

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年9月17日

【計算期間】 第32特定期間（自 2020年12月22日 至 2021年6月21日）

【ファンド名】 ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー
（愛称：BR Win）

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 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

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03-6703-7940

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

< 各分類および区分の定義 >

・ 商品分類

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

・ 属性区分

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

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

ファンドの特色

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

主要投資対象ファンドの投資対象

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

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

主要投資対象ファンドの投資アプローチ

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

■柔軟性の高い運用

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

■リスクコントロール

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

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

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

c．当ファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。

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

d．原則として、毎月分配を行いません。

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

【イメージ図】



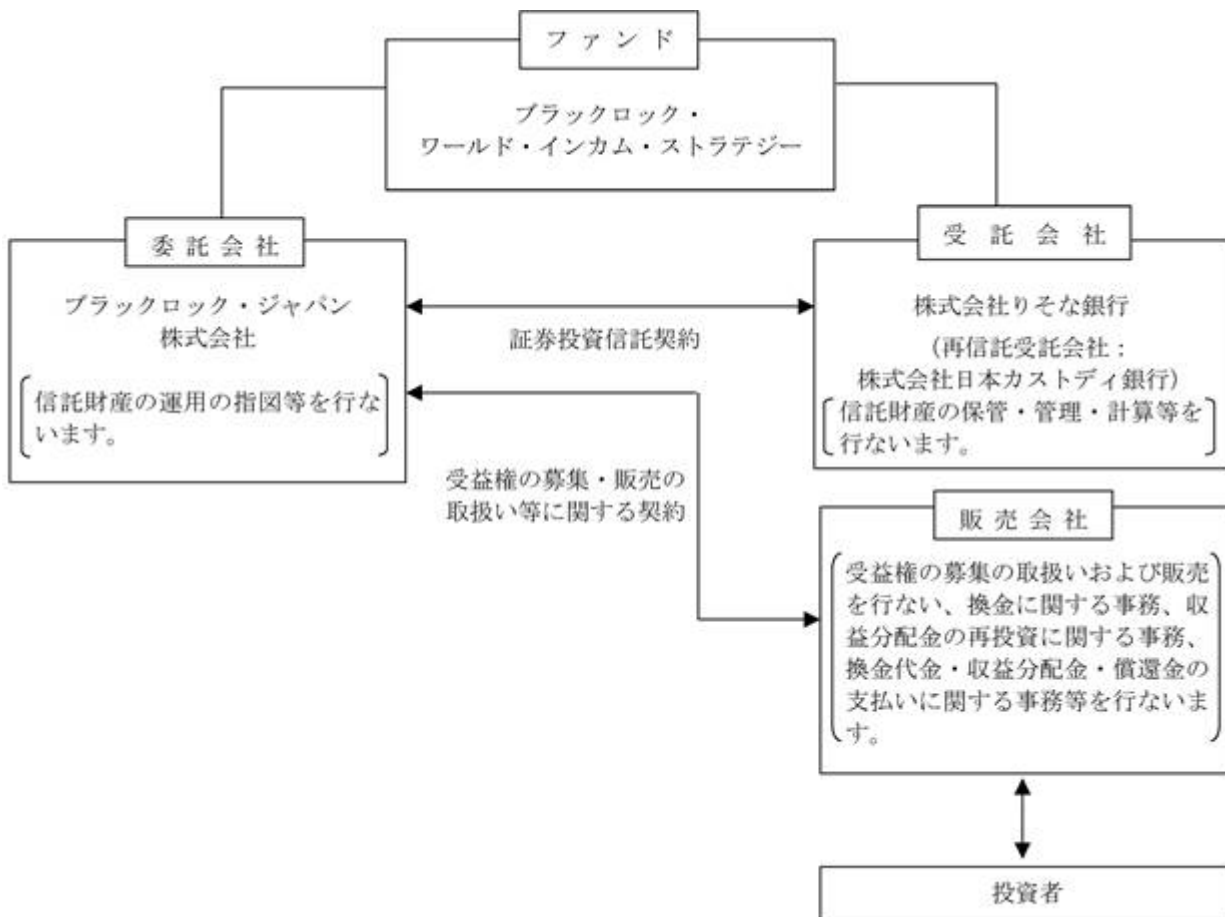
※上図はイメージであり、将来の分配金のお支払いおよび金額について示唆、保証するものではありません。

