States Treasury Note/ Bond 2.375% 15/11/2049†	17,881,931	0.18
USD	567,700	United States Treasury Note/ Bond 3% 15/8/2048	767,637	0.01
USD	1,174,000	UnitedHealth Group Inc 2.9% 15/5/2050	1,234,615	0.01
USD	6,370,000	University of California 3.349% 1/7/2029	7,386,461	0.08
USD	975,000	University of California 4.601% 15/5/2031	1,194,239	0.01
USD	1,095,000	University of California 5.77% 15/5/2043	1,602,927	0.02
USD	2,385,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	2,899,051	0.03

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	164,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	181,184	0.00
USD	1,980,000	University of Vermont and State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,347,043	0.02
USD	2,290,000	University of Virginia 2.256% 1/9/2050	2,298,187	0.02
USD	810,000	US 2018-USDC ‘Series 2018- USDC E’ ‘144A’ FRN 13/5/2038	657,731	0.01
USD	1,300,000	US 2018-USDC ‘Series 2018- USDC F’ ‘144A’ FRN 13/5/2038	970,697	0.01
USD	1,920,592	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	1,589,696	0.02
USD	624,181	US Airways 2013-1 Class B Pass Through Trust 5.375% 15/11/2021	503,088	0.01
EUR	1,685,000	US Bancorp 0.85% 7/6/2024	2,064,965	0.02
USD	340,000	US Concrete Inc 6.375% 1/6/2024	352,107	0.00
USD	170,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘Series 2016-2 M2’ FRN 25/10/2046	170,546	0.00
USD	710,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘Series 2016-2 M3’ FRN 25/10/2046	715,463	0.01
USD	310,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2016-2 ‘Series 2016-2 M4’ FRN 25/10/2046	314,609	0.00
USD	330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ‘Series 2017-1 M2’ ‘144A’ FRN 25/5/2047	327,968	0.00
USD	330,000	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-1 ‘Series 2017-1 M3’ ‘144A’ FRN 25/5/2047	324,694	0.00
USD	1,683,933	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ‘Series 2017-2 M3’ ‘144A’ FRN 25/11/2047	1,554,093	0.02
USD	280,756	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 ‘Series 2017-2 M4’ ‘144A’ FRN 25/11/2047	238,698	0.00
USD	306,975	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 ‘Series 2018-1 M2’ ‘144A’ 4.26% 25/4/2048	314,765	0.00
USD	2,214,000	Verizon Communications Inc 4% 22/3/2050*	2,757,634	0.03
USD	2,612,000	Vertical US Newco Inc ‘144A’ 5.25% 15/7/2027	2,723,010	0.03
USD	1,254,000	Vibrant Clo VII Ltd ‘Series 2017-7A A1’ ‘144A’ FRN 15/9/2030	1,245,794	0.01
USD	14,479,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ‘144A’ 3.5% 15/2/2025	14,493,407	0.15
USD	2,582,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ‘144A’ 3.75% 15/2/2027	2,577,559	0.03
USD	3,086,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ‘144A’ 4.125% 15/8/2030	3,093,715	0.03
USD	7,943,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ‘144A’ 4.25% 1/12/2026	8,134,228	0.08
USD	4,650,000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc ‘144A’ 4.625% 1/12/2029	4,864,039	0.05
USD	2,420,000	Virginia College Building Authority 1.965% 1/2/2032	2,453,565	0.03
USD	13,491,000	Vistra Operations Co LLC ‘144A’ 3.55% 15/7/2024	14,286,293	0.15
USD	5,190,000	Vistra Operations Co LLC ‘144A’ 5% 31/7/2027	5,528,803	0.06
USD	2,099,000	Vistra Operations Co LLC ‘144A’ 5.5% 1/9/2026	2,201,326	0.02
USD	1,223,000	Vistra Operations Co LLC ‘144A’ 5.625% 15/2/2027	1,295,108	0.01
USD	450,000	VNDO 2013-PENN Mortgage Trust ‘Series 2013-PENN D’ ‘144A’ FRN 13/12/2029	446,478	0.00
USD	880,000	Volkswagen Group of America Finance LLC ‘144A’ 3.35% 13/5/2025	967,664	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,855,000	Voya CLO 2013-2 Ltd ‘Series 2013-2A A1R’ ‘144A’ FRN 25/4/2031	1,833,663	0.02
USD	270,000	Voya CLO 2014-3 Ltd ‘Series 2014-3A CR’ ‘144A’ FRN 25/7/2026	237,072	0.00
USD	750,000	Voya CLO 2015-2 Ltd ‘Series 2015-2A BR’ ‘144A’ FRN 23/7/2027	735,586	0.01
USD	665,000	Voya CLO 2017-3 Ltd ‘Series 2017-3A A1A’ ‘144A’ FRN 20/7/2030	665,431	0.01
USD	3,500,000	Voya Clo 2017-4 Ltd ‘Series 2017-4A A1’ ‘144A’ FRN 15/10/2030	3,492,221	0.04
EUR	422,000	Voya Euro CLO I DAC FRN 15/10/2030	341,190	0.00
USD	15,861,624	Voyager OPTONE Delaware Trust ‘Series 2009-1 SAA7’ ‘144A’ FRN 25/2/2038	5,636,467	0.06
USD	1,701,567	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust ‘Series 2007-HE2A A’ ‘144A’ FRN 25/7/2037	1,523,561	0.02
USD	7,595,410	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust ‘Series 2006-AR3 A1B’ FRN 25/2/2046	6,948,707	0.07
USD	576,126	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust ‘Series 2007-OA5 1A’ FRN 25/6/2047	528,942	0.01
USD	955,611	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust ‘Series 2006-1 4CB’ 6.5% 25/2/2036	833,062	0.01
USD	4,926,106	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust ‘Series 2006-4 1A1’ 6% 25/4/2036	4,942,124	0.05
USD	317,523	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) ‘Series 2006-4 3A5’ 6.35% 25/5/2036	296,780	0.00
USD	1,389,032	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust (Step-up coupon) ‘Series 2006-4 3A1’ 6.5% 25/5/2036	1,298,134	0.01
USD	4,659,961	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust (Step-up coupon) ‘Series 2006-9 A7’ 4.568% 25/10/2036	2,037,958	0.02
USD	4,464,664	Washington Mutural Asset- Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust ‘Series 2006-HE4 2A2’ FRN 25/9/2036	2,044,777	0.02
USD	3,491,503	Washington Mutural Asset- Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust ‘Series 2006-HE5 1A’ FRN 25/10/2036	2,860,414	0.03
USD	2,355,000	Waste Management Inc 3.15% 15/11/2027	2,620,296	0.03
USD	3,208,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6% 1/2/2023	3,211,673	0.03
USD	1,738,000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6.625% 15/8/2025	1,796,475	0.02
USD	9,789,000	Wells Fargo & Co FRN 30/4/2041	10,286,204	0.11
USD	1,268,117	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 ‘Series 2015-C27 C’ 3.894% 15/2/2048	1,165,073	0.01
USD	572,513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 ‘Series 2015-NXS4 B’ FRN 15/12/2048	604,615	0.01
USD	458,011	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-P2 ‘Series 2015-P2 D’ ‘144A’ 3.241% 15/12/2048	357,036	0.00
USD	2,633,561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 ‘Series 2016-BNK1 XD’ ‘144A’ FRN 15/8/2049	164,387	0.00
USD	448,469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 ‘Series 2016-NXS5 B’ FRN 15/1/2059	507,027	0.01
USD	949,418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 ‘Series 2016-NXS5 C’ FRN 15/1/2059	1,027,175	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,770,974	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 ‘Series 2017-C39 D’ ‘144A’ FRN 15/9/2050	1,422,948	0.01
USD	1,851,126	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 ‘Series 2017-C39 C’ 4.118% 15/9/2050	1,870,685	0.02
USD	1,431,283	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 ‘Series 2017-C41 C’ FRN 15/11/2050	1,308,548	0.01
USD	1,356,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB ‘Series 2017-HSDB A’ ‘144A’ FRN 13/12/2031	1,307,084	0.01
USD	1,420,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 ‘Series 2018-1745 A’ ‘144A’ FRN 15/6/2036	1,582,660	0.02
USD	697,273	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-BXI ‘Series 2018-BXI E’ ‘144A’ FRN 15/12/2036	663,211	0.01
USD	316,791	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 ‘Series 2018-C44 D’ ‘144A’ 3% 15/5/2051	251,996	0.00
USD	467,552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 ‘Series 2018-C45 C’ 4.727% 15/6/2051	442,633	0.00
USD	410,000	WESCO Distribution Inc 5.375% 15/12/2021	411,958	0.00
USD	650,000	WESCO Distribution Inc ‘144A’ 7.125% 15/6/2025	718,396	0.01
USD	1,119,000	Wesleyan University 4.781% 1/7/2116	1,402,289	0.01
USD	320,000	West CLO 2013-1 Ltd ‘Series 2013-1A C’ ‘144A’ FRN 7/11/2025	307,223	0.00
USD	5,680,000	Western Digital Corp 1.5% 1/2/2024	5,537,307	0.06
USD	1,625,000	Western Digital Corp 4.75% 15/2/2026	1,761,094	0.02
USD	1,929,000	Western Midstream Operating LP FRN 13/1/2023	1,833,188	0.02
USD	343,508	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 ‘Series 2012- C8 C’ FRN 15/8/2045	343,268	0.00
USD	496,178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 ‘Series 2014-C24 B’ FRN 15/11/2047	472,204	0.01
USD	250,000	William Carter Co/The ‘144A’ 5.5% 15/5/2025	267,656	0.00
USD	285,000	William Carter Co/The ‘144A’ 5.625% 15/3/2027	303,868	0.00
USD	2,522,000	William Lyon Homes Inc 6% 1/9/2023	2,590,573	0.03
USD	512,000	William Lyon Homes Inc ‘144A’ 6.625% 15/7/2027	555,361	0.01
EUR	1,355,000	WMG Acquisition Corp 3.625% 15/10/2026	1,680,719	0.02
USD	225,000	WPX Energy Inc 5.25% 15/9/2024	230,340	0.00
USD	278,000	WPX Energy Inc 5.875% 15/6/2028	283,218	0.00
USD	398,000	WPX Energy Inc 8.25% 1/8/2023	448,011	0.00
USD	540,000	Wyndham Destinations Inc ‘144A’ 6.625% 31/7/2026	576,450	0.01
USD	772,000	Wyndham Hotels & Resorts Inc ‘144A’ 5.375% 15/4/2026	804,328	0.01
USD	850,000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp ‘144A’ 5.25% 15/5/2027	827,666	0.01
USD	1,702,000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp ‘144A’ 5.5% 1/3/2025	1,679,661	0.02
USD	3,771,000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp ‘144A’ 5.125% 1/10/2029	3,672,011	0.04
USD	2,856,000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp ‘144A’ 7.75% 15/4/2025	2,991,560	0.03
USD	739,000	Xerox Corp 4.07% 17/3/2022	754,530	0.01
USD	735,000	Xerox Corp 4.5% 15/5/2021	751,181	0.01
USD	4,600,000	Xerox Holdings Corp ‘144A’ 5% 15/8/2025	4,666,125	0.05
USD	1,750,000	Xerox Holdings Corp ‘144A’ 5.5% 15/8/2028	1,798,125	0.02
USD	128,000	XPO Logistics Inc ‘144A’ 6.125% 1/9/2023	130,480	0.00
USD	576,000	XPO Logistics Inc ‘144A’ 6.75% 15/8/2024	613,930	0.01

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

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,755,000	Yale University 1.482% 15/4/2030	2,800,009	0.03
USD	1,000,000	York CLO 1 Ltd ‘Series 2014-1A BRR’ ‘144A’ FRN 22/10/2029	988,614	0.01
USD	250,000	York CLO 1 Ltd ‘Series 2014-1A DRR’ ‘144A’ FRN 22/10/2029	235,773	0.00
USD	250,000	York CLO-2 Ltd ‘Series 2015-1A AR’ ‘144A’ FRN 22/1/2031	249,007	0.00
USD	960,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A AR’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	948,615	0.01
USD	5,995,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A BR’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	5,922,867	0.06
USD	4,240,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A DR’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	4,134,093	0.04
USD	1,520,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A ER’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	1,323,417	0.01
USD	730,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A FR’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	518,873	0.01
USD	3,180,000	York Clo-3 Ltd ‘Series 2016-1A SUB’ ‘144A’ FRN 20/10/2029	1,410,518	0.01
USD	2,010,000	York Clo-4 Ltd ‘Series 2016-2A SUB’ ‘144A’ FRN 20/4/2032	1,286,884	0.01
USD	465,000	Yum! Brands Inc ‘144A’ 4.75% 15/1/2030	511,553	0.01
			4,807,319,245	49.32
		ウルグアイ		
USD	4,483,954	Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	5,221,004	0.06
USD	169,793	Uruguay Government International Bond 4.975% 20/4/2055	233,572	0.00
			5,454,576	0.06
		ベトナム		
USD	4,473,000	No Va Land Investment Group Corp 5.5% 27/4/2023	4,497,378	0.05
債券合計			8,612,259,935	88.36
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計			8,820,685,417	90.50

その他の譲渡可能な有価証券

保有高		銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
債券				
		バミューダ		
USD	8,777	Digicel Group Two Ltd 9.125% 1/4/2024	—	0.00
		米国		
USD	1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series ‘2003-MH1 B2’ ‘144A’ 15/8/2030 (Zero Coupon)**	990,209	0.01
USD	12,127,675	American Airlines Pass Through Certificate 3.5% 15/12/2027**	10,823,950	0.11
USD	2,035,000	American Airlines Pass Through Certificate 4% 15/12/2025**	1,760,275	0.02
USD	10,453,000	American Airlines Pass Through Certificate ‘2019-1C’ 4% 15/6/2022**	8,872,506	0.09
USD	2,391	Lehman Brothers Holdings Inc 31/12/2049 (Zero Coupon)**	11	0.00
USD	2,391	Lehman Brothers Special Finance 31/12/2049 (Zero Coupon)**	—	0.00
USD	1,480,000	Sun Country 4.7% 15/12/2025**	1,211,824	0.01
USD	1,480,000	Sun Country 7% 15/12/2023**	1,198,800	0.01
USD	3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 4/2/2018 (Zero Coupon)	—	0.00
USD	7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 1/5/2018 (Zero Coupon)	—	0.00
USD	3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	—	0.00
USD	630,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 16/6/2018 (Zero Coupon)	—	0.00
USD	10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow (Defaulted) 6/11/2018 (Zero Coupon)	—	0.00
			24,857,575	0.25
債券合計			24,857,575	0.25
その他の譲渡可能な有価証券合計			24,857,575	0.25
投資有価証券合計			8,845,542,992	90.75
その他の純資産			901,396,340	9.25
純資産合計（米ドル）			9,746,939,332	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

** 注記２(j)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

事後通告証券契約　2020年８月31日現在

保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
ＴＢＡ			
	米国		
USD (51,194,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ‘2 9/20’ 2% TBA	(52,697,821)	(0.54)
USD (22,616,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ‘2.5 9/20’ 2.5% TBA	(23,768,002)	(0.25)
USD (89,936,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ‘3 10/20’ 3% TBA	(94,719,615)	(0.97)
USD (784,600,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ‘3 11/20’ 3% TBA	(825,551,059)	(8.47)
USD 124,524,000	Fannie Mae or Freddie Mac ‘3 9/20’ 3% TBA	131,343,631	1.35
USD (793,066,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ‘3.5 9/20’ 3.5% TBA	(836,622,652)	(8.58)
USD 544,161,000	Fannie Mae or Freddie Mac ‘4 10/20’ 4% TBA	580,626,154	5.96
USD 229,521,000	Fannie Mae or Freddie Mac ‘4.5 9/20’ 4.5% TBA	248,030,595	2.54
ＴＢＡ合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－2,793,359,529米ドル）		(873,358,769)	(8.96)

事後通告（以下「ＴＢＡ」という。）契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。
添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
BRL	158,675,474	USD	29,224,333	Citibank	2/9/2020	(237,752)
BRL	39,893,730	USD	7,698,000	Bank of America	2/9/2020	(410,278)
BRL	21,644,228	USD	3,853,000	Barclays	2/9/2020	100,933
BRL	5,969,880	USD	1,104,000	Goldman Sachs	2/9/2020	(13,432)
USD	4,163,600	BRL	22,179,497	Citibank	2/9/2020	111,885
USD	3,788,000	BRL	20,109,432	BNP Paribas	2/9/2020	114,441
USD	899,000	BRL	4,658,933	Bank of America	2/9/2020	47,914
USD	7,692,000	BRL	42,490,608	UBS	2/9/2020	(70,116)
AUD	29,415,000	USD	21,587,724	HSBC Bank Plc	3/9/2020	80,579
EUR	51,662,000	USD	61,661,774	JP Morgan	3/9/2020	(44,399)
GBP	153,476,000	USD	204,276,556	Bank of America	3/9/2020	170,307
IDR	657,956,500,000	USD	45,251,479	JP Morgan	3/9/2020	(72,945)
USD	21,387,367	AUD	29,958,000	HSBC Bank Plc	3/9/2020	(680,933)
USD	1,294,707	EUR	1,100,000	Morgan Stanley	3/9/2020	(17,265)
USD	4,756,918	EUR	4,036,000	State Street	3/9/2020	(56,827)
USD	1,270,221,007	EUR	1,073,539,000	UBS	3/9/2020	(10,191,192)
USD	17,645,510	EUR	14,926,000	HSBC Bank Plc	3/9/2020	(156,762)
USD	16,892,163	EUR	14,285,000	Citibank	3/9/2020	(145,586)
USD	202,487,620	GBP	154,025,000	State Street	3/9/2020	(2,690,571)
USD	9,761,125	IDR	144,464,655,000	Standard Chartered Bank	3/9/2020	(158,529)
USD	34,734,359	IDR	513,491,845,000	Bank of America	3/9/2020	(524,521)
USD	61,097,441	JPY	6,413,264,000	BNP Paribas	3/9/2020	634,054
AUD	10,651,994	USD	7,704,300	JP Morgan	10/9/2020	142,615
AUD	5,242,918	USD	3,852,150	Goldman Sachs	10/9/2020	10,106
CAD	5,028,061	USD	3,852,150	HSBC Bank Plc	10/9/2020	(1,040)
CAD	10,128,520	USD	7,704,300	JP Morgan	10/9/2020	53,371
EUR	3,232,485	USD	3,852,150	Goldman Sachs	10/9/2020	3,828
EUR	6,533,220	USD	7,704,300	JP Morgan	10/9/2020	89,071
GBP	2,892,473	USD	3,852,150	Goldman Sachs	10/9/2020	1,137
GBP	5,840,719	USD	7,704,300	JP Morgan	10/9/2020	76,574
USD	11,556,450	AUD	15,717,715	Goldman Sachs	10/9/2020	(22,187)
USD	11,556,450	CAD	15,142,622	BNP Paribas	10/9/2020	(41,640)
USD	11,556,450	EUR	9,710,375	Goldman Sachs	10/9/2020	(26,896)
USD	11,556,450	GBP	8,658,324	Citibank	10/9/2020	22,027
USD	443,350,908	JPY	47,300,000,000	Bank of America	14/9/2020	(2,653,824)
EUR	1,359,600	USD	1,624,262	ANZ	15/9/2020	(2,242)
IDR	90,000,000,000	USD	6,107,950	Bank of America	15/9/2020	66,076
JPY	290,000,000	USD	2,716,584	Morgan Stanley	15/9/2020	17,943
JPY	203,000,000	USD	1,862,628	Citibank	15/9/2020	51,541
MYR	44,200,000	USD	10,561,529	State Street	15/9/2020	51,109
USD	72,998,301	CNH	511,255,943	Citibank	15/9/2020	(1,571,444)
USD	1,121,526	CNH	8,040,107	Goldman Sachs	15/9/2020	(51,172)
USD	9,262,431	EUR	8,239,006	Bank of America	15/9/2020	(566,812)

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
USD	12,075,523	HKD	93,695,000	Bank of America	15/9/2020	(12,835)
USD	10,178,518	HKD	78,991,408	Morgan Stanley	15/9/2020	(12,810)
USD	6,852,512	IDR	100,272,802,660	Bank of America	15/9/2020	(26,232)
USD	9,076,291	IDR	133,214,770,976	Goldman Sachs	15/9/2020	(62,281)
USD	254,572	IDR	3,736,094,060	JP Morgan	15/9/2020	(1,725)
USD	1,023,859	IDR	15,026,157,625	HSBC Bank Plc	15/9/2020	(6,940)
USD	853,986	JPY	90,225,000	BNP Paribas	15/9/2020	3,218
USD	8,925,188	JPY	969,370,000	Goldman Sachs	15/9/2020	(215,393)
USD	8,925,902	JPY	969,366,368	Morgan Stanley	15/9/2020	(214,645)
USD	2,312,121	TWD	68,575,206	Bank of America	15/9/2020	(25,917)
AUD	1,097,199	EUR	662,700	Citibank	16/9/2020	17,657
AUD	5,470,147	EUR	3,313,000	BNP Paribas	16/9/2020	77,204
AUD	17,972,605	EUR	11,045,000	JP Morgan	16/9/2020	62,923
AUD	2,208,556	JPY	170,801,107	Citibank	16/9/2020	16,422
AUD	1,325,000	JPY	100,462,295	UBS	16/9/2020	28,787
AUD	3,322,000	JPY	251,227,135	Goldman Sachs	16/9/2020	78,293
AUD	39,458,878	JPY	2,890,352,159	HSBC Bank Plc	16/9/2020	1,813,857
AUD	39,429,690	JPY	2,992,651,960	Morgan Stanley	16/9/2020	827,716
AUD	14,358,000	NZD	15,738,625	Morgan Stanley	16/9/2020	(18,693)
AUD	3,978,824	USD	2,871,347	Citibank	16/9/2020	59,769
AUD	16,536,000	USD	11,780,077	JP Morgan	16/9/2020	401,646
AUD	5,381,000	USD	3,848,916	UBS	16/9/2020	115,153
AUD	4,218,000	USD	2,976,250	Royal Bank of Canada	16/9/2020	131,061
AUD	6,958,000	USD	4,890,951	Bank of America	16/9/2020	234,862
AUD	1,113,000	USD	794,708	Goldman Sachs	16/9/2020	25,216
AUD	4,348,000	USD	3,005,011	Morgan Stanley	16/9/2020	198,070
BRL	38,972,462	USD	7,420,110	Citibank	16/9/2020	(304,169)
BRL	5,257,968	USD	962,203	JP Morgan	16/9/2020	(2,156)
BRL	7,048,209	USD	1,325,000	UBS	16/9/2020	(38,075)
CAD	5,522,000	JPY	436,300,619	Morgan Stanley	16/9/2020	115,396
CAD	9,940,000	JPY	801,864,770	JP Morgan	16/9/2020	52,208
CAD	9,718,389	NZD	11,044,000	JP Morgan	16/9/2020	8,375
CAD	5,936,725	USD	4,434,000	Bank of America	16/9/2020	113,160
CAD	2,669,912	USD	2,000,000	Royal Bank of Canada	16/9/2020	44,986
CAD	2,369,802	USD	1,766,933	Deutsche Bank	16/9/2020	48,187
CAD	7,928,278	USD	5,964,067	JP Morgan	16/9/2020	108,498
CAD	6,001,293	USD	4,434,000	HSBC Bank Plc	16/9/2020	162,615
CAD	7,497,664	USD	5,533,000	BNP Paribas	16/9/2020	209,741
CAD	6,037,641	USD	4,435,000	Toronto Dominion	16/9/2020	189,455
CLP	2,039,735,000	USD	2,535,943	Goldman Sachs	16/9/2020	93,396
CNH	65,483,875	USD	9,391,947	Bank of America	16/9/2020	158,488

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
CNH	279,811,763	USD	39,835,904	HSBC Bank Plc	16/9/2020	972,988
CNH	51,270,000	USD	7,303,107	Deutsche Bank	16/9/2020	174,320
CNH	118,180,582	USD	16,868,000	Morgan Stanley	16/9/2020	367,939
CNH	120,800,000	USD	17,170,967	Citibank	16/9/2020	446,999
CNH	47,690,000	USD	6,772,339	BNP Paribas	16/9/2020	182,965
CNH	49,750,000	USD	7,243,212	Barclays	16/9/2020	12,532
COP	24,940,965,000	USD	6,635,000	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(13,976)
COP	25,262,996,313	USD	6,721,967	Citibank	16/9/2020	(15,453)
COP	2,158,108,167	USD	571,338	BNP Paribas	16/9/2020	1,570
EUR	663,000	AUD	1,089,750	Citibank	16/9/2020	(11,811)
EUR	21,379,391	AUD	35,013,473	Morgan Stanley	16/9/2020	(287,239)
EUR	5,082,000	AUD	8,315,176	Bank of America	16/9/2020	(62,591)
EUR	18,300,000	GBP	16,458,876	BNP Paribas	16/9/2020	(94,479)
EUR	6,160,000	GBP	5,526,351	Citibank	16/9/2020	(13,279)
EUR	6,150,000	GBP	5,489,041	HSBC Bank Plc	16/9/2020	24,496
EUR	3,790,000	NOK	40,361,427	Deutsche Bank	16/9/2020	(93,364)
EUR	2,664,000	NOK	28,717,094	Bank of America	16/9/2020	(105,297)
EUR	4,418,000	NOK	47,406,097	Morgan Stanley	16/9/2020	(149,632)
EUR	7,731,000	NOK	82,306,159	Citibank	16/9/2020	(187,616)
EUR	4,558,000	NOK	48,688,247	JP Morgan	16/9/2020	(129,210)
EUR	3,335,000	USD	3,741,818	Standard Chartered Bank	16/9/2020	236,967
EUR	78,722,157	USD	90,573,619	Morgan Stanley	16/9/2020	3,344,995
EUR	15,896,000	USD	18,310,571	Credit Suisse	16/9/2020	653,979
EUR	23,935,000	USD	27,279,888	RBS Plc	16/9/2020	1,275,503
EUR	34,841,000	USD	41,192,334	Deutsche Bank	16/9/2020	374,342
EUR	5,820,000	USD	6,870,944	UBS	16/9/2020	72,544
EUR	52,128,657	USD	60,865,579	Bank of America	16/9/2020	1,325,949
EUR	1,077,918	USD	1,273,630	Royal Bank of Canada	16/9/2020	12,368
EUR	42,232,152	USD	49,005,621	JP Morgan	16/9/2020	1,378,990
EUR	31,934,161	USD	37,382,340	BNP Paribas	16/9/2020	716,366
EUR	1,080,000	USD	1,211,342	State Street	16/9/2020	77,140
EUR	47,025,588	USD	54,476,306	Citibank	16/9/2020	1,627,062
EUR	57,005,000	USD	66,865,326	Barclays	16/9/2020	1,143,869
EUR	33,305,000	USD	39,264,930	Goldman Sachs	16/9/2020	469,238
GBP	16,611,655	EUR	18,540,000	BNP Paribas	16/9/2020	11,688
GBP	5,613,011	EUR	6,240,000	Royal Bank of Canada	16/9/2020	33,287
GBP	5,245,805	EUR	5,830,000	State Street	16/9/2020	33,228
GBP	8,724,863	EUR	9,684,507	JP Morgan	16/9/2020	69,575
GBP	83,861,988	USD	108,660,036	Citibank	16/9/2020	3,063,868
GBP	33,410,800	USD	42,206,377	Goldman Sachs	16/9/2020	2,304,672
GBP	24,396,857	USD	31,938,276	Deutsche Bank	16/9/2020	564,078
GBP	37,801,112	USD	48,052,746	HSBC Bank Plc	16/9/2020	2,307,232
GBP	11,050,000	USD	14,442,074	Barclays	16/9/2020	279,127
GBP	340,453	USD	435,527	Standard Chartered Bank	16/9/2020	18,036

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
GBP	2,729,932	USD	3,559,239	Bank of America	16/9/2020	77,673
GBP	10,482,858	USD	13,807,864	BNP Paribas	16/9/2020	157,770
IDR	114,350,000,000	USD	7,790,020	Bank of America	16/9/2020	53,872
IDR	52,490,000,000	USD	3,590,287	BNP Paribas	16/9/2020	10,289
IDR	52,490,000,000	USD	3,587,833	Barclays	16/9/2020	12,743
IDR	28,359,675,653	USD	1,937,825	Deutsche Bank	16/9/2020	7,520
IDR	48,330,000,000	USD	3,311,635	HSBC Bank Plc	16/9/2020	3,584
INR	1,386,334,542	USD	18,483,397	BNY Mellon	16/9/2020	342,038
INR	583,949,000	USD	7,805,843	Barclays	16/9/2020	123,767
INR	230,351,000	USD	3,067,461	BNP Paribas	16/9/2020	60,541
INR	1,194,000,000	USD	16,015,047	Bank of America	16/9/2020	198,622
INR	131,400,000	USD	1,714,957	Deutsche Bank	16/9/2020	69,361
INR	678,375,000	USD	8,897,570	JP Morgan	16/9/2020	314,279
INR	356,525,000	USD	4,674,512	Citibank	16/9/2020	166,844
INR	525,610,000	USD	7,056,115	ANZ	16/9/2020	81,294
JPY	34,171,052	AUD	460,553	Deutsche Bank	16/9/2020	(17,063)
JPY	7,123,935,073	AUD	95,702,515	Bank of America	16/9/2020	(3,326,655)
JPY	202,998,029	AUD	2,650,000	JP Morgan	16/9/2020	(38,023)
JPY	118,538,116	AUD	1,555,000	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(27,777)
JPY	133,905,910	AUD	1,767,000	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(39,042)
JPY	438,398,206	CAD	5,522,000	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(95,616)
JPY	805,037,173	CAD	9,940,000	Morgan Stanley	16/9/2020	(22,294)
JPY	80,856,775	NZD	1,135,000	JP Morgan	16/9/2020	(1,690)
JPY	61,602,954	NZD	884,000	Deutsche Bank	16/9/2020	(14,260)
JPY	91,482,293	NZD	1,325,000	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(29,413)
JPY	106,894,509	NZD	1,555,000	Standard Chartered Bank	16/9/2020	(38,929)
JPY	123,980,636	NZD	1,767,000	BNP Paribas	16/9/2020	(20,542)
JPY	2,778,806,658	USD	26,018,838	Bank of America	16/9/2020	184,009
JPY	529,431,312	USD	4,983,000	BNP Paribas	16/9/2020	9,289
JPY	910,103,985	USD	8,505,000	JP Morgan	16/9/2020	76,855
JPY	236,925,060	USD	2,220,000	Standard Chartered Bank	16/9/2020	14,093
JPY	176,000,000	USD	1,646,394	RBS Plc	16/9/2020	13,204
JPY	1,239,265,152	USD	11,622,204	Royal Bank of Canada	16/9/2020	63,487
JPY	232,119,290	USD	2,209,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(20,224)
MYR	29,950,000	USD	7,009,472	Morgan Stanley	16/9/2020	181,757
NOK	77,196,804	EUR	7,288,000	Citibank	16/9/2020	131,922
NOK	24,595,385	EUR	2,333,000	Toronto Dominion	16/9/2020	28,910
NOK	35,184,203	EUR	3,335,000	RBS Plc	16/9/2020	44,225
NOK	40,521,438	EUR	3,785,000	BNP Paribas	16/9/2020	117,625
NOK	11,998,886	EUR	1,104,000	Bank of America	16/9/2020	54,854
NZD	15,651,512	AUD	14,358,000	JP Morgan	16/9/2020	(39,956)
NZD	884,000	JPY	61,679,862	Royal Bank of Canada	16/9/2020	13,535
NZD	1,560,000	JPY	109,406,076	RBS Plc	16/9/2020	18,612

