

- 【表紙】
- 【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
- 【提出先】 関東財務局長
- 【提出日】 令和4年4月28日
- 【発行者名】 ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc
(BlackRock Fixed Income Dublin Funds public limited company)
- 【代表者の役職氏名】 取締役 ディアドリ・サマーズ
(Deirdre Somers, Director)
- 【本店の所在の場所】 アイルランド、D02 RK57、ダブリン2、サー・ジョン・ロジャーソンズ・キー79番、キャピタル・ドック200
(200 Capital Dock, 79 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2 D02 RK57, Ireland)
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
- 【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【電話番号】 03(6212)8316
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc
- iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド
クラスD米ドルヘッジ投資証券
(BlackRock Fixed Income Dublin Funds public limited company
- iShares Green Bond Index Fund (IE)
D USD Hedged Accumulating Share Class)
- 【届出の対象とした募集(売出)外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券
ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc
- iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド
クラスD米ドルヘッジ投資証券
上限見込額は以下のとおりである。
クラスD米ドルヘッジ投資証券：11億6,400万米ドル(約1,289億円)
- (注1) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2021年3月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=110.71円および1ユーロ=129.80円)による。
- (注2) 上限見込額は、便宜上、2021年2月26日現在の1口当たり純資産価格(11.64米ドル)に1億口を乗じて算出された金額である。
- 【縦覧に供する場所】 該当事項なし。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2021年6月30日付をもって提出した有価証券届出書（2021年7月30日付、2021年10月29日付および2022年1月31日付有価証券届出書の訂正届出書により訂正済）（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いることがあり、原届出書の換算レートとは異なる場合があります。

2【訂正箇所および訂正事項】

半期報告書に係る訂正

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

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加 または 更新
5 運用状況	(1) 投資状況		(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「要約貸借対照表」 「要約損益計算書」 「重要な会計方針」の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		1 外国投資法人の概況	(4) 役員の状況	更新
5 その他			(5) その他	追加
第4 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況	(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	3 資産運用会社の概況	(1) 名称及び資本金の額	更新
	(3) 大株主の状況		(2) 大株主の状況	更新
	(4) 役員の状況		(3) 役員の状況	更新
	(5) 事業の内容及び営業の概況		(4) 事業の内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況 1 財務諸表		4 外国投資法人の経理状況		追加
第6 販売及び買戻しの実績		5 販売及び買戻しの実績		追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc (以下、ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plcを「本投資法人」、iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンドを「ファンド」という。ただし、文脈により、iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンドを含む本投資法人のサブ・ファンドを「ファンド」または「サブ・ファンド」ということがある。)の概況は以下のとおりである。

(1) 主要な経営指標等の推移

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

	2020年1月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年7月末日に 終了する 会計年度末	2021年1月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年7月末日に 終了する 会計年度末	2022年1月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	6,251千ユーロ	14,754千ユーロ	9,725千ユーロ	21,634千ユーロ	19,076千ユーロ
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	35,650千ユーロ	25,333千ユーロ	-7,029千ユーロ	6,142千ユーロ	-54,329千ユーロ
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	35,650千ユーロ	25,333千ユーロ	-7,029千ユーロ	6,142千ユーロ	-54,329千ユーロ
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,438,150千ユーロ	1,769,781千ユーロ	2,872,847千ユーロ	2,817,909千ユーロ	3,290,151千ユーロ
(e) 発行済投資口の総口数 (クラスD米ドル ヘッジ投資証券)	36,131,329口	42,990,713口	79,105,863口	67,614,508口	82,057,856口
(f) 純資産額	1,438,150千ユーロ	1,769,781千ユーロ	2,872,847千ユーロ	2,817,909千ユーロ	3,290,151千ユーロ
(g) 資産総額	1,455,145千ユーロ	1,799,722千ユーロ	2,911,421千ユーロ	2,842,612千ユーロ	3,332,966千ユーロ
(h) 1口当たり純資産額 (クラスD米ドル ヘッジ投資証券)	11.44米ドル	11.72米ドル	11.85米ドル	11.85米ドル	11.42米ドル
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスD米ドル ヘッジ投資証券)	0.99米ドル	0.59米ドル	-0.09米ドル	0.09米ドル	1.38米ドル
(j) 分配総額	0	984千ユーロ	0	1,340千ユーロ	0
(k) 1口当たり分配金額 (クラスD米ドル ヘッジ投資証券)	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.83%	98.34%	98.68%	99.13%	98.72%
(m) 自己資本利益率	2.48%	1.43%	-0.24%	0.22%	-1.65%