e．外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

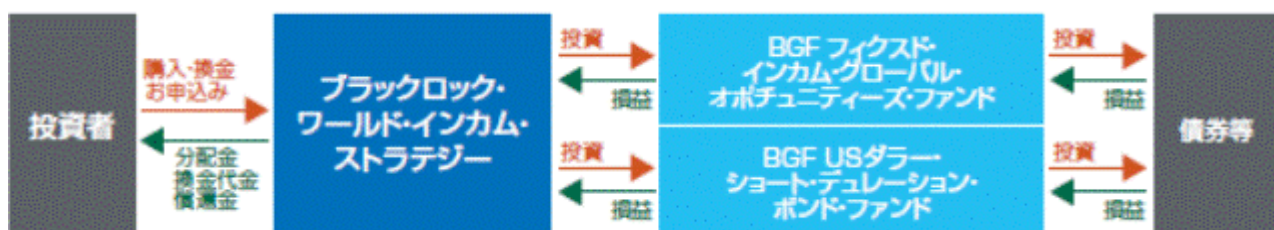
ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< ファンド・オブ・ファンズの仕組み >

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



< 委託会社の概況 >

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

投資対象ファンドの概要

投資方針における「別に定める投資信託証券」の概要は以下の通りです。

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

| | |
|-------------|--|
| 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 | <p>ファンドはトータル・リターンを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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 設定日 | 2007年1月31日 |
| 存続期間 | 無期限 |
| 主な投資制限 | <ul style="list-style-type: none"> ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。 |
| 管理報酬 | ありません。（注） |
| その他費用 | 保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。 |
| 決算日 | 年1回（原則として8月末日）に決算を行ないます。 |
| 収益分配方針 | 毎月（原則として毎月末営業日）に分配を行ないます。 |
| 申込手数料 | ありません。 |
| 管理会社 | ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー |
| 投資顧問会社 | ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック（シンガポール）リミテッド（副投資顧問会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド） |
| 保管会社 | ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー / エヌ・ブイ |