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
NZD	1,767,000	JPY	123,301,436	Deutsche Bank	16/9/2020	26,946
NZD	1,555,000	JPY	106,443,466	Standard Chartered Bank	16/9/2020	43,182
NZD	1,325,000	JPY	91,184,247	ANZ	16/9/2020	32,223
RUB	2,985,318,540	USD	40,683,000	JP Morgan	16/9/2020	(540,596)
RUB	1,217,953,200	USD	16,261,000	Bank of America	16/9/2020	116,339
RUB	146,359,304	USD	2,071,318	BNP Paribas	16/9/2020	(103,282)
SGD	3,815,000	USD	2,738,104	Deutsche Bank	16/9/2020	65,431
TWD	163,300,000	USD	5,604,943	Barclays	16/9/2020	(37,145)
USD	6,483,581	AUD	9,127,667	Deutsche Bank	16/9/2020	(240,579)
USD	2,392,334	AUD	3,313,000	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(48,284)
USD	797,104	AUD	1,113,333	Citibank	16/9/2020	(23,065)
USD	2,363,524	AUD	3,340,000	JP Morgan	16/9/2020	(96,984)
USD	3,188,587	AUD	4,438,824	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(81,401)
USD	323,159	AUD	445,000	Bank of America	16/9/2020	(4,664)
USD	3,080,612	AUD	4,425,000	Morgan Stanley	16/9/2020	(179,192)
USD	2,394,292	AUD	3,313,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(46,326)
USD	1,326,733	BRL	7,174,309	Bank of America	16/9/2020	16,784
USD	2,209,000	CAD	2,932,459	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(37,080)
USD	2,000,000	CAD	2,666,402	JP Morgan	16/9/2020	(42,297)
USD	3,313,000	CAD	4,431,800	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(81,482)
USD	2,228,000	CAD	2,976,407	Goldman Sachs	16/9/2020	(51,742)
USD	2,210,000	CAD	2,983,098	Deutsche Bank	16/9/2020	(74,866)
USD	2,225,000	CAD	3,009,753	Bank of America	16/9/2020	(80,283)
USD	6,635,000	CAD	9,037,696	Citibank	16/9/2020	(287,310)
USD	3,313,000	CAD	4,506,757	RBS Plc	16/9/2020	(138,894)
USD	2,225,000	CAD	3,038,839	Toronto Dominion	16/9/2020	(102,560)
USD	2,656,562	CLP	2,039,735,000	Goldman Sachs	16/9/2020	27,224
USD	105,205,849	CNH	743,848,157	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(3,280,008)
USD	26,003,960	CNH	184,941,000	Standard Chartered Bank	16/9/2020	(968,591)
USD	16,046,462	CNH	110,980,000	Societe Generale	16/9/2020	(139,315)
USD	33,004,794	CNH	233,921,125	JP Morgan	16/9/2020	(1,111,220)
USD	14,618,174	CNH	102,952,000	BNP Paribas	16/9/2020	(396,766)
USD	1,661,792	CNH	11,511,396	Bank of America	16/9/2020	(17,078)
USD	8,843,006	CNH	62,080,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(210,995)
USD	14,968,912	CNH	104,915,240	Deutsche Bank	16/9/2020	(332,357)
USD	21,867,147	CNH	153,372,000	Citibank	16/9/2020	(501,253)
USD	28,418,000	CNH	198,997,045	Morgan Stanley	16/9/2020	(604,543)
USD	12,707,625	CNH	89,143,000	Barclays	16/9/2020	(293,354)
USD	15,805,821	COP	58,008,751,567	Barclays	16/9/2020	406,361
USD	7,706,000	COP	29,358,545,000	Citibank	16/9/2020	(87,750)
USD	15,975,306	EUR	13,694,763	Morgan Stanley	16/9/2020	(363,082)
USD	7,480,050	EUR	6,644,000	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(446,503)
USD	43,462,860	EUR	37,995,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(1,866,661)
USD	10,128,943	EUR	8,865,000	State Street	16/9/2020	(447,349)

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
USD	4,777,820	EUR	4,121,902	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(139,770)
USD	90,343,719	EUR	80,110,515	JP Morgan	16/9/2020	(5,231,261)
USD	2,513,199	EUR	2,225,000	Standard Chartered Bank	16/9/2020	(141,313)
USD	35,416,680	EUR	29,976,000	UBS	16/9/2020	(345,861)
USD	21,911,651	EUR	19,025,232	RBS Plc	16/9/2020	(786,195)
USD	86,471,888	EUR	73,850,000	Barclays	16/9/2020	(1,634,052)
USD	62,295,480	EUR	52,620,000	Citibank	16/9/2020	(482,238)
USD	49,178,616	EUR	41,882,902	BNP Paribas	16/9/2020	(789,324)
USD	26,598,998	EUR	22,499,752	Deutsche Bank	16/9/2020	(244,086)
USD	131,808,306	EUR	112,577,048	Bank of America	16/9/2020	(2,500,519)
USD	7,277,333	GBP	5,510,000	Bank of America	16/9/2020	(63,284)
USD	17,566,936	GBP	14,190,000	Standard Chartered Bank	16/9/2020	(1,337,483)
USD	21,196,969	GBP	16,710,000	UBS	16/9/2020	(1,064,683)
USD	42,509,208	GBP	33,360,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(1,934,163)
USD	47,664,974	GBP	37,167,000	BNP Paribas	16/9/2020	(1,850,216)
USD	32,146,541	GBP	24,450,000	Citibank	16/9/2020	(426,613)
USD	63,940,715	GBP	49,264,649	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(1,691,390)
USD	50,551,557	GBP	38,755,351	Barclays	16/9/2020	(1,079,691)
USD	5,821,515	GBP	4,418,000	JP Morgan	16/9/2020	(64,301)
USD	44,820,699	IDR	657,329,483,541	BNP Paribas	16/9/2020	(269,123)
USD	7,391,794	IDR	108,219,550,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(31,576)
USD	2,146,500	IDR	31,426,842,105	Toronto Dominion	16/9/2020	(9,239)
USD	5,455,115	IDR	79,611,946,632	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(5,904)
USD	12,424,592	IDR	177,671,671,393	Barclays	16/9/2020	237,122
USD	45,226,595	IDR	657,956,500,000	JP Morgan	16/9/2020	93,763
USD	3,573,141	INR	274,310,000	Citibank	16/9/2020	(151,794)
USD	101,593,154	INR	7,784,067,424	Deutsche Bank	16/9/2020	(4,108,930)
USD	9,071,391	INR	689,970,000	Bank of America	16/9/2020	(297,910)
USD	6,262,595	INR	476,330,000	BNP Paribas	16/9/2020	(205,627)
USD	1,435,000	JPY	152,067,351	Morgan Stanley	16/9/2020	1,076
USD	5,555,000	JPY	588,569,230	Goldman Sachs	16/9/2020	5,068
USD	8,735,000	JPY	932,521,457	Royal Bank of Canada	16/9/2020	(58,241)
USD	5,537,000	JPY	590,064,283	RBS Plc	16/9/2020	(27,030)
USD	6,497,903	JPY	693,256,665	UBS	16/9/2020	(39,182)
USD	2,209,000	JPY	237,231,755	HSBC Bank Plc	16/9/2020	(27,985)
USD	2,220,000	JPY	238,491,580	JP Morgan	16/9/2020	(28,864)
USD	23,276,411	JPY	2,473,821,616	Bank of America	16/9/2020	(50,570)
USD	1,546,000	JPY	163,110,111	Citibank	16/9/2020	7,948
USD	6,657,033	KRW	8,000,000,000	BNP Paribas	16/9/2020	(81,510)
USD	1,105,000	RUB	83,107,050	BNP Paribas	16/9/2020	(12,508)
USD	6,684,000	RUB	472,221,344	Goldman Sachs	16/9/2020	334,225
USD	3,261,500	RUB	230,258,639	Bank of America	16/9/2020	165,303

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
USD	2,004,250	RUB	142,346,822	Morgan Stanley	16/9/2020	90,168
USD	1,918,506	RUB	135,983,700	Credit Suisse	16/9/2020	89,987
USD	55,791,729	RUB	3,885,838,072	JP Morgan	16/9/2020	3,540,393
USD	30,028,000	RUB	2,213,687,383	Citibank	16/9/2020	261,416
USD	2,863,843	RUB	203,685,085	HSBC Bank Plc	16/9/2020	124,969
USD	2,747,888	SGD	3,815,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(55,647)
USD	13,869,000	TRY	103,830,269	Citibank	16/9/2020	(193,166)
USD	5,596,134	TWD	163,300,000	BNP Paribas	16/9/2020	28,336
USD	7,507,000	ZAR	127,262,303	Citibank	16/9/2020	(37,159)
USD	66,889,066	ZAR	1,162,338,197	Bank of America	16/9/2020	(2,014,797)
USD	5,082,000	ZAR	87,288,400	Morgan Stanley	16/9/2020	(92,491)
USD	3,977,000	ZAR	66,200,707	BNP Paribas	16/9/2020	52,597
ZAR	70,976,716	USD	4,197,000	Morgan Stanley	16/9/2020	10,528
ZAR	94,117,304	USD	5,412,000	Deutsche Bank	16/9/2020	167,311
ZAR	121,191,846	USD	7,104,000	Bank of America	16/9/2020	80,301
ZAR	19,217,848	USD	1,105,000	Barclays	16/9/2020	34,241
ZAR	54,957,591	USD	3,313,000	BNP Paribas	16/9/2020	(55,092)
ZAR	116,486,003	USD	6,847,000	Citibank	16/9/2020	58,335
AUD	1,110,000	USD	767,839	Royal Bank of Canada	17/9/2020	49,878
AUD	3,335,000	USD	2,309,097	Deutsche Bank	17/9/2020	147,737
EUR	890,000	NOK	9,550,860	Morgan Stanley	17/9/2020	(30,239)
EUR	2,225,000	NOK	23,981,651	Deutsche Bank	17/9/2020	(87,547)
MXN	848,331,194	USD	38,196,964	Bank of America	17/9/2020	528,691
MXN	25,675,390	USD	1,110,000	UBS	17/9/2020	64,215
MXN	75,405,537	USD	3,313,000	Morgan Stanley	17/9/2020	129,204
MXN	178,986,955	USD	7,824,000	BNP Paribas	17/9/2020	346,614
MXN	96,986,721	USD	4,418,000	State Street	17/9/2020	17,503
NOK	33,592,692	EUR	3,115,000	Bank of America	17/9/2020	124,667
USD	3,079,269	AUD	4,425,000	JP Morgan	17/9/2020	(180,548)
USD	7,768,345	MXN	179,165,206	JP Morgan	17/9/2020	(410,405)
USD	16,991,595	MXN	381,021,696	Citibank	17/9/2020	(401,749)
USD	1,104,000	MXN	24,464,640	HSBC Bank Plc	17/9/2020	(12,792)
USD	453,060	MXN	10,057,425	Barclays	17/9/2020	(6,054)
USD	4,870,431	MXN	106,773,490	Barclays	23/9/2020	(112)
USD	9,492,000	TRY	71,427,300	Citibank	30/9/2020	(138,343)
BRL	136,092,200	USD	24,231,000	Citibank	2/10/2020	604,014
USD	1,104,000	BRL	6,086,904	Citibank	2/10/2020	(6,779)
USD	204,319,683	GBP	153,476,000	Bank of America	5/10/2020	(172,737)
USD	21,589,619	AUD	29,415,000	HSBC Bank Plc	6/10/2020	(81,373)
JPY	980,422,280	USD	9,217,600	HSBC Bank Plc	14/10/2020	30,670
USD	5,583,439	AUD	7,594,000	BNP Paribas	14/10/2020	(11,419)
USD	9,652,000	JPY	1,028,021,392	BNP Paribas	14/10/2020	(45,270)

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
KZT	623,111,297	USD	1,468,390	Citibank	23/10/2020	(4,060)
TWD	29,306,000	USD	1,000,000	Standard Chartered Bank	13/11/2020	4,016
USD	1,000,000	TWD	29,306,000	Citibank	13/11/2020	(4,016)
USD	10,494,921	EUR	8,948,260	UBS	27/11/2020	(197,067)
未実現純評価損						(29,444,680)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	106,875,975	USD	76,727,211	BNY Mellon	15/9/2020	2,005,662
USD	246,325	AUD	341,265	BNY Mellon	15/9/2020	(5,077)
未実現純評価益						2,000,585
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,527,236,734	USD	1,148,900,621	BNY Mellon	15/9/2020	20,862,789
USD	1,503,988	CAD	2,000,000	BNY Mellon	15/9/2020	(27,880)
未実現純評価益						20,834,909
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	135,041,783	USD	148,211,462	BNY Mellon	15/9/2020	1,387,925
USD	3,285,801	CHF	2,981,184	BNY Mellon	15/9/2020	(16,762)
未実現純評価益						1,371,163
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	9,663,636	USD	1,389,329	BNY Mellon	15/9/2020	20,192
未実現純評価益						20,192
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,325,606,691	USD	1,563,935,267	BNY Mellon	15/9/2020	17,526,065
USD	12,155,791	EUR	10,264,623	BNY Mellon	15/9/2020	(90,014)
未実現純評価益						17,436,051
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,175,131,485	USD	1,538,619,362	BNY Mellon	15/9/2020	26,918,407
USD	2,222,471	GBP	1,693,331	BNY Mellon	15/9/2020	(33,425)
未実現純評価益						26,884,982
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	5,923,208	USD	764,356	BNY Mellon	15/9/2020	(155)
USD	3,865	HKD	29,950	BNY Mellon	15/9/2020	1
未実現純評価損						(154)

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在（続き）

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	43,929,004,172	USD	414,041,345	BNY Mellon	15/9/2020	182,951
USD	2,558,777	JPY	270,971,889	BNY Mellon	15/9/2020	3,673
未実現純評価益						186,624
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	135,477,275	USD	36,287,202	BNY Mellon	15/9/2020	430,074
USD	374,144	PLN	1,380,527	BNY Mellon	15/9/2020	(9)
未実現純評価益						430,065
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,306,216,986	USD	149,812,849	BNY Mellon	15/9/2020	1,469,891
USD	1,433,818	SEK	12,496,074	BNY Mellon	15/9/2020	(13,446)
未実現純評価益						1,456,445
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	140,974,184	USD	102,818,079	BNY Mellon	15/9/2020	779,823
USD	637,167	SGD	871,640	BNY Mellon	15/9/2020	(3,376)
未実現純評価益						776,447
未実現純評価益合計 （米ドル建の基礎となるエクスポージャー－12,212,220,853米ドル）						41,952,629

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引　2020年８月31日現在

契約数	通貨	契約／摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー（米ドル）	未実現評価益／（損）（米ドル）
(12)	AUD	Australian 10 Year Bond	2020年９月	1,303,572	6,879
1,485	EUR	Short-Term Euro-BPT	2020年９月	199,021,214	(10,471)
841	EUR	Euro-BTP	2020年９月	146,865,212	(297,668)
373	EUR	EURO STOXX 50 Index	2020年９月	14,618,369	(320,401)
269	EUR	Euro BOBL	2020年９月	43,190,119	(65,818)
73	EUR	FTSE MIB Market Index	2020年９月	8,584,644	144,940
53	EUR	Dax Index	2020年９月	20,532,785	1,895,646
5	EUR	Euro Schatz	2020年９月	668,018	(779)
(16)	EUR	Euro-OAT	2020年９月	3,194,273	3,991
(491)	EUR	Euro BUXL	2020年９月	126,748,128	2,709,840
(1,890)	EUR	Euro Bund	2020年９月	395,559,635	3,326,270
29	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2020年９月	41,437,163	(155,840)
1,096	KRW	Korean 10 Year Bond	2020年９月	121,972,556	(2,081,236)
(3,851)	KRW	Korean 3 Year Bond	2020年９月	362,407,010	1,466,030
127	USD	MSCI Emerging Markets Index	2020年９月	6,967,855	(49,139)
(83)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2020年９月	19,978,930	(1,221,609)
(178)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2020年９月	13,920,490	(1,037,411)
(2,096)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2020年９月	366,800,000	(24,335,189)
36	USD	CBOE Volatility Index	2020年10月	1,161,000	81,900
206	GBP	Long Gilt	2020年12月	37,048,445	118,747
4,015	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2020年12月	887,032,689	368,670
3,549	USD	US Ultra 10 Year Note	2020年12月	564,401,906	(531,064)
1,074	USD	90 Day Euro $	2020年12月	267,734,775	1,580,217
401	USD	US Long Bond (CBT)	2020年12月	87,869,125	(1,013,819)
(197)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2020年12月	27,404,547	(18,013)
(1,924)	USD	US Long Bond (CBT)	2020年12月	336,700,000	2,967,207
(8,288)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2020年12月	1,044,158,500	(1,013,896)
(1,074)	USD	90 Day Euro $	2021年３月	267,963,000	(1,766,105)
237	USD	90 Day Euro $	2021年６月	59,137,425	38,625
237	USD	90 Day Euro $	2021年９月	59,134,463	15,900
237	USD	90 Day Euro $	2021年12月	59,119,650	45,209
237	USD	90 Day Euro $	2022年３月	59,131,500	(333)
(237)	USD	90 Day Euro $	2023年６月	59,069,288	(117,512)
(237)	USD	90 Day Euro $	2023年９月	59,045,588	(120,475)
(237)	USD	90 Day Euro $	2023年12月	59,013,000	(120,550)
(237)	USD	90 Day Euro $	2024年３月	58,992,263	29,625
合計				5,887,887,137	(19,477,632)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ　2020年８月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 16,583,472	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(9,776)	(7,066)
CDS	JPY 307,692,308	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(16,141)	(21,484)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2021	(9,888)	(13,427)
CDS	EUR (9,250)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(565)	(2,023)
CDS	USD 21,027,900	ファンドはCDX.NA.HY.30.V14に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Bank of America	20/６/2023	(274,974)	(1,092,305)
CDS	EUR (107,914)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2023	(6,594)	(23,606)
CDS	USD 66,000,000	ファンドはCDX.NA.IG.31.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(67,019)	(914,762)
CDS	USD 17,865,450	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2023	(279,871)	(1,025,181)
CDS	USD 28,620,000	ファンドはCDX.NA.HY.33.V11に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	(1,546,967)	(1,561,117)
CDS	EUR 500,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	(4,128)	(8,692)
CDS	USD 2,315,700	ファンドはCDX.NA.HY.34.V8に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(36,476)	(129,008)
CDS	EUR 11,250,000	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(32,068)	(253,756)
CDS	USD 5,100,000	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(230,770)	80,319
CDS	USD (5,100,000)	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2025	203,576	12,024

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 525,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(358)	(10,762)
CDS	EUR 8,360,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(249,326)	132,305
CDS	EUR (46,862,087)	ファンドはITRAXX.XO.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2025	786,301	4,312,594
CDS	EUR 700,000	ファンドはContinental AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	(37,796)	(10,218)
CDS	USD (32,342,771)	ファンドはCDX.NA.IG.34.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2025	86,178	512,592
CDS	USD (3,000,000)	ファンドChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/9/2020	26,036	1,545
CDS	USD 1,310,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(129,797)	(6,593)
CDS	USD 1,310,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(100,295)	(4,273)
CDS	JPY 74,812,967	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(2,043)	(2,066)
CDS	JPY 142,719,549	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(4,031)	(4,000)
CDS	USD 1,310,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2020	(83,301)	(6,593)
CDS	JPY 115,384,616	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2021	(5,884)	(8,056)
CDS	EUR 400,000	ファンドはMarks & Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(7,618)	5,785
CDS	EUR 570,000	ファンドはStonegate Pub Co Financing Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2022	(2,603)	(4,507)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (3,633)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(331)	(795)
CDS	EUR (275,799)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(23,962)	(60,330)
CDS	EUR (412,016)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(37,545)	(90,128)
CDS	EUR (36,367)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2023	(3,211)	(7,955)
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(44,049)	(87,412)
CDS	USD 500,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(25,040)	(29,411)
CDS	EUR 700,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(24,188)	(13,232)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(13,975)	(93,517)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2024	(18,455)	(93,517)
CDS	EUR 1,568,000	ファンドはAccor SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	66,006	51,694
CDS	USD 2,740,000	ファンドはOccidental Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(825,870)	411,845
CDS	USD 248,320	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(325)	(43,378)
CDS	EUR 1,030,000	ファンドはSunrise Communications Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(38,309)	(234,924)
CDS	USD (500,000)	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	5,539	84,195

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD (1,000,000)	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(17,696)	168,391
CDS	EUR 1,640,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(11,663)	3,317
CDS	EUR 21,075,000	ファンドはAkzo Nobel NVに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(197,288)	(797,576)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	(47,832)	600,913
CDS	USD 1,250,000	ファンドはXerox Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(25,563)	54,322
CDS	EUR (3,180,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	26,174	71,728
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはContinental AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(59,488)	(16,349)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	175	39,740
CDS	EUR 1,100,000	ファンドはBP Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(13,956)	(21,408)
CDS	EUR (490,000)	ファンドはUPC Holding BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	286	64,909
CDS	EUR 1,100,000	ファンドはAnglo American Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(43,160)	(258,187)
CDS	EUR 336,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(4,586)	10,907
CDS	EUR 300,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(5,930)	(34,357)
CDS	USD 1,120,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(74,953)	57,052
CDS	EUR 1,110,000	ファンドはDeutsche Telekom AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(6,708)	(45,590)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 1,110,000	ファンドはTelefonica Saに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(7,943)	(16,221)
CDS	USD (510,000)	ファンドはSprint Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	586	96,929
CDS	USD 560,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(34,190)	28,526
CDS	USD (256,667)	ファンドはSprint Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	1,739	48,781
CDS	USD 3,520,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(12,282)	27,211
CDS	USD 3,520,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(7,403)	27,211
CDS	USD 3,669,993	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	6,362	307,888
CDS	USD (750,000)	ファンドはYum! Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	3,374	1,572
CDS	USD 200,000	ファンドはXerox Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(3,257)	10,918
CDS	USD 1,325,000	ファンドはSimon Property Group LPに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2025	(72,323)	18,943
CDS	USD (725,000)	ファンドはSprint Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	7,155	137,792
CDS	USD (525,000)	ファンドはSprint Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	10,223	99,780
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(6,480)	(4,642)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 2,460,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2020	(11,565)	(8,216)
CDS	USD 8,439,000	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(137,535)	(408,454)
CDS	EUR (254,908)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(17,326)	(55,761)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(20,396)	(67,812)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,031)	(15,312)
CDS	EUR (70,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2023	(8,031)	(15,312)
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(26,943)	(51,058)
CDS	EUR (303,519)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	64,617	(1,568)
CDS	USD 1,801,083	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(5,745)	(57,501)
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USA Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(43,078)	(76,587)
CDS	USD 1,789,638	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(4,534)	(57,136)
CDS	EUR 282,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	9,153	18,394
CDS	EUR (130,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2024	10,236	(671)
CDS	EUR 500,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(4,072)	(8,692)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (206,667)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(4,565)	(21)
CDS	USD (1,085,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(15,200)	217,330
CDS	USD 1,250,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	109,558	88,139
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはHellenic Telecommunications Organisation SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(38,694)	(237,390)
CDS	EUR 580,000	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(54,752)	(91,636)
CDS	USD 1,000,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	20,944	18,547
CDS	USD 500,000	ファンドはHess Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(7,177)	6,789
CDS	EUR (103,333)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2024	(2,382)	(11)
CDS	USD 300,000	ファンドはXerox Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	(10,206)	16,377
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはHSBC Holdings Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	(12,289)	14,122
CDS	USD (1,300,000)	ファンドはAT&T Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	51,194	13,765
CDS	USD 700,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	(65,572)	(660)
CDS	EUR (600,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	(8,535)	(93,896)
CDS	USD 1,150,000	ファンドはGeneral Electric Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	(33,948)	33,309

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (336,290)	ファンドはLadbrokes Coral Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	27,956	(17,242)
CDS	EUR 8,200,000	ファンドはLloyds Banking Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	(56,978)	(181,696)
CDS	USD (875,000)	ファンドはYum! Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	10,145	1,834
CDS	USD 250,000	ファンドはMacy ' s Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2025	16,948	77,296
CDS	USD (750,000)	ファンドはAT&T Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	24,194	7,942
CDS	EUR (520,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2025	(7,397)	(81,376)
CDS	USD (535,000)	ファンドはVerizon Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citibank	20/6/2025	16,679	12,636
CDS	USD 3,000,000	ファンドはWestpac Banking Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2020	(8,136)	(8,715)
CDS	JPY 112,296,354	ファンドはSoftBank Group Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2021	(6,055)	3,256
CDS	USD 560,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2022	(32,152)	(3,544)
CDS	USD 1,120,000	ファンドはBausch Health Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2022	(7,711)	(81,042)
CDS	EUR 900,000	ファンドはStonegate Pub Co Financing Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2022	18,422	(7,117)
CDS	EUR (7,854)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(592)	(1,718)
CDS	EUR (20,750)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(1,454)	(4,539)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (100,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(8,667)	(21,875)
CDS	EUR (247,704)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(18,678)	(54,185)
CDS	EUR (78,540)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(5,922)	(17,180)
CDS	EUR (253,054)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2023	(23,059)	(55,355)
CDS	USD (5,648,500)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	460,729	49,495
CDS	USD 1,250,000	ファンドはStaples Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	326,922	342,254
CDS	USD (9,322,000)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	760,363	81,684
CDS	USD (8,445,100)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	688,838	74,000
CDS	EUR 710,000	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2024	(24,498)	(13,421)
CDS	EUR 671,573	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(6,793)	(106,104)
CDS	EUR 2,080,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(3,320)	8,663
CDS	EUR 1,000,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(45)	(138,606)
CDS	USD 248,320	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(872)	(43,378)
CDS	USD 430,000	ファンドはDevon Energy Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	10,372	7,975
CDS	EUR 1,045,000	ファンドはHSBC Holdings Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	4,257	6,815

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 273,153	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/12/2024	(2,255)	(47,717)
CDS	EUR 600,000	ファンドはGlencore International AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(80,307)	(121,936)
CDS	USD 325,000	ファンドはAlly Financial Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(25,710)	(59,154)
CDS	USD 215,000	ファンドはAlly Financial Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(17,005)	(39,133)
CDS	EUR (560,000)	ファンドはADLER Real Estate AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	33,780	77,438
CDS	EUR 537,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(61,559)	17,287
CDS	EUR (611,264)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	16,834	(95,659)
CDS	USD (750,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	2	(122,823)
CDS	EUR (278,736)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	7,676	(43,620)
CDS	EUR 560,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(39,961)	49,349
CDS	EUR 550,000	ファンドはBanco Santander SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(65,699)	10,365
CDS	EUR 538,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(61,217)	17,319
CDS	EUR 500,000	ファンドはBanco Santander SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(59,726)	9,422

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (20,605)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	567	(3,225)
CDS	EUR 560,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(38,922)	49,349
CDS	EUR 560,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(54,940)	(109,061)
CDS	EUR (295,330)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	8,133	(46,217)
CDS	EUR 1,080,000	ファンドはGlencore International AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(144,553)	(219,485)
CDS	EUR 400,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(46,312)	(1,911)
CDS	USD 225,000	ファンドはTeva Pharmaceutical Industries Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(2,258)	28,433
CDS	EUR 2,035,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(40,000)	(45,476)
CDS	EUR (600,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	48,252	(93,896)
CDS	USD 22,900,795	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(1,340,271)	(594,143)
CDS	USD 6,078,440	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(299,316)	(115,659)
CDS	USD 2,920,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(6,136)	22,573
CDS	USD 10,866,555	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(941,062)	90,592

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 750,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(118)	6,253
CDS	USD 2,930,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(7,511)	22,650
CDS	USD 4,378,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(11,223)	33,844
CDS	EUR (9,395)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	259	(1,470)
CDS	EUR (134,670)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2025	3,709	(21,075)
CDS	EUR 1,066,667	ファンドはStora Enso Oyjに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Citigroup	20/6/2025	(59,523)	(269,070)
CDS	USD (2,261,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Citigroup	17/9/2058	(455,257)	(466,444)
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、３%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	247,777	297,072
CDS	EUR (800,000)	ファンドはMatalan Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2021	(115,087)	(675,191)
CDS	EUR 560,000	ファンドはStonegate Pub Co Financing Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	(12,835)	(6,155)
CDS	EUR 500,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	(209)	4,095
CDS	EUR 760,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2021	10,414	37,544
CDS	EUR 600,000	ファンドはStonegate Pub Co Financing Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/3/2022	7,364	(5,670)
CDS	EUR 730,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	12,717	11,560

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 560,000	ファンドはStonegate Pub Co Financing Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2022	(9,340)	(4,428)
CDS	EUR 1,680,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	42,381	23,177
CDS	EUR 420,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(194)	15,620
CDS	EUR 540,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2022	(24,693)	20,082
CDS	EUR (200,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2023	(1,657)	(2,368)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	34,766	(878)
CDS	EUR (480,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	64,246	(2,479)
CDS	EUR (530,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	6,201	(2,738)
CDS	EUR 280,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	6,407	18,264
CDS	EUR 860,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	3,943	56,097
CDS	EUR 188,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	6,102	12,263
CDS	EUR 310,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2024	572	20,221
CDS	EUR (290,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	29,597	(1,498)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (196,481)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	39,836	(1,015)
CDS	EUR (310,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2024	26,629	(1,601)
CDS	EUR 210,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	22,832	18,822
CDS	EUR (20,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	292	(2)
CDS	EUR (20,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(682)	(2)
CDS	EUR 1,323,742	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	(21,786)	(209,143)
CDS	EUR (170,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	2,483	(17)
CDS	EUR (960,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(57,417)	(98)
CDS	EUR (10,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(598)	(1)
CDS	EUR (270,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(16,149)	(27)
CDS	EUR 5,310,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	(374,342)	34,203
CDS	EUR (770,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	160	(78)
CDS	EUR 1,360,000	ファンドはSunrise Communications Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	(31,931)	(310,191)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (270,000)	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2024	(19,065)	(24,200)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	(16,013)	(43,928)
CDS	USD (300,000)	ファンドはNRG Energy Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	4,758	47,128
CDS	EUR 1,115,385	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	12,766	(132,812)
CDS	EUR 17,003	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(516)	(83)
CDS	EUR 3,220,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(36,069)	(54,583)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはthyssenkrupp AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	(19,446)	(77,786)
CDS	EUR (560,000)	ファンドはthyssenkrupp AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	37,802	(66,001)
CDS	EUR 560,000	ファンドはArcelorMittalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(97,443)	(97,130)
CDS	EUR (224,194)	ファンドはOI European Group BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	30,406	42,312
CDS	EUR 338,255	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(36,093)	(67,639)
CDS	EUR 790,000	ファンドはBoparan Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(2,230)	47,508
CDS	EUR (290,000)	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	1,816	34,531
CDS	EUR 165,153	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(4,606)	(805)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 1,390,000	ファンドはStora Enso Oyjに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(86,343)	(350,632)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	78,124	3,154
CDS	EUR 2,085,000	ファンドはVolkswagen AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(35,153)	(18,546)
CDS	EUR 890,000	ファンドはVolkswagen AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(14,945)	(7,917)
CDS	EUR 17,785	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(496)	(87)
CDS	USD (1,320,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	35,588	(216,169)
CDS	EUR 157,885	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2025	(4,789)	(770)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	(66,361)	(111,509)
CDS	EUR (330,000)	ファンドはVerisure Midholding ABに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	48,341	52,180
CDS	EUR (20,000)	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2025	125	2,381
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	56,613	2,119
CDS	USD 3,560,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(85,263)	(44,756)
CDS	USD (670,000)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(155,277)	(212,221)
CDS	EUR 300,000	ファンドはMarks & Spencer Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2022	(4,103)	4,339
CDS	USD 2,549,100	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2022	(41,244)	(123,378)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 1,188,175	ファンドはEnel SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(27,151)	(33,768)
CDS	EUR 224,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(3,411)	7,271
CDS	EUR 2,035,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(42,311)	(45,476)
CDS	EUR 4,070,000	ファンドはDaimler AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(93,354)	(90,953)
CDS	EUR 1,160,000	ファンドはRepsol SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(81,048)	(16,407)
CDS	EUR 580,000	ファンドはAnglo American Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(19,819)	(136,135)
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはCompagnie Financiere Michelin Scmaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2025	(34,670)	(46,109)
CDS	USD 2,860,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(68,964)	(35,956)
CDS	USD (98,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	(9,443)	(20,217)
CDS	USD 4,426,829	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(24,719)	(26,201)
CDS	USD 1,891,126	ファンドはCMBX.NA.6.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(11,543)	(11,193)
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはChina Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/9/2020	27,457	1,545
CDS	JPY 175,953,079	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(4,966)	(4,906)
CDS	USD (5,750,000)	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.IG.24.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2020	184,412	17,087
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsui & Co Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,458)	(2,453)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	JPY 96,070,381	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,783)	(2,671)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,452)	(2,446)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,483)	(2,446)
CDS	EUR 1,820,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(7,176)	(6,079)
CDS	USD 1,310,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(71,420)	(4,273)
CDS	JPY 87,976,539	ファンドはITOCHU Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,485)	(2,446)
CDS	JPY 87,976,540	ファンドはMitsubishi Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2020	(2,542)	(2,465)
CDS	USD 560,000	ファンドはFord Motor Credit Co LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(24,324)	(12,634)
CDS	USD 660,000	ファンドはCarnival Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(9,540)	35,742
CDS	EUR 220,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2021	(177)	4,998
CDS	USD 340,000	ファンドはFord Motor Credit Co LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	(33,525)	(15,039)
CDS	USD 400,000	ファンドはStaples Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	7,777	54,369
CDS	USD 175,000	ファンドはStaples Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2022	5,447	23,787
CDS	EUR 1,350,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	75,402	125,344
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(9,079)	(17,500)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (237,328)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(26,935)	(51,915)
CDS	USD 560,000	ファンドはAlly Financial Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(22,056)	(66,063)
CDS	USD 700,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2023	(22,369)	(3,532)
CDS	EUR 254,169	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(10,712)	(44,536)
CDS	EUR 244,510	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2023	(8,991)	(42,844)
CDS	USD 800,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(28,362)	(50,187)
CDS	USD 894,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(43,092)	(52,586)
CDS	USD 47,540,000	ファンドはCDX.NA.IG.32.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	(367,367)	(714,901)
CDS	USD 825,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(29,248)	(51,755)
CDS	EUR (500,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2024	24,694	(2,583)
CDS	USD 875,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(31,180)	(54,892)
CDS	EUR 522,000	ファンドはAccor SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	20,761	17,209
CDS	EUR 4,200,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	98,708	106,698
CDS	USD 165,547	ファンドはNetflix Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(217)	(28,919)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(11,417)	(32,568)
CDS	USD (8,388,000)	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	247,109	129,572
CDS	USD (3,000,000)	ファンドはHCA-The Healthcare Coに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2024	(38,689)	505,171
CDS	EUR 1,560,000	ファンドはStandard Chartered Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	13,675	6,497
CDS	EUR 1,170,000	ファンドはITV Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2024	(17,882)	(216,355)
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはGlencore International AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(59,099)	(227,614)
CDS	USD 165,000	ファンドはMacy’s Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	12,482	51,015
CDS	EUR 840,000	ファンドはNext Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(69,988)	4,978
CDS	USD 3,525,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(66,899)	(134,217)
CDS	USD 300,000	ファンドはTeva Pharmaceutical Industries Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(434)	41,537
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはDeutsche Telekom AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(4,860)	(46,001)
CDS	EUR 200,000	ファンドはCrown European Holdings SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(8,561)	(43,764)
CDS	EUR 67,490,000	ファンドはITRAXX.EUR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(129,404)	(1,773,117)
CDS	EUR (560,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	(19,616)	(94,614)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 306,000	ファンドはOccidental Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(32,955)	50,357
CDS	EUR (1,690,000)	ファンドはAltice France Holding Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	(7,656)	11,743
CDS	USD 204,000	ファンドはOccidental Petroleum Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(22,000)	33,571
CDS	EUR 520,000	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(17,406)	(2,535)
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	2,537	23,357
CDS	USD (725,000)	ファンドはYum! Brands Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	4,969	1,520
CDS	USD 250,000	ファンドはSimon Property Group LPに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(22,371)	3,574
CDS	USD 6,486,638	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	43,090	544,187
CDS	USD 6,238,357	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(7,128)	523,357
CDS	USD 4,592,012	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(1,480)	385,240
CDS	USD 2,340,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(7,084)	18,089
CDS	USD 675,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	1,081	23,708
CDS	USD 290,000	ファンドはSimon Property Group LPに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(18,730)	4,146
CDS	EUR 560,000	ファンドはPeugeot SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(41,125)	(112,130)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 600,000	ファンドはRepsol SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(40,481)	(8,486)
CDS	EUR 600,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(46,998)	19,477
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(35,128)	(76,151)
CDS	USD 675,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	1,081	23,708
CDS	USD 1,040,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(23,028)	36,528
CDS	USD (1,250,000)	ファンドはVerizon Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	35,891	29,524
CDS	EUR 600,000	ファンドはStora Enso Oyjに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(28,271)	(151,352)
CDS	EUR 966,344	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(45,096)	(15,352)
CDS	USD 500,000	ファンドはXerox Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(25,299)	27,295
CDS	USD 300,000	ファンドはHalliburton Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(28,034)	(283)
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはHeidelbergCement AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(53,567)	(275,237)
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはNokia Oyjに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(69,069)	(267,332)
CDS	USD (725,000)	ファンドはPetroleos Mexicanosに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	8,936	(118,729)
CDS	USD 725,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(3,425)	6,044
CDS	EUR 520,000	ファンドはRepsol SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(29,810)	(7,355)
CDS	EUR 1,120,000	ファンドはRenault SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(48,836)	72,567