(1) 営業収益には投資収益ならびに実現および未実現利益(損失)を含めている。以下同じ。

(2) ファンドは変動資本を有する投資法人であり、純資産額を記載している。以下同じ。

(3) 「主要な経営指標等の推移(e)発行済投資口の総口数、(h)1口当たり純資産額、(i)1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額および(k)1口当たり分配金額」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

(2) 外国投資法人の出資総額

2022年1月末日現在の出資総額および発行済投資口の総口数は以下のとおりである。なお、発行可能投資口総口数には制限がない。

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

	出資総額		発行済投資口の総口数 (口)	
	ユーロ	百万円		
2022年1月末日現在	3,289,040,309.40	425,404	クラスD米ドルヘッジ 投資証券	82,009,261

(注1) 上記の出資総額および発行済口数は、取引を取引日翌日に反映するという原則に基づく数値が記載されており、取引日現在の処理に基づき作成される財務書類と比較した場合、数値が異なる。

(注2) 米ドルおよびユーロの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=115.55円および1ユーロ=129.34円)による。以下同じ。

(3) 主要な投資主の状況

(iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

本投資法人の主要な株主に関する情報は、本投資法人に適用あるEUの一般データ保護規則に基づき開示することができない。

(4) 役員状況

(2022年1月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有 投資証券
ポール・マクノートン (Paul McNaughton)	取締役会議 長、独立非業 務執行取締役	ポール・マクノートンは、現在、複数のオル タナティブ/ヘッジ・ファンド・エンティ ティを含む、アイルランドにおける複数の投 資会社およびその他の金融エンティティのア ドバイザーおよび非業務執行取締役を務めて いる。	0
ジェシカ・イルシック (Jessica Irschick)	非業務執行取 締役	ジェシカ・イルシックはブラックロックの業 務執行取締役であり、ETFおよびインデック ス投資(EII)におけるグローバル責任者で ある。	0
ポール・マッゴワン (Paul McGowan)	監査委員会委 員長、独立非 業務執行取締 役、上席独立 取締役	ポール・マッゴワンは、25年以上の間、 KPMG(アイルランド)の金融サービス税務の パートナーであり、またKPMG(インターナ ショナル)の金融サービス税務のグローバル 責任者であった。	0
バリー・オドワイヤー (Barry O'Dwyer)	非業務執行取 締役	バリー・オドワイヤーは、欧州、中東および アフリカ(EMEA)のブラックロックのファン ド・ガバナンスの責任者であり、アイルラン ド、ルクセンブルグ、スイスおよびドイツに おける多数のブラックロックの企業、ファン ド、管理会社ならびにブラックロックの英国 ライフ・カンパニーの取締役を務めている。	0
ロス・オシェイ (Ros O'Shea)	独立非業務執 行取締役、監 査委員会委員	ロス・オシェイは、バンク・オブ・モントリ オール(アイルランド)plcおよびピエタ・ ハウス等の取締役を務めている独立非業務執 行取締役である。	0
ディアドリ・サマーズ (Deirdre Somers)	独立非業務執 行取締役、監 査委員会委員	ディアドリ・サマーズは、アイルランド証券 取引所の最高経営責任者兼業務執行役員を 2007年から当該取引所がユーロネクストNVに 売却される2018年初頭まで、また、ユーロネ クスト・ダブリンの最高経営責任者ならびに デット、ファンドおよびETFの最高経営責任 者を2018年9月まで務めていた。	0

(注) 本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はアイルランド、ダブリン2、アールスフォート・テラス29、デ
ロイト・アンド・トウシュハウスに所在するデロイト・アイルランド・エルエルピーである。

(5) その他

a. 定款の変更

定款の変更には、中央銀行の事前承認に加え、特別決議が必要である。

b. 事業譲渡または事業譲受

いずれかのファンドの投資主は、特別決議により、また中央銀行の要件に従い、他の集団投資スキームとファンドの合併/併合を許可することができ、当該合併/併合は、関連するファンドの参加投資証券の償還およびファンドの資産の全部または一部の関連する集団投資スキームの保管会社/受託会社(中央銀行により規制されているか否かを問わない。)への譲渡を含む場合がある。