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

(b) BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

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

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

(3) 【運用体制】

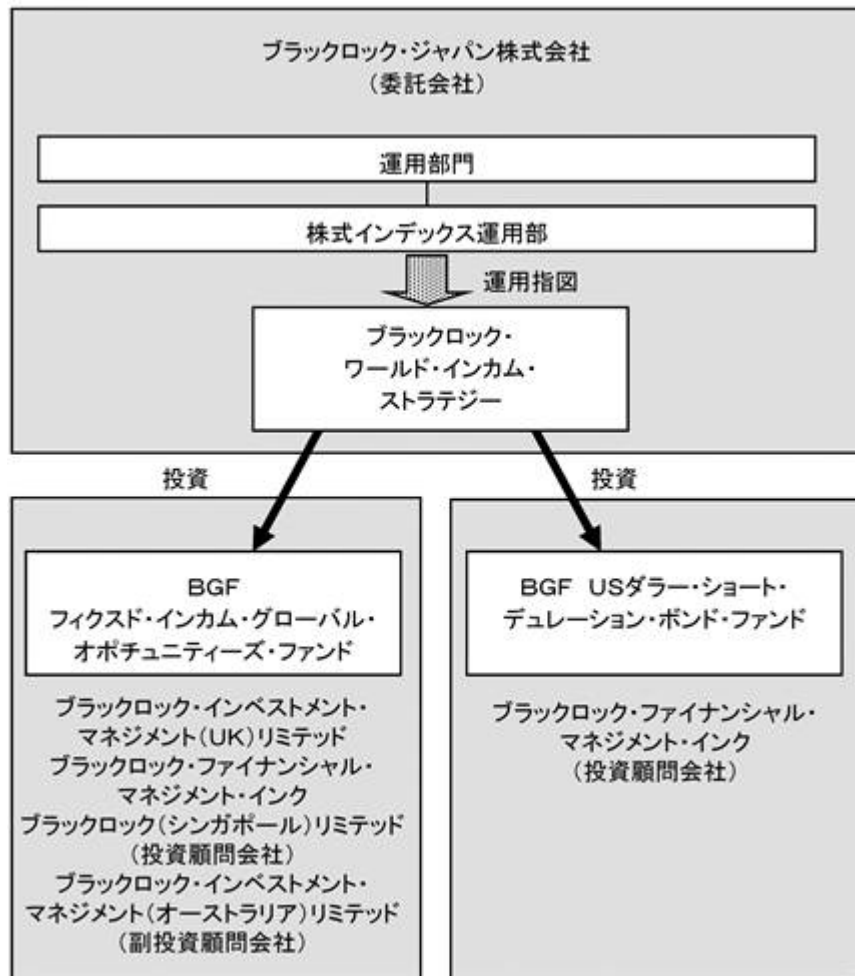
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

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

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

<参考：主要投資対象ファンドの運用体制>

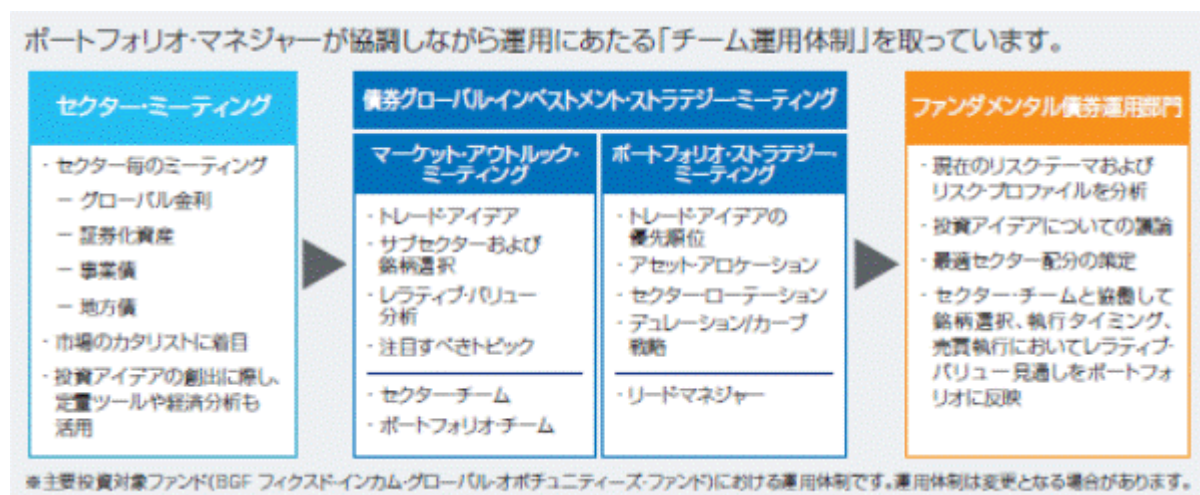
ブラックロック・グループのファンダメンタル債券運用部門によって運用されます。

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

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

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

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



ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約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】

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わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c. 留保益の運用方針