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 180,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(11,156)	5,843
CDS	EUR (560,000)	ファンドはAltice France Holding Saに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2025	(1,217)	3,891
CDS	EUR 600,000	ファンドはSES SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(16,552)	(2,925)
CDS	EUR 200,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(13,962)	6,492
CDS	EUR 400,000	ファンドはValeo SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(30,696)	12,985
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlines Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	3,980	23,357
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(41,751)	(2,119)
CDS	USD (1,841,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(156,711)	(379,798)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(115,387)	(232,913)
CDS	USD (220,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(20,793)	(45,386)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(451,913)	(464,175)
CDS	EUR 11,875,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2024	(109,959)	(338,263)
CDS	EUR 4,100,000	ファンドはLANXESS AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/12/2024	(37,965)	(116,790)
CDS	EUR 520,000	ファンドはRepsol SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2025	(34,307)	(7,355)
CDS	USD 1,120,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	HSBC Bank Plc	20/6/2025	(28,196)	57,052
CDS	USD (16,583,472)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	238,664	7,066

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 3,000,000	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(8,622)	(8,688)
CDS	USD 3,450,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(9,286)	(10,054)
CDS	JPY 75,949,367	ファンドはSumitomo Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(2,089)	(2,097)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCommonwealth Bank of Australiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(8,250)	(8,742)
CDS	USD 3,614,314	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(9,443)	(10,467)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはNational Australia Bank Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(8,447)	(8,695)
CDS	USD 2,385,686	ファンドはAustralia & New Zealand Banking Group Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2020	(6,164)	(6,909)
CDS	EUR 560,000	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(37,511)	7,695
CDS	EUR 520,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(4,912)	(19,232)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(4,843)	(6,714)
CDS	JPY 192,307,692	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(9,685)	(13,427)
CDS	JPY 96,153,846	ファンドはITRAXX.JPN.25.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2021	(4,440)	(6,714)
CDS	EUR 100,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	128	819

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 310,000	ファンドはIceland Bondco Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2021	1,353	2,539
CDS	EUR 470,000	ファンドはAltice Luxembourg SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(20,108)	(28,780)
CDS	USD 400,000	ファンドはStaples Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2022	(9,118)	54,369
CDS	EUR (80,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(9,259)	(17,500)
CDS	EUR (247,944)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(18,696)	(54,237)
CDS	EUR (31,447)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(2,659)	(6,879)
CDS	EUR (210,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(17,072)	(45,937)
CDS	EUR (360,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(9,381)	(78,749)
CDS	EUR (78,616)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(5,928)	(17,197)
CDS	EUR (7,862)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(593)	(1,720)
CDS	EUR (3,144)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(266)	(688)
CDS	EUR (4,717)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(399)	(1,032)
CDS	EUR (47,170)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(3,989)	(10,318)
CDS	EUR 105,734	ファンドはCable & Wireless Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(3,676)	(18,527)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sons Coに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	62,623	90,536
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Homeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(122,412)	(213,165)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogy Group LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(38,100)	(43,135)
CDS	USD 250,000	ファンドはTenet Healthcare Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(13,112)	(15,683)
CDS	EUR 470,000	ファンドはJaguar Land Rover Automotive Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	14,249	30,657
CDS	USD 1,110,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(73,518)	7,312
CDS	USD 290,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(19,208)	1,910
CDS	EUR 750,000	ファンドはUniCredit SpAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	13,995	46,147
CDS	USD (425,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(6,309)	85,129
CDS	USD (1,150,000)	ファンドはAdvanced Micro Devices Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(17,071)	230,350
CDS	USD 1,495,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(42,447)	(2,940)
CDS	USD 10,210,000	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(62,942)	115,290
CDS	USD (10,210,000)	ファンドはItaly Buoni Poliennali Del Tesoroに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	37,176	45,653
CDS	USD 825,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(23,424)	(1,623)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR 1,130,000	ファンドはBanco Bilbao Vizcaya Argentaria SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(11,843)	36,377
CDS	EUR 3,185,000	ファンドはNatwest Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(29,632)	(64,988)
CDS	EUR (3,180,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	29,443	71,728
CDS	EUR 3,190,000	ファンドはNatwest Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(29,678)	(65,090)
CDS	EUR (3,180,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	27,486	71,728
CDS	EUR (560,000)	ファンドはthyssenkrupp AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	4,301	(66,001)
CDS	USD (1,250,000)	ファンドはVerizon Communications Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	4,201	29,524
CDS	EUR 600,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	180	(12,300)
CDS	EUR (1,130,000)	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	11,515	134,553
CDS	USD (1,000,000)	ファンドはAT&T Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	3,500	10,589
CDS	EUR (600,000)	ファンドはAtlantia SpAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	16,751	(34,556)
CDS	USD 1,380,000	ファンドはAvis Budget Group Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(153,103)	12,348
CDS	USD (500,000)	ファンドはNRG Energy Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	11,744	78,547
CDS	EUR 1,860,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(24,282)	(31,530)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (1,739,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	13,780	39,225
CDS	EUR 525,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(417)	(10,762)
CDS	EUR 1,123,656	ファンドはSuedzucker AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(51,352)	(17,851)
CDS	EUR 3,220,000	ファンドはBarclays Bank Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(38,437)	(54,583)
CDS	EUR 1,825,000	ファンドはNatwest Group Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(15,104)	(37,238)
CDS	EUR (1,820,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	13,138	41,052
CDS	USD 950,000	ファンドはFord Motor Credit Co LLCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(145,094)	(68,075)
CDS	USD 840,000	ファンドはCaterpillar Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(20,286)	(31,984)
CDS	EUR (20,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	(147)	(3,130)
CDS	EUR (530,000)	ファンドはADLER Real Estate AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	79,560	73,289
CDS	USD 1,275,000	ファンドはAvnet Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	3,158	(23,787)
CDS	EUR 600,000	ファンドはClariant AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	1,748	(12,300)
CDS	USD 500,000	ファンドはCenturyLink Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(20,983)	41,880
CDS	EUR (790,000)	ファンドはZiggo Bond Co BVに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	6,650	128,740

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (790,000)	ファンドはAltice France SA/Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	7	94,068
CDS	EUR 2,040,000	ファンドはHSBC Holdings Plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(31,220)	25,722
CDS	EUR 1,060,000	ファンドはMonitchem HoldCo 3 SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(10,203)	(121,394)
CDS	EUR (3,181,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	22,019	71,751
CDS	EUR (300,000)	ファンドはRolls-Royce Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	(2,201)	(46,948)
CDS	EUR (340,000)	ファンドはADLER Real Estate AGに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	38,079	47,016
CDS	EUR 1,100,000	ファンドはTelefonica Saに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(45,744)	(16,075)
CDS	EUR (1,130,000)	ファンドはVirgin Media Finance Plcに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	5,687	174,620
CDS	USD (507,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(49,012)	(104,594)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	(3,156)	(6,319)
CDS	USD 670,000	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、３%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	149,545	212,221
CDS	EUR 720,000	ファンドはStandard Chartered Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2020	(3,376)	(2,405)
CDS	EUR 1,020,000	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2021	53,634	50,388
CDS	EUR 530,000	ファンドはDeutsche Bank AGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2021	(25,447)	4,585

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	EUR (630,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachon SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(44,965)	(137,811)
CDS	EUR (330,000)	ファンドはGarfunkelux Holdco 2 SAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、５%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	(648)	(3,908)
CDS	USD 2,785,000	ファンドはAllstate Corp/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(16,946)	(96,320)
CDS	USD 2,820,000	ファンドはLowes Companies Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(30,893)	(91,241)
CDS	USD 2,800,000	ファンドはPfizer Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2024	(22,229)	(94,564)
CDS	EUR 195,604	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	(5,788)	(30,904)
CDS	USD 3,445,000	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	277,616	242,912
CDS	EUR 260,805	ファンドはArdagh Packaging Finance plcに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	(7,717)	(41,206)
CDS	EUR (8,220,000)	ファンドはITRAXX.FINSR.33.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2025	71,120	185,411
CDS	USD (750,000)	ファンドはFreeport-Mcmoran Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2025	24,458	(13,220)
CDS	USD 275,000	ファンドはTeva Pharmaceutical Industries Ltdに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	1,357	38,075
CDS	USD 1,250,000	ファンドはSimon Property Group LPに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(83,009)	17,870
CDS	USD 9,067,499	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(643,943)	461,896
CDS	USD 1,320,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(20,742)	11,005

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 29,455,121	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(1,345,595)	2,471,093
CDS	USD 9,332,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(788,564)	475,369
CDS	USD 3,000,000	ファンドはMckesson Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2025	(5,035)	(91,202)
CDS	USD 3,000,000	ファンドはCardinal Health Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2025	1,844	(76,299)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(452,292)	(464,175)
CDS	USD (700,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(145,037)	(144,410)
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(47,900)	(25,144)
CDS	USD 3,630,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(86,941)	(45,636)
CDS	USD 4,020,000	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(101,229)	(50,539)
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、３%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	97,025	133,270
CDS	USD (9,149,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,846,653)	(1,887,438)
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、３%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	76,149	104,594
CDS	USD (6,630,000)	ファンドはCmbx.Na.9.Bbb-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、３%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,345,992)	(1,367,769)
IFS	GBP 4,085,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.4075%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(65,892)	(65,892)
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.505%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(452,053)	(452,053)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.4475%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2024	(452,732)	(452,732)
IFS	GBP 1,917,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.745%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2029	129,200	129,200
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.53%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	257,531	257,531
IFS	GBP 19,180,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.58%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	429,284	429,284
IFS	GBP 4,085,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.51%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/12/2029	40,262	40,262
IFS	USD 38,921,724	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、-0.6%の固定金利を受け取る	Citibank	15/4/2021	(494,340)	(494,340)
IFS	USD 38,922,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.2725%の固定金利を支払う	Citibank	15/4/2022	679,238	679,238
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.345%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/1/2025	(102,162)	(102,162)
IFS	GBP 20,590,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3.2975%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	17/2/2025	(60,752)	(60,752)
IFS	EUR 4,110,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.3225%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	18/3/2029	(219,222)	(219,222)
IFS	GBP 1,946,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.71%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/8/2029	118,749	118,749
IFS	GBP 1,947,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.725%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/8/2029	124,125	124,125
IFS	GBP 9,585,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.4805%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	16/1/2030	38,841	38,841
IFS	EUR 7,700,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.049%の固定金利を支払う	Merrill Lynch	16/2/2030	(82,479)	(82,479)
IFS	GBP 20,590,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.41%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	18/2/2030	(266,728)	(266,728)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IFS	GBP 3,720,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.2675%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/3/2030	(130,083)	(130,083)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.334%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/5/2030	(60,219)	(60,219)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Merrill Lynch	15/3/2048	660,334	660,334
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	1,291,436	1,291,436
IRS	USD 184,220,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.5594%の固定金利を支払う	Bank of America	27/3/2021	(1,349,190)	(1,349,190)
IRS	USD 184,220,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.559%の固定金利を支払う	Bank of America	30/3/2021	(1,360,524)	(1,360,524)
IRS	USD 360,985,000	ファンドは2.093%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/5/2021	4,629,667	4,629,667
IRS	USD 377,330,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.7605%の固定金利を支払う	Bank of America	12/6/2021	(4,479,668)	(4,479,668)
IRS	CAD 23,215,000	ファンドは1.905%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	244,816	244,816
IRS	CAD 299,555,000	ファンドは1.9075%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/7/2021	3,164,713	3,164,713
IRS	USD 275,700,000	ファンドは2.222%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/11/2021	6,342,307	6,342,307
IRS	CHF 114,451,000	ファンドは-0.62%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/1/2022	38,859	38,859
IRS	CHF 182,004,000	ファンドは-0.62%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/1/2022	61,456	61,456
IRS	CHF 57,475,000	ファンドは-0.5975%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/1/2022	33,317	33,317
IRS	EUR 23,760,000	ファンドは-0.477%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/3/2022	(18,179)	(18,179)
IRS	EUR 17,090,000	ファンドは-0.4925%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/3/2022	(17,954)	(17,954)
IRS	EUR 52,170,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.292%の固定金利を支払う	Bank of America	23/3/2022	(136,112)	(136,112)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 210,859,868	ファンドは1.209%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/3/2022	3,250,582	3,250,582
IRS	USD 76,210,000	ファンドは2.2432%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/4/2022	2,539,507	2,539,507
IRS	USD 250,597,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.9005%の固定金利を支払う	Bank of America	29/4/2022	(6,941,730)	(6,941,730)
IRS	USD 319,810,000	ファンドは1.7055%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2022	4,827,085	4,827,085
IRS	EUR 20,540,000	ファンドは-0.299%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/7/2022	54,328	54,328
IRS	USD 289,329,655	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.88%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2022	(3,668,878)	(3,668,878)
IRS	USD 13,490,000	ファンドは0.6415%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2022	112,629	112,629
IRS	USD 13,490,000	ファンドは0.66%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2022	117,618	117,618
IRS	USD 13,490,000	ファンドは0.665%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2022	118,966	118,966
IRS	USD 13,490,000	ファンドは0.69%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2022	125,708	125,708
IRS	USD 9,356,000	ファンドは0.437%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/9/2022	39,900	39,900
IRS	USD 8,687,000	ファンドは0.439%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/9/2022	37,395	37,395
IRS	USD 8,687,000	ファンドは0.4625%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/9/2022	41,481	41,481
IRS	USD 13,370,000	ファンドは0.521%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/9/2022	79,500	79,500
IRS	USD 78,000,000	ファンドは1.36%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	22/9/2022	894,823	894,823
IRS	USD 45,920,000	ファンドは0.36%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/9/2022	124,561	124,561
IRS	EUR 24,400,000	ファンドは-0.3075%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	29/9/2022	73,752	73,752
IRS	EUR 18,190,000	ファンドは-0.328%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/10/2022	45,984	45,984

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	EUR 18,630,000	ファンドは-0.341%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/10/2022	41,257	41,257
IRS	USD 21,110,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.5138%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2023	(973,300)	(973,300)
IRS	EUR 7,600,000	ファンドは-0.333%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2023	17,023	17,023
IRS	USD 54,430,000	ファンドは1.088%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2023	949,641	949,641
IRS	EUR 11,880,000	ファンドは-0.472%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/3/2023	(13,518)	(13,518)
IRS	USD 123,010,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.43%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2023	(5,439,040)	(5,437,170)
IRS	CHF 31,792,000	ファンドは-0.6575%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/5/2023	(36,309)	(36,309)
IRS	CHF 42,919,200	ファンドは-0.685%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	16/5/2023	(62,895)	(62,895)
IRS	CHF 43,777,584	ファンドは-0.68%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	18/5/2023	(62,071)	(62,071)
IRS	CHF 49,857,804	ファンドは-0.68%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/5/2023	(70,943)	(70,943)
IRS	GBP 25,870,000	ファンドは0.02%の固定金利を受け取り、１日GBP LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2023	27,686	27,686
IRS	CHF 49,359,226	ファンドは-0.6175%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/6/2023	(36,943)	(36,943)
IRS	CHF 50,107,093	ファンドは-0.62375%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/6/2023	(41,030)	(41,030)
IRS	CHF 50,107,093	ファンドは-0.58%の固定金利を受け取り、６ヶ月CHF LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2023	(16,534)	(16,534)
IRS	EUR 26,100,000	ファンドは-0.421%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/7/2023	(2,712)	(2,712)
IRS	USD 324,970,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.7605%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2023	(4,905,520)	(4,905,520)
IRS	EUR 27,847,350	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.3%の固定金利を支払う	Bank of America	25/7/2023	(76,886)	(76,886)
IRS	EUR 28,990,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.29%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2023	(87,121)	(87,121)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	CAD 25,050,000	ファンドは0.783%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2023	9,844	9,844
IRS	CAD 25,050,000	ファンドは0.49%の固定金利を受け取り、１日CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	16/8/2023	6,851	6,851
IRS	USD 31,840,000	ファンドは0.258%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2023	17,492	17,492
IRS	CAD 25,050,000	ファンドは0.49%の固定金利を受け取り、１日CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2023	6,161	6,161
IRS	CAD 152,600,000	ファンドは0.76375%の固定金利を受け取り、１日CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2023	25,963	25,963
IRS	USD 115,605,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.29375%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2023	(35,800)	(35,800)
IRS	EUR 12,180,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.4495%の固定金利を支払う	Bank of America	28/9/2023	12,139	12,139
IRS	MXN 336,953,207	ファンドは8.39%の固定金利を受け取り、１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2024	1,761,422	1,761,422
IRS	USD 87,929,483	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.525%の固定金利を支払う	Bank of America	6/6/2024	(392,562)	(392,562)
IRS	EUR 137,810,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.54%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	(5,892,769)	(5,892,769)
IRS	MXN 343,311,495	ファンドは6.67%の固定金利を受け取り、１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	1,010,046	1,017,428
IRS	MXN 278,202,000	ファンドは6.715%の固定金利を受け取り、１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	845,692	845,692
IRS	USD 113,340,000	ファンドは1.568%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/9/2024	5,908,523	5,908,523
IRS	MXN 209,222,697	ファンドは１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、7.4914992%の固定金利を支払う	Bank of America	8/11/2024	605,206	605,206
IRS	EUR 1,050,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.175%の固定金利を支払う	Bank of America	18/3/2025	(11,569)	(11,569)
IRS	USD 880,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.494%の固定金利を支払う	Bank of America	7/4/2025	(7,252)	(7,252)
IRS	USD 890,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.625%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2025	(12,687)	(12,687)
IRS	USD 50,000,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.33625%の固定金利を支払う	Bank of America	27/4/2025	(4,692,994)	(4,692,994)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	CAD 8,825,000	ファンドは0.751%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2025	4,386	4,386
IRS	CAD 2,968,000	ファンドは0.815%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	3/6/2025	8,520	8,520
IRS	CAD 2,967,000	ファンドは0.82%の固定金利を受け取り、３ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America	3/6/2025	9,080	9,080
IRS	USD 5,330,000	ファンドは0.755%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2025	109,632	109,632
IRS	USD 10,200,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.815%の固定金利を支払う	Bank of America	8/9/2025	(240,341)	(240,341)
IRS	USD 3,246,500	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	(477,615)	(477,615)
IRS	USD 17,730,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.4985%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2027	4,137	4,137
IRS	USD 289,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2028	(50,966)	(50,966)
IRS	USD 3,930,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Bank of America	13/9/2028	(766,987)	(766,987)
IRS	JPY 863,940,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.1915%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2029	(111,771)	(111,771)
IRS	JPY 124,920,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.159%の固定金利を支払う	Bank of America	29/1/2029	(12,949)	(12,949)
IRS	USD 67,625,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、3.0035%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	(13,508,043)	(13,508,043)
IRS	USD 11,320,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.6155%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2030	(980,372)	(980,372)
IRS	USD 5,670,000	ファンドは1.419%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/2/2030	387,262	387,262
IRS	USD 5,635,000	ファンドは1.31%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/2/2030	327,609	327,609
IRS	USD 11,260,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.3%の固定金利を支払う	Bank of America	27/2/2030	(643,621)	(643,621)
IRS	USD 5,700,000	ファンドは1.0195%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/3/2030	176,701	176,701
IRS	EUR 492,000	ファンドは-0.2095%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/3/2030	(2,763)	(2,763)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 2,820,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.6465%の固定金利を支払う	Bank of America	11/3/2030	11,605	11,605
IRS	USD 8,710,000	ファンドは0.9595%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/3/2030	219,403	219,403
IRS	USD 9,220,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.6685%の固定金利を支払う	Bank of America	25/3/2030	21,424	21,424
IRS	USD 460,000	ファンドは0.82%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/4/2030	5,360	5,360
IRS	USD 21,857,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.688%の固定金利を支払う	Bank of America	23/6/2030	45,189	45,189
IRS	USD 9,400,000	ファンドは1.6615%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2030	867,428	867,428
IRS	USD 6,350,000	ファンドは0.686%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2030	(21,292)	(21,292)
IRS	USD 33,510,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.4145%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2030	(2,284,635)	(2,284,635)
IRS	USD 5,580,000	ファンドは0.6485%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/8/2030	(39,046)	(39,046)
IRS	USD 2,400,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.7045%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2030	3,879	3,879
IRS	USD 7,610,000	ファンドは1.015%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2030	218,782	218,782
IRS	USD 10,660,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.67%の固定金利を支払う	Bank of America	9/10/2030	65,868	65,868
IRS	USD 10,220,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.685%の固定金利を支払う	Bank of America	23/9/2031	(844,093)	(844,093)
IRS	JPY 287,470,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2034	(76,161)	(76,161)
IRS	JPY 255,240,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.336%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2034	(61,375)	(61,375)
IRS	USD 4,760,000	ファンドは1.785%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/9/2034	276,753	276,753
IRS	USD 5,720,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.982%の固定金利を支払う	Bank of America	7/11/2034	(433,094)	(433,094)
IRS	USD 11,640,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.0915%の固定金利を支払う	Bank of America	12/11/2034	(1,001,415)	(1,001,415)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 9,000,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.757%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2035	(466,673)	(466,673)
IRS	JPY 224,900,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.6165%の固定金利を支払う	Bank of America	14/12/2038	(139,745)	(139,745)
IRS	USD 3,480,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.9151%の固定金利を支払う	Bank of America	21/9/2039	(158,838)	(158,838)
IRS	USD 6,370,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.1225%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2039	(408,588)	(408,588)
IRS	USD 5,090,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.9665%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2040	78,812	78,812
IRS	JPY 163,330,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.715%の固定金利を支払う	Bank of America	21/3/2044	(97,974)	(97,974)
IRS	JPY 150,180,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.2005%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2044	56,626	56,626
IRS	USD 4,960,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3375%の固定金利を支払う	Bank of America	5/7/2049	(416,664)	(416,664)
IRS	JPY 232,000,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.428%の固定金利を支払う	Bank of America	9/1/2050	(30,484)	(30,484)
IRS	USD 4,460,000	ファンドは1.8115%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2050	816,229	816,229
IRS	USD 3,500,000	ファンドは1.709%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2050	546,268	546,268
IRS	USD 1,000,000	ファンドは0.682%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/3/2050	(114,182)	(114,182)
IRS	USD 32,204,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.912%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2050	1,739,567	1,739,567
IRS	USD 7,730,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、2.3405%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2050	(2,514,202)	(2,514,202)
IRS	USD 4,708,394	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.03%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2050	107,794	107,794
IRS	USD 3,540,000	ファンドは1.0145%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2050	(96,327)	(96,327)
IRS	USD 1,759,000	ファンドは1.242%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	8/9/2050	58,924	58,924
IRS	USD 10,866,394	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.15%の固定金利を支払う	Bank of America	8/6/2051	(23,640)	(23,640)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 3,543,389	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.177%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2051	(32,400)	(32,400)
IRS	USD 930,000	ファンドは3.0335%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/2/2053	444,798	444,798
IRS	BRL 64,965,000	ファンドは5.42%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2023	575,028	575,028
IRS	MXN 279,950,277	ファンドは１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	(1,640,292)	(1,640,292)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を支払う	Citigroup	24/3/2026	494,137	494,137
IRS	USD 25,040,000	ファンドは1.3565%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/9/2021	278,954	278,954
IRS	EUR 10,447,500	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.45%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/12/2021	11,623	11,623
IRS	EUR 44,360,000	ファンドは-0.2975%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	16/1/2022	78,343	78,813
IRS	EUR 11,130,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.3365%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/3/2022	(19,866)	(19,866)
IRS	EUR 11,120,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.355%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/3/2022	(16,001)	(16,001)
IRS	EUR 10,348,000	ファンドは-0.25%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	24/6/2022	34,465	34,465
IRS	EUR 3,882,000	ファンドは-0.29%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	25/6/2022	9,653	9,653
IRS	EUR 3,882,000	ファンドは-0.28%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	26/6/2022	10,642	10,642
IRS	EUR 3,882,000	ファンドは-0.275%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	30/6/2022	11,126	11,126
IRS	EUR 20,960,000	ファンドは-0.2955%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	16/7/2022	54,902	54,902
IRS	EUR 21,390,000	ファンドは-0.3005%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/7/2022	55,849	55,849
IRS	EUR 20,430,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.397%の固定金利を支払う	Credit Suisse	21/7/2022	(8,468)	(8,468)
IRS	USD 218,945,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.75%の固定金利を支払う	Credit Suisse	12/8/2022	(2,214,783)	(2,214,782)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 110,370,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.21%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/9/2022	(12,773)	(19,881)
IRS	EUR 22,310,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.255%の固定金利を支払う	Credit Suisse	22/9/2022	(95,826)	(95,826)
IRS	USD 11,400,000	ファンドは0.353%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/9/2022	29,252	29,252
IRS	USD 23,040,000	ファンドは0.3525%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/10/2022	58,914	58,914
IRS	EUR 16,060,000	ファンドは-0.3425%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/11/2022	34,323	34,323
IRS	USD 4,240,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.451%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/12/2022	(103,736)	(103,736)
IRS	EUR 20,220,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.401%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/2/2023	(11,957)	(11,957)
IRS	EUR 19,940,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.405%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/2/2023	(9,867)	(9,867)
IRS	EUR 18,330,000	ファンドは-0.4135%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2023	4,975	4,975
IRS	EUR 48,865,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.169%の固定金利を支払う	Credit Suisse	24/3/2023	(300,949)	(300,949)
IRS	EUR 48,865,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.1735%の固定金利を支払う	Credit Suisse	24/3/2023	(295,639)	(295,639)
IRS	EUR 48,660,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.18%の固定金利を支払う	Credit Suisse	24/3/2023	(286,761)	(286,761)
IRS	EUR 17,260,000	ファンドは-0.298%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/4/2023	51,818	51,818
IRS	EUR 16,020,000	ファンドは-0.341%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	3/5/2023	31,265	31,265
IRS	EUR 13,980,000	ファンドは-0.378%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	4/5/2023	14,733	14,733
IRS	EUR 10,270,000	ファンドは-0.415%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	24/6/2023	492	673
IRS	EUR 10,210,000	ファンドは-0.395%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	25/6/2023	5,816	5,598
IRS	USD 20,310,000	ファンドは0.25%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/7/2023	193	193

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	EUR 10,620,000	ファンドは-0.4%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/7/2023	3,710	3,976
IRS	EUR 22,750,000	ファンドは-0.409%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/7/2023	3,112	3,112
IRS	EUR 10,110,000	ファンドは-0.411%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	27/7/2023	763	763
IRS	EUR 7,090,000	ファンドは-0.4285%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	5/8/2023	(2,422)	(2,422)
IRS	GBP 108,240,000	ファンドは-0.09613%の固定金利を受け取り、１日GBP LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/8/2023	(67,683)	(65,326)
IRS	GBP 107,950,000	ファンドは-0.1%の固定金利を受け取り、１日GBP LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/8/2023	(78,225)	(68,357)
IRS	EUR 5,160,000	ファンドは-0.4305%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	9/8/2023	(1,523)	(2,062)
IRS	GBP 110,470,000	ファンドは-0.07476%の固定金利を受け取り、１日GBP LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	10/8/2023	(63,295)	(33,082)
IRS	GBP 107,260,000	ファンドは-0.09681%の固定金利を受け取り、１日GBP LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	11/8/2023	(22,820)	(63,807)
IRS	EUR 10,840,000	ファンドは-0.439%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	24/8/2023	(7,119)	(7,119)
IRS	EUR 20,370,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.17%の固定金利を支払う	Credit Suisse	13/12/2023	(113,690)	(113,690)
IRS	EUR 10,855,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.052%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2024	(90,627)	(90,627)
IRS	EUR 10,855,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.059%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/1/2024	(88,783)	(88,783)
IRS	EUR 4,580,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.173%の固定金利を支払う	Credit Suisse	11/11/2024	(46,298)	(46,298)
IRS	USD 48,010,000	ファンドは3.0855%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/11/2024	5,684,906	5,684,906
IRS	USD 41,590,000	ファンドは2.5155%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2025	4,118,581	4,118,581
IRS	USD 16,670,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.295%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2025	3,248	5,348
IRS	USD 14,170,000	ファンドは0.358%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/6/2025	22,074	22,074

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	EUR 8,070,000	ファンドは-0.3385%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/7/2026	(15,581)	(15,581)
IRS	USD 2,310,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.65%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/4/2027	(10,982)	(10,982)
IRS	USD 14,610,000	ファンドは0.6485%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2027	48,579	48,579
IRS	USD 14,610,000	ファンドは0.6795%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2027	71,080	71,080
IRS	EUR 7,850,000	ファンドは-0.249%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	16/8/2027	(13,121)	(13,121)
IRS	EUR 7,960,000	ファンドは-0.2495%の固定金利を受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	16/8/2027	(13,548)	(13,548)
IRS	EUR 3,990,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、-0.2585%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/8/2027	8,991	8,991
IRS	USD 14,810,000	ファンドは0.6555%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	12/7/2028	(81,165)	(81,165)
IRS	USD 5,370,000	ファンドは1.7835%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	7/1/2030	547,080	547,080
IRS	USD 5,400,000	ファンドは1.713%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	8/1/2030	515,042	515,042
IRS	EUR 9,150,000	ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.185%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/1/2030	(367,949)	(366,318)
IRS	USD 9,310,000	ファンドは1.737%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	23/1/2030	910,182	910,182
IRS	USD 5,400,000	ファンドは1.6815%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/1/2030	500,440	500,440
IRS	USD 4,760,000	ファンドは1.567%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	29/1/2030	390,777	390,777
IRS	USD 5,610,000	ファンドは1.2315%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	2/3/2030	285,073	285,073
IRS	USD 37,570,000	ファンドは0.634%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	15/5/2030	(272,100)	(281,084)
IRS	USD 6,290,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.63358%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/5/2030	47,303	47,303
IRS	USD 13,510,000	ファンドは0.599%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	18/5/2030	(135,941)	(135,941)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 7,230,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.6475%の固定金利を支払う	Credit Suisse	2/6/2030	40,785	40,785
IRS	USD 6,930,000	ファンドは0.664%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	3/6/2030	(27,425)	(27,425)
IRS	USD 6,960,000	ファンドは0.575%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	28/7/2030	(95,427)	(95,427)
IRS	USD 6,720,000	ファンドは0.575%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	31/7/2030	(92,472)	(92,472)
IRS	USD 2,400,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.672%の固定金利を支払う	Credit Suisse	27/8/2030	11,565	11,565
IRS	USD 2,400,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.6795%の固定金利を支払う	Credit Suisse	27/8/2030	9,794	9,794
IRS	USD 2,400,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.683%の固定金利を支払う	Credit Suisse	27/8/2030	8,968	8,968
IRS	USD 2,405,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.725%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/9/2030	(664)	(664)
IRS	USD 2,405,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.7365%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/9/2030	(3,389)	(3,389)
IRS	USD 2,410,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.74%の固定金利を支払う	Credit Suisse	1/9/2030	(4,227)	(4,227)
IRS	USD 2,420,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.746%の固定金利を支払う	Credit Suisse	2/9/2030	(5,670)	(5,670)
IRS	USD 10,700,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.65%の固定金利を支払う	Credit Suisse	4/11/2030	95,831	95,831
IRS	USD 13,120,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.76%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/6/2031	57,796	57,796
IRS	USD 13,950,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.76%の固定金利を支払う	Credit Suisse	3/5/2032	208,019	208,019
IRS	USD 14,460,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.765%の固定金利を支払う	Credit Suisse	4/5/2032	208,791	208,791
IRS	USD 7,930,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.77%の固定金利を支払う	Credit Suisse	6/5/2032	111,126	111,126
IRS	JPY 211,250,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3714%の固定金利を支払う	Credit Suisse	30/1/2045	17,877	17,877
IRS	USD 5,650,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.976%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/2/2047	186,821	185,099