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

(2022年1月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(ユーロ)	投資比率 (%)
債券	フランス	582,097,047.60	17.43
	国際機関	465,116,700.65	13.93
	イタリア	319,873,803.15	9.58
	ベルギー	319,700,171.04	9.57
	オランダ	274,162,312.00	8.21
	英国	152,986,457.34	4.58
	アイルランド	152,265,635.19	4.56
	ドイツ	138,429,082.77	4.15
	スペイン	110,376,213.10	3.31
	カナダ	75,719,693.20	2.27
	中国	73,196,983.13	2.19
	香港	68,089,255.18	2.04
	米国	53,373,564.93	1.60
	チリ	46,639,313.63	1.40
	ポーランド	44,295,076.21	1.33
	スウェーデン	42,410,997.36	1.27
	ハンガリー	41,892,856.73	1.25
	ノルウェー	37,811,298.30	1.13
	オーストラリア	34,663,595.30	1.04
	インドネシア	34,454,314.57	1.03
	カタール	32,761,831.50	0.98
	ルクセンブルグ	26,528,674.54	0.79
	アラブ首長国連邦	20,820,562.92	0.62
	デンマーク	16,505,600.50	0.49
	韓国	11,311,372.04	0.34
	日本	9,357,244.87	0.28
	ブラジル	9,229,390.89	0.28
	フィンランド	8,219,703.39	0.25
	ポルトガル	7,217,797.75	0.22
	英領ヴァージン諸島	6,897,763.00	0.21
	インド	3,667,188.22	0.11
オーストリア	3,557,764.00	0.11	
サウジアラビア	3,406,544.15	0.10	
スイス	3,356,897.19	0.10	

	ケイマン諸島	3,253,698.00	0.10
	チャンネル諸島	3,178,990.00	0.10
	バミューダ	3,100,320.00	0.09
	リトアニア	2,003,944.25	0.06
	チェコ共和国	1,934,840.00	0.06
	ニュージーランド	1,867,029.44	0.06
	スロバキア	1,438,995.00	0.04
	シンガポール	1,350,602.14	0.04
	フィリピン	910,918.82	0.03
	アイスランド	593,046.00	0.02
投資信託	アイルランド	17,064,599.87	0.51
ポートフォリオ合計		3,267,089,689.86	97.84
現金・その他資産(負債控除後)		72,280,877.77	2.16
資産総額		3,339,370,567.63	100.00
負債総額		50,330,258.23	1.51
合計 (純資産総額)		3,289,040,309.40 (約425,404百万円)	98.49

(注1) 投資比率とは、ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

(注2) 上記の資産総額、負債総額および純資産総額は取引を取引日翌日に反映するという原則に基づく数値が記載されており、取引日現在の処理に基づき作成される財務書類と比較した場合、数値が異なる。

(2) 運用実績

純資産等の推移

2022年1月末日までの1年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスD米ドルヘッジ 投資証券)	
	千ユーロ	百万円	千ユーロ	百万円	米ドル	円
2021年2月末日	3,167,988	409,748	3,107,872	401,972	11.64	1,345
3月末日	2,902,462	375,404	2,835,408	366,732	11.61	1,342
4月末日	3,067,893	396,801	2,989,432	386,653	11.58	1,338
5月末日	3,120,542	403,611	3,052,300	394,784	11.59	1,339
6月末日	3,509,433	453,910	2,880,563	372,572	11.65	1,346
7月末日	2,842,612	367,663	2,817,909	364,468	11.85	1,369
8月末日	2,874,745	371,820	2,844,604	367,921	11.81	1,365
9月末日	2,889,445	373,721	2,859,810	369,888	11.66	1,347
10月末日	2,989,553	386,669	2,950,953	381,676	11.60	1,340
11月末日	3,323,508	429,863	3,234,109	418,300	11.74	1,357
12月末日	3,347,943	433,023	3,280,443	424,293	11.62	1,343
2022年1月末日	3,339,371	431,914	3,289,040	425,404	11.42	1,320

(注) 2022年1月末日の資産総額および純資産総額は取引を取引日翌日に反映するという原則に基づく数値が記載されており、取引日現在の処理に基づき作成される財務書類と比較した場合、数値が異なる。

iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンドのクラスD米ドルヘッジ投資証券は、ユーロネクスト・ダブリンに上場されている。