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

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

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

b. 時効

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

収益分配金に関する留意事項

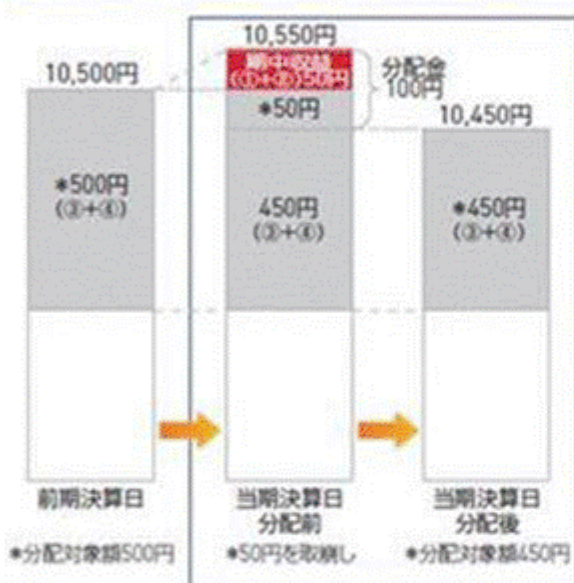
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



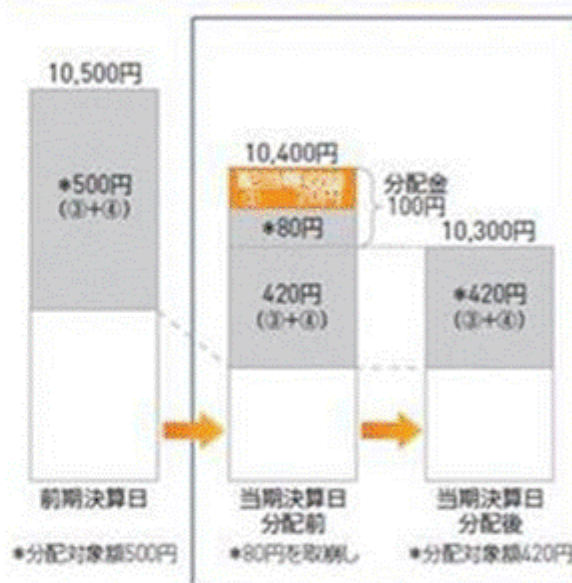
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合

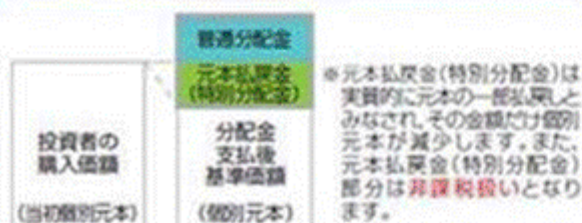


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

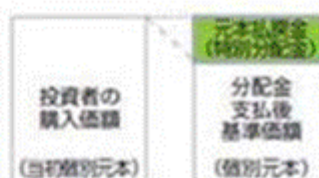
※ 上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

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

(5) 【投資制限】

当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資制限

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

基準価額の変動要因

a．金利変動リスク

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

b．信用リスク

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

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

c．期限前償還リスク

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

d．為替変動リスク

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

e．カントリー・リスク

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

f. デリバティブ取引のリスク

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

ファンド運営上のリスク

a. 購入および換金の受付の中止・取消

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

b. ファンドの繰上償還

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

c. 法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

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

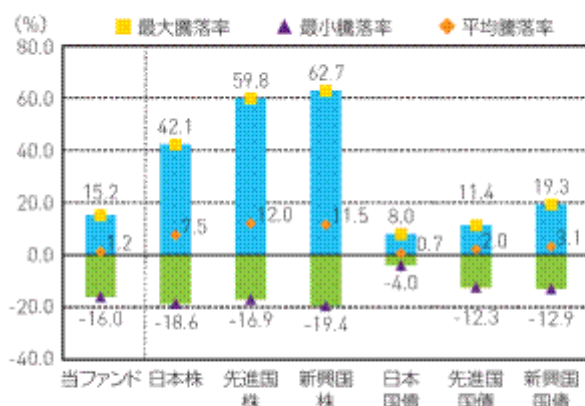
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）が運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内の関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