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	USD 3,440,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.705%の固定金利を支払う	Credit Suisse	16/8/2049	(114,087)	(114,087)
IRS	JPY 231,500,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.3795%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(175)	(175)
IRS	JPY 231,500,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.401%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(13,575)	(13,575)
IRS	JPY 232,000,000	ファンドは６ヶ月JPY LIBORの変動金利を受け取り、0.429%の固定金利を支払う	Credit Suisse	10/1/2050	(31,092)	(31,092)
IRS	USD 680,000	ファンドは0.9815%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	21/8/2050	(24,460)	(24,460)
IRS	USD 680,000	ファンドは0.993%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	21/8/2050	(22,372)	(22,372)
IRS	USD 2,655,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.0835%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2052	65,705	65,705
IRS	USD 2,655,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、1.1295%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/6/2052	33,627	33,627
IRS	USD 2,730,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.881%の固定金利を支払う	Credit Suisse	12/7/2053	235,215	235,215
IRS	USD 420,000	ファンドは1.9125%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	1/12/2056	67,751	67,751
IRS	USD 67,298,000	ファンドは0.345%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	27/8/2025	(9,272)	(9,272)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	2,244,023	2,244,023
IRS	USD 57,865,931	ファンドは1.076%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	17/8/2030	2,021,145	2,021,145
IRS	USD 23,142,534	ファンドは0.6305%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	21/8/2030	(203,043)	(203,043)
IRS	USD 16,373,000	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.8815%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	2/7/2050	1,021,057	1,021,057
IRS	USD 10,475,159	ファンドは３ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.872%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	21/7/2050	680,778	680,778
IRS	USD 12,761,000	ファンドは0.956%の固定金利を受け取り、３ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	28/10/2050	(563,269)	(563,269)
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	928,105	928,105

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
IRS	BRL 64,155,897	ファンドは5.13%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	401,460	401,460
IRS	BRL 14,017,904	ファンドは8.195%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	413,869	413,869
IRS	BRL 10,765,416	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	342,681	342,681
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	312,077	312,077
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、１日BRL BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,472,487	1,472,487
TRS	MXN 144,525,723	ファンドは１ヶ月MXN MXIBTIIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	(821,723)	(821,723)
TRS	USD 59,729,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2020	2,666,694	2,630,696
TRS	USD 2,810,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/9/2020	100,508	98,921
TRS	USD 4,710,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2020	465,638	464,220
TRS	EUR 3,500,000	ファンドはIBOXX Euro Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/9/2020	26,608	27,266
TRS	EUR 2,700,000	ファンドはIBOXX Euro Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/9/2020	28,122	28,453
TRS	USD 1,760,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid Investment Grade + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2020	58,088	57,407
TRS	USD (9,260)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Tidewater Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	29/9/2020	(16,483)	(16,483)
TRS	USD (10,523)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 30bpsを受け取り、Tidewater Inc + 0bpsを支払う	BNP Paribas	29/9/2020	(18,731)	(18,731)
TRS	USD (284,458)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 65bpsを受け取り、EQT Corp + 0bpsを支払う	BNP Paribas	12/2/2021	233,256	233,256
TRS	USD (15,000)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 25bpsを受け取り、General Electric Co + 0bpsを支払う	Citibank	31/8/2020	(825)	(825)

スワップ　2020年８月31日現在（続き）

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
TRS	USD 5,033	ファンドはPerformance Shell Construction Inc + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 5bpsを支払う	Citibank	10/12/2020	215,242	215,242
TRS	USD (106,265)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 15bpsを受け取り、EQT Corp + 0bpsを支払う	Citibank	12/2/2021	94,576	94,576
TRS	USD 2,830,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Credit Suisse	20/9/2020	216,082	215,170
TRS	USD 2,360,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2020	108,589	107,676
TRS	EUR 2,700,000	ファンドはIBOXX Euro Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月EUR EURIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2020	23,942	24,333
TRS	USD 6,610,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2020	469,789	467,724
TRS	USD 4,710,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2020	203,238	201,372
TRS	USD 2,830,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid High Yield + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2020	136,093	134,988
TRS	USD (22,000)	ファンドは３ヶ月USD BBA LIBOR - 20bpsを受け取り、Commscope Holding Inc + 0bpsを支払う	Merrill Lynch	6/11/2020	16,500	16,500
TRS	USD 890,000	ファンドはIBOXX US Dollar Liquid Investment Grade + 0bpsを受け取り、３ヶ月USD BBA LIBOR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2020	27,291	26,938
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－10,007,232,232米ドル）					(13,432,259)	(6,357,145)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ
IFS:インフレーション・スワップ
IRS: 金利スワップ
TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建オプション　2020年８月31日現在

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
22,302,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 70	2/9/2020	(375,476)	—
16,152,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.18	4/9/2020	147,112	192,949
15,250,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.175	4/9/2020	100,748	271,277
30,204,000	コール	OTC USD/TWD	Bank of America	USD 30.25	4/9/2020	(129,734)	23
134,990,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.205	9/9/2020	(225,400)	240,602
134,990,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.235	9/9/2020	(96,035)	5,332
110,000	コール	OTC EUR/NOK	Bank of America	EUR 10.5	10/9/2020	(17,197)	38,395
13,270,000	コール	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.85	10/9/2020	(63,241)	13,062
13,270,000	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.3	10/9/2020	(120,907)	40,457
690,000	コール	OTC USD/CLP	Bank of America	USD 1	10/9/2020	(104,165)	9,686
220,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 101	11/9/2020	(22,225)	1,443
4,341,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1675	18/9/2020	(14,895)	4,069
4,824,000	プット	OTC GBP/USD	Bank of America	GBP 1.29	18/9/2020	(20,688)	4,338
19,282,407	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.185	22/9/2020	(15,894)	254,079
16,566,000	プット	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.67	23/9/2020	(140,840)	118
16,566,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.2	24/9/2020	37,420	103,539
331,500	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1	24/9/2020	23,716	55,325
15,250,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.185	25/9/2020	57,593	210,011
15,220,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.18	25/9/2020	84,135	261,219
8,177,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.2075	29/9/2020	5,444	24,780
8,177,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.2075	29/9/2020	5,444	24,780
7,353,798	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 107	29/9/2020	(143,086)	32,523
7,353,798	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 107	29/9/2020	(68,203)	99,169
3,327,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 108.45	6/10/2020	(14,018)	82,531
3,327,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 108.45	6/10/2020	(48,217)	6,479
14,630,888	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.25	8/10/2020	(110,389)	145,344
687,126	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4.9	8/10/2020	(71,950)	55,580
89,990,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1845	9/10/2020	39,013	637,448
8,990,000	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 23.8	9/10/2020	474,140	773,057
14,796,044	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.2	13/10/2020	(125,227)	132,535
694,867	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4.9	13/10/2020	(101,543)	65,920
14,976,000	コール	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 17	15/10/2020	(109,634)	283,936
11,044,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 106	22/10/2020	18,559	124,361
22,275,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 104	26/10/2020	(26,661)	26,465
4,328,084	プット	OTC NZD/USD	Bank of America	NZD 0.62	27/10/2020	(248,442)	80,974
440,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 100	28/10/2020	(25,753)	19,875
59,101,208	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.36	3/11/2020	(364,513)	96,004
1,784,299	コール	OTC USD/CAD	Bank of America	USD 1.4	3/11/2020	(168,218)	26,805
5,525,000	コール	OTC USD/TWD	Bank of America	USD 30.9	11/11/2020	(18,301)	3,561
2,618,080	プット	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 1	12/11/2020	(271,207)	56,482
1,925,000	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 1	18/11/2020	(153,305)	30,230
22,089,000	プット	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 70	20/11/2020	(141,560)	28,784
50,990,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 102.7	27/11/2020	(51,436)	330,224
309,080,000	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.18	13/10/2020	2,377,669	6,197,591

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
666,180	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 105.6	19/11/2020	(41,316)	653
15,250,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.125	4/9/2020	821,100	1,032,283
33,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 16.7	9/9/2020	612	11,947
16,214,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.17	23/9/2020	(92,148)	27,577
8,898,912	コール	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 75	29/9/2020	8,802	125,555
4,263,000	プット	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.609	6/10/2020	(57,678)	－
4,263,000	コール	OTC AUD/USD	BNP Paribas	AUD 0.609	6/10/2020	385,497	544,582
11,044,000	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 18.75	13/10/2020	(22,716)	24,142
5,522,000	プット	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 16	13/10/2020	(12,247)	21,217
884,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.4	22/10/2020	(159,602)	7,474
110,000	コール	OTC USD/CAD	BNP Paribas	USD 1.4	22/10/2020	(14,030)	930
19,880,000	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 74	27/11/2020	74,859	462,077
4,418,000	コール	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 82	27/11/2020	(10,434)	38,827
3,100,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.25	28/6/2021	586,656	907,353
15,400,000	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1125	31/8/2020	1,011,690	1,234,337
5,695,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.1	1/9/2020	(75,851)	1,515
995,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.2	4/9/2020	26,487	285,885
793,022	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7.1	4/9/2020	(263,283)	－
6,629,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.75	4/9/2020	(101,053)	256
19,880,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.1	9/9/2020	180,048	382,381
16,566,000	コール	OTC USD/BRL	Citibank	USD 6	10/9/2020	(44,653)	3,885
9,417,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.5	22/9/2020	(65,249)	42,664
8,898,912	コール	OTC USD/MXN	Citibank	USD 23	29/9/2020	(79,428)	29,628
8,898,912	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.2	29/9/2020	(28,867)	89,711
28,506,000	プット	OTC USD/RUB	Citibank	USD 73.5	2/10/2020	(143,732)	338,562
19,217,000	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.75	13/10/2020	(159,618)	135,912
44,325,906	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7.05	3/11/2020	(340,553)	117,555
6,055,000	コール	OTC USD/TRY	Citibank	USD 7.7	6/11/2020	(161,281)	149,183
11,044,000	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 5.4	24/11/2020	69,145	338,413
6,393,000	プット	OTC EUR/RUB	Citibank	EUR 73.441	22/12/2020	(183,731)	－
463,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 100	18/2/2021	(31,996)	127,739
370,000	プット	OTC USD/CAD	Credit Suisse	USD 1.41	21/12/2020	(157,862)	19,738
11,044,000	プット	OTC NZD/JPY	Deutsche Bank	NZD 69	9/9/2020	(23,627)	1,107
2,618,080	プット	OTC AUD/JPY	Deutsche Bank	AUD 71	12/10/2020	(317,652)	23,691
8,835,000	プット	OTC NZD/JPY	Deutsche Bank	NZD 69	15/10/2020	(15,645)	11,902
19,284,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 5.45	22/10/2020	130,507	535,143
9,642,000	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 6	22/10/2020	(49,778)	75,404
18,940,000	コール	OTC USD/CLP	Deutsche Bank	USD 775	3/11/2020	32,615	417,930
5,634,000	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 21.4	10/9/2020	(72,523)	9,358
37,178,024	コール	OTC EUR/AUD	Goldman Sachs	EUR 1.65	13/10/2020	(272,233)	178,408
1,235,640	コール	OTC EUR/AUD	Goldman Sachs	EUR 1.7	13/10/2020	(131,173)	67,785
245,390,000	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.18	13/10/2020	1,870,903	4,920,496
14,868,000	プット	OTC USD/INR	HSBC Bank Plc	USD 75	4/9/2020	141,190	278,123
7,718,000	コール	OTC USD/CAD	HSBC Bank Plc	USD 1.335	18/9/2020	(21,402)	5,997
19,880,000	プット	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.27	2/10/2020	(138,194)	15,972

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
2,079,000	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 100	18/2/2021	(90,657)	573,584
19,910,059	プット	OTC NZD/JPY	JP Morgan	NZD 68	10/9/2020	(226,882)	1,508
25,679,000	プット	OTC USD/TRY	JP Morgan	USD 6.5	10/9/2020	(117,093)	4
14,976,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 16	15/9/2020	(3,484)	11,042
15,250,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.215	25/9/2020	(20,509)	42,941
3,342,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107	29/9/2020	(23,356)	45,068
3,342,000	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107	29/9/2020	(89,436)	14,780
19,880,000	コール	OTC EUR/AUD	JP Morgan	EUR 1.65	6/10/2020	(159,700)	78,342
89,890,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.22	9/10/2020	(97,066)	324,018
884,000	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.7	15/10/2020	8,421	48,469
19,282,406	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.165	22/10/2020	361,001	626,044
22,275,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 106	22/10/2020	(44,974)	5,034
11,044,000	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107.5	22/10/2020	(9,622)	57,746
15,396,000	コール	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 15,000	23/10/2020	(109,373)	129,727
663,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 100	30/10/2020	(38,329)	32,612
13,472,000	コール	OTC USD/TWD	JP Morgan	USD 30	3/11/2020	(93,933)	21,117
4,400,000	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.2	16/11/2020	(59,177)	7,791
5,682,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 22.5	4/9/2020	110,242	167,181
9,940,000	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 16.7	9/9/2020	(1,059)	54,575
8,835,000	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 16.7	9/9/2020	28,338	48,508
4,418,000	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 17.8	9/9/2020	(5,082)	1,995
5,634,000	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 21.4	10/9/2020	(59,676)	9,358
5,467,000	プット	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.705	18/9/2020	(15,323)	2,205
8,898,912	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 5.4	29/9/2020	133,198	277,538
8,835,000	プット	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.58	6/10/2020	(4,231)	18,676
40,429,966	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 72.5	12/10/2020	(400,467)	23,339
40,429,965	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 73	13/10/2020	(391,194)	33,949
663,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 100	3/12/2020	(7,620)	62,393
5,522,000	プット	OTC AUD/USD	RBS Plc	AUD 0.67	23/9/2020	(9,685)	39
16,887,000	プット	OTC USD/JPY	Standard Chartered Bank	USD 105	22/10/2020	(46,896)	5,961
11,050,000	コール	OTC USD/TWD	Standard Chartered Bank	USD 30.9	11/11/2020	(30,237)	7,123
884,000	プット	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 1	8/9/2020	(61,843)	141
552,000	プット	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 1	10/9/2020	(56,626)	2,975
371,456	プット	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 1	10/9/2020	(41,905)	2,002
167	コール	Jupai Holdings Ltd	Goldman Sachs	JPY 7,000	4/9/2020	(33,690)	1,429
567	コール	Jupai Holdings Ltd	JP Morgan	JPY 7,000	30/10/2020	(15,210)	135,979
7,135	プット	S&P 500 Index	JP Morgan	USD 2,900	18/12/2020	(193,320)	67,108
277,000	コール	SPDR S&P 500 Trust	Morgan Stanley	USD 360	18/6/2021	4,825,139	5,974,689
59	コール	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 1,660	18/9/2020	(59,647)	249,865
1,680	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 4.5	18/12/2020	(76,621)	42,078
30	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 3,600	18/9/2020	(328,044)	184,425
100	プット	American Airlines Group Inc	Exchange Traded	USD 5	19/2/2021	(1,118)	3,850
948	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 420	18/9/2020	1,909,895	2,223,060

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
5,932	プット	Apple Inc	Exchange Traded	USD 350	16/10/2020	(1,594,522)	266,940
1,784	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 25	18/9/2020	12,131	224,784
2,632	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 27	18/12/2020	45,775	422,436
743	プット	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Exchange Traded	USD 30	20/11/2020	(155,064)	27,863
566	コール	Caesars Entertainment Corp Inc	Exchange Traded	USD 40	19/3/2021	111,046	815,040
421	コール	Caesars Entertainment Corp Inc	Exchange Traded	USD 35	19/3/2021	230,826	742,013
743	プット	Carnival Corp	Exchange Traded	USD 12.5	18/9/2020	(100,977)	10,030
1,174	プット	Carnival Corp	Exchange Traded	USD 15	16/10/2020	(106,829)	167,295
250	プット	Carnival Corp	Exchange Traded	USD 10	16/10/2020	(2,377)	6,125
258	プット	Caterpillar Inc	Exchange Traded	USD 115	18/9/2020	(13,500)	3,225
5,064	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 24	16/9/2020	(404,721)	468,420
297	プット	Chewy Inc	Exchange Traded	USD 45	16/10/2020	(129,474)	31,928
892	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 55	18/9/2020	(187,091)	49,506
370	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 65	18/9/2020	(148,903)	1,295
500	プット	Delta Air Lines Inc	Exchange Traded	USD 10	19/3/2021	(1,100)	17,000
891	コール	DR Horton Inc	Exchange Traded	USD 80	15/1/2021	(115,941)	371,993
600	コール	EPR Properties	Exchange Traded	USD 50	18/12/2020	(222,311)	34,500
297	プット	Etsy Inc	Exchange Traded	USD 70	18/9/2020	(177,450)	1,485
2,428	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,500	18/9/2020	(1,193,151)	99,906
526	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 2,900	18/9/2020	(14,381)	40,464
197	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,400	18/9/2020	(47,354)	40,177
131	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,250	18/9/2020	(4,653)	82,026
1,694	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,800	20/11/2020	(18,553)	76,775
122	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,300	18/12/2020	151,352	230,628
2,953	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 70	18/9/2020	(380,918)	57,232
1,860	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.75	13/12/2021	171,343	499,875
1,481	プット	Exxon Mobil Corp	Exchange Traded	USD 37.5	16/10/2020	(103,226)	168,093
385	コール	Facebook Inc	Exchange Traded	USD 265	18/9/2020	808,244	1,205,050
225	プット	Ford Motor Co	Exchange Traded	USD 7	18/9/2020	(832)	7,088
400	コール	Freeport-McMoRan Inc	Exchange Traded	USD 19	20/11/2020	4,120	22,000
154	コール	Freeport-McMoRan Inc	Exchange Traded	USD 15	20/11/2020	26,229	30,415
42	コール	Intel Corp	Exchange Traded	USD 75	18/9/2020	(6,179)	126
534	コール	JPMorgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 100	18/9/2020	(42,156)	206,925
605	コール	JPMorgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 110	18/12/2020	(72,122)	260,150
258	コール	Lions Gate Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 10	16/10/2020	3,074	15,480

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
210	コール	Lions Gate Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 10	18/12/2020	7,833	23,625
251	コール	Lions Gate Entertainment Corp	Exchange Traded	USD 11	15/1/2021	790	21,335
63	プット	Macy ' s Inc	Exchange Traded	USD 5	18/9/2020	(863)	472
39	コール	Micron Technology Inc	Exchange Traded	USD 60	16/10/2020	(5,614)	858
899	コール	Micron Technology Inc	Exchange Traded	USD 60	15/1/2021	(113,516)	114,173
129	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 230	18/9/2020	53,271	81,915
520	コール	MSCI Emerging Markets Index	Exchange Traded	USD 1,100	25/9/2020	(602,532)	1,110,200
23	コール	NASDAQ 100 Stock Index	Exchange Traded	USD 11,450	18/9/2020	1,185,217	1,647,490
22	コール	NASDAQ 100 Stock Index	Exchange Traded	USD 11,950	16/10/2020	574,630	1,292,720
334	コール	NXP Semiconductors NV	Exchange Traded	USD 150	18/9/2020	(16,287)	1,670
129	コール	NXP Semiconductors NV	Exchange Traded	USD 150	16/10/2020	(2,799)	5,998
225	プット	Occidental Petroleum Corp	Exchange Traded	USD 12	18/9/2020	2,543	9,113
444	コール	PayPal Holdings Inc	Exchange Traded	USD 200	18/9/2020	40,759	361,860
254	コール	Russell 2000 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 1,610	18/9/2020	(62,787)	369,570
200	コール	Russell 2000 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 1,550	18/9/2020	(23,830)	858,000
60	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,400	18/9/2020	460,886	769,800
44	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,400	18/9/2020	(43,599)	124,960
42	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,150	18/9/2020	(89,470)	34,440
42	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,375	18/9/2020	(230,706)	102,900
34	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,225	18/9/2020	(306,285)	38,590
34	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 2,925	18/9/2020	(106,899)	12,240
24	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,300	18/9/2020	(93,677)	39,000
53	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,500	18/12/2020	843,869	924,850
125	コール	Sabre Corp	Exchange Traded	USD 15	16/10/2020	(8,216)	625
1,487	プット	Slack Technologies Inc	Exchange Traded	USD 25	18/12/2020	(27,474)	273,608
1,487	コール	Slack Technologies Inc	Exchange Traded	USD 42	18/12/2020	(46,004)	342,753
394	プット	Southwest Airlines Co	Exchange Traded	USD 15	18/9/2020	(34,199)	1,576
100	プット	Southwest Airlines Co	Exchange Traded	USD 20	18/9/2020	(16,020)	900
134	プット	Southwest Airlines Co	Exchange Traded	USD 15	18/12/2020	(17,882)	1,005
134	プット	Southwest Airlines Co	Exchange Traded	USD 12.5	18/12/2020	(13,829)	536
129	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 342	4/9/2020	(12,034)	10,127
1,484	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 345	11/9/2020	747,961	1,128,582
7,448	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 342	18/9/2020	4,586,478	8,334,312
2,110	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	18/9/2020	1,607,547	2,703,965

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
1,187	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 345	18/9/2020	590,524	1,054,056
386	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 333	18/9/2020	529,515	728,768
129	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 325	18/9/2020	(15,970)	18,253
4,999	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	16/10/2020	2,161,583	4,501,599
1,776	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 333	16/10/2020	2,448,795	3,815,736
1,480	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 320	16/10/2020	(1,211,676)	551,300
1,034	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	20/11/2020	1,039,052	1,501,368
1,894	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	18/12/2020	2,578,302	4,521,925
1,485	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 360	18/12/2020	865,458	1,740,420
951	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	18/12/2020	699,746	1,646,181
743	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	31/12/2020	859,874	1,343,716
890	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	18/6/2021	144,002	498,845
1,211	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 305	17/12/2021	5,850,704	7,580,254
236	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 360	17/12/2021	320,088	625,990
125	プット	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 10	18/9/2020	3,038	9,063
200	プット	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Exchange Traded	USD 8	16/10/2020	(2,308)	3,800
200	プット	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 20	18/9/2020	(6,640)	400
120	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 138.5	4/9/2020	(16,180)	8,437
38	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 138.5	25/9/2020	(355)	9,203
1,280	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 138	23/10/2020	(141,946)	420,000
596	コール	Walmart Inc	Exchange Traded	USD 140	18/9/2020	51,664	157,344
593	コール	Walmart Inc	Exchange Traded	USD 135	18/9/2020	48,592	287,605
334	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 155	18/9/2020	(19,125)	7,515
200	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 145	18/9/2020	(3,321)	14,700
134	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 150	18/9/2020	(3,846)	5,025
1,361	コール	Wells Fargo & Co	Exchange Traded	USD 35	16/10/2020	(236,406)	8,847
630	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 70	16/10/2020	(23,301)	2,835
200	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 40	16/10/2020	20,260	39,100
129	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 42.5	16/10/2020	1,135	16,125
500	コール	Xerox Holdings Corp	Exchange Traded	USD 25	16/10/2020	(10,199)	7,500
134	コール	Xerox Holdings Corp	Exchange Traded	USD 30	15/1/2021	(2,908)	3,685
403	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 120	18/9/2020	(25,958)	9,471
67	コール	Zimmer Biomet Holdings Inc	Exchange Traded	USD 150	18/9/2020	(10,501)	6,834

買建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
35	コール	Zimmer Biomet Holdings Inc	Exchange Traded	USD 155	18/9/2020	(5,900)	1,138
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－2,061,004,324米ドル）						27,199,747	94,350,021

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建オプション　2020年８月31日現在

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
(15,400,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1125	31/8/2020	(718,091)	(1,234,337)
(13,938,000)	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 68	2/9/2020	90,444	－
(15,250,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.125	4/9/2020	(272,882)	(1,032,283)
(33,560,000)	コール	OTC USD/TWD	Bank of America	USD 31	4/9/2020	66,885	－
(269,980,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.22	9/9/2020	328,046	(97,759)
(13,270,000)	コール	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.6	10/9/2020	106,592	(80,913)
(14,976,000)	プット	OTC USD/ZAR	Bank of America	USD 16	15/9/2020	119,219	(11,042)
(19,282,407)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.205	22/9/2020	46,645	(84,306)
(6,627,000)	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.72	23/9/2020	(79,514)	(124,703)
(27,611,000)	プット	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.63	23/9/2020	73,004	－
(33,133,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.22	24/9/2020	(26,340)	(67,642)
(15,220,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.21	25/9/2020	427	(56,376)
(15,250,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.215	25/9/2020	5,654	(42,941)
(21,946,331)	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5.05	8/10/2020	73,650	(79,733)
(14,384,000)	プット	OTC USD/MXN	Bank of America	USD 22.8	9/10/2020	(416,126)	(641,523)
(22,194,067)	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 5	13/10/2020	76,538	(75,003)
(2,209,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	22/10/2020	16,981	(16,662)
(16,566,000)	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 107.5	22/10/2020	(7,268)	(86,619)
(28,715,700)	プット	OTC AUD/JPY	Bank of America	AUD 67	20/11/2020	100,946	(6,677)
(122,510,000)	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.2	13/10/2020	(956,853)	(1,157,806)
(186,570,000)	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.2	13/10/2020	(1,453,912)	(1,763,218)
(15,250,000)	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.175	4/9/2020	(242,486)	(271,277)
(16,214,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.153	23/9/2020	37,280	(5,806)
(4,418,000)	コール	OTC USD/ZAR	BNP Paribas	USD 17.75	13/10/2020	14,569	(31,246)
(20,045,000)	プット	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 100	22/10/2020	30,189	(19,723)
(4,418,000)	コール	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 76	27/11/2020	29,251	(104,946)
(33,133,000)	プット	OTC USD/RUB	BNP Paribas	USD 71.5	27/11/2020	(76,386)	(355,586)
(9,470,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 18.5	4/9/2020	54,357	－
(4,418,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.8	9/9/2020	64,821	(1,996)
(28,715,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 16.7	9/9/2020	(32,717)	(157,658)
(20,904,000)	プット	OTC USD/RUB	Citibank	USD 70.5	2/10/2020	45,029	(50,881)
(5,522,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 16	13/10/2020	36,957	(21,217)
(30,924,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 18.75	13/10/2020	153,613	(67,599)
(6,055,000)	プット	OTC USD/TRY	Citibank	USD 7.25	6/11/2020	(1,850)	(96,604)
(463,000)	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 100	18/11/2020	27,976	(76,663)
(5,522,000)	コール	OTC USD/BRL	Citibank	USD 6	24/11/2020	29,247	(76,696)
(22,089,000)	プット	OTC USD/BRL	Citibank	USD 5	24/11/2020	(58,689)	(188,888)
(308,000)	プット	OTC USD/CAD	Credit Suisse	USD 1.41	21/10/2020	118,573	(1,547)
(4,418,000)	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 17.1	9/9/2020	(47,314)	(84,978)
(5,522,500)	プット	OTC USD/ZAR	Deutsche Bank	USD 17.1	9/9/2020	(65,991)	(106,222)
(9,642,000)	コール	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 5.65	22/10/2020	104,520	(191,518)
(110,500)	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 107.25	26/10/2020	16,863	(71,488)
(9,470,000)	プット	OTC USD/CLP	Deutsche Bank	USD 740	3/11/2020	102,424	(48,301)
(22,728,000)	コール	OTC USD/CLP	Deutsche Bank	USD 810	3/11/2020	27,908	(191,213)
(8,451,000)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 20.3	10/9/2020	31,903	(24)

売建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
(37,178,024)	コール	OTC EUR/AUD	Goldman Sachs	EUR 1.71	13/10/2020	123,720	(31,382)
(245,390,000)	コール	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.2	13/10/2020	(1,914,642)	(2,319,109)
(7,434,000)	コール	OTC USD/INR	HSBC Bank Plc	USD 77	4/9/2020	24,474	—
(4,418,000)	コール	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.32	2/10/2020	(42,371)	(90,121)
(16,566,600)	プット	OTC GBP/USD	HSBC Bank Plc	GBP 1.23	2/10/2020	35,490	(727)
(2,079,000)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank Plc	USD 100	19/11/2020	69,636	(349,282)
(11,044,000)	コール	OTC EUR/NOK	JP Morgan	EUR 10.6	2/9/2020	56,519	(767)
(24,887,574)	プット	OTC NZD/JPY	JP Morgan	NZD 65	10/9/2020	131,986	(91)
(15,250,000)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.185	25/9/2020	(17,327)	(210,011)
(10,695,798)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107	29/9/2020	172,919	(144,238)
(10,695,798)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 107	29/9/2020	269,854	(47,303)
(4,263,000)	プット	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.609	6/10/2020	93,598	—
(4,263,000)	コール	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.609	6/10/2020	(450,984)	(544,582)
(8,835,000)	プット	OTC EUR/AUD	JP Morgan	EUR 1.58	6/10/2020	22,859	(18,676)
(26,506,560)	コール	OTC EUR/AUD	JP Morgan	EUR 1.7	6/10/2020	110,557	(20,963)
(3,327,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 108.45	6/10/2020	560	(82,532)
(3,327,000)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 108.45	6/10/2020	76,613	(6,479)
(89,890,000)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.23	9/10/2020	88,028	(206,413)
(19,282,406)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.185	22/10/2020	(216,259)	(349,898)
(3,313,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 105	22/10/2020	16,473	(24,989)
(11,044,000)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 106	22/10/2020	8,940	(124,361)
(23,094,000)	コール	OTC USD/IDR	JP Morgan	USD 15,500	23/10/2020	104,163	(74,584)
(4,400,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7.6	16/11/2020	25,248	(359)
(4,735,000)	コール	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 24	4/9/2020	28,524	—
(5,522,000)	コール	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 16.7	9/9/2020	3,412	(79,031)
(9,939,500)	プット	OTC USD/ZAR	Morgan Stanley	USD 17.1	9/9/2020	(20,828)	(191,181)
(16,566,000)	コール	OTC USD/BRL	Morgan Stanley	USD 6.2	10/9/2020	32,782	(351)
(8,451,000)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 20.3	10/9/2020	23,690	(23)
(1,325,000)	コール	OTC EUR/AUD	Morgan Stanley	EUR 1.65	6/10/2020	17,455	(5,222)
(40,429,965)	プット	OTC AUD/JPY	Morgan Stanley	AUD 69.5	13/10/2020	165,541	(2,260)
(74,291)	コール	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 1	10/9/2020	19,622	(25,931)
(110,000)	コール	OTC EUR/NOK	UBS	EUR 1	10/9/2020	31,805	(38,395)
(167)	コール	Jupai Holdings Ltd	Goldman Sachs	JPY 8,000	4/9/2020	5,707	—
(567)	コール	Jupai Holdings Ltd	JP Morgan	JPY 8,000	30/10/2020	2,809	(28,907)
(567)	コール	Jupai Holdings Ltd	JP Morgan	JPY 7,600	30/10/2020	3,241	(55,891)
(15)	コール	Adobe Inc	Exchange Traded	USD 470	16/10/2020	(83,171)	(93,937)
(4)	コール	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 1,640	18/9/2020	(14,744)	(20,900)
(119)	コール	Alphabet Inc	Exchange Traded	USD 1,760	18/9/2020	192,207	(147,560)
(1,680)	コール	Altice Europe NV	Exchange Traded	EUR 6.5	18/12/2020	30,706	(6,011)
(2)	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 2,960	18/9/2020	(89,787)	(97,425)
(59)	コール	Amazon.com Inc	Exchange Traded	USD 4,000	18/9/2020	469,782	(74,045)
(297)	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 55	18/9/2020	(1,890,269)	(2,171,812)
(1,896)	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 445	18/9/2020	(3,010,058)	(3,346,440)
(1,996)	コール	Apple Inc	Exchange Traded	USD 555	18/9/2020	(172,257)	(499,998)