分配の推移

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

クラスD米ドルヘッジ投資証券 該当事項なし

自己資本利益率(収益率)の推移

2022年1月末日までの1年間における自己資本利益率(収益率)は以下のとおりである。

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

自己資本利益率(収益率)(%)	
クラスD米ドルヘッジ投資証券	- 3.63

(注) 自己資本利益率(収益率)(%) = (a - b) / b × 100

a = 2022年1月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2021年1月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において2022年1月31日提出の有価証券報告書「第一部ファンド情報 第1ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド (BlackRock Asset Management Ireland Limited) (「管理会社」)

資本金 (株主資本) の額

管理会社の2020年12月31日現在の払込済株式資本金は、125,000英ポンド (約1,932万円) である。

(注) 英ポンドの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1英ポンド = 154.58円) による。以下同じ。

ブラックロック・アドバイザーズ (UK) リミテッド (BlackRock Advisors (UK) Limited) (「投資運用会社」)

資本金 (株主資本) の額

投資運用会社の2020年12月31日現在の払込済株式資本金は、900,000英ポンド (約1億3,912万円) である。

(2) 大株主の状況

管理会社および投資運用会社の主要な株主に関する情報は、管理会社および投資運用会社に適用あるEUの一般データ保護規則に基づき開示することができない。

(3) 役員 の状況

管理会社

(2022年1月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ウィリアム・ロバーツ (William Roberts)	取締役	ウィリアム・ロバーツは、スコットランド、香港、バミューダおよびケイマン諸島の弁護士である。	0
パトリック・ボイルン (Patrick Boylan)	取締役	パトリック・ボイルンは、RQA内のインフラストラクチャー・デット、再生可能エネルギーおよびインフラストラクチャー・ソリューションに係る投資リスクのグローバル責任者であり、インフラストラクチャーに焦点を当て、ブラックロック・オルタナティブ・インベスターズ部門の受託者リスク管理を行っている。	0
ポール・フリーマン (Paul Freeman)	取締役	ポール・フリーマンは、現在、多数のブラックロック・グループの会社および投資ファンドの取締役を務めている。	0

エンダ・マクマホン (Enda McMahon)	取締役	エンダ・マクマホンは、ブラックロックの業務執行取締役である。ブラックロックのカバナンズおよび監督に係る欧州、中東およびアフリカ(EMEA)の責任者である。アイルランド部門の責任者でもあり、ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッドの最高経営責任者および取締役である。	0
ジャスティン・ミーリ (Justin Mealy)	取締役	ジャスティン・ミーリは、欧州、中東およびアフリカ(EMEA)の投資監督責任者である。マネージャーの投資ディレクターを務め、投資運用の指定人である。	0
バリー・オドワイヤー (Barry O' Dwyer)	取締役	バリー・オドワイヤーは、欧州、中東およびアフリカ(EMEA)のブラックロックのファンド・ガバナンスの責任者であり、アイルランド、ルクセンブルグ、スイスおよびドイツにおける多数のブラックロックの企業、ファンド、管理会社ならびにブラックロックの英国ライフ・カンパニーの取締役を務めている。	0
アデル・スピレイン (Adele Spillane)	取締役	アデル・スピレインは、ブラックロックの機関投資家顧客向けビジネス部門のメンバーであり、また、ブラックロックのアイルランドにおける機関投資家向けビジネス部門の責任者である。	0
キャサリン・ウッズ (Catherine Woods)	取締役	キャサリン・ウッズは、JPモルガン・ヨーロッパ・バンクの株式リサーチ・チームの元ヴァイス・プレジデントであり、元責任者である。	0
エイマー・マーティン (Eimear Martin)	取締役	エイマー・マーティンは、サービス・センター戦略および決済の責任者である。	0
マイケル・ホドソン (Michael Hodson)	取締役	ホドソン氏は独立した独立非業務執行取締役である。以前は、2011年から2020年にかけてアイルランド中央銀行に勤務し、数多くの上級職を務めた後、資産運用・投資銀行部門の取締役を務めた。	0