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。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(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。

<各指数について>

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30%（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。

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.584%（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、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

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

投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

委託会社は、年0.11%（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。

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

- a．追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合については各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれます。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「収益分配金の課税について」を参照。）

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

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

b．法人の投資者に対する課税

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

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】

【投資有価証券の主要銘柄】

| 順位 | 銘柄 | 国/ 地域 | 種類 | 投資口数 | 簿価単価 (円) | 簿価金額 (円) | 評価単価 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|--|----------|------|-----------|-------------|---------------|-------------|---------------|-----------------|
| 1 | ブラックロック・グローバル・ファンズ フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドクラスJ投資証券 | ルクセンブルグ | 投資証券 | 1,261,533 | 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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

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 | |

【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 |

【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 |

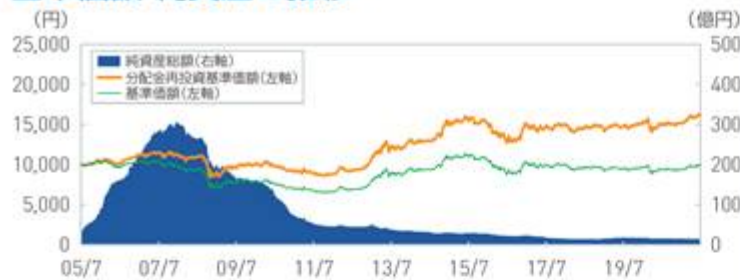
| 特定期間 | 計算期間 | 設定数量(口) | 解約数量(口) | 発行済数量(口) |
|---------|-------|-------------|-------------|---------------|
| 第23特定期間 | 第130期 | 34,403,560 | 1,255,876 | 2,490,788,777 |
| | 第131期 | 2,139,407 | 10,897,657 | 2,482,030,527 |
| | 第132期 | 2,298,361 | 22,218,045 | 2,462,110,843 |
| | 第133期 | 2,269,566 | 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)

2021年6月末現在

運用実績

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

| 設定来累計 | | 4,540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 (GOVERNMENT) 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 (GOVERNMENT) 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。

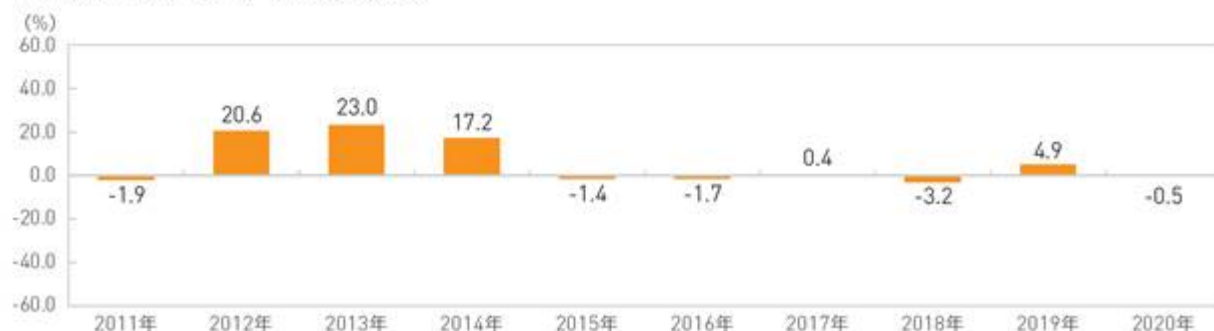
通貨構成比率*(%)

| 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 フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」の運用状況です。
 比率はBGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの純資産総額に対する割合。

年間収益率の推移

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



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

投資者は販売会社に、購入と同時にまたはあらかじめ当該投資者が受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該購入の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。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け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

- a . 購入受付日の翌営業日の基準価額に3.30% (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場合があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱とします。

(2) 換金不可日

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

(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お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けけたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