売建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
(8,908)	プット	Apple Inc	Exchange Traded	USD 330	16/10/2020	606,849	(289,510)
(102)	コール	Applied Materials Inc	Exchange Traded	USD 72.5	16/10/2020	5,487	(6,222)
(1,238)	コール	Bank of America Corp	Exchange Traded	USD 28	18/9/2020	26,368	(24,141)
(743)	プット	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Exchange Traded	USD 25	20/11/2020	39,229	(33,435)
(92)	コール	Capital One Financial Corp	Exchange Traded	USD 82.5	18/9/2020	11,205	(2,852)
(129)	プット	Caterpillar Inc	Exchange Traded	USD 100	18/9/2020	1,916	(710)
(898)	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 30	16/9/2020	13,806	(206,540)
(7,595)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	16/9/2020	161,729	(56,962)
(11)	コール	Charter Communications Inc	Exchange Traded	USD 605	18/9/2020	(17,265)	(23,815)
(297)	プット	Chewy Inc	Exchange Traded	USD 35	16/10/2020	51,422	(7,871)
(126)	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 60	18/9/2020	8,102	(1,323)
(892)	コール	Citigroup Inc	Exchange Traded	USD 62.5	18/9/2020	77,930	(5,352)
(891)	プット	DR Horton Inc	Exchange Traded	USD 60	15/1/2021	(48,695)	(285,120)
(891)	コール	DR Horton Inc	Exchange Traded	USD 95	15/1/2021	14,206	(108,257)
(297)	プット	Etsy Inc	Exchange Traded	USD 60	18/9/2020	87,313	(891)
(131)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,050	18/9/2020	4,503	(23,202)
(197)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,550	18/9/2020	25,578	(3,877)
(2,428)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,700	18/9/2020	139,757	(10,135)
(1,694)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,900	20/11/2020	—	(34,347)
(122)	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,550	18/12/2020	(45,546)	(72,098)
(5,906)	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 80	18/9/2020	205,052	(26,415)
(465)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 100	13/12/2021	22,492	(52,313)
(930)	コール	Eurodollar IMM	Exchange Traded	USD 99.375	13/12/2021	(600,203)	(1,005,562)
(24)	コール	Facebook Inc	Exchange Traded	USD 275	18/9/2020	(43,452)	(56,280)
(770)	コール	Facebook Inc	Exchange Traded	USD 285	18/9/2020	(885,756)	(1,283,975)
(24)	コール	Home Depot Inc/The	Exchange Traded	USD 280	18/9/2020	(13,259)	(19,980)
(39)	コール	Johnson & Johnson	Exchange Traded	USD 165	18/9/2020	4,263	(624)
(534)	コール	JPMorgan Chase & Co	Exchange Traded	USD 110	18/9/2020	70,454	(37,380)
(250)	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 232.5	28/8/2020	2,010	(1,250)
(129)	コール	Microsoft Corp	Exchange Traded	USD 250	18/9/2020	(13,590)	(19,930)
(142)	コール	Morgan Stanley	Exchange Traded	USD 50	18/9/2020	(33,470)	(43,665)
(520)	コール	MSCI Emerging Markets Index	Exchange Traded	USD 1,150	25/9/2020	262,766	(247,000)
(14)	コール	NASDAQ 100 Stock Index	Exchange Traded	USD 9,175	18/9/2020	(3,188,379)	(4,015,410)
(46)	コール	NASDAQ 100 Stock Index	Exchange Traded	USD 11,800	18/9/2020	(1,559,689)	(2,090,010)
(16)	コール	NVIDIA Corp	Exchange Traded	USD 460	18/9/2020	(91,340)	(108,360)

売建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
(38)	コール	PayPal Holdings Inc	Exchange Traded	USD 180	18/9/2020	(82,012)	(91,010)
(889)	コール	PayPal Holdings Inc	Exchange Traded	USD 220	18/9/2020	66,533	(136,906)
(134)	コール	Russell 2000 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 1,650	18/9/2020	134,045	(75,710)
(134)	プット	Russell 2000 E-Mini Index	Exchange Traded	USD 1,200	18/9/2020	260,092	(10,385)
(34)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,050	18/9/2020	165,931	(19,040)
(42)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,250	18/9/2020	132,773	(53,550)
(42)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,275	18/9/2020	147,443	(60,270)
(44)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,325	18/9/2020	31,582	(81,400)
(58)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,100	18/9/2020	238,997	(38,860)
(60)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,500	18/9/2020	(262,354)	(335,100)
(53)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,600	18/12/2020	(584,534)	(628,315)
(1,487)	コール	Slack Technologies Inc	Exchange Traded	USD 35	18/12/2020	72,956	(613,387)
(258)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 330	4/9/2020	7,731	(4,773)
(338)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 337	11/9/2020	5,566	(42,926)
(338)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 358	11/9/2020	(2,474)	(36,504)
(743)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	11/9/2020	60,959	(120,366)
(1,484)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	11/9/2020	(453,663)	(622,538)
(129)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 305	18/9/2020	5,792	(8,062)
(593)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 360	18/9/2020	(73,058)	(93,694)
(474)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 253	30/9/2020	(3,374,286)	(4,609,176)
(474)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 253	30/9/2020	1,201,654	(14,457)
(771)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 230	30/9/2020	(7,558,425)	(9,262,408)
(771)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 230	30/9/2020	2,037,488	(12,721)
(618)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	16/10/2020	(2,302,199)	(3,468,834)
(618)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 295	16/10/2020	1,121,519	(114,330)
(938)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 375	16/10/2020	(58,650)	(104,587)
(1,468)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	16/10/2020	246,739	(310,482)
(2,424)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	16/10/2020	1,074,387	(676,296)
(1,128)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	20/11/2020	307,696	(709,512)
(1,128)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 360	20/11/2020	(524,757)	(1,025,352)
(1,531)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	20/11/2020	72,863	(770,093)

売建オプション　2020年８月31日現在（続き）

契約数	コール／プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
(1,793)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 300	18/12/2020	(9,699)	(1,269,444)
(743)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	31/12/2020	347,192	(209,155)
(890)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 250	18/6/2021	(20,217)	(663,050)
(118)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 270	17/12/2021	48,647	(174,758)
(354)	コール	STMicroelectronics NV	Exchange Traded	EUR 29	18/9/2020	16,702	(4,855)
(166)	コール	Uber Technologies Inc	Exchange Traded	USD 46	18/9/2020	16,649	(415)
(20)	コール	Unitedhealth Group Inc	Exchange Traded	USD 340	18/9/2020	6,206	(1,290)
(173)	コール	US Bancorp	Exchange Traded	USD 42.5	18/9/2020	6,626	(1,125)
(731)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 138	20/11/2020	67,420	(468,297)
(596)	プット	Walmart Inc	Exchange Traded	USD 125	18/9/2020	16,293	(30,694)
(1,783)	コール	Walmart Inc	Exchange Traded	USD 145	18/9/2020	(21,811)	(246,054)
(200)	コール	Walt Disney Co/The	Exchange Traded	USD 160	18/9/2020	5,053	(3,300)
(129)	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 47.5	16/10/2020	(864)	(7,546)
(134)	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 57.5	16/10/2020	17,125	(1,474)
(200)	コール	Western Digital Corp	Exchange Traded	USD 45	16/10/2020	(8,740)	(16,500)
(65)	コール	Xilinx Inc	Exchange Traded	USD 110	18/9/2020	1,937	(6,370)
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー−1,153,006,136米ドル）						(19,983,039)	(57,873,992)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済取引　2020年８月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／（損）（米ドル）
	ブラジル		
179,649	Oi SA	Merrill Lynch	19,761
			19,761
	カナダ		
44,319	Bausch Health Cos Inc	Merrill Lynch	(50,967)
			(50,967)
	ドイツ		
99,951	Tele Columbus AG	Merrill Lynch	(35,763)
			(35,763)
	イタリア		
2,397,642	Telecom Italia SpA/Milano	Merrill Lynch	106,949
29,149	UniCredit SpA	Merrill Lynch	6,918
			113,867
	ルクセンブルグ		
12,754	Ardagh Group SA	Merrill Lynch	1,275
65,483	Aroundtown SA	Merrill Lynch	(37,800)
			(36,525)
	オランダ		
226,901	ALTICE EUROPE NV	Merrill Lynch	(83,621)
			(83,621)
	英国		
345,810	Arrow Global Group Plc	Merrill Lynch	160,307
609,424	ITV Plc	Merrill Lynch	(7,793)
			152,514
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－5,427,995米ドル）			79,266

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション　2020年８月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD 52,820,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.39%の固定金利を24/11/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/8/2023より四半期毎に支払う。	Bank of America	22/5/2023	(5,124)	155,977
JPY 1,354,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	(344,458)	－
JPY 1,354,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を16/3/2021より半年毎に受け取り、６ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/9/2020	537,558	882,016
USD 165,050,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2%の固定金利を25/3/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に支払う。	Barclays	23/9/2020	2,703,072	3,222,979
USD 14,853,200	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/6/2021より四半期毎に受け取り、1.25%の固定金利を25/9/2021より半年毎に支払う。	Barclays	23/3/2021	150,726	666,132
USD 19,910,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2021より四半期毎に受け取り、3.8%の固定金利を9/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	(738,191)	38,532
USD 16,665,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	817,449	1,384,059
USD 16,665,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/11/2021より四半期毎に受け取り、1.65%の固定金利を17/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	13/8/2021	(523,609)	43,001
USD 16,020,250	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	2,250,505	2,987,036
USD 16,020,250	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/6/2024より四半期毎に受け取り、2.9775%の固定金利を11/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	7/3/2024	(600,499)	136,032
USD 16,020,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に受け取り、2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	(585,681)	136,421

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD 16,020,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.95%の固定金利を14/9/2024より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2024より四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2024	2,220,256	2,942,357
EUR 5,600,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	16/9/2020	4,543	60,856
EUR 16,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	18/11/2020	(294,101)	155,257
EUR 16,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	18/11/2020	(112,721)	35,419
USD 14,173,556	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは１%の固定金利を15/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2021より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	11/6/2021	12,231	868,314
USD 15,712,739	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.72%の固定金利を21/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/1/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	19/10/2020	(248,561)	142,275
USD 35,567,419	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/2/2021より四半期毎に受け取り、0.81%の固定金利を23/5/2021より半年毎に支払う。	Citibank	19/11/2020	71,720	327,805
USD 24,436,269	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/5/2021より四半期毎に受け取り、0.8875%の固定金利を10/8/2021より半年毎に支払う。	Citibank	8/2/2021	1,415,804	2,567,685
USD 7,510,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に受け取り、1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	(242,352)	26,413
USD 7,510,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.46%の固定金利を18/2/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を18/11/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	16/8/2021	221,941	490,705
USD 10,460,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/5/2025より四半期毎に受け取り、1.492%の固定金利を27/8/2025より半年毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	(169,114)	380,298

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD 10,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.492%の固定金利を27/8/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/5/2025より四半期毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	106,089	655,501
USD 10,193,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2028より四半期毎に支払う。	Citibank	27/6/2028	1,137,424	1,713,416
EUR 11,200,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	Credit Suisse	21/10/2020	(127,148)	33,502
USD 4,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/12/2020より四半期毎に受け取り、1.35%の固定金利を8/3/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	4/9/2020	(174,136)	14
USD 76,183,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/1/2021より四半期毎に受け取り、1.145%の固定金利を28/4/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	26/10/2020	1,280,997	2,553,253
USD 4,680,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.828%の固定金利を25/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/2/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	23/11/2020	(211,469)	112,387
USD 4,680,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/2/2021より四半期毎に受け取り、0.828%の固定金利を25/5/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	23/11/2020	158,035	481,891
USD 5,900,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.89%の固定金利を2/11/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/8/2025より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	30/4/2025	(90,211)	228,094
USD 5,900,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/8/2025より四半期毎に受け取り、0.89%の固定金利を2/11/2025より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	30/4/2025	99,874	418,179
USD 38,377,975	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.58%の固定金利を29/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/1/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2020	(486,202)	278,968
USD 38,377,975	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/1/2021より四半期毎に受け取り、0.98%の固定金利を29/4/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2020	1,685,983	2,395,757

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD 13,330,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/3/2021より四半期毎に受け取り、1.06%の固定金利を22/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	18/12/2020	520,500	835,002
USD 52,970,099	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.85%の固定金利を22/6/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/3/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	18/12/2020	(1,284,535)	1,607,565
USD 15,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/3/2021より四半期毎に受け取り、1.1%の固定金利を23/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/12/2020	246,687	845,187
USD 19,520,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/9/2021より四半期毎に受け取り、1.41%の固定金利を22/12/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	18/6/2021	240,017	637,319
USD 17,465,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/8/2022より四半期毎に受け取り、3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	(787,630)	137,279
USD 4,215,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/9/2025より四半期毎に受け取り、1.2825%の固定金利を6/12/2025より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	4/6/2025	(20,144)	207,887
USD 4,215,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2825%の固定金利を6/12/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/9/2025より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	4/6/2025	(2,257)	225,774
EUR 2,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	JP Morgan	16/9/2020	(44,109)	3,666
USD 31,493,631	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/1/2020より四半期毎に受け取り、0.75%の固定金利を6/4/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/10/2020	(415,037)	189,425
EUR 11,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	JP Morgan	21/10/2020	(75,554)	113,409
EUR 11,300,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に受け取り、５%の固定金利を支払う。	JP Morgan	21/10/2020	(36,385)	33,801

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
JPY 592,100,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、６ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	333,452	518,517
JPY 592,100,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月JPY BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より半年毎に受け取り、0.78%の固定金利を20/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	16/4/2021	(178,483)	6,660
USD 43,465,573	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは１%の固定金利を6/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/9/2021より四半期毎に支払う。	JP Morgan	4/6/2021	(76,164)	2,633,914
USD 32,780,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に受け取り、2.25%の固定金利を4/2/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	(591,456)	293,604
USD 92,660,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/2/2025より四半期毎に受け取り、1.772%の固定金利を7/5/2025より半年毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2024	(390,787)	110,504
USD 92,660,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.772%の固定金利を7/5/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/2/2025より四半期毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2024	654,150	1,155,441
USD 14,419,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に受け取り、3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	(580,347)	209,093
USD 14,419,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1825%の固定金利を4/11/2028より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2028より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/5/2028	1,792,596	2,582,036
USD 2,255,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(32,220)	73,765
USD 2,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/7/2038より四半期毎に受け取り、2.985%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	272,524	378,509
USD 2,777,500	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に受け取り、2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(44,228)	93,189

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD 2,777,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.86%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2039より四半期毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	305,906	443,323
USD 64,407,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.93%の固定金利を23/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/1/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	21/10/2020	(2,465,338)	1,229,936
USD 32,040,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に受け取り、2.5%の固定金利を17/12/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	(1,119,440)	321,025
USD 4,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に受け取り、3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	(194,220)	86,990
USD 4,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.0366%の固定金利を16/7/2029より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/4/2029より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	11/1/2029	540,606	821,816
USD 20,510,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/8/2022より四半期毎に受け取り、2.85%の固定金利を11/11/2022より半年毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	(790,406)	400,480
USD 8,940,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に受け取り、3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	(351,556)	156,907
USD 8,940,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.04%の固定金利を12/7/2029より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2029より四半期毎に支払う。	Nomura	10/1/2029	980,642	1,489,104
USD 4,215,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2025より四半期毎に受け取り、1.429%の固定金利を9/12/2025より半年毎に支払う。	UBS	5/6/2025	(48,141)	177,783
USD 4,215,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.429%の固定金利を9/12/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2025より四半期毎に支払う。	UBS	5/6/2025	27,979	253,903

買建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
EUR 12,595,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を20/7/2028より半年毎に受け取り、３％の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(669,719)	165,648
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－658,465,753米ドル）				5,637,533	44,958,992

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

売建スワップション　2020年８月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (784,851,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.55%の固定金利を7/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/1/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	5/10/2020	3,973,308	－
USD (627,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.75%の固定金利を15/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/1/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	13/10/2020	2,273,129	－
USD (10,480,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.625%の固定金利を4/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	2/11/2020	255,369	(81)
USD (4,405,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.765%の固定金利を19/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/7/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	15/4/2021	26,407	(94,951)
USD (4,405,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/7/2021より四半期毎に受け取り、0.765%の固定金利を19/10/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	15/4/2021	36,809	(84,549)
USD (4,405,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.7175%の固定金利を19/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を20/7/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	16/4/2021	11,773	(109,805)
USD (4,405,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を20/7/2021より四半期毎に受け取り、0.7175%の固定金利を19/10/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	16/4/2021	42,776	(78,802)
USD (38,370,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは１%の固定金利を3/12/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2023より四半期毎に支払う。	Bank of America	1/6/2021	160,382	(418,046)
USD (9,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.05%の固定金利を15/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	11/6/2021	52,625	(81,158)
USD (9,235,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.742%%の固定金利を29/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	25/6/2021	(10,176)	(253,056)
USD (9,235,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/9/2021より四半期毎に受け取り、0.742%の固定金利を29/12/2021より半年毎に支払う。	Bank of America	25/6/2021	53,492	(189,389)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (9,340,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.665%の固定金利を16/1/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/10/2021より四半期毎に支払う。	Bank of America	14/7/2021	(78,561)	(317,198)
USD (9,340,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/10/2021より四半期毎に受け取り、0.665%の固定金利を16/1/2022より半年毎に支払う。	Bank of America	14/7/2021	60,771	(177,866)
USD (15,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を12/7/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	10/1/2022	299,177	(68,892)
USD (5,270,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.15%の固定金利を12/7/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/4/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	10/1/2022	273	(79,304)
USD (12,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.85%の固定金利を24/8/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	22/2/2022	135,878	(78,842)
USD (12,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.85%の固定金利を24/8/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を24/5/2022より四半期毎に支払う。	Bank of America	22/2/2022	129,778	(78,842)
USD (32,290,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/7/2023より四半期毎に受け取り、0.61%の固定金利を12/10/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	6/4/2023	(26,483)	(145,956)
USD (32,290,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.61%の固定金利を12/10/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/7/2023より四半期毎に支払う。	Bank of America	6/4/2023	60,635	(58,837)
USD (330,110,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に受け取り、0.7%の固定金利を25/3/2021より半年毎に支払う。	Barclays	23/9/2020	(2,779,038)	(3,142,159)
USD (100,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは２%の固定金利を1/6/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/3/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	27/11/2020	136,827	(1)
USD (24,030,250)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/6/2021より四半期毎に受け取り、2.7875%の固定金利を10/9/2021より半年毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	(4,028,432)	(4,744,833)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (24,030,250)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.7875%の固定金利を10/9/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/6/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	8/3/2021	712,437	(3,965)
EUR (155,850,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.1%の固定金利を31/3/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を30/9/2021より半年毎に支払う。	Barclays	29/3/2021	532,666	(10,084)
USD (4,610,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.6925%の固定金利を8/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	6/4/2021	9,235	(119,845)
USD (9,220,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に受け取り、0.7125%の固定金利を8/10/2021より半年毎に支払う。	Barclays	6/4/2021	97,238	(160,922)
USD (9,220,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.7125%の固定金利を8/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	6/4/2021	31,400	(226,760)
USD (4,610,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に受け取り、0.6925%の固定金利を8/10/2021より半年毎に支払う。	Barclays	6/4/2021	51,202	(77,878)
USD (4,660,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/7/2021より四半期毎に受け取り、0.877%の固定金利を16/10/2021より半年毎に支払う。	Barclays	14/4/2021	16,665	(109,621)
USD (4,660,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.877%の固定金利を16/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/7/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	14/4/2021	57,450	(68,836)
EUR (14,100,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは２%の固定金利を6/5/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を6/11/2021より半年毎に支払う。	Barclays	4/5/2021	349,445	(2,109)
EUR (79,776,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.11%の固定金利を19/5/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を19/11/2021より半年毎に支払う。	Barclays	17/5/2021	256,272	(7,879)
USD (259,565,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を1/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/9/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	27/5/2021	726,491	(1,588)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (42,170,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.87%の固定金利を9/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/9/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	7/6/2021	808,510	(17,633)
EUR (79,370,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.05%の固定金利を14/6/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/12/2021より半年毎に支払う。	Barclays	10/6/2021	187,728	(11,824)
EUR (40,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.05%の固定金利を7/7/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を7/1/2022より半年毎に支払う。	Barclays	2/7/2021	75,568	(10,659)
USD (8,070,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.95%の固定金利を6/2/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/11/2021より四半期毎に支払う。	Barclays	4/8/2021	(42,284)	(131,861)
EUR (53,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.15%の固定金利を11/8/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	45,964	(26,913)
EUR (95,440,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.15%の固定金利を11/8/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/2/2022より半年毎に支払う。	Barclays	9/8/2021	84,687	(47,734)
USD (15,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.1%の固定金利を10/7/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/4/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	6/1/2022	291,546	(69,720)
USD (11,167,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.6%の固定金利を8/9/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	4/3/2022	89,406	(94,850)
EUR (20,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.115%の固定金利を6/4/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を6/10/2022より半年毎に支払う。	Barclays	4/4/2022	98,381	(154,578)
EUR (20,040,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を6/10/2022より半年毎に受け取り、-0.115%の固定金利を6/4/2023より毎年支払う。	Barclays	4/4/2022	(27,563)	(280,522)
EUR (23,090,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/10/2022より半年毎に受け取り、-0.02%の固定金利を11/4/2023より毎年支払う。	Barclays	7/4/2022	(103,849)	(399,942)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
EUR (23,090,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.02%の固定金利を11/4/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を11/10/2022より半年毎に支払う。	Barclays	7/4/2022	184,065	(112,027)
EUR (81,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.021%の固定金利を12/4/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を12/10/2022より半年毎に支払う。	Barclays	8/4/2022	524,021	(505,745)
EUR (81,940,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を12/10/2022より半年毎に受け取り、-0.021%の固定金利を12/4/2023より毎年支払う。	Barclays	8/4/2022	(757,685)	(1,787,451)
EUR (21,622,636)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2022より半年毎に受け取り、-0.15%の固定金利を21/4/2023より毎年支払う。	Barclays	19/4/2022	(85,009)	(353,338)
EUR (54,010,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2022より半年毎に受け取り、-0.127%の固定金利を21/4/2023より毎年支払う。	Barclays	19/4/2022	(67,685)	(737,498)
EUR (21,622,636)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.15%の固定金利を21/4/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2022より半年毎に支払う。	Barclays	19/4/2022	119,794	(148,535)
EUR (54,010,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.127%の固定金利を21/4/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2022より半年毎に支払う。	Barclays	19/4/2022	319,240	(350,573)
EUR (10,450,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは-0.035%の固定金利を15/9/2023より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に支払う。	Barclays	13/9/2022	67,549	(94,959)
EUR (10,450,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に受け取り、-0.035%の固定金利を15/9/2023より毎年支払う。	Barclays	13/9/2022	(52,521)	(215,028)
USD (12,705,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2029より四半期毎に受け取り、3.05%の固定金利を14/9/2029より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	(1,450,202)	(2,124,202)
USD (12,705,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を14/9/2029より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/6/2029より四半期毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	447,751	(226,250)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
EUR (5,600,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	16/9/2020	52,132	(1,621)
EUR (16,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	18/11/2020	185,539	(71,237)
EUR (16,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	18/11/2020	166,454	(60,694)
USD (14,173,556)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/9/2021より四半期毎に受け取り、0.5%の固定金利を15/12/2021より半年毎に支払う。	BNP Paribas	11/6/2021	(146,906)	(487,072)
USD (9,235,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/10/2021より四半期毎に受け取り、0.715%の固定金利を1/1/2022より半年毎に支払う。	BNP Paribas	29/6/2021	57,322	(184,058)
USD (9,235,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.715%の固定金利を1/1/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/10/2021より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	29/6/2021	(31,219)	(272,599)
USD (15,712,739)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.07%の固定金利を21/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/1/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	19/10/2020	(337,917)	(665,754)
USD (57,750,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.28%の固定金利を10/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/2/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	6/11/2020	(137,035)	(376,850)
USD (9,548,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/2/2021より四半期毎に受け取り、0.5%の固定金利を16/5/2021より半年毎に支払う。	Citibank	12/11/2020	8,195	(51,480)
USD (35,567,419)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/2/2021より四半期毎に受け取り、0.51%の固定金利を23/5/2021より半年毎に支払う。	Citibank	19/11/2020	21,544	(217,469)
USD (222,586,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.485%の固定金利を27/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を27/2/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	25/11/2020	96,335	(398,919)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (49,530,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より四半期毎に受け取り、1.53%の固定金利を16/6/2021より半年毎に支払う。	Citibank	14/12/2020	(1,055,630)	(1,293,374)
USD (49,530,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.53%の固定金利を16/6/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/3/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	14/12/2020	237,739	(5)
USD (36,654,402)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2375%の固定金利を10/8/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/5/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	8/2/2021	(871,215)	(1,525,895)
USD (134,399,473)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.385%の固定金利を10/8/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を10/5/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	8/2/2021	(294,525)	(801,124)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.1%の固定金利を14/4/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/10/2021より半年毎に支払う。	Citibank	12/4/2021	397,937	(8,779)
USD (5,180,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.79%の固定金利を19/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/7/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	15/4/2021	37,479	(102,666)
USD (5,180,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/7/2021より四半期毎に受け取り、0.79%の固定金利を19/10/2021より半年毎に支払う。	Citibank	15/4/2021	36,999	(103,146)
USD (193,485,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.35%の固定金利を19/11/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/8/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	17/5/2021	382,889	(695)
USD (5,730,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.1%の固定金利を16/1/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を16/10/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	14/7/2021	11,316	(49,422)
USD (5,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.1%の固定金利を20/1/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を20/10/2021より四半期毎に支払う。	Citibank	16/7/2021	7,519	(51,481)
EUR (11,200,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	Credit Suisse	21/10/2020	64,873	(15,452)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (80,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.6%の固定金利を28/3/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/12/2020より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	24/9/2020	93,965	－
USD (12,348,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.764%の固定金利を29/3/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/12/2020より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	25/9/2020	256,794	(53,141)
USD (12,348,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/12/2020より四半期毎に受け取り、0.764%の固定金利を29/3/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	25/9/2020	215,181	(94,754)
USD (44,545,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは１%の固定金利を7/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/1/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	5/10/2020	46,772	－
USD (12,860,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/1/2021より四半期毎に受け取り、0.15%の固定金利を15/4/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	13/10/2020	6,952	(8,994)
USD (25,720,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.45%の固定金利を15/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/1/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	13/10/2020	19,656	(22,782)
USD (20,920,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/1/2021より四半期毎に受け取り、0.15%の固定金利を21/4/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/10/2020	(5,733)	(18,450)
USD (20,920,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.45%の固定金利を21/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/1/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	19/10/2020	(4,159)	(23,601)
USD (76,183,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.405%の固定金利を28/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を28/1/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	26/10/2020	(135,449)	(543,028)
USD (38,216,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を12/2/2021より四半期毎に受け取り、0.5%の固定金利を12/5/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	10/11/2020	101,863	(200,044)
USD (4,610,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.688%の固定金利を8/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	6/4/2021	3,975	(121,302)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (4,610,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に受け取り、0.688%の固定金利を8/10/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/4/2021	47,977	(77,299)
USD (17,940,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/9/2021より四半期毎に受け取り、0.746%の固定金利を4/12/2021より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	2/6/2021	91,323	(358,522)
USD (17,940,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.746%の固定金利を4/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/9/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	2/6/2021	(12,940)	(462,786)
USD (8,790,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.95%の固定金利を9/2/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/11/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	5/8/2021	(42,658)	(144,622)
USD (11,350,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.6%の固定金利を2/9/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を2/6/2021より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	28/2/2022	112,414	(94,723)
USD (11,350,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.6%の固定金利を7/9/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/6/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	3/3/2022	105,919	(96,111)
USD (17,815,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.6%の固定金利を8/9/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/6/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	4/3/2022	147,976	(151,316)
USD (9,120,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2022より四半期毎に受け取り、0.74%の固定金利を4/11/2022より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	2/5/2022	86,391	(229,161)
USD (9,120,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.74%の固定金利を4/11/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/8/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	2/5/2022	(67,507)	(383,059)
USD (52,820,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.685%の固定金利を13/10/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/7/2023より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	113,838	(88,859)
USD (52,820,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/7/2023より四半期毎に受け取り、0.685%の固定金利を13/10/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	(68,794)	(271,491)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (48,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.05%の固定金利を6/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/1/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	2/10/2020	84,744	－
USD (48,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.05%の固定金利を6/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を6/1/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	2/10/2020	56,576	－
USD (194,258,887)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/1/2021より四半期毎に受け取り、0.17%の固定金利を29/4/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2020	124,965	(252,756)
USD (194,258,887)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.37%の固定金利を29/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を29/1/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	27/10/2020	(305,897)	(611,871)
USD (49,530,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.535%の固定金利を15/6/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/3/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	11/12/2020	236,501	(4)
USD (49,530,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/3/2021より四半期毎に受け取り、1.535%の固定金利を15/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/12/2020	(1,061,610)	(1,298,116)
USD (52,970,099)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.2%の固定金利を22/6/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/3/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	18/12/2020	(650,011)	(2,124,161)
USD (52,970,099)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/3/2021より四半期毎に受け取り、0.6%の固定金利を22/6/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	18/12/2020	599,521	(989,530)
EUR (121,810,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.16%の固定金利を14/4/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を14/10/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/4/2021	403,556	(7,181)
USD (8,890,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/8/2021より四半期毎に受け取り、0.685%の固定金利を17/11/2021より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	13/5/2021	68,107	(158,255)
USD (8,890,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.685%の固定金利を17/11/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/8/2021より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	13/5/2021	(31,132)	(257,494)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (43,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.25%の固定金利を5/11/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を5/8/2022より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	3/5/2022	844,685	(68,633)
EUR (2,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	JP Morgan	16/9/2020	15,607	(811)
USD (15,435,000)	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.66%の固定金利を25/3/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に支払う。	JP Morgan	23/9/2020	425,933	(53,324)
USD (15,435,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を25/12/2020より四半期毎に受け取り、0.66%の固定金利を25/3/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	23/9/2020	322,112	(157,144)
EUR (22,600,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは５%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.33.V1の変動金利を20/6/2020より四半期毎に支払う。	JP Morgan	21/10/2020	99,575	(116,382)
USD (92,660,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.582%の固定金利を9/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/2/2021より四半期毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2020	219,141	－
USD (92,660,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/2/2021より四半期毎に受け取り、1.582%の固定金利を9/5/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	5/11/2020	(1,019,818)	(1,238,959)
EUR (23,400,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.15%の固定金利を21/4/2022より半年毎に受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	19/4/2021	498,932	(2,415)
USD (43,465,573)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/9/2021より四半期毎に受け取り、0.5%の固定金利を8/12/2021より半年毎に支払う。	JP Morgan	4/6/2021	(423,269)	(1,466,442)
USD (111,407,434)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは２%の固定金利を15/8/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を15/5/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	11/2/2022	1,535,270	(620,464)
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.25%の固定金利を4/2/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	1,908	(212,801)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (32,780,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を4/2/2023より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/11/2022より四半期毎に支払う。	JP Morgan	2/8/2022	204,988	(244,098)
USD (10,162,452)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/12/2020より四半期毎に受け取り、0.675%の固定金利を14/3/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	10/9/2020	240,721	(20,962)
USD (10,162,452)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.675%の固定金利を14/3/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を14/12/2020より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	10/9/2020	190,491	(71,192)
USD (64,407,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/1/2021より四半期毎に受け取り、0.69%の固定金利を23/4/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	21/10/2020	1,336,197	(564,693)
USD (64,407,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.19%の固定金利を23/4/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を23/1/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	21/10/2020	209,398	(1,621,442)
USD (92,660,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/6/2021より四半期毎に受け取り、0.41%の固定金利を19/9/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	17/3/2021	(39,496)	(197,018)
USD (92,660,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.41%の固定金利を19/9/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を19/6/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	17/3/2021	153,055	(4,467)
USD (9,220,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.7075%の固定金利を7/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/7/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	1/4/2021	32,616	(227,849)
USD (9,220,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を7/7/2021より四半期毎に受け取り、0.7075%の固定金利を7/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	1/4/2021	102,693	(157,772)
USD (5,530,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に受け取り、0.73%の固定金利を8/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	6/4/2021	45,637	(99,249)
USD (5,530,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.73%の固定金利を8/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を8/7/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	6/4/2021	15,645	(129,241)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (3,690,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/7/2021より四半期毎に受け取り、0.85%の固定金利を9/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	7/4/2021	14,579	(81,730)
USD (3,690,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.85%の固定金利を9/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を9/7/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	7/4/2021	37,903	(58,406)
USD (9,330,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.87%の固定金利を13/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/7/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	9/4/2021	113,563	(139,280)
USD (9,330,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を13/7/2021より四半期毎に受け取り、0.87%の固定金利を13/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	9/4/2021	37,686	(215,157)
EUR (121,800,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.15%の固定金利を21/4/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を21/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	19/4/2021	430,395	(8,035)
USD (14,260,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/7/2021より四半期毎に受け取り、0.7425%の固定金利を21/10/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	19/4/2021	129,421	(266,650)
USD (14,260,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.7425%の固定金利を21/10/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を21/10/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	19/4/2021	63,834	(332,238)
EUR (51,990,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.08%の固定金利を2/6/2022より毎年受け取り、６ヶ月EUR EURIBORの変動金利を2/12/2021より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	31/5/2021	145,741	(5,776)
USD (321,250,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.4%の固定金利を3/12/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を3/9/2021より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	1/6/2021	579,593	(1,870)
USD (15,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.95%の固定金利を1/8/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を1/5/2022より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	28/1/2022	284,415	(85,611)
USD (25,790,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2022より四半期毎に受け取り、0.605%の固定金利を17/12/2022より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	15/6/2022	27,376	(359,474)