(4) 事業の内容及び営業の概況

管理会社

管理会社は、2022年1月末日現在、多数のファンドを管理・運用しており、主要なものは以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (米ドル)
1	インスティテューショナル・ キャッシュ・シリーズ plc	UCITS	1998年12月29日	207,146,827,554.05
2	ブラックロック・インデックス・ セレクション・ファンド	UCITS	1996年2月27日	48,245,138,340.07
3	ブラックロック・ライアビリティ・ ソリューションズ・ファンズ (ダブリン)	Non-UCITS	2011年8月24日	29,486,657,555.58
4	ブラックロック・フィクスト・ インカム・ダブリン・ファンズ plc	UCITS	2005年4月25日	27,147,573,631.44
5	ブラックロック・ライアビリティ・ ソリューションズ・ファンズ (ダブリン)	Non-UCITS	2008年6月5日	16,299,771,655.06
6	ブラックロック・ライアビリティ・ マッチング・ファンズ(ダブリン)	Non-UCITS	2005年7月21日	8,262,477,766.22
7	ブラックロック・ インスティテューショナル・ ジャージー・ファンズ	Non-UCITS	2005年5月31日	4,751,427,415.02
8	ブラックロック・ インスティテューショナル・ ブルド・ファンズ plc	UCITS	2002年10月1日	3,802,084,298.85
9	ブラックロック・ファンズ ICAV	UCITS	2018年3月8日	3,799,835,721.95
10	ブラックロック・アクティブ・ セレクション・ファンド	Non-UCITS	2001年3月29日	3,481,819,593.59

上記は、管理会社が運用する投資ファンドの網羅的な一覧ではない。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、英国およびアイルランドにおいて適用される財務報告基準第104号に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc およびすべてのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。本書において日本語の作成にあたっては関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、サブ・ファンドには以下に記載した投資証券クラス以外の投資証券クラスも存在するが、以下に記載した投資証券クラスに関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド
クラスD米ドルヘッジ投資証券
- c . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d . ファンドの原文の中間財務書類は、ユーロで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2022年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ=129.34円）で換算されている。なお、百万円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc

要約貸借対照表

2022年1月31日現在

i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド

	千ユーロ	百万円
流動資産		
現金	17,121	2,214
現金等価物	17,065	2,207
現金担保	388	50
未収金	35,425	4,582
損益を通じて公正価値で測定される 金融資産	3,262,967	422,032
流動資産合計	3,332,966	431,086
流動負債		
未払現金担保	-	-
未払金	26,396	3,414
損益を通じて公正価値で測定される 金融負債	16,419	2,124
流動負債合計	42,815	5,538
買戻可能投資証券保有者に帰属する 純資産	3,290,151	425,548

添付の注記は本財務書類と不可分のものである。

ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc

要約損益計算書

2022年1月31日に終了した会計期間

i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド

	千ユーロ	百万円
運営収益	19,076	2,467
金融商品に係る純利益 / (損失)	(70,070)	(9,063)
投資収益 / (損失) 合計	(50,994)	(6,596)
運営費用	(3,307)	(428)
運営純収益 / (損失)	(54,301)	(7,023)
財務費用：		
利息費用または類似費用	(28)	(4)
買戻可能投資証券保有者に対する分配金	-	-
財務費用合計	(28)	(4)
税引前純利益 / (損失)	(54,329)	(7,027)
税金	-	-
税引後純利益 / (損失)	(54,329)	(7,027)
買戻可能投資証券保有者に帰属する 純資産の増加 / (減少)	(54,329)	(7,027)

要約損益計算書で扱われている以外に当会計期間における認識済損益はない。

添付の注記は本財務書類と不可分のものである。

ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc

買戻可能投資証券保有者に帰属する純資産要約変動計算書

2022年1月31日に終了した会計期間

	i シェアーズ・グリーンボンド・ インデックス・ファンド	
	千ユーロ	百万円
期首純資産	2,817,909	364,468
買戻可能投資証券保有者に帰属する 純資産の増加 / (減少)	(54,329)	(7,027)
投資証券取引：		
買戻可能投資証券の発行	825,770	106,805
買戻可能投資証券の買戻し	(299,199)	(38,698)
投資証券取引による純資産の増加 / (減少)	526,571	68,107
期末純資産	3,290,151	425,548