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

信託約款の変更

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

運用報告書の作成

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

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について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います。

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

委託会社が投資者に対してする公告は日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

投資者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払い請求を行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、

(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られ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られ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 | <p>第178期計算期間(2020年6月23日～2020年7月20日)</p> <p>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。</p> <p>第179期計算期間(2020年7月21日～2020年8月20日)</p> <p>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。</p> <p>第180期計算期間(2020年8月21日～2020年9月23日)</p> <p>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。</p> <p>第181期計算期間(2020年9月24日～2020年10月20日)</p> <p>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。</p> <p>第182期計算期間(2020年10月21日～2020年11月20日)</p> <p>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。</p> <p>第183期計算期間(2020年11月21日～2020年12月21日)</p> <p>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。</p> |

| 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 | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

| 項目 | 前特定期間末 (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。

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

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

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

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

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 フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券 | 1,298,538.930 | 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 フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ投資証券」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 | フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド | USドル・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド |
|--------------------|------------|---|------------------------------------|
| | | 米ドル | 米ドル |
| 資産 | | | |
| 投資有価証券 - 取得原価 | | 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/スワップシヨンの時価 | 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/スワップシヨンの時価 | 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

| フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド | | | | |
|------------------------------------|-------------|------------------|------------------|------------------|
| | 通貨 | 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A I 無分配投資証券 | 米ドル | 12.09 | 11.60 | - |
| クラスA I 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)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

| | 通貨 | 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 |
| クラス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)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(続き)

| | 通貨 | 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）

| | 通貨 | U S ダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド | | |
|-----------------------------|-----------|-------------------------------|------------------|--------------------|
| | | 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A I 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 | フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド | USダラー・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド |
|---------------------------|----------|---|-------------------------------------|
| | | 米ドル | 米ドル |
| 期首純資産 | | 9,742,532,405 | 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 / スワップオプション契約 | 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 / スワップオプション契約 | 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 | フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニ ティーズ・ファンド | USダラー・ショート・ デュレーション・ボン ド・ファンド |
|-----------------|----|---|-------------------------------------|
| | | 米ドル | 米ドル |
| 資本の変動 | | | |
| 投資証券発行による正味受取額 | | 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

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド

| | 期首発行済 投資証券口数 | 当期発行 投資証券口数 | 当期買戻し 投資証券口数 | 期末発行済 投資証券口数 |
|------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| クラスA 毎年分配型投資証券 | 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A I 無分配投資証券 | 445 | 10,888 | 2,769 | 8,564 |
| クラスA I 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)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド(続き)

| | 期首発行済 投資証券口数 | 当期発行 投資証券口数 | 当期買戻し 投資証券口数 | 期末発行済 投資証券口数 |
|----------------------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| クラスD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)

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・
ファンド(続き)

| | 期首発行済 投資証券口数 | 当期発行 投資証券口数 | 当期買戻し 投資証券口数 | 期末発行済 投資証券口数 |
|----------------------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| クラス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)

| | U S 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A I 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。

フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 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 |
| | 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 |
| | 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 |
| | 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 |
| | 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 |
| | 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 Mediterraneo 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 |
| パハマ | | | |
| 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 RKP Overseas 2019 A Ltd 6% 4/9/2025 | 635,556 | 0.01 |
| USD | 300,000 RKP 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 GoI 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 Ferroviaal 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 |
| | | <hr/> | <hr/> |
| | | 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 |
| | | <hr/> | <hr/> |
| | | 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 |
| | | <hr/> | <hr/> |
| | | 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 Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Ulisses Finance No. 1 FRN 20/3/2033 | 595,435 | 0.01 |
| EUR | 900,000 SAGRES Sociedade 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 |
| | | <hr/> | <hr/> |
| | | 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 | Ladbroke Group Finance Plc 5.125% 16/9/2022 | 429,759 | 0.00 |
| GBP 350,000 | Ladbroke 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 Stanlinton 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- 0A11 'Series 2006-0A11 A4' FRN 25/9/2046 | 552,076 | 0.01 |
| USD 4,087,233 | Alternative Loan Trust 2006- 0A14 'Series 2006-0A14 1A1' FRN 25/11/2046 | 3,388,750 | 0.04 |
| USD 3,219,906 | Alternative Loan Trust 2006- 0A16 'Series 2006-0A16 A4C' FRN 25/10/2046 | 2,300,955 | 0.02 |
| USD 537,692 | Alternative Loan Trust 2006- 0A8 'Series 2006-0A8 1A1' FRN 25/7/2046 | 469,649 | 0.01 |
| USD 1,410,699 | Alternative Loan Trust 2006- 0C10 'Series 2006-0C10 2A3' FRN 25/11/2036 | 1,120,242 | 0.01 |
| USD 5,524,726 | Alternative Loan Trust 2006- 0C7 'Series 2006-0C7 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- 0A3 'Series 2007-0A3 2A2' FRN 25/4/2047 | 845 | 0.00 |
| USD 296,786 | Alternative Loan Trust 2007- 0A8 'Series 2007-0A8 2A1' FRN 25/6/2047 | 225,633 | 0.00 |
| USD 367,538 | Alternative Loan Trust 2007- 0H2 'Series 2007-0H2 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 | Bamll 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 / GCSI Selico 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 1 5/10/2026 | 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-OA4 'Series 2006-OA4 A1' FRN 25/4/2046 | 1,074,754 | 0.01 |
| USD 566,862 | CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 'Series 2006-OA5 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-WFHE2 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 0A 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 | Goldentree Loan Management US CLO 1 Ltd 'Series 2017-1A CR' '144A' FRN 20/4/2029 | 2,239,806 | 0.02 |
| USD 3,000,000 | Goldentree 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 | ToII Brothers Finance Corp 3.8% 1/11/2029 | 3,473,572 | 0.04 |
| USD 3,924,000 | ToII Brothers Finance Corp 4.375% 15/4/2023 | 4,154,123 | 0.04 |
| USD 1,239,000 | ToII Brothers Finance Corp 4.875% 15/11/2025 | 1,373,611 | 0.01 |
| USD 2,783,000 | ToII 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 22/11/2031 | 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 (%) |
|--|---|---------------|--------------|
| T B A | | | |
| | 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 |
| T B A 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「T B A」という。)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 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.X0.33.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/TheIに係るデフォルト・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/TheIに係るデフォルト・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Lowe's 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/TheIに係るデフォルト・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 CorpIに係るデフォルト・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 MXIBTIE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 MXIBTIE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 MXIBTIE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 MXIBTIE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 MXIBTIE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 MXIBTIE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 MXIBT1IE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 BRO1S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 MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う | UBS | 18/11/2026 | (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 + Obps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 + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月EUR EURIBOR + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 + Obps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 + Obpsを受け取り、3ヶ月USD BBA LIBOR + Obps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 |
| | | | <u>19,761</u> |
| カナダ | | | |
| 44,319 | Bausch Health Cos Inc | Merrill Lynch | (50,967) |
| | | | <u>(50,967)</u> |
| ドイツ | | | |
| 99,951 | Tele Columbus AG | Merrill Lynch | (35,763) |
| | | | <u>(35,763)</u> |
| イタリア | | | |
| 2,397,642 | Telecom Italia SpA/Milano | Merrill Lynch | 106,949 |
| 29,149 | UniCredit SpA | Merrill Lynch | 6,918 |
| | | | <u>113,867</u> |
| ルクセンブルグ | | | |
| 12,754 | Ardagh Group SA | Merrill Lynch | 1,275 |
| 65,483 | Aroundtown SA | Merrill Lynch | (37,800) |
| | | | <u>(36,525)</u> |
| オランダ | | | |
| 226,901 | ALTICE EUROPE NV | Merrill Lynch | (83,621) |
| | | | <u>(83,621)</u> |
| 英国 | | | |
| 345,810 | Arrow Global Group Plc | Merrill Lynch | 160,307 |
| 609,424 | ITV Plc | Merrill Lynch | (7,793) |
| | | | <u>152,514</u> |
| 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) | | | <u>79,266</u> |