売建スワップション　2020年８月31日現在（続き）

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
USD (25,790,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.605%の固定金利を17/12/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2022より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	15/6/2022	59,472	(327,378)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.5%の固定金利を17/12/2024より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	311,949	(224,287)
USD (32,040,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは３%の固定金利を17/12/2024より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を17/9/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	13/6/2024	621,437	(258,409)
USD (16,785,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.25%の固定金利を22/2/2025より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を22/11/2024より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/8/2024	294,876	(202,743)
USD (44,725,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を11/11/2022より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を11/8/2022より四半期毎に支払う。	Nomura	9/5/2022	1,045,795	(249,667)
USD (10,480,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.635%の固定金利を4/5/2021より半年毎に受け取り、３ヶ月USD BBA LIBORの変動金利を4/2/2021より四半期毎に支払う。	UBS	2/11/2020	253,015	(77)
合計（米ドル建の基礎となるエクスポージャー－1,763,174,532米ドル）				13,376,604	(44,869,247)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ＵＳダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表　2020年８月31日現在

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
ファンド				
		アイルランド		
	705,000	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF~	71,451,750	4.35
	435,000	iShares USD Short Duration High Yield Corp Bond UCITS ETF~	39,228,300	2.39
ファンド合計			110,680,050	6.74
コマーシャル・ペーパー				
		米国		
USD	5,000,000	Bayer Corp 1/9/2020 (Zero Coupon)	4,999,914	0.30
USD	12,000,000	Boeing Co/The 18/11/2020 (Zero Coupon)	11,968,020	0.73
USD	8,000,000	Ford Motor Credit Co LLC 25/9/2020 (Zero Coupon)	7,988,302	0.49
			24,956,236	1.52
コマーシャル・ペーパー合計			24,956,236	1.52
債券				
		オーストラリア		
AUD	135,845	National Rmbs Trust 2012-2 ‘Series 2012-2 A1’ FRN 20/6/2044	100,201	0.01
EUR	1,100,000	Telstra Corp Ltd 3.5% 21/9/2022*	1,408,369	0.08
AUD	874,166	TORRENS Series 2013-1 Trust ‘Series 2013-1 A’ FRN 12/4/2044	644,306	0.04
USD	8,450,000	Westpac Banking Corp ‘144A’ 3.15% 16/1/2024*	9,196,570	0.56
			11,349,446	0.69
		オーストリア		
USD	200,000	BRF GmbH 4.35% 29/9/2026	205,813	0.01
USD	200,000	Suzano Austria GmbH 5.75% 14/7/2026	228,625	0.02
			434,438	0.03
		バーレーン		
USD	320,000	Bahrain Government International Bond 7% 26/1/2026	366,150	0.02
USD	200,000	CBB International Sukuk Co 7 SPC 6.875% 5/10/2025	226,750	0.02
			592,900	0.04
		ベルギー		
EUR	910,000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 2.875% 25/9/2024	1,212,126	0.07
EUR	900,000	KBC Group NV 1.125% 25/1/2024	1,112,046	0.07
			2,324,172	0.14
		バミューダ諸島		
USD	200,000	Credicorp Ltd ‘144A’ 2.75% 17/6/2025	204,750	0.01
USD	200,000	Geopark Ltd ‘144A’ 5.5% 17/1/2027	180,502	0.01
			385,252	0.02
		ブラジル		
USD	5,000,000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands ‘144A’ 2.85% 27/1/2023	5,081,250	0.31
USD	260,000	Banco Bradesco SA/Cayman Islands ‘144A’ 3.2% 27/1/2025	266,175	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ブラジル（続き）		
USD	510,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	563,904	0.03
USD	270,000	Centrais Eletricas Brasileiras SA ‘144A’ 3.625% 4/2/2025	271,055	0.02
USD	250,000	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island ‘144A’ 3.25% 24/1/2025	256,328	0.01
			6,438,712	0.39
		英領バージン諸島		
USD	520,000	Central American Bottling Corp (Restricted) ‘144A’ 5.75% 31/1/2027	553,800	0.04
USD	330,000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd ‘144A’ 5.125% 15/5/2024	364,495	0.02
USD	207,000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd ‘144A’ 2.7% 13/5/2030	219,763	0.01
			1,138,058	0.07
		カナダ		
USD	1,251,587	Air Canada 2013-1 Class B Pass Through Trust ‘144A’ 5.375% 15/5/2021	1,126,429	0.07
EUR	730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	880,566	0.05
USD	475,000	TransCanada PipeLines Ltd 3.75% 16/10/2023	516,209	0.03
			2,523,204	0.15
		ケイマン諸島		
USD	2,780,000	Baidu Inc 2.875% 6/7/2022*	2,864,748	0.17
USD	1,145,523	OFSI Fund VI Ltd FRN 20/3/2025	1,129,257	0.07
USD	235,000	Vale Overseas Ltd 3.75% 8/7/2030	247,925	0.02
			4,241,930	0.26
		チリ		
USD	250,000	Chile Government International Bond 2.25% 30/10/2022*	260,141	0.02
USD	679,000	Chile Government International Bond 2.45% 31/1/2031	716,345	0.05
USD	1,080,000	Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	1,207,744	0.07
USD	200,000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado ‘144A’ 3.068% 18/8/2050	200,750	0.01
USD	200,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA ‘144A’ 3.65% 7/5/2030	222,750	0.01
USD	550,000	Enel Americas SA 4% 2 5/10/2026	604,055	0.04
USD	790,000	GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	863,075	0.05
USD	310,000	Inversiones CMPC SA ‘144A’ 3.85% 13/1/2030	336,253	0.02
			4,411,113	0.27
		コロンビア		
USD	200,000	Bancolombia SA 3% 29/1/2025	203,500	0.01
USD	660,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	718,410	0.04
USD	980,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	1,087,341	0.07
USD	250,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	281,562	0.02
USD	540,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	656,640	0.04
USD	540,000	Ecopetrol SA 5.375% 26/6/2026	597,291	0.04

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		コロンビア（続き）		
USD	340,000	SURA Asset Management SA ‘144A’ 4.875% 17/4/2024	371,344	0.02
			3,916,088	0.24
		デンマーク		
USD	2,560,000	Danske Bank A/S ‘144A’ FRN 20/9/2022	2,615,539	0.16
		ドミニカ共和国		
USD	200,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA ‘144A’ 6.75% 30/3/2029	182,500	0.01
USD	444,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	465,714	0.03
USD	290,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 27/1/2025	304,183	0.02
USD	270,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	298,856	0.02
			1,251,253	0.08
		エジプト		
EUR	100,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 4.75% 11/4/2025	117,963	0.01
USD	310,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 5.577% 21/2/2023	320,580	0.02
USD	200,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/6/2025	207,063	0.01
USD	200,000	Egypt Government International Bond 6.125% 31/1/2022	205,812	0.01
EUR	330,000	Egypt Government International Bond ‘144A’ 6.375% 11/4/2031	378,824	0.03
USD	200,000	Egypt Government International Bond 7.6003% 1/3/2029	210,688	0.01
			1,440,930	0.09
		フィンランド		
EUR	905,000	CRH Finland Services Oyj 0.875% 5/11/2023	1,106,529	0.07
		フランス		
EUR	600,000	Air Liquide Finance SA 0.375% 18/4/2022	720,755	0.04
EUR	400,000	APRR SA 20/1/2023 (Zero Coupon)	478,351	0.03
EUR	600,000	Autoroutes du Sud de la France SA 2.95% 17/1/2024	782,805	0.05
EUR	700,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.125% 5/2/2024	838,826	0.05
USD	1,495,000	BNP Paribas SA ‘144A’ FRN 9/6/2026	1,562,019	0.09
EUR	800,000	BNP Paribas SA 0.75% 11/11/2022	973,077	0.06
EUR	500,000	Capgemini SE 0.625% 23/6/2025	607,063	0.04
EUR	1,200,000	Dassault Systemes SE 16/9/2022 (Zero Coupon)*	1,431,949	0.09
EUR	900,000	Engie SA 0.375% 28/2/2023	1,086,278	0.07
EUR	500,000	FCT Autonoria 2019 FRN 25/9/2035	588,786	0.03
EUR	400,000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 28/2/2021 (Zero Coupon)	477,481	0.03
EUR	700,000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2024 (Zero Coupon)	836,969	0.05
EUR	700,000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 11/2/2026 (Zero Coupon)	832,273	0.05

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		フランス（続き）		
EUR	80,000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE 0.375% 26/5/2022	96,207	0.00
EUR	800,000	Orange SA 0.5% 15/1/2022	962,833	0.06
EUR	1,300,000	Orange SA 0.75% 11/9/2023	1,585,355	0.10
EUR	1,600,000	Pernod Ricard SA 24/10/2023 (Zero Coupon)	1,906,917	0.12
EUR	300,000	Pernod Ricard SA 1.125% 7/4/2025	372,974	0.02
EUR	300,000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.625% 8/10/2024	381,400	0.02
EUR	300,000	Schneider Electric SE 12/6/2023 (Zero Coupon)	358,699	0.02
EUR	600,000	Schneider Electric SE 0.25% 9/9/2024	725,330	0.04
EUR	1,400,000	Societe Generale SA 27/5/2022 (Zero Coupon)	1,670,815	0.10
EUR	900,000	Thales SA 0.75% 7/6/2023	1,093,716	0.07
EUR	900,000	Total Capital International SA 0.25% 12/7/2023	1,085,871	0.07
EUR	1,200,000	Veolia Environnement SA 0.672% 30/3/2022	1,444,592	0.09
			22,901,341	1.39
		ドイツ		
EUR	535,000	Amphenol Technologies Holding GmbH 0.75% 4/5/2026	642,839	0.04
EUR	600,000	BASF SE 0.101% 5/6/2023	718,016	0.04
EUR	1,105,000	BASF SE 2% 5/12/2022	1,381,304	0.08
EUR	290,000	Covestro AG 0.875% 3/2/2026	354,643	0.02
USD	3,695,000	Deutsche Bank AG/New York NY 4.25% 4/2/2021	3,746,355	0.23
EUR	1,315,000	E.ON SE 24/10/2022 (Zero Coupon)	1,571,443	0.10
EUR	1,600,000	Merck Financial Services GmbH 0.005% 15/12/2023	1,908,454	0.12
EUR	1,100,000	Volkswagen Bank GmbH 1.875% 31/1/2024	1,364,238	0.08
EUR	1,900,000	Volkswagen Leasing GmbH FRN 2/8/2021	2,259,774	0.14
EUR	2,455,000	Volkswagen Leasing GmbH 1% 16/2/2023	2,964,327	0.18
			16,911,393	1.03
		インド		
USD	200,000	Adani Electricity Mumbai Ltd '144A' 3.949% 12/2/2030	201,000	0.01
USD	290,000	Muthoot Finance Ltd '144A' 6.125% 31/10/2022	298,338	0.02
			499,338	0.03
		インドネシア		
EUR	490,000	Indonesia Government International Bond 0.9% 14/2/2027	571,987	0.04
USD	420,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028	462,787	0.03
USD	340,000	Indonesia Government International Bond 3.75% 25/4/2022	354,662	0.02
USD	310,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	353,837	0.02
USD	200,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	239,632	0.01
			1,982,905	0.12
		アイルランド		
EUR	820,000	Abbott Ireland Financing DAC 0.1% 19/11/2024	980,224	0.06
EUR	610,000	Abbott Ireland Financing DAC 0.875% 27/9/2023	748,442	0.05

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		アイルランド（続き）		
USD	1,700,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,632,273	0.10
USD	2,160,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	2,152,934	0.13
USD	4,300,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.5% 26/5/2022	4,320,838	0.26
USD	3,000,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.95% 1/2/2022	3,038,970	0.19
USD	2,889,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.5% 15/5/2021	2,938,693	0.18
USD	325,000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 4.625% 1/7/2022	332,817	0.02
USD	1,665,000	Aon Plc 2.8% 15/3/2021	1,685,587	0.10
EUR	1,135,000	Eaton Capital Unlimited Co 0.021% 14/5/2021	1,352,983	0.08
EUR	525,000	ESB Finance DAC 3.494% 12/1/2024*	695,386	0.04
USD	11,000,000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 2.342% 15/11/2020	11,045,649	0.67
USD	310,000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC '144A' 3.05% 23/1/2025	318,477	0.02
EUR	467,650	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	549,441	0.03
EUR	243,775	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	285,717	0.02
EUR	940,275	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	1,112,294	0.07
USD	1,200,000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23/9/2023	1,277,587	0.08
GBP	880,000	Taurus 2020-2 UK DAC 17/8/2030 (Zero Coupon)	1,172,790	0.07
USD	754,000	Willis Towers Watson Plc 5.75% 15/3/2021	774,280	0.05
			36,415,382	2.22
		イスラエル		
USD	515,000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 29/1/2031	521,759	0.03
USD	265,000	Israel Government International Bond 2.75% 3/7/2030	292,163	0.02
			813,922	0.05
		日本		
USD	1,999,000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.95% 1/3/2021	2,025,022	0.12
EUR	1,045,000	Mizuho Financial Group Inc 0.523% 10/6/2024	1,263,715	0.08
USD	1,480,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 4.4% 26/11/2023	1,655,008	0.10
			4,943,745	0.30
		ルクセンブルク		
EUR	460,000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 4/6/2026	559,645	0.03
USD	160,000	Gol Finance SA '144A' 7% 31/1/2025	83,275	0.01
EUR	3,760,000	Medtronic Global Holdings SCA 2/12/2022 (Zero Coupon)*	4,489,350	0.27
EUR	635,000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 7/3/2023	764,681	0.05
USD	430,000	Millicom International Cellular SA '144A' 5.125% 15/1/2028	452,306	0.03
USD	210,000	Minerva Luxembourg SA '144A' 6.5% 20/9/2026	222,403	0.01
USD	446,000	Nexa Resources SA '144A' 5.375% 4/5/2027	473,039	0.03
USD	230,000	Rumo Luxembourg Sarl '144A' 5.875% 18/1/2025*	244,447	0.01
EUR	360,000	Simon International Finance SCA 1.375% 18/11/2022	432,112	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		ルクセンブルク（続き）		
USD	200,000	Usiminas International Sarl ‘144A’ 5.875% 18/7/2026	204,031	0.01
			7,925,289	0.48
		マレーシア		
USD	391,000	Petronas Capital Ltd ‘144A’ 3.5% 21/4/2030	444,150	0.03
		メキシコ		
USD	150,000	BBVA Bancomer SA/Texas ‘144A’ 6.75% 30/9/2022	163,102	0.01
USD	200,000	Braskem Idesa SAPI ‘144A’ 7.45% 15/11/2029	185,500	0.01
USD	520,000	Grupo Bimbo SAB de CV 4.5% 25/1/2022	546,406	0.03
USD	200,000	Grupo KUO SAB De CV ‘144A’ 5.75% 7/7/2027	189,625	0.01
USD	200,000	Industrias Penoles SAB de CV ‘144A’ 4.75% 6/8/2050	211,250	0.01
USD	200,000	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV ‘144A’ 2.431% 1/7/2031	204,314	0.01
USD	550,000	Mexico City Airport Trust ‘144A’ 4.25% 31/10/2026	517,859	0.03
USD	380,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	423,890	0.03
USD	260,000	Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER ‘144A’ 8.25% 11/2/2025	229,613	0.02
USD	1,400,000	Petroleos Mexicanos ‘144A’ 5.95% 28/1/2031	1,254,750	0.08
USD	410,000	Petroleos Mexicanos ‘144A’ 6.84% 23/1/2030	393,600	0.02
USD	450,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	457,875	0.03
USD	620,000	Trust Fibra Uno ‘144A’ 4.869% 15/1/2030	627,215	0.04
			5,404,999	0.33
		オランダ		
EUR	460,000	Airbus SE 1.375% 9/6/2026	569,240	0.03
EUR	300,000	Allianz Finance II BV 14/1/2025 (Zero Coupon)	360,327	0.02
EUR	1,400,000	Allianz Finance II BV 0.25% 6/6/2023*	1,690,956	0.10
EUR	600,000	Bayer Capital Corp BV 1.5% 26/6/2026	756,334	0.05
EUR	890,000	BMW Finance NV 14/4/2023 (Zero Coupon)	1,059,688	0.06
EUR	490,000	Conti-Gummi Finance BV 1.125% 25/9/2024	595,143	0.04
USD	2,175,000	Cooperatieve Rabobank UA ‘144A’ FRN 24/6/2026	2,212,742	0.14
EUR	150,000	Daimler International Finance BV 0.25% 9/8/2021	179,529	0.01
EUR	450,000	Daimler International Finance BV 0.25% 6/11/2023	533,887	0.03
EUR	1,440,000	Deutsche Telekom International Finance BV 4.25% 13/7/2022	1,857,134	0.11
EUR	1,860,000	Enel Finance International NV 17/6/2024 (Zero Coupon)	2,212,355	0.14
EUR	600,000	Enexis Holding NV 3.375% 26/1/2022	750,302	0.05
EUR	1,470,000	Fiat Chrysler Automobiles NV 3.375% 7/7/2023	1,821,049	0.11
EUR	1,300,000	ING Bank NV FRN 8/4/2022	1,559,076	0.10
EUR	600,000	ING Bank NV 8/4/2022 (Zero Coupon)	717,259	0.04
EUR	1,094,000	ING Bank NV FRN 25/2/2026	1,325,566	0.08
EUR	800,000	ING Groep NV 1% 20/9/2023	981,711	0.06
EUR	275,000	innogy Finance BV 0.75% 30/11/2022	333,066	0.02
EUR	300,000	Magoi 2019 BV FRN 27/7/2039	356,253	0.02

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		オランダ（続き）		
USD	470,000	MDGH - GMTN BV ‘144A’ 2.5% 7/11/2024	496,120	0.03
USD	4,593,000	NXP BV / NXP Funding LLC ‘144A’ 3.875% 1/9/2022	4,875,267	0.30
USD	1,967,000	NXP BV / NXP Funding LLC ‘144A’ 4.125% 1/6/2021	2,018,006	0.12
USD	1,195,000	NXP BV / NXP Funding LLC ‘144A’ 4.625% 15/6/2022	1,274,518	0.08
USD	120,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ‘144A’ 2.7% 1/5/2025	127,927	0.01
USD	1,500,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ‘144A’ 3.875% 18/6/2026	1,688,625	0.10
USD	200,000	Petrobras Global Finance BV 4.375% 20/5/2023	209,250	0.01
USD	1,040,000	Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025	1,137,663	0.07
USD	140,000	Petrobras Global Finance BV 7.375% 17/1/2027	166,040	0.01
EUR	200,000	Redexis Gas Finance BV 1.875% 28/5/2025	248,810	0.02
EUR	725,000	RELX Finance BV 18/3/2024 (Zero Coupon)	862,533	0.05
EUR	1,905,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 5/9/2021 (Zero Coupon)	2,274,116	0.14
EUR	1,100,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/2/2023 (Zero Coupon)	1,314,220	0.08
EUR	935,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.375% 6/9/2023	1,130,720	0.07
EUR	1,130,000	Upjohn Finance BV 0.816% 23/6/2022	1,362,589	0.08
USD	440,000	VEON Holdings BV ‘144A’ 4% 9/4/2025	459,800	0.03
EUR	1,000,000	Vonovia Finance BV 0.125% 6/4/2023	1,196,308	0.07
EUR	400,000	Vonovia Finance BV 1.625% 7/4/2024	501,097	0.03
			41,215,226	2.51
		ノルウェー		
EUR	460,000	Telenor ASA 25/9/2023 (Zero Coupon)	549,794	0.03
		パナマ		
USD	265,000	AES Panama Generation Holdings SRL ‘144A’ 4.375% 31/5/2030	276,014	0.02
USD	295,000	Banco Nacional de Panama ‘144A’ 2.5% 11/8/2030	298,702	0.02
USD	200,000	Cable Onda SA ‘144A’ 4.5% 30/1/2030	214,563	0.01
USD	670,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	763,381	0.04
USD	740,000	Panama Government International Bond 4% 22/9/2024	815,850	0.05
			2,368,510	0.14
		パラグアイ		
USD	959,000	Paraguay Government International Bond ‘144A’ 4.95% 28/4/2031*	1,122,030	0.07
		ペルー		
USD	155,000	Banco de Credito del Peru ‘144A’ FRN 1/7/2030	156,356	0.01
USD	540,000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank ‘144A’ 3.25% 4/10/2026	564,469	0.03
USD	1,250,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/1/2026	1,317,500	0.08
			2,038,325	0.12

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		フィリピン		
USD	1,235,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	1,427,969	0.09
		ポーランド		
USD	374,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	423,029	0.03
		カタール		
USD	275,000	Qatar Government International Bond ‘144A’ 3.4% 16/4/2025	301,400	0.02
USD	580,000	Qatar Government International Bond ‘144A’ 4% 14/3/2029	680,267	0.04
USD	785,000	Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	942,491	0.06
			1,924,158	0.12
		ルーマニア		
USD	436,000	Romanian Government International Bond ‘144A’ 3% 14/2/2031*	441,450	0.03
		ロシア連邦		
USD	1,200,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	1,359,000	0.08
USD	1,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.75% 27/5/2026	1,153,500	0.07
			2,512,500	0.15
		サウジアラビア		
USD	865,000	Saudi Arabian Oil Co ‘144A’ 2.875% 16/4/2024	911,710	0.06
USD	240,000	Saudi Arabian Oil Co ‘144A’ 3.5% 16/4/2029	263,212	0.02
USD	215,000	Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	233,544	0.01
USD	200,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028	222,125	0.01
USD	200,000	Saudi Government International Bond 4% 17/4/2025	222,200	0.01
USD	570,000	Saudi Government International Bond ‘144A’ 4.375% 16/4/2029	671,353	0.04
			2,524,144	0.15
		スペイン		
EUR	800,000	Amadeus Capital Markets SAU 1.625% 17/11/2021	965,752	0.06
EUR	900,000	Amadeus IT Group SA 2.5% 20/5/2024	1,119,544	0.07
EUR	500,000	Banco de Sabadell SA FRN 7/11/2025	583,666	0.04
USD	2,800,000	Banco Santander SA 2.706% 27/6/2024	2,987,464	0.18
USD	1,600,000	Banco Santander SA 2.746% 28/5/2025	1,699,642	0.10
			7,356,068	0.45
		スウェーデン		
EUR	850,000	Atlas Copco AB 2.5% 28/2/2023	1,079,999	0.07
EUR	1,000,000	Volvo Treasury AB FRN 13/9/2021	1,193,422	0.07
EUR	241,000	Volvo Treasury AB 11/2/2023 (Zero Coupon)	285,807	0.02
			2,559,228	0.16
		スイス		
EUR	1,460,000	UBS AG FRN 12/2/2026	1,783,429	0.11
EUR	875,000	UBS AG/London 0.75% 21/4/2023	1,065,450	0.07

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		スイス（続き）		
USD	2,215,000	UBS Group AG ‘144A’ FRN 15/8/2023	2,304,966	0.14
EUR	715,000	UBS Group AG FRN 29/1/2026	853,403	0.05
			6,007,248	0.37
		ウクライナ		
USD	254,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2024	269,875	0.01
USD	250,000	Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2024	273,375	0.02
			543,250	0.03
		英国		
USD	677,000	Anglo American Capital Plc ‘144A’ 4.125% 15/4/2021	689,209	0.04
GBP	555,000	Azure Finance No 2 Plc 20/7/2030 (Zero Coupon)	730,550	0.04
GBP	2,075,000	Azure Finance No 2 Plc 20/7/2030 (Zero Coupon)	2,766,111	0.17
USD	2,200,000	Barclays Bank Plc 5.14% 14/10/2020	2,210,362	0.13
USD	2,125,000	Barclays Plc FRN 15/2/2023	2,235,586	0.14
EUR	545,000	BAT International Finance Plc 0.875% 13/10/2023	662,025	0.04
EUR	870,000	BP Capital Markets Plc 1.109% 16/2/2023	1,069,899	0.07
EUR	355,000	BP Capital Markets Plc 1.526% 26/9/2022	438,420	0.03
GBP	105,000	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	133,300	0.01
GBP	220,000	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	287,324	0.02
GBP	1,039,649	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	1,381,745	0.08
GBP	255,000	Economic Master Issuer 2020-1 Plc 25/6/2072 (Zero Coupon)	340,393	0.02
GBP	224,959	Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	293,593	0.02
GBP	600,843	Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	797,199	0.05
GBP	320,000	Finsbury Square 2020-2 Plc 16/6/2070 (Zero Coupon)	428,534	0.03
USD	2,681,000	Lanark Master Issuer Plc FRN 22/12/2069	2,688,394	0.16
GBP	335,000	Lanark Master Issuer Plc ‘Series 2020-1A 2A’ ‘144A’ FRN 22/12/2069	443,707	0.03
USD	1,095,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 15/6/2023	1,105,855	0.07
EUR	795,000	Motability Operations Group Plc 1.625% 9/6/2023	997,835	0.06
EUR	600,000	National Grid Electricity Transmission Plc 0.19% 20/1/2025	721,667	0.04
USD	1,780,000	Natwest Group Plc FRN 22/5/2024	1,842,046	0.11
USD	2,650,000	Natwest Group Plc 3.875% 12/9/2023	2,877,044	0.18
GBP	2,055,000	Oat Hill NO 2 Plc 27/5/2046 (Zero Coupon)	2,708,585	0.16
GBP	375,000	Orbita Funding 2020-1 Plc FRN 17/3/2027	490,277	0.03
GBP	100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	126,195	0.01
GBP	115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	148,485	0.01
GBP	100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B Plc FRN 16/10/2056	128,476	0.01
GBP	1,055,000	Residential Mortgage Securities 32 Plc 20/6/2070 (Zero Coupon)	1,412,707	0.09
GBP	525,000	Residential Mortgage Securities 32 Plc 20/6/2070 (Zero Coupon)	702,500	0.04
EUR	140,000	Rolls-Royce Plc 2.125% 18/6/2021	166,339	0.01
USD	2,235,000	Santander UK Group Holdings Plc FRN 5/1/2024	2,351,904	0.14
USD	475,000	Santander UK Group Holdings Plc 3.571% 10/1/2023	491,967	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		英国（続き）		
GBP	7,210,836	Silk Road Finance Number Six Plc FRN 21/9/2067	9,468,166	0.58
GBP	1,745,000	Silverstone Master Issuer Plc FRN 21/1/2070	2,331,023	0.14
EUR	515,000	Sky Ltd 1.5% 15/9/2021	624,584	0.04
GBP	875,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc 20/9/2063 (Zero Coupon)	1,169,080	0.07
GBP	115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc 20/9/2063 (Zero Coupon)	154,282	0.01
GBP	145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc 20/9/2063 (Zero Coupon)	194,512	0.01
GBP	560,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc 20/9/2063 (Zero Coupon)	750,432	0.05
GBP	3,161,594	Twin Bridges 2019-1 Plc ‘Series 2019-1 A’ FRN 12/12/2052	4,169,699	0.25
GBP	1,245,000	Twin Bridges 2020-1 Plc 14/12/2054 (Zero Coupon)	1,662,798	0.10
GBP	1,145,000	Twin Bridges 2020-1 Plc 14/12/2054 (Zero Coupon)	1,520,526	0.09
GBP	225,000	Twin Bridges 2020-1 Plc 14/12/2054 (Zero Coupon)	295,856	0.02
GBP	390,000	Twin Bridges 2020-1 Plc 14/12/2054 (Zero Coupon)	515,649	0.03
GBP	1,080,000	Unique Pub Finance Co Plc/The 7.395% 28/3/2024	1,499,810	0.09
EUR	314,000	WPP Finance 2013 3% 20/11/2023	408,388	0.02
			58,633,038	3.57
		米国		
USD	2,073,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 ‘Series 2015-1211 A1A2’ ‘144A’ 3.901% 10/8/2035	2,307,186	0.14
USD	2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016-225L ‘Series 2016-225L A’ ‘144A’ 3.597% 10/2/2036	2,356,420	0.14
USD	1,865,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust ‘Series 2017-280P D’ ‘144A’ FRN 15/9/2034	1,832,774	0.11
EUR	320,000	AbbVie Inc ‘144A’ 1.25% 1/6/2024	395,968	0.02
EUR	1,305,000	AbbVie Inc 1.5% 15/11/2023	1,622,467	0.10
USD	1,630,000	AbbVie Inc ‘144A’ 2.6% 21/11/2024	1,744,613	0.11
USD	1,300,000	AbbVie Inc ‘144A’ 2.8% 15/3/2023	1,350,561	0.08
USD	3,780,000	AbbVie Inc ‘144A’ 3.25% 1/10/2022	3,963,334	0.24
USD	8,459,000	AbbVie Inc ‘144A’ 3.45% 15/3/2022	8,799,657	0.54
USD	2,504,031	Adams Mill CLO Ltd ‘Series 2014-1A A2R’ ‘144A’ FRN 15/7/2026	2,491,151	0.15
USD	855,000	Air Lease Corp 2.625% 1/7/2022	860,902	0.05
USD	180,000	Air Products and Chemicals Inc 1.5% 15/10/2025	187,623	0.01
USD	650,000	Allegro CLO II-S Ltd ‘Series 2014-1RA B’ ‘144A’ FRN 21/10/2028	636,410	0.04
USD	2,815,000	Alliant Energy Finance LLC ‘144A’ 3.75% 15/6/2023	3,031,272	0.18
USD	8,000,000	ALM XVII Ltd ‘Series 2015-17A A1AR’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	7,960,802	0.49
USD	900,000	Altria Group Inc 2.35% 6/5/2025	955,744	0.06
USD	2,350,000	Altria Group Inc 3.8% 14/2/2024	2,578,918	0.16
USD	925,000	American Tower Corp 1.3% 15/9/2025	939,980	0.06
EUR	440,000	American Tower Corp 1.95% 22/5/2026	568,099	0.03
USD	450,000	American Tower Corp 2.4% 15/3/2025	479,064	0.03
USD	2,150,364	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-1 ‘Series 2018-1 A3’ 3.07% 19/12/2022	2,170,039	0.13

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,827,469	Americredit Automobile Receivables Trust 2018-2 ‘Series 2018-2 A3’ 3.15% 20/3/2023	1,849,972	0.11
USD	3,363,240	AMMC CLO XIII Ltd ‘Series 2013-13A A1LR’ ‘144A’ FRN 24/7/2029	3,354,661	0.20
USD	5,300,000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc 3.7% 1/2/2024	5,841,592	0.36
USD	1,300,000	AOA 2015-1177 Mortgage Trust ‘Series 2015-1177 D’ ‘144A’ FRN 13/12/2029	1,293,074	0.08
USD	3,349,409	ARI Fleet Lease Trust 2017-A ‘Series 2017-A A3’ ‘144A’ 2.28% 15/4/2026	3,365,353	0.21
EUR	845,000	AT&T Inc 1.05% 5/9/2023	1,034,947	0.06
USD	293,341	B2R Mortgage Trust 2015-2 ‘Series 2015-2 A’ ‘144A’ 3.336% 15/11/2048	293,221	0.02
USD	3,078,493	B2R Mortgage Trust 2016-1 ‘Series 2016-1 A’ ‘144A’ 2.567% 15/6/2049	3,085,732	0.19
USD	4,425,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 ‘Series 2016-UB10 A2’ 2.723% 15/7/2049	4,461,999	0.27
USD	19,085	Banc of America Mortgage 2003-J Trust ‘Series 2003-J 2A1’ FRN 25/11/2033	18,211	0.00
USD	975,000	Bank of America Corp FRN 23/1/2022	983,976	0.06
USD	5,125,000	Bank of America Corp FRN 20/12/2023	5,402,482	0.33
USD	5,900,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2024	6,425,221	0.39
USD	1,575,000	Bank of America Corp 3.875% 1/8/2025	1,797,078	0.11
USD	405,000	Bank of America NA FRN 25/1/2023	421,665	0.03
USD	55,000	BAT Capital Corp 2.764% 15/8/2022	57,219	0.00
USD	4,655,000	BAT Capital Corp 2.789% 6/9/2024	4,958,118	0.30
USD	8,380,000	BAT Capital Corp 3.222% 15/8/2024	9,038,650	0.55
USD	1,880,000	BBCMS Trust 2013-TYSN ‘Series 2013-TYSN E’ ‘144A’ 3.708% 5/9/2032	1,877,041	0.11
USD	8,506,000	Becton Dickinson and Co FRN 29/12/2020*	8,509,373	0.52
EUR	310,000	Becton Dickinson and Co 1.401% 24/5/2023	379,788	0.02
USD	4,200,000	Becton Dickinson and Co 2.894% 6/6/2022	4,360,746	0.27
USD	2,000,000	Benefit Street Partners CLO II Ltd ‘Series 2013-IIA A2R’ ‘144A’ FRN 15/7/2029	2,000,653	0.12
USD	520,000	Benefit Street Partners CLO V-B Ltd ‘Series 2018-5BA A1A’ ‘144A’ FRN 20/4/2031	507,229	0.03
USD	299,979	Black Diamond CLO 2013-1 Ltd ‘Series 2013-1A A2R’ ‘144A’ FRN 6/2/2026	298,708	0.02
USD	4,970,000	BMW US Capital LLC ‘144A’ 3.8% 6/4/2023	5,376,367	0.33
USD	765,000	Bristol-Myers Squibb Co 2.75% 15/2/2023	810,055	0.05
USD	1,380,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.625% 15/1/2024	1,488,416	0.09
USD	7,545,000	Broadcom Inc 4.7% 15/4/2025	8,621,498	0.53
USD	1,624,660	BX Commercial Mortgage Trust 2018-IND ‘Series 2018-IND A’ ‘144A’ FRN 15/11/2035	1,621,057	0.10
USD	1,485,000	Capital One Financial Corp 2.4% 30/10/2020	1,487,506	0.09
USD	2,333,392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd ‘Series 2014-5A A1RR’ ‘144A’ FRN 15/7/2031	2,289,592	0.14
USD	420,000	Carrier Global Corp ‘144A’ 2.242% 15/2/2025	440,417	0.03
USD	937,341	Catamaran CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A AR’ ‘144A’ FRN 22/4/2027	924,588	0.06

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,095,000	CCRESG Commercial Mortgage Trust 2016-HEAT 'Series 2016-HEAT A' '144A' 3.357% 10/4/2029	1,095,772	0.07
USD	3,000,000	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 'Series 2016-CD1 ASB' 2.622% 10/8/2049	3,168,151	0.19
USD	4,580,000	Cedar Funding VI CLO Ltd 'Series 2016-6A AR' '144A' FRN 20/10/2028	4,565,025	0.28
USD	1,820,000	CenterPoint Energy Inc 2.5% 1/9/2022	1,886,460	0.12
USD	1,896,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 'Series 2016-C4 ASB' 3.091% 10/5/2058	2,013,891	0.12
USD	2,877,662	CGDBB Commercial Mortgage Trust 2017-BIOC 'Series 2017-BIOC A' '144A' FRN 15/7/2032	2,873,664	0.18
USD	633,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.5% 1/2/2024	705,899	0.04
USD	2,500,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	2,908,236	0.18
USD	1,039,476	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-2A A2' '144A' FRN 15/5/2029	1,039,485	0.06
USD	531,857	Chesapeake Funding II LLC 'Series 2017-3A A2' '144A' FRN 15/8/2029	531,526	0.03
USD	185,959	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 'Series 2005-HYB8 2A1' FRN 20/12/2035	170,250	0.01
EUR	340,000	Chubb INA Holdings Inc 0.3% 15/12/2024	406,327	0.02
USD	1,975,000	Cifc Funding 2014-IV-R Ltd 'Series 2014-4RA A1A' '144A' FRN 17/10/2030	1,963,125	0.12
USD	2,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 'Series 2013-375P A' '144A' 3.251% 10/5/2035	2,855,114	0.17
USD	4,105,233	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 'Series 2013-GC11 A3' 2.815% 10/4/2046	4,233,807	0.26
USD	2,157,656	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 'Series 2014-GC19 AAB' 3.552% 10/3/2047	2,252,105	0.14
USD	2,899,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 'Series 2016-P4 A4' 2.902% 10/7/2049	3,149,036	0.19
USD	115,000	Citigroup Inc FRN 24/1/2023	119,023	0.01
USD	4,370,000	Citigroup Inc FRN 8/4/2026	4,749,511	0.29
EUR	1,035,000	Coca-Cola Co/The 1.125% 22/9/2022	1,267,777	0.08
USD	3,012,806	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust 'Series 2013-CR7 ASB' 2.739% 10/3/2046	3,086,082	0.19
USD	5,329,972	COMM 2013-CCRE9 Mortgage Trust 'Series 2013-CR9 A4' FRN 10/7/2045	5,718,917	0.35
USD	203,479	COMM 2013-GAM 'Series 2013-GAM A1' '144A' 1.705% 10/2/2028	202,782	0.01
USD	787,528	COMM 2013-LC6 Mortgage Trust 'Series 2013-LC6 ASB' 2.478% 10/1/2046	801,183	0.05
USD	496,160	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 'Series 2013-SFS A1' '144A' 1.873% 12/4/2035	492,519	0.03
USD	3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 'Series 2014-277P A' '144A' FRN 10/8/2049	3,217,103	0.20
USD	3,000,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 'Series 2014-CR18 A5' 3.828% 15/7/2047	3,287,661	0.20
USD	5,202,712	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 'Series 2014-CR21 A3' 3.528% 10/12/2047	5,627,972	0.34
USD	2,560,687	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS3 ASB' 3.367% 10/6/2047	2,663,157	0.16
USD	2,223,943	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 'Series 2014-UBS5 ASB' 3.548% 10/9/2047	2,317,530	0.14

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	3,450,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust ‘Series 2015-3BP A’ ‘144A’ 3.178% 10/2/2035	3,706,990	0.23
USD	1,574,235	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust ‘Series 2015-CR22 A2’ 2.856% 10/3/2048	1,573,952	0.10
USD	9,158,068	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ‘Series 2015-CR23 XA’ FRN 10/5/2048	292,821	0.02
USD	2,576,278	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust ‘Series 2015-CR24 ASB’ 3.445% 10/8/2048	2,719,129	0.17
USD	673,566	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ‘Series 2015-LC21 A2’ 2.976% 10/7/2048	679,248	0.04
USD	3,964,282	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust ‘Series 2015-LC21 ASB’ 3.421% 10/7/2048	4,182,648	0.26
USD	3,220,000	Concho Resources Inc 4.375% 15/1/2025	3,327,406	0.20
USD	258	Continental Airlines 2000-1 Class B Pass Through Trust 8.388% 1/11/2020	247	0.00
USD	1,895,000	Cox Communications Inc ‘144A’ 3.15% 15/8/2024	2,056,380	0.13
USD	3,226,863	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 3.01% 16/2/2027	3,242,995	0.20
USD	3,321,904	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-2 ‘Series 2018-2A A’ ‘144A’ 3.47% 17/5/2027	3,357,684	0.20
USD	4,760,000	Credit Acceptance Auto Loan Trust 2018-3 ‘Series 2018-3A A’ ‘144A’ 3.55% 15/8/2027	4,835,966	0.29
USD	3,085,000	Crown Castle International Corp 1.35% 15/7/2025	3,133,403	0.19
USD	635,000	Crown Castle International Corp 3.2% 1/9/2024	689,147	0.04
USD	1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust ‘Series 2015-C1 A4’ 3.505% 15/4/2050	1,791,021	0.11
USD	2,668,253	CSWF 2018-TOP ‘Series 2018-TOP A’ ‘144A’ FRN 15/8/2035	2,601,161	0.16
USD	2,005,000	CVS Health Corp 1.3% 21/8/2027	1,995,747	0.12
USD	1,717,000	CVS Health Corp 4.1% 25/3/2025	1,959,293	0.12
USD	1,490,000	Daimler Finance North America LLC ‘144A’ 3.35% 4/5/2021	1,517,013	0.09
EUR	375,000	Danaher Corp 1.7% 30/3/2024	471,836	0.03
USD	2,076,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust ‘Series 2018-GLKS A’ ‘144A’ FRN 19/12/2030	2,011,963	0.12
USD	9,059,000	Dell International LLC / EMC Corp ‘144A’ 4.42% 15/6/2021	9,294,948	0.57
USD	1,560,000	Dell International LLC / EMC Corp ‘144A’ 5.45% 15/6/2023	1,720,015	0.10
USD	2,180,000	Diamondback Energy Inc 2.875% 1/12/2024	2,238,434	0.14
USD	1,000,000	Discover Bank 3.35% 6/2/2023	1,060,160	0.06
USD	2,790,000	Dominion Energy Inc (Step-up coupon) 2.715% 15/8/2021	2,848,347	0.17
USD	2,835,000	Duke Energy Corp 3.95% 15/10/2023	3,106,274	0.19
USD	1,510,000	DuPont de Nemours Inc 2.169% 1/5/2023	1,540,194	0.09
USD	3,800,000	DuPont de Nemours Inc 4.205% 15/11/2023	4,200,191	0.26
USD	1,215,000	Energy Transfer Operating LP 2.9% 15/5/2025	1,247,988	0.08
USD	1,250,000	Energy Transfer Operating LP 3.6% 1/2/2023	1,294,800	0.08
USD	1,435,000	Energy Transfer Operating LP 4.5% 15/4/2024	1,545,588	0.09
USD	4,400,000	Energy Transfer Operating LP 5.875% 15/1/2024	4,890,237	0.30

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,270,712	Enterprise Fleet Financing LLC ‘Series 2018-1 A2’ ‘144A’ 2.87% 20/10/2023	2,284,187	0.14
USD	1,500,000	Enterprise Products Operating LLC 2.85% 15/4/2021	1,519,597	0.09
USD	1,525,000	Equinix Inc 1.25% 15/7/2025	1,545,161	0.09
USD	50,000	Equinix Inc 2.625% 18/11/2024	53,530	0.00
USD	169,613	Exantas Capital Corp 2018-RS06 Ltd ‘Series 2018-RS06 A’ ‘144A’ FRN 15/6/2035	169,771	0.01
USD	2,125,000	Exelon Corp 2.45% 15/4/2021	2,148,769	0.13
USD	2,165,000	Expedia Group Inc ‘144A’ 3.6% 15/12/2023	2,176,402	0.13
EUR	1,890,000	Exxon Mobil Corp 0.142% 26/6/2024	2,262,295	0.14
USD	48,230	Fannie Mae Pool ‘AB4997’ 3% 1/4/2027	50,688	0.00
USD	27	Fannie Mae Pool ‘AD0454’ 5% 1/11/2021	28	0.00
USD	2,172	Fannie Mae Pool ‘AE0812’ 5% 1/7/2025	2,174	0.00
USD	1,292,718	Fannie Mae Pool ‘AL4364’ FRN 1/9/2042	1,359,866	0.08
USD	61,958	Fannie Mae Pool ‘AL7139’ 3% 1/7/2030	66,368	0.00
USD	43,514	Fannie Mae Pool ‘AL7227’ 3% 1/8/2030	46,439	0.00
USD	512,975	Fannie Mae Pool ‘AL9376’ 3% 1/8/2031	548,225	0.03
USD	52,007	Fannie Mae Pool ‘AL9378’ 3% 1/9/2031	55,710	0.00
USD	312,438	Fannie Mae Pool ‘AL9899’ 3% 1/3/2032	334,524	0.02
USD	23,546	Fannie Mae Pool ‘AS5622’ 3% 1/8/2030	25,223	0.00
USD	81,879	Fannie Mae Pool ‘AS5728’ 3% 1/9/2030	87,852	0.01
USD	749,819	Fannie Mae Pool ‘AS5794’ 3% 1/9/2030	799,556	0.05
USD	78,875	Fannie Mae Pool ‘AS8604’ 3% 1/1/2032	84,555	0.01
USD	1,632,536	Fannie Mae Pool ‘AS8980’ 4.5% 1/3/2047	1,792,231	0.11
USD	5,158,494	Fannie Mae Pool ‘AS9610’ 4.5% 1/5/2047	5,645,352	0.34
USD	61,664	Fannie Mae Pool ‘AU0967’ 3% 1/8/2028	64,815	0.00
USD	1,884,692	Fannie Mae Pool ‘AX0000’ FRN 1/9/2044	1,970,610	0.12
USD	639,525	Fannie Mae Pool ‘AX5552’ 3% 1/10/2031	675,112	0.04
USD	285,471	Fannie Mae Pool ‘AY4218’ 3% 1/5/2030	300,288	0.02
USD	737,111	Fannie Mae Pool ‘AY6268’ 3% 1/3/2030	775,460	0.05
USD	113,819	Fannie Mae Pool ‘AZ4080’ 3% 1/12/2031	121,793	0.01
USD	546,480	Fannie Mae Pool ‘AZ5005’ 3% 1/12/2030	574,329	0.04
USD	63,172	Fannie Mae Pool ‘AZ5798’ 3% 1/9/2030	66,848	0.00
USD	35,050	Fannie Mae Pool ‘BA0776’ 3% 1/9/2030	37,088	0.00
USD	22,380	Fannie Mae Pool ‘BA2882’ 3% 1/11/2030	23,507	0.00
USD	651,652	Fannie Mae Pool ‘BA5803’ 3% 1/12/2030	685,462	0.04
USD	515,557	Fannie Mae Pool ‘BC0853’ 3% 1/4/2031	549,260	0.03
USD	87,119	Fannie Mae Pool ‘BC1707’ 3% 1/1/2031	91,519	0.01
USD	30,923	Fannie Mae Pool ‘BC1774’ 3% 1/1/2031	32,481	0.00
USD	73,496	Fannie Mae Pool ‘BC4017’ 3% 1/3/2031	77,273	0.00
USD	82,837	Fannie Mae Pool ‘BC4263’ 3% 1/5/2031	88,364	0.01
USD	53,091	Fannie Mae Pool ‘BC7657’ 3% 1/4/2031	56,637	0.00
USD	26,335	Fannie Mae Pool ‘BD1996’ 3% 1/8/2031	27,706	0.00
USD	84,258	Fannie Mae Pool ‘BD4404’ 3% 1/7/2031	89,374	0.01
USD	450,835	Fannie Mae Pool ‘BD6154’ 3% 1/11/2031	477,868	0.03
USD	532,156	Fannie Mae Pool ‘BE3155’ 3% 1/1/2032	567,893	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	516,118	Fannie Mae Pool ‘BE6942’ 3% 1/2/2032	547,652	0.03
USD	44,205	Fannie Mae Pool ‘BH2512’ 3% 1/7/2032	47,314	0.00
USD	638,303	Fannie Mae Pool ‘BH4308’ 3% 1/6/2032	687,153	0.04
USD	21,401	Fannie Mae Pool ‘BH5232’ 3% 1/7/2032	22,470	0.00
USD	745,757	Fannie Mae Pool ‘BH5623’ 3% 1/6/2032	800,796	0.05
USD	371,352	Fannie Mae Pool ‘BH6399’ 3% 1/11/2032	390,385	0.02
USD	458,013	Fannie Mae Pool ‘BH6518’ 3% 1/9/2032	485,452	0.03
USD	2,271,251	Fannie Mae Pool ‘BJ2716’ 4% 1/4/2033	2,458,846	0.15
USD	20,641	Fannie Mae Pool ‘BJ2995’ 3% 1/1/2033	22,124	0.00
USD	112,475	Fannie Mae Pool ‘BJ3883’ 3% 1/1/2033	119,947	0.01
USD	100,828	Fannie Mae Pool ‘BJ4268’ 3% 1/12/2032	106,458	0.01
USD	30,433	Fannie Mae Pool ‘BJ4734’ 3% 1/12/2032	32,459	0.00
USD	62,047	Fannie Mae Pool ‘BJ5289’ 3% 1/2/2033	66,436	0.00
USD	688,893	Fannie Mae Pool ‘BJ9249’ 4.5% 1/6/2048	784,933	0.05
USD	45,443	Fannie Mae Pool ‘BK7893’ 3% 1/10/2033	47,931	0.00
USD	508,604	Fannie Mae Pool ‘BK9849’ 4% 1/9/2033	570,926	0.03
USD	591,838	Fannie Mae Pool ‘BM1775’ 4.5% 1/7/2047	657,467	0.04
USD	6,035,775	Fannie Mae Pool ‘BM3280’ 4.5% 1/11/2047	6,648,216	0.41
USD	302,313	Fannie Mae Pool ‘BM3947’ 3% 1/1/2033	317,499	0.02
USD	2,178,171	Fannie Mae Pool ‘BM5082’ 4.5% 1/11/2048	2,447,879	0.15
USD	5,868,619	Fannie Mae Pool ‘BM5568’ 4.5% 1/2/2049	6,797,538	0.41
USD	775,566	Fannie Mae Pool ‘BN5294’ 4% 1/2/2034	852,760	0.05
USD	58,246	Fannie Mae Pool ‘BN5357’ 4% 1/3/2034	62,091	0.00
USD	446,274	Fannie Mae Pool ‘BN5360’ 4% 1/3/2034	484,303	0.03
USD	1,524,441	Fannie Mae Pool ‘BN5404’ 4.5% 1/4/2049	1,765,766	0.11
USD	176,931	Fannie Mae Pool ‘BN6416’ 3.5% 1/4/2034	192,215	0.01
USD	914,701	Fannie Mae Pool ‘BN6570’ 3.5% 1/4/2034	999,987	0.06
USD	713,146	Fannie Mae Pool ‘CA0780’ 3% 1/11/2032	763,561	0.05
USD	371,986	Fannie Mae Pool ‘CA1095’ 3% 1/2/2033	401,134	0.02
USD	1,716,458	Fannie Mae Pool ‘CA1937’ 4% 1/6/2033	1,865,401	0.11
USD	467,732	Fannie Mae Pool ‘CA3287’ 4% 1/3/2034	504,167	0.03
USD	15,395,739	Fannie Mae Pool ‘FM1245’ 4% 1/9/2033	16,333,503	1.00
USD	10,420	Fannie Mae Pool ‘MA0909’ 3% 1/11/2021	10,932	0.00
USD	524,608	Fannie Mae Pool ‘MA2561’ 3% 1/3/2031	551,770	0.03
USD	102,162	Fannie Mae Pool ‘MA2684’ 3% 1/7/2031	107,479	0.01
USD	30,790	Fannie Mae Pool ‘MA3090’ 3% 1/8/2032	32,387	0.00
USD	9,114,909	Fannie Mae Pool ‘MA4053’ 2.5% 1/6/2035	9,565,469	0.58
USD	22,965,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 0.25% 24/8/2023	22,959,404	1.40
USD	34,300,000	Federal National Mortgage Association 0.375% 25/8/2025	34,173,379	2.08
USD	2,660,000	Federal National Mortgage Association 0.5% 17/6/2025	2,669,829	0.16
USD	16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	16,001,154	0.98
EUR	1,530,000	Fidelity National Information Services Inc 0.125% 3/12/2022	1,833,116	0.11

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
EUR	2,385,000	Fidelity National Information Services Inc 0.4% 15/1/2021	2,848,273	0.17
EUR	1,945,000	Fidelity National Information Services Inc 0.75% 21/5/2023	2,365,883	0.14
USD	1,330,000	FirstEnergy Corp 2.85% 15/7/2022	1,367,094	0.08
USD	11,462,000	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-B ‘Series 2018-B A4’ 3.38% 15/3/2024	12,114,198	0.74
USD	3,850,000	Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A ‘Series 2017-2 A1’ 2.16% 15/9/2022	3,852,668	0.23
USD	1,895,000	Ford Motor Credit Co LLC 5.085% 7/1/2021	1,902,106	0.12
USD	4,836,867	Freddie Mac Gold Pool ‘G15602’ 2.5% 1/11/2027	5,125,248	0.31
USD	2,107,674	Freddie Mac Gold Pool ‘G16763’ 4% 1/2/2034	2,287,807	0.14
USD	2,487,216	Freddie Mac Gold Pool ‘G16789’ 4% 1/2/2034	2,725,651	0.17
USD	2,137,227	Freddie Mac Gold Pool ‘G16792’ 4% 1/3/2034	2,388,012	0.15
USD	486,151	Freddie Mac Gold Pool ‘G61047’ 4.5% 1/7/2047	547,035	0.03
USD	13,345,449	Freddie Mac Gold Pool ‘G67720’ 4.5% 1/3/2049	15,004,595	0.91
USD	105,015,673	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates FRN 25/9/2024	2,616,108	0.16
USD	1,661,175	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 2.158% 25/10/2021	1,686,376	0.10
USD	2,061,832	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 3.065% 25/8/2022	2,139,821	0.13
USD	4,620,251	Freddie Mac Non Gold Pool ‘849692’ FRN 1/5/2045	4,837,549	0.29
USD	2,460,639	Freddie Mac REMICS ‘Series 4459 BN’ 3% 15/8/2043	2,648,962	0.16
USD	3,290,111	Freddie Mac REMICS ‘Series 4748 HC’ 3% 15/1/2044	3,388,241	0.21
USD	2,208,521	Freddie Mac REMICS ‘Series 4286 MP’ 4% 15/12/2043	2,417,935	0.15
USD	186,939	Freddie Mac REMICS ‘Series 3986 M’ 4.5% 15/9/2041	199,088	0.01
USD	143,201	Freddie Mac REMICS ‘Series 3959 MA’ 4.5% 15/11/2041	158,513	0.01
USD	1,493,500	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3 ‘Series 2020-DNA3 M1’ ‘144A’ FRN 25/6/2050	1,505,016	0.09
USD	1,226,766	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes ‘Series 2017-DNA2 M1’ FRN 25/10/2029	1,228,966	0.08
USD	1,085,000	FREMF 2012-K18 Mortgage Trust ‘Series 2012-K18 B’ ‘144A’ FRN 25/1/2045	1,127,844	0.07
USD	645,000	FREMF 2012-K19 Mortgage Trust ‘Series 2012-K19 B’ ‘144A’ FRN 25/5/2045	672,257	0.04
USD	620,000	FREMF 2012-K20 Mortgage Trust ‘Series 2012-K20 B’ ‘144A’ FRN 25/5/2045	647,007	0.04
USD	590,000	FREMF 2013-K27 Mortgage Trust ‘Series 2013-K27 B’ ‘144A’ FRN 25/1/2046	619,649	0.04
USD	465,000	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust ‘Series 2013-K31 B’ ‘144A’ FRN 25/7/2046	493,103	0.03
USD	1,400,000	FREMF 2015-K720 Mortgage Trust ‘Series 2015-K720 B’ ‘144A’ FRN 25/7/2022	1,446,565	0.09
USD	3,410,000	GE Capital Funding LLC ‘144A’ 3.45% 15/5/2025	3,616,006	0.22
EUR	360,000	General Mills Inc 0.45% 15/1/2026	432,423	0.03
USD	965,000	General Motors Co 5.4% 2/10/2023	1,073,533	0.07
USD	4,261,000	General Motors Financial Co Inc 3.2% 6/7/2021	4,333,227	0.26
USD	2,435,000	General Motors Financial Co Inc 3.7% 24/11/2020	2,445,427	0.15
USD	3,190,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 1/3/2021	3,233,469	0.20

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	1,610,000	General Motors Financial Co Inc 4.2% 6/11/2021	1,667,262	0.10
USD	4,360,000	General Motors Financial Co Inc 5.2% 20/3/2023	4,750,505	0.29
USD	1,000,000	Goldentree Loan Opportunities XI Ltd ‘Series 2015-11A AR2’ ‘144A’ FRN 18/1/2031	991,535	0.06
EUR	1,220,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 21/4/2023	1,453,472	0.09
USD	2,095,288	Gosforth Funding 2018-1 plc ‘Series 2018-1A A1’ ‘144A’ FRN 25/8/2060	2,095,131	0.13
USD	6,205,689	Government National Mortgage Association ‘Series 2012-120 IO’ FRN 16/2/2053	236,935	0.01
USD	3,923,134	Government National Mortgage Association ‘Series 2018-36 AM’ 3% 20/7/2045	4,072,762	0.25
USD	7,350,000	GRACE 2014-GRCE Mortgage Trust ‘Series 2014-GRCE A’ ‘144A’ 3.369% 10/6/2028	7,409,257	0.45
USD	3,375,000	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-500K ‘Series 2017-500K A’ ‘144A’ FRN 15/7/2032	3,367,242	0.21
USD	2,495,000	GS Mortgage Securities Trust 2011-GC5 ‘Series 2011-GC5 AS’ ‘144A’ FRN 10/8/2044	2,555,851	0.16
USD	2,397,403	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ7 ‘Series 2012-GCJ7 A4’ 3.377% 10/5/2045	2,433,820	0.15
USD	2,315,128	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16 ‘Series 2013GC16 AAB’ 3.813% 10/11/2046	2,425,286	0.15
USD	3,495,242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 ‘Series 2014-GC18 A4’ 4.074% 10/1/2047	3,796,440	0.23
USD	1,500,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC34 ‘Series 2015-GC34 A4’ 3.506% 10/10/2048	1,661,995	0.10
USD	3,161,000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS3 ‘Series 2016-GS3 AAB’ 2.777% 10/10/2049	3,328,141	0.20
USD	2,411,062	Halcyon Loan Advisors Funding 2015-2 Ltd ‘Series 2015-2A AR’ ‘144A’ FRN 25/7/2027	2,389,411	0.15
USD	92,000	Halliburton Co 3.8% 15/11/2025	100,975	0.01
USD	2,213,648	Holmes Master Issuer Plc ‘Series 2018-2A A2’ ‘144A’ FRN 15/10/2054	2,212,655	0.13
EUR	1,985,000	Honeywell International Inc 1.3% 22/2/2023	2,441,908	0.15
USD	1,290,000	Huntington National Bank/The 3.125% 1/4/2022	1,342,380	0.08
USD	1,750,000	ICG US CLO 2015-1 Ltd ‘Series 2015-1A A1R’ ‘144A’ FRN 19/10/2028	1,745,049	0.11
USD	1,455,000	Interpublic Group of Cos Inc/ The 3.5% 1/10/2020	1,458,863	0.09
USD	500,000	Interpublic Group of Cos Inc/The 3.75% 1/10/2021	517,728	0.03
USD	900,000	ITC Holdings Corp 2.7% 15/11/2022	940,474	0.06
USD	3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-BCON ‘Series 2018BCON A’ ‘144A’ 3.735% 5/1/2031	3,939,044	0.24
USD	373,848	John Deere Owner Trust 2017-B ‘Series 2017-B A3’ 1.82% 15/10/2021	374,284	0.02
USD	1,243,369	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2011-C4 ‘Series 2011-C4 A4’ ‘144A’ 4.388% 15/7/2046	1,258,950	0.08
USD	4,676,408	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-CIBX ‘Series 2012-CBX A4’ 3.483% 15/6/2045	4,783,153	0.29
USD	3,615,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2012-HSBC ‘Series 2012-HSBC D’ ‘144A’ FRN 5/7/2032	3,734,521	0.23

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,692,498	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C16 ‘Series 2013-C16 ASB’ 3.674% 15/12/2046	2,798,362	0.17
USD	4,042,520	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2013-LC11 ‘Series 2013-LC11 ASB’ 2.554% 15/4/2046	4,130,494	0.25
USD	3,889,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP2 ‘Series 2016-JP2 ASB’ 2.713% 15/8/2049	4,086,580	0.25
USD	2,743,962	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 ‘Series 2016-2 A1’ ‘144A’ FRN 25/6/2046	2,831,487	0.17
USD	2,077,411	JP Morgan Mortgage Trust 2017-1 ‘Series 2017-1 A4’ ‘144A’ FRN 25/1/2047	2,100,249	0.13
USD	1,664,828	JP Morgan Mortgage Trust 2017-3 ‘Series 2017-3 1A6’ ‘144A’ FRN 25/8/2047	1,674,496	0.10
USD	3,083,054	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17 ‘Series 2013-C17 ASB’ 3.705% 15/1/2047	3,226,763	0.20
USD	3,113,468	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23 ‘Series 2014-C23 ASB’ 3.657% 15/9/2047	3,278,309	0.20
USD	889,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C26 ‘Series 2014-C26 ASB’ 3.288% 15/1/2048	931,091	0.06
USD	1,528,565	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C33 ‘Series 2015-C33 A3’ 3.504% 15/12/2048	1,691,862	0.10
USD	6,115,000	JPMorgan Chase & Co FRN 25/4/2023	6,349,444	0.39
USD	2,305,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/4/2024	2,482,637	0.15
USD	2,405,000	JPMorgan Chase & Co FRN 15/10/2025	2,537,842	0.15
USD	4,155,000	JPMorgan Chase & Co FRN 22/4/2026	4,358,745	0.27
USD	365,000	Kinder Morgan Energy Partners LP 4.25% 1/9/2024	407,010	0.02
USD	2,715,000	Kinder Morgan Inc ‘144A’ 5% 15/2/2021	2,759,375	0.17
USD	1,503,000	Kraft Heinz Foods Co 3.95% 15/7/2025	1,642,719	0.10
USD	3,790,000	Lendmark Funding Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 3.81% 21/12/2026	3,843,784	0.23
USD	1,240,780	LFRF ‘2015-1’ ‘144A’ 4% 30/10/2027	1,239,291	0.08
USD	1,935,000	Marathon Petroleum Corp 4.5% 1/5/2023	2,105,650	0.13
EUR	730,000	Marsh & McLennan Cos Inc 1.349% 21/9/2026*	918,448	0.06
USD	4,595,000	Mercedes-Benz Master Owner Trust 2018-BA ‘Series 2018-BA A’ ‘144A’ FRN 15/5/2023	4,597,829	0.28
USD	2,362,208	Mill City Mortgage Loan Trust 2016-1 ‘Series 2016-1 A1’ ‘144A’ FRN 25/4/2057	2,395,393	0.15
EUR	700,000	MMS USA Investments Inc 0.625% 13/6/2025	833,224	0.05
EUR	700,000	Morgan Stanley FRN 26/7/2024	845,823	0.05
USD	4,825,000	Morgan Stanley FRN 28/4/2026	5,084,400	0.31
USD	1,078,546	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 ‘Series 2013-C10 ASB’ FRN 15/7/2046	1,117,072	0.07
USD	1,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 ‘Series 2013-C13 A4’ 4.039% 15/11/2046	1,602,874	0.10
USD	3,167,434	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 ‘Series 2014-C18 ASB’ 3.621% 15/10/2047	3,326,018	0.20
USD	2,385,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 ‘Series 2015-C25 ASB’ 3.383% 15/10/2048	2,523,338	0.15
USD	4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 ‘Series 2015-C25 A5’ 3.635% 15/10/2048	4,619,203	0.28

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	3,438,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 ‘Series 2016-C30 ASB’ 2.729% 15/9/2049	3,619,109	0.22
USD	3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 ‘Series 2016-C31 A5’ 3.102% 15/11/2049	3,300,494	0.20
USD	1,388,882	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-TOP27 ‘Series 2007-T27 AJ’ FRN 11/6/2042	1,395,434	0.09
USD	4,940,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-MP ‘Series 2014-MP A’ ‘144A’ 3.469% 11/8/2033	5,033,238	0.31
USD	1,945,000	MPLX LP FRN 9/9/2021	1,944,940	0.12
USD	1,190,000	MPLX LP 1.75% 1/3/2026	1,187,318	0.07
USD	1,995,000	MPLX LP 3.5% 1/12/2022	2,088,824	0.13
USD	1,435,000	MPLX LP 6.25% 15/10/2022	1,437,971	0.09
USD	600,940	Navient Private Education Loan Trust 2014-A ‘Series 2014-AA A2B’ ‘144A’ FRN 15/2/2029	604,127	0.04
USD	970,518	Navient Private Education Loan Trust 2014-A ‘Series 2014-AA A2A’ ‘144A’ 2.74% 15/2/2029	990,463	0.06
USD	620,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A ‘Series 2020-A A2B’ ‘144A’ FRN 15/11/2068	617,241	0.04
USD	2,000,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-A ‘Series 2020-A B’ ‘144A’ 3.16% 15/11/2068	1,806,382	0.11
USD	897,000	Navient Student Loan Trust 2018-EA ‘Series 2018-EA A2’ ‘144A’ 4% 15/12/2059	933,148	0.06
USD	4,300,552	Neuberger Berman CLO XX Ltd ‘Series 2015-20A AR’ ‘144A’ FRN 15/1/2028	4,263,353	0.26
USD	4,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 Ltd ‘Series 2017-26A A’ ‘144A’ FRN 18/10/2030	4,827,632	0.29
USD	658,899	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 ‘Series 2016-3A A1B’ ‘144A’ FRN 25/9/2056	697,526	0.04
USD	3,071,113	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A A1A’ ‘144A’ FRN 25/12/2057	3,308,172	0.20
USD	34,244	Northwest Airlines 2002-1 Class G-2 Pass Through Trust 6.264% 20/11/2021	34,252	0.00
USD	265,000	Nucor Corp 2% 1/6/2025	278,033	0.02
USD	660,000	NVIDIA Corp 2.85% 1/4/2030	732,447	0.04
USD	725,000	Occidental Petroleum Corp 2.9% 15/8/2024	668,356	0.04
USD	6,931,385	OneMain Direct Auto Receivables Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 3.43% 16/12/2024	7,016,618	0.43
USD	1,415,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 ‘Series 2018-1A A’ ‘144A’ 3.3% 14/3/2029	1,437,966	0.09
USD	1,900,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 ‘Series 2019-2A A’ ‘144A’ 3.14% 14/10/2036	2,065,400	0.13
USD	2,175,000	Ovintiv Inc 3.9% 15/11/2021	2,200,784	0.13
USD	575,000	Parker-Hannifin Corp 2.7% 14/6/2024	616,212	0.04
USD	1,450,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ‘144A’ 2.7% 14/3/2023	1,510,247	0.09
USD	855,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ‘144A’ 2.7% 1/11/2024	905,526	0.06
USD	4,635,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ‘144A’ 4.125% 1/8/2023	5,034,892	0.31
USD	1,075,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ‘144A’ 4.25% 17/1/2023	1,160,138	0.07
USD	3,630,000	PFS Financing Corp ‘Series 2018-B A’ ‘144A’ 2.89% 15/2/2023	3,672,393	0.22