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

買建スワップション 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.X0.33.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 | 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 | 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 | Credit Suisse | 21/10/2020 | (127,148) | 33,502 |
| USD 4,300,000 | ITRAXX.X0.33.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。 | 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 | 26/10/2020 | 1,280,997 | 2,553,253 |
| 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 | 23/11/2020 | (211,469) | 112,387 |
| 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 | 158,035 | 481,891 |
| 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.X0.33.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.X0.33.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.X0.33.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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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、ブット・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ドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 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 | GoI 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 | LFRR '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 |
| | | <u>1,164,478,729</u> | <u>70.97</u> |
| 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 | | <u>1,438,967,978</u> | <u>87.70</u> |
| 公認の証券取引所に上場されているまたはそ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 | | <u>1,574,604,264</u> | <u>95.96</u> |
| 投資有価証券合計 | | <u>1,574,604,264</u> | <u>95.96</u> |
| その他の純資産 | | 66,262,821 | 4.04 |
| 純資産合計(米ドル) | | <u>1,640,867,085</u> | <u>100.00</u> |

~ 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 B0BL | 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USD 3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USD 3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、USD 3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USD 3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USD 3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」

| | |
|------------------|----------------|
| 資産総額 | 1,512,456,343円 |
| 負債総額 | 660,725円 |
| 純資産総額(-) | 1,511,795,618円 |
| 発行済数量 | 1,525,194,695口 |
| 1 単位当たり純資産額(/) | 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
投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
前項の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

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

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分の承認、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いません。

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する証券投資信託は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 | | |
| ソフトウェア | 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 |

| | 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 | |
| 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 |

| | 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 繰越利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | | | | |
| 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 繰越利益 剰余金 | 利益剰余金 合計 | | | | |
| 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ェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

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

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

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

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度(DC)による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

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

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

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

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(9年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生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・ネットリ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の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、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、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(確定拠出年金制度及び確定給付年金制度)を承継しました。また、2011年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

| | 前事業年度 (自 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

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。

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、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、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（確定拠出年金制度及び 確定給付年金制度）を承継しました。また、2011年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の 確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、 から の三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：百万円）

| | 当事業年度 (自 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

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。

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 | | 時価 | 評価損益 |
|---------------|--------------|------|-------|----|------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の 取引 | 為替予約取引 売建 | 79 | - | 0 | 0 |
| | 米ドル | | | | |
| | 買建 | 0 | - | 0 | 0 |
| 英ポンド | | | | | |
| 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 | | 時価 | 評価損益 |
|---------------|--------------|------|-------|----|------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の 取引 | 為替予約取引 買建 | 99 | - | 0 | 0 |
| | 米ドル | | | | |
| 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

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。

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

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。

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 : 株式会社りそな銀行
- ・資本金の額 : 279,928百万円(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 | |
| SMB C日興証券株式会社 | 10,000 | |
| 松井証券株式会社 | 11,945 | |
| マネックス証券株式会社 | 12,200 | |
| 三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 | 40,500 | |
| 楽天証券株式会社 | 7,495 | 銀行法に基づき、銀行業を営んでおります。 |
| 株式会社伊予銀行* | 20,948 | |

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

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下の通り提出されております。

| | |
|------------|-----------------|
| 2021年1月22日 | 臨時報告書 |
| 2021年3月19日 | 有価証券報告書、有価証券届出書 |
| 2021年4月23日 | 臨時報告書 |

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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

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

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、継続企業的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。