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	2,830,000	PFS Financing Corp ‘Series 2018-D A’ ‘144A’ 3.19% 17/4/2023	2,878,071	0.18
USD	4,430,000	PFS Financing Corp ‘Series 2018-F A’ ‘144A’ 3.52% 15/10/2023	4,576,135	0.28
USD	1,150,000	Roper Technologies Inc 1% 15/9/2025	1,158,707	0.07
USD	2,094,517	Rosslyn Portfolio Trust 2017ROSS ‘Series 2017-ROSS B’ ‘144A’ FRN 15/6/2033	2,028,101	0.12
USD	1,702,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.75% 15/5/2024	1,943,964	0.12
USD	700,000	Santander Holdings USA Inc 3.5% 7/6/2024	753,556	0.05
USD	1,535,000	Santander Holdings USA Inc 3.7% 28/3/2022	1,594,929	0.10
USD	5,041,744	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 ‘Series 2019-4 MA’ 3% 25/2/2059	5,379,073	0.33
USD	2,755,000	Sempra Energy FRN 15/1/2021*	2,755,989	0.17
USD	1,823,911	Sequoia Mortgage Trust 2017CH1 ‘Series 2017-CH1 A2’ ‘144A’ FRN 25/8/2047	1,872,359	0.11
USD	676,793	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH2 ‘Series 2017-CH2 A10’ ‘144A’ FRN 25/12/2047	683,138	0.04
USD	762,300	Sesac Finance LLC ‘Series 2019-1 A2’ ‘144A’ 5.216% 25/7/2049	804,457	0.05
USD	8,050,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A ‘Series 2005-A A4’ FRN 15/12/2038	7,696,595	0.47
USD	5,646,555	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ‘Series 2005-B A4’ FRN 15/6/2039	5,340,755	0.33
USD	3,882,460	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ‘Series 2006-A A5’ FRN 15/6/2039	3,669,128	0.22
USD	2,918,064	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ‘Series 2006-B A5’ FRN 15/12/2039	2,716,464	0.17
USD	1,704,473	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A ‘Series 2007-A A4A’ FRN 16/12/2041	1,627,992	0.10
USD	1,900,000	SLM Private Education Loan Trust 2010-C ‘Series 2010-C A5’ ‘144A’ FRN 15/10/2041	2,065,499	0.13
USD	310,583	SLM Private Education Loan Trust 2011-B ‘Series 2011-B A3’ ‘144A’ FRN 16/6/2042	311,220	0.02
USD	1,162,383	SLM Student Loan Trust 2013-4 ‘Series 2013-4 A’ FRN 25/6/2043	1,136,516	0.07
USD	1,151,644	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ‘Series 2015-C A2A’ ‘144A’ 2.75% 15/7/2027	1,169,066	0.07
USD	1,225,136	SMB Private Education Loan Trust 2016-A ‘Series 2016-A A2A’ ‘144A’ 2.7% 15/5/2031	1,253,923	0.08
USD	1,442,215	SMB Private Education Loan Trust 2016-B ‘Series 2016-B A2A’ ‘144A’ 2.43% 17/2/2032	1,472,804	0.09
USD	3,490,088	SMB Private Education Loan Trust 2017-A ‘Series 2017-A A2B’ ‘144A’ FRN 15/9/2034	3,481,608	0.21
USD	2,150,000	SMB Private Education Loan Trust 2019-A ‘Series 2019-A A2A’ ‘144A’ 3.44% 15/7/2036	2,262,444	0.14
USD	3,249,831	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ‘Series 2020-A A1’ ‘144A’ FRN 15/3/2027	3,237,520	0.20
USD	680,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ‘Series 2020-A A2B’ ‘144A’ FRN 15/9/2037	665,498	0.04
USD	726,262	Sofi Professional Loan Program 2016-A LLC ‘Series 2016-A A2’ ‘144A’ 2.76% 26/12/2036	733,727	0.04
USD	428,459	SoFi Professional Loan Program 2016-C LLC ‘Series 2016-C A2B’ ‘144A’ 2.36% 27/12/2032	432,653	0.03

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	449,908	SoFi Professional Loan Program 2016-D LLC ‘Series 2016-D A2B’ ‘144A’ 2.34% 25/4/2033	456,637	0.03
USD	2,463,471	Sofi Professional Loan Program 2016-E LLC ‘Series 2016-E A2B’ ‘144A’ 2.49% 25/1/2036	2,497,731	0.15
USD	3,656,216	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC ‘Series 2017-D A2FX’ ‘144A’ 2.65% 25/9/2040	3,748,908	0.23
USD	238,769	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust ‘Series 2018-B A1FX’ ‘144A’ 2.64% 25/8/2047	239,078	0.01
USD	4,425,000	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust ‘Series 2018-C A2FX’ ‘144A’ 3.59% 25/1/2048	4,675,903	0.29
USD	4,375,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust ‘Series 2018-D A2FX’ ‘144A’ 3.6% 25/2/2048	4,584,874	0.28
USD	68,073	Soundview Home Loan Trust 2003-2 ‘Series 2003-2 A2’ FRN 25/11/2033	67,746	0.00
USD	2,480,000	South Carolina Public Service Authority 2.388% 1/12/2023	2,570,694	0.16
USD	2,197,000	South Carolina Public Service Authority 3.722% 1/12/2023	2,380,669	0.15
USD	620,000	Spectra Energy Partners LP 4.75% 15/3/2024	696,848	0.04
USD	3,087,225	Springleaf Funding Trust 2015B ‘Series 2015-BA A’ ‘144A’ 3.48% 15/5/2028	3,102,227	0.19
USD	2,336,925	Springleaf Funding Trust 2017A ‘Series 2017-AA A’ ‘144A’ 2.68% 15/7/2030	2,340,793	0.14
USD	289,063	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ‘144A’ 3.36% 20/9/2021	292,897	0.02
USD	2,975,000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC ‘144A’ 4.738% 20/3/2025	3,250,559	0.20
USD	165,000	Steel Dynamics Inc 2.4% 15/6/2025	173,626	0.01
USD	1,305,000	Synchrony Financial 2.85% 25/7/2022	1,343,984	0.08
EUR	565,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2% 15/4/2025	732,026	0.04
USD	2,485,000	T-Mobile USA Inc ‘144A’ 3.5% 15/4/2025	2,744,931	0.17
USD	1,590,279	Towd Point Mortgage Trust 2016-3 ‘Series 2016-3 A1’ ‘144A’ FRN 25/4/2056	1,616,835	0.10
USD	2,329,942	Towd Point Mortgage Trust 2016-4 ‘Series 2016-4 A1’ ‘144A’ FRN 25/7/2056	2,365,654	0.14
USD	1,750,000	TRESTLES CLO 2017-1 Ltd ‘Series 2017-1A B’ ‘144A’ FRN 25/7/2029	1,745,691	0.11
USD	2,900,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 ‘Series 2017-C1 A4’ 3.46% 15/6/2050	3,245,667	0.20
USD	20,735,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2022	22,476,459	1.37
USD	8,200,000	United States Treasury Note/ Bond 0.125% 31/7/2022	8,197,918	0.50
USD	81,000,000	United States Treasury Note/ Bond 0.125% 15/7/2023	80,946,211	4.93
USD	121,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 30/6/2021*	121,999,668	7.44
USD	965,000	ViacomCBS Inc 3.875% 1/4/2024	1,053,719	0.06
USD	430,000	Volkswagen Group of America Finance LLC ‘144A’ 2.7% 26/9/2022	447,315	0.03
USD	4,700,000	Volkswagen Group of America Finance LLC ‘144A’ 3.125% 12/5/2023	4,984,683	0.30
USD	1,484,873	Voya CLO 2014-3 Ltd ‘Series 2014-3A A1R’ ‘144A’ FRN 25/7/2026	1,470,567	0.09

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

	保有高	銘柄	時価（米ドル）	純資産比率（%）
		米国（続き）		
USD	3,500,000	Wells Fargo & Co FRN 2/6/2024	3,576,781	0.22
USD	5,995,000	Wells Fargo & Co 3.069% 24/1/2023	6,200,429	0.38
USD	3,215,000	Wells Fargo & Co 3.75% 24/1/2024	3,514,914	0.21
USD	3,085,085	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 ‘Series 2014-LC16 ASB’ 3.477% 15/8/2050	3,228,172	0.20
USD	499,995	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22 ‘Series 2015-LC22 ASB’ 3.571% 15/9/2058	528,694	0.03
USD	1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 ‘Series 2015-NXS1 A5’ 3.148% 15/5/2048	1,711,178	0.10
USD	4,996,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 ‘Series 2017-C39 A5’ 3.418% 15/9/2050	5,621,710	0.34
USD	3,358,915	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2012-C8 ‘Series 2012-C8 AFL’ ‘144A’ FRN 15/8/2045	3,354,965	0.20
USD	4,292,576	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 ‘Series 2014-C21 ASB’ 3.393% 15/8/2047	4,455,622	0.27
USD	1,000,000	Williams Cos Inc/The 3.6% 15/3/2022	1,040,059	0.06
USD	2,400,000	Williams Cos Inc/The 3.7% 15/1/2023	2,549,687	0.16
USD	1,765,000	Williams Cos Inc/The 4% 15/11/2021	1,822,070	0.11
USD	2,000,000	WRKCo Inc 3.75% 15/3/2025	2,253,112	0.14
USD	719,000	ZF North America Capital Inc ‘144A’ 4.5% 29/4/2022	746,412	0.05
			1,164,478,729	70.97
		ウルグアイ		
USD	370,374	Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	431,254	0.03
		債券合計	1,438,967,978	87.70
		公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券合計	1,574,604,264	95.96
		投資有価証券合計	1,574,604,264	95.96
		その他の純資産	66,262,821	4.04
		純資産合計（米ドル）	1,640,867,085	100.00

~ 関連当事者ファンドに対する投資。詳細については注記11を参照のこと。
*** 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。**

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約　2020年８月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損）（米ドル）
AUD	1,007,000	USD	739,342	BNP Paribas	3/9/2020	2,455
GBP	28,766,000	USD	38,287,546	Bank of America	3/9/2020	31,921
USD	1,320,706	AUD	1,841,446	Citibank	3/9/2020	(35,779)
USD	116,042,039	EUR	98,074,000	UBS	3/9/2020	(931,024)
USD	2,012,656	EUR	1,700,964	Citibank	3/9/2020	(16,087)
USD	3,111,661	GBP	2,376,324	Citibank	3/9/2020	(53,864)
USD	1,146,079	GBP	880,000	Royal Bank of Canada	3/9/2020	(26,178)
USD	33,606,574	GBP	25,805,000	JP Morgan	3/9/2020	(768,516)
USD	3,425,425	GBP	2,624,000	State Street	3/9/2020	(70,030)
USD	2,651,895	GBP	2,007,000	Toronto Dominion	3/9/2020	(21,649)
AUD	5,640,000	NZD	6,170,525	JP Morgan	16/9/2020	603
AUD	5,160,000	NZD	5,509,987	Bank of America	16/9/2020	91,700
EUR	3,370,000	USD	3,997,309	Bank of America	16/9/2020	23,233
EUR	3,400,000	USD	4,007,287	Morgan Stanley	16/9/2020	49,046
GBP	3,100,000	NOK	36,255,880	Goldman Sachs	16/9/2020	(15,618)
GBP	3,030,000	NOK	36,034,926	Morgan Stanley	16/9/2020	(83,611)
NOK	36,323,779	EUR	3,470,000	Toronto Dominion	16/9/2020	13,466
NOK	36,138,777	GBP	3,030,000	Citibank	16/9/2020	95,485
NOK	36,441,748	GBP	3,100,000	BNP Paribas	16/9/2020	36,871
NOK	36,900,000	SEK	35,960,858	Morgan Stanley	16/9/2020	54,245
NZD	11,809,499	AUD	10,800,000	Goldman Sachs	16/9/2020	(5,463)
SEK	36,013,588	NOK	36,900,000	Morgan Stanley	16/9/2020	(48,138)
USD	4,030,028	EUR	3,400,000	JP Morgan	16/9/2020	(26,305)
USD	4,004,576	EUR	3,370,000	BNP Paribas	16/9/2020	(15,966)
USD	38,295,629	GBP	28,766,000	Bank of America	5/10/2020	(32,376)
USD	739,412	AUD	1,007,000	BNP Paribas	6/10/2020	(2,477)
未実現純評価損						(1,754,056)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	153,398,407	USD	180,997,092	BNY Mellon	15/9/2020	2,008,666
USD	849,144	EUR	719,750	BNY Mellon	15/9/2020	(9,524)
未実現純評価益						1,999,142
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	773,642	USD	564,234	BNY Mellon	15/9/2020	4,292
未実現純評価益						4,292
未実現純評価益合計 （米ドル建の基礎となるエクスポージャー−533,554,221米ドル）						249,378

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済上場先物取引　2020年８月31日現在

契約数	通貨	契約／摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー（米ドル）	未実現評価益／（損）（米ドル）
301	EUR	Short-Term Euro-BPT	2020年９月	40,340,327	10,388
(3)	EUR	Euro Bund	2020年９月	627,872	5,216
(273)	EUR	Euro BOBL	2020年９月	43,832,352	2,697
(673)	EUR	Euro Schatz	2020年９月	89,915,211	17,497
2,396	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2020年12月	529,347,528	157,385
160	USD	90 Day Euro $	2020年12月	39,886,000	20,000
11	USD	US Long Bond (CBT)	2020年12月	2,410,375	(37,271)
(9)	USD	US Long Bond (CBT)	2020年12月	1,575,000	16,839
(66)	USD	US Ultra 10 Year Note	2020年12月	10,496,063	12,080
(189)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2020年12月	26,291,672	(5,716)
(1,815)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2020年12月	228,661,641	(138,876)
		合計		1,013,384,041	60,239

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ　2020年８月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／（損）（米ドル）	時価（米ドル）
CDS	USD 575,434	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2020	(339)	(245)
CDS	USD 16,873,650	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、５％の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2022	(88,667)	(816,697)
CDS	USD (6,500,000)	ファンドはBoeing Co/Theに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2020	(72,077)	(33,021)
CDS	USD 842,012	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(2,134)	(26,882)
CDS	USD 844,970	ファンドはTWDC Enterprises 18 Corpに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(2,695)	(26,976)
CDS	USD (130,500)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/12/2022	(3,161)	6,316
CDS	USD (3,555,000)	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	Citigroup	20/6/2024	289,969	31,151
CDS	USD (7,830,000)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2022	(238,983)	378,978
CDS	USD (8,913,150)	ファンドはCDX.NA.HY.29.V14に係るデフォルト・プロテクションを提供し、５％の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	20/12/2022	(98,434)	431,403
CDS	USD (575,434)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、１％の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/9/2020	8,281	245
CDS	USD 400,000	ファンドはBroadcom Incに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、１％の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(11,358)	(787)
IRS	USD 36,430,000	ファンドはUSD３ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.21%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/9/2022	(4,216)	(6,562)
IRS	USD 5,600,000	ファンドはUSD３ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.295%の固定金利を支払う	Credit Suisse	28/2/2025	1,091	1,797
IRS	USD 12,470,000	ファンドは0.634%の固定金利を受け取り、USD３ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	15/5/2030	(90,314)	(93,296)
IRS	USD 1,990,000	ファンドはUSD３ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.63358%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/5/2030	14,966	14,965
IRS	USD 1,980,000	ファンドはUSD３ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.976%の固定金利を支払う	Credit Suisse	15/2/2047	65,470	64,867
合計 （米ドル建の基礎となるエクスポージャー－107,018,481米ドル）					(232,601)	(74,744)

CDS:クレジット・デフォルト・スワップ
IRS:金利スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2021年６月末現在)

「ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー」

Ⅰ　資産総額	1,512,456,343円
Ⅱ　負債総額	660,725円
Ⅲ　純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	1,511,795,618円
Ⅳ　発行済数量	1,525,194,695口
Ⅴ　１単位当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9912円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

１　受益証券の名義書換え等

該当事項はありません。

２　受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成していません。

３　投資者に対する特典

該当事項はありません。

４　内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

譲渡制限は設けておりません。

５　受益証券の再発行

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

６　受益権の譲渡

①　投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

②　前項の申請のある場合には、①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③　①の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

７　受益権の譲渡の対抗要件

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

８　受益権の再分割

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

９　償還金

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

１０　質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

① 資本金　　3,120百万円

② 発行する株式の総数　　36,000株

③ 発行済株式の総数　　15,000株

④ 直近５ヵ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

① 経営の意思決定機構

＜株主総会＞

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

＜取締役会＞

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

＜エグゼクティブ委員会他各委員会＞

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

② 運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する証券投資信託は2021年６月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)。

種類	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	173	10,389,095
単位型株式投資信託	43	381,865
合計	216	10,770,960

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自2020年1月1日　至2020年12月31日）の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第33期 (2019年12月31日現在)	第34期 (2020年12月31日現在)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		20,388	17,786
立替金		26	29
前払費用		175	190
未収入金	※２	9	3
未収委託者報酬		1,696	1,756
未収運用受託報酬		2,268	2,166
未収収益	※２	1,327	872
その他流動資産		0	0
流動資産計		25,892	22,805
固定資産			
有形固定資産			
建物附属設備	※１	1,240	1,002
器具備品	※１	475	480
有形固定資産計		1,716	1,482
無形固定資産			
ソフトウエア		5	6
無形固定資産計		5	6
投資その他の資産			
投資有価証券		49	142
長期差入保証金		1,120	1,122
前払年金費用		800	899
長期前払費用		45	34
繰延税金資産		824	888
投資その他の資産計		2,839	3,088
固定資産計		4,561	4,577
資産合計		30,454	27,383

（単位：百万円）

		第33期 (2019年12月31日現在)	第34期 (2020年12月31日現在)
負債の部			
流動負債			
預り金		94	121
未払金	※２		
未払収益分配金		4	4
未払償還金		74	74
未払手数料		487	444
その他未払金		908	1,508
未払費用	※２	653	859
未払消費税等		117	210
未払法人税等		363	343
前受金		97	84
賞与引当金		2,017	1,987
役員賞与引当金		139	195
早期退職慰労引当金		10	-
流動負債計		4,967	5,835
固定負債			
退職給付引当金		67	69
資産除去債務		782	783
固定負債計		850	853
負債合計		5,818	6,688
純資産の部			
株主資本			
資本金		3,120	3,120
資本剰余金			
資本準備金		3,001	3,001
その他資本剰余金		3,846	3,846
資本剰余金合計		6,847	6,847
利益剰余金			
利益準備金		336	336
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		14,330	10,386
利益剰余金合計		14,666	10,723
株主資本合計		24,634	20,691
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		1	3
評価・換算差額等合計		1	3
純資産合計		24,636	20,694
負債・純資産合計		30,454	27,383

(2)【損益計算書】

（単位：百万円）

		第33期 (自　2019年1月1日 至　2019年12月31日)	第34期 (自　2020年1月1日 至　2020年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,643	5,605
運用受託報酬	※1	7,545	7,342
その他営業収益	※1	13,290	12,092
営業収益計		26,480	25,041
営業費用			
支払手数料		1,632	1,405
広告宣伝費		167	127
調査費			
調査費		381	352
委託調査費	※1	3,587	3,346
調査費計		3,968	3,698
委託計算費		82	85
営業雑経費			
通信費		53	64
印刷費		82	82
諸会費		43	49
営業雑経費計		178	195
営業費用計		6,029	5,512
一般管理費			
給料			
役員報酬		482	601
給料・手当		4,441	4,691
賞与		2,343	2,384
給料計		7,268	7,678
退職給付費用		308	331
福利厚生費		977	1,028
事務委託費	※1	2,339	2,701
交際費		57	16
寄付金		2	1
旅費交通費		233	60
租税公課		257	246
不動産賃借料		875	905
水道光熱費		76	60
固定資産減価償却費		404	428
資産除去債務利息費用		0	0
諸経費		312	390
一般管理費計		13,114	13,851
営業利益		7,335	5,677

（単位：百万円）

	第33期 （自　2019年1月1日 至　2019年12月31日）	第34期 （自　2020年1月1日 至　2020年12月31日）
営業外収益		
その他	1	5
営業外収益計	1	5
営業外費用		
為替差損	32	20
固定資産除却損	3	0
その他	0	-
営業外費用計	36	20
経常利益	7,300	5,662
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	36	-
特別損失計	36	-
税引前当期純利益	7,263	5,662
法人税、住民税及び事業税	2,338	1,970
法人税等調整額	22	△64
当期純利益	4,902	3,756

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期　(自　2019年1月1日　至　2019年12月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
						繰越利益剰余金					
2019年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431
当期変動額											
剰余金の配当						△7,700	△7,700	△7,700			△7,700
当期純利益						4,902	4,902	4,902			4,902
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	△2,797	△2,797	△2,797	1	1	△2,795
2019年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636

第34期　(自　2020年1月1日　至　2020年12月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
						繰越利益剰余金					
2020年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636
当期変動額											
剰余金の配当						△7,700	△7,700	△7,700			△7,700
当期純利益						3,756	3,756	3,756			3,756
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	△3,943	△3,943	△3,943	1	1	△3,942
2020年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,386	10,723	20,691	3	3	20,694

注　記　事　項

［重要な会計方針］

1.　有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

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

2.　デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.　固定資産の減価償却方法

(1)　有形固定資産

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

(2)　無形固定資産

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

4.　引当金の計上基準

(1)　貸倒引当金の計上方法

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

(2)　退職給付引当金の計上方法

①　旧退職金制度

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

②　確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

③　確定給付年金制度

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

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

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

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

(3)　賞与引当金の計上方法

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

(4)　役員賞与引当金の計上方法

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

(5)　早期退職慰労引当金の計上方法

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

5.　外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

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

6.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1)　消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

(2)　連結納税制度の適用

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

(3)　連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（会計方針の変更）

（金銭債権と金銭債務の相殺表示に関わる会計方針の変更）

当社は、当社グループ会社間の債権債務を含む金銭債権及び金銭債務を従来総額で表示しておりましたが、グループ会社間でのマスター・ネッティング契約締結を契機に見直しを行った結果、「金融商品会計に関する実務指針」(日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第14号)第140項に基づき、金銭債権と金銭債務を相殺表示する方が当社の財政状態をより適切に表示できると判断し、当事業年度から相殺表示する方法へ変更しております。

前事業年度末の財務諸表等については、当該変更に伴う組替えを行っております。この結果、遡及修正を行う前と比べて、前事業年度末の未収入金、金銭債権である未収収益、その他未払金及び金銭債務である未払費用が、それぞれ20百万円、505百万円、77百万円及び449百万円減少しています。

（未適用の会計基準等）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　2020年3月31日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　2020年3月31日）

(1)　概要

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

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。

ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ５：履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。

(2)　適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

(3)　当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準30号　2019年7月4日)
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号　2019年7月4日)
「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号　2019年7月4日)
「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号　2020年3月31日)

(1)　概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

(2)　適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

(3)　当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
建物附属設備	1,769　百万円	2,010　百万円
器具備品	1,104　百万円	1,290　百万円

※２　関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
未収入金	3　百万円	-　百万円
未収収益	579　百万円	185　百万円
その他未払金	894　百万円	1,496　百万円
未払費用	182　百万円	89　百万円

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

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
当座貸越極度額	1,000　百万円	1,000　百万円
借入実行残高	―	―
差引額	1,000　百万円	1,000　百万円

（損益計算書関係）

※１　関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 （自　2019年1月1日 至　2019年12月31日）	当事業年度 （自　2020年1月1日 至　2020年12月31日）
運用受託報酬	225　百万円	247　百万円
その他営業収益	5,554　百万円	5,052　百万円
委託調査費	698　百万円	763　百万円
事務委託費	954　百万円	851　百万円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度　（自　2019年1月1日　至　2019年12月31日）

1.　発行済株式に関する事項

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

2.　自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3.　新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4.　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年3月28日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2018年12月31日	2019年3月29日

当事業年度　（自　2020年1月1日　至　2020年12月31日）

1.　発行済株式に関する事項

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

2.　自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3.　新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4.　配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年3月30日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2019年12月31日	2020年3月30日

（金融商品関係）

1.　金融商品の状況に関する事項

(1)　金融商品に対する取組方針

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

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

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

(2)　金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料及び未払費用はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2.　金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度　（2019年12月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1)　現金・預金	20,388	20,388	－
(2)　未収委託者報酬	1,696	1,696	－
(3)　未収運用受託報酬	2,268	2,268	－
(4)　未収収益	1,327	1,327	－
(5)　長期差入保証金	1,120	1,116	△4
資産計	26,801	26,797	△4
(1)　未払手数料	487	487	－
(2)　未払費用	653	653	－
負債計	1,141	1,141	－

当事業年度　（2020年12月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1)　現金・預金	17,786	17,786	－
(2)　未収委託者報酬	1,756	1,756	－
(3)　未収運用受託報酬	2,166	2,166	－
(4)　未収収益	872	872	－
(5)　長期差入保証金	1,122	1,123	1
資産計	23,704	23,705	1
(1)　未払手数料	444	444	－
(2)　未払費用	859	859	－
負債計	1,304	1,304	－

(注1)　金融商品の時価の算定方法に関する事項

資　産

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

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

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負　債

(1)未払手数料、(2) 未払費用

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

(注2)　金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年12月31日）

	1年以内 （百万円）	1年超 5年以内 （百万円）	5年超 10年以内 （百万円）	10年超 （百万円）
(1)　現金・預金	20,388	－	－	－
(2)　未収委託者報酬	1,696	－	－	－
(3)　未収運用受託報酬	2,268	－	－	－
(4)　未収収益	1,327	－	－	－
(5)　長期差入保証金	－	1,051	57	11
合計	25,680	1,051	57	11

当事業年度（2020年12月31日）

	1年以内 （百万円）	1年超 5年以内 （百万円）	5年超 10年以内 （百万円）	10年超 （百万円）
(1)　現金・預金	17,786	－	－	－
(2)　未収委託者報酬	1,756	－	－	－
(3)　未収運用受託報酬	2,166	－	－	－
(4)　未収収益	872	－	－	－
合計	22,581	－	－	－

（有価証券関係）

前事業年度　(2019年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	49	47	1
合計		49	47	1

当事業年度　(2020年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	142	138	4
合計		142	138	4

（退職給付関係）

前事業年度　(自　2019年1月1日　至　2019年12月31日)

1.　採用している退職給付制度の概要

当社は、旧バークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、①旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、2009年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（②確定拠出年金制度及び③確定給付年金制度）を承継しました。また、2011年1月1日付で旧バークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の③確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、①から③の三つの制度を有しています。

2.　確定給付制度

(1)　退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,934
勤務費用	290
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	14
退職給付の支払額	△204
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,047

(2)　年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
年金資産の期首残高	2,696
期待運用収益	26
数理計算上の差異の発生額	132
事業主からの拠出額	328
退職給付の支払額	△204
年金資産の期末残高	2,979

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

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,979
年金資産	△2,979
	△999
非積立型制度の退職給付債務	67
未積立退職給付債務	△931
未認識数理計算上の差異	157
未認識過去勤務費用	41
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△732
退職給付引当金	67
前払年金費用	△800
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△732

(4)　退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
勤務費用	290
利息費用	11
期待運用収益	△26
数理計算上の差異の費用処理額	△33
過去勤務費用の処理額	△10
確定給付制度に係る退職給付費用合計	231
特別退職金	36
合計	267

(5)　年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2019年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券76%、株式21%及びその他3%となっております。

②長期期待運用収益率の算定方法

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

(6)　数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

3.　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円 でありました。

当事業年度 (自 2020年1月1日 至 2020年12月31日)

1.　採用している退職給付制度の概要

当社は、旧バークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、①旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、2009年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（②確定拠出年金制度及び③確定給付年金制度）を承継しました。また、2011年1月1日付で旧バークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の③確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、①から③の三つの制度を有しています。

2.　確定給付制度

(1)　退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,047
勤務費用	297
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	△82
退職給付の支払額	△123
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,149

(2)　年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
年金資産の期首残高	2,979
期待運用収益	14
数理計算上の差異の発生額	92
事業主からの拠出額	350
退職給付の支払額	△123
年金資産の期末残高	3,313

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

（単位：百万円）

	当事業年度 (2020年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,080
年金資産	△3,313
	△1,233
非積立型制度の退職給付債務	69
未積立退職給付債務	△1,163
未認識数理計算上の差異	296
未認識過去勤務費用	37
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△829
退職給付引当金	69
前払年金費用	△899
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	△829

(4)　退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：百万円）

	当事業年度 (自　2020年1月　1日 至　2020年12月31日)
勤務費用	297
利息費用	11
期待運用収益	△14
数理計算上の差異の費用処理額	△36
過去勤務費用の処理額	△4
確定給付制度に係る退職給付費用合計	252
特別退職金	-
合計	252

(5)　年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2020年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券74%、株式24%及びその他3%となっております。

②長期期待運用収益率の算定方法

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

(6)　数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自　2020年1月　1日 至　2020年12月31日)
割引率	1.0%
長期期待運用収益率	0.5%

3.　確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、78百万円 でありました。

（税効果会計関係）

1.　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	191	215
賞与引当金	617	608
資産除去債務	239	239
未払事業税	72	72
早期退職慰労引当金	3	-
退職給付引当金	20	21
有形固定資産	1	2
その他	45	94
繰延税金資産合計	1,191	1,256
繰延税金負債		
退職給付引当金	△245	△275
資産除去債務に対応する除去費用	△121	△90
その他	△0	△1
繰延税金負債合計	△366	△367
繰延税金資産の純額	824	888

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

（単位：百万円）

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
固定資産－繰延税金資産	824	888

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

	前事業年度 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.9	2.9
その他	0.0	0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.5%	33.7%

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1.　当該資産除去債務の概要

当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2.　当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を合理的に見積り、割引率は0.16%～0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3.　当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
期首残高	781	782
時の経過による調整額	0	0
期末残高	782	783

（デリバティブ取引関係）

前事業年度　(2019年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：百万円）

区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	79	-	0	0
	買建				
	英ポンド	0	-	0	0
合計		79	-	0	0

（注）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度　(2020年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：百万円）

区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	99	-	0	0
合計		99	-	0	0

（注）時価の算定方法　先物為替相場に基づき算定しております。

（セグメント情報等）

前事業年度　(自　2019年1月1日　至　2019年12月31日)

1.　セグメント情報

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

2.　関連情報

(1)　製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,643	7,545	13,290	26,480

(2)　地域ごとの情報

①　売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
12,538	11,197	2,744	26,480

（注）　売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

②　有形固定資産

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

(3)　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,779	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,314	投資運用業

3.　報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.　報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.　報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度　(自　2020年1月1日　至　2020年12月31日)

1.　セグメント情報

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

2.　関連情報

(1)　製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,605	7,342	12,092	25,041

(2)　地域ごとの情報

①　売上高

（単位：百万円）

日本	北米	その他	合計
12,247	10,417	2,375	25,041

（注）　売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

②　有形固定資産

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

(3)　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

（単位：百万円）

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,299	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,874	投資運用業

3.　報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.　報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.　報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1.　関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者との取引

(1)　財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等に限る。）等

前事業年度　（自　2019年1月1日　至　2019年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国ニューヨーク州	73百万米ドル	投資顧問業	（被所有）間接100	投資顧問契約の再委任等	運用受託報酬	225	未収収益	579
							受入手数料	5,554		
							委託調査費	698	未払費用	182
							事務委託費	954		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本東京都	1万円	持株会社	（被所有）直接100	株式の保有等	営業外収益	-	未収入金	3
									その他未払金	894

当事業年度　（自　2020年1月1日　至　2020年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国ニューヨーク州	73百万米ドル	投資顧問業	（被所有）間接100	投資顧問契約の再委任等	運用受託報酬	247	未収収益	185
							受入手数料	5,052		
							委託調査費	763	未払費用	89
							事務委託費	851		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本東京都	1万円	持株会社	（被所有）直接100	株式の保有等	連結法人税の個別帰属額	1,496	未収入金	-
									その他未払金	1,496

(2)　財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度　（自　2019年1月1日　至　2019年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度　（自　2020年1月1日　至　2020年12月31日）

該当事項はありません。

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

前事業年度　（自　2019年1月1日　至　2019年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,314	未収収益	351
							委託調査費	145	未払費用	-
							事務委託費	28		

当事業年度　（自　2020年1月1日　至　2020年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	2,874	未収収益	314
							委託調査費	220	未払費用	-
							事務委託費	16		

（注）　1．取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。

(2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。

(3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。

(4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

2．　親会社に関する注記

(1)　親会社情報

ブラックロック・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）

ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク（非上場）

ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

（１株当たり情報）

項目	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
１株当たり純資産額	1,642,418 円　94 銭	1,379,616 円　18 銭
１株当たり当期純利益金額	326,833 円　15 銭	250,430 円　96 銭

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

２．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
当期純利益（百万円）	4,902	3,756
普通株主に帰属しない金額（百万円）	―	―
普通株式に係る当期純利益（百万円）	4,902	3,756
普通株式の期中平均株式数（株）	15,000	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度（自　2020年1月1日　至2020年12月31日）を対象としております。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

(2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)。

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。

(4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

(5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

・名称　　：株式会社りそな銀行
・資本金の額　　：279,928百万円(2021年３月末現在)
・事業の内容　　：銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

＜参考：再信託受託会社の概要＞

・名称　　株式会社日本カストディ銀行
・資本金　　51,000百万円（2021年３月末現在)
・事業の内容　　銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。
・再信託の目的　　原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託会社から再信託受託会社(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2021年３月末現在)	事業の内容
藍澤證券株式会社	8,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
四国アライアンス証券株式会社＊	3,000	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	
松井証券株式会社	11,945	
マネックス証券株式会社	12,200	
三菱ＵＦＪモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	
楽天証券株式会社	7,495	
株式会社伊予銀行＊	20,948	銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第３【その他】

１　交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

①　委託会社名

②　金融商品取引業者登録番号

③　設立年月日

④　資本金

⑤　当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

⑥　「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

①　委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

②　請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

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

①　届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②　届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

①　商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、以下「投信法」という。）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

②　投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

③　請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

④　「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年2月26日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会　御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　山田信之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　中島紀子

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2020年1月1日から2020年12月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2020年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2021年８月４日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　和田　渉
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2020年12月22日から2021年６月21日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーの2021年６月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以　上

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