添付の注記は本財務書類と不可分のものである。

財務書類に対する注記

1. 一般情報

本投資法人は、アイルランドの法律に基づき、公開有限責任会社として設立され、本拠地を有する、オープン・エンド型の投資法人である。本投資法人は、アイルランド中央銀行によって認可されており、アイルランド、D02 RK57、ダブリン 2、サー・ジョン・ロジャーソンズ・キー79番、キャピタル・ドック200（200 Capital Dock, 79 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 RK57, Ireland）に登記上の事務所を置き、UCITS指令の条項に準拠している。

2. 重要な会計方針

2.1 作成の基礎

本投資法人の本財務書類は、英国およびアイルランド共和国に適用される財務報告基準第104号中間財務報告（以下「FRS第104号」という。）に準拠して作成されている。本財務書類の主要な会計方針および評価手法は、前年度の年次財務書類に適用されたものと一致している。

すべての金額は、別途記載のない限り、千単位に四捨五入されている。

3. 金融リスク

各ファンドの投資活動は、投資する金融商品および市場に関連する様々な種類のリスクにさらされている。リスクは、以下に記載するものを除き、前年度の年次財務書類で開示されたものと実質的に一致している。

3.1 価格リスクから生じる市場リスク

価格リスクは、市場価格の変動（金利リスクまたは為替リスクから生じる変動を除く）により金融商品の公正価値または将来キャッシュ・フローが変動するリスクであり、その変動の要因については、個々の金融商品もしくはその発行体固有の要因であるか、または市場で取引されている類似の金融商品にも影響を与える要因であるかを問わない。戦争、テロ行為、感染症またはその他の公衆衛生上の問題の蔓延、不況、その他の事象のような地方、地域または世界的な事象は、各ファンドおよびその投資の市場価格に重大な影響を与える可能性がある。

新型コロナウイルス「COVID-19」による感染性呼吸器疾患は、近年、社会のあらゆる側面に大きな影響を与えた。先進国では、最悪期を脱したというコンセンサスが高まっているが、旅行制限、入港などにおける健康検査の強化、医療サービスの準備や提供の中断および遅延、キャンセル、サプライチェーンの寸断、消費者需要の低下は継続的に課題を生むと予想される。多くの国々で大規模なワクチンプログラムが実施され、効果が出ている一方で、COVID-19の影響は、世界の多くの国々の経済に悪影響を与え続けており、この影響は、予防接種率が低い特定の新興市場などにおいてより大きくなる可能性がある。タイミングを予測することは難しいが、COVID-19による経済的影響は、ウイルス自体の性質がパンデミック（世界的大流行）からエンデミック（風土病）に移行した後もしばらく続くと予想され、結果的に本投資法人が保有する投資に影響を及ぼし続ける可能性がある。

i シェアーズ・中国人民元ボンド・インデックス・ファンドは、その資産の大部分を発行体が中国に所在する証券に投資するかまたは中国の発行体もしくは国々に多大なエクスポージャーを有している。中国証券への投資は、中国特有のリスクが伴う。中国は、経済的、政治的、社会的に著しく不安定になる可能性があり、先進国市場と比べて非常に高いボラティリティーを示すことがある。中国市場は、一般に、政府の影響、公開情報の欠如および/または政治的ならびに社会的な不安定性に起因する非効率性、変動性および価格設定の異常を経験し続けている。国内の社会不安や他の近隣諸国との対立は、中国の経済発展を混乱させ、為替変動リスク、通貨が交換できなくなるリスク、金利変動リスク、インフレ率上昇のリスクを高める可能性がある。中国または地域の安全保障に関連する事件は、中国市場に不

確実性を引き起こし、中国経済およびファンドの投資に悪影響を与える可能性がある。中国の製品およびサービスへの支出の削減、関税およびその他の貿易障壁の制定、または中国の主要な貿易相手国の経済の低迷は、中国経済に悪影響を与える可能性がある。さらに、資本の移動を制限するための措置および/または制裁が課される可能性があり、これによってファンド資産の所有または譲渡が禁止または制限され、ファンド資産の差押さえなどの報復措置が講じられる可能性もある。

4. 公正価値の階層

各ファンドは、公正価値の階層を使用して、公正価値で測定される金融商品进行分类している。公正価値の階層には以下のレベルがある。

レベル1：事業体が測定日に入手可能な同一資産または負債の活発な市場における未調整の公表価格。

レベル2：資産または負債に関して直接的または間接的に観察可能なく(すなわち市場データを用いて開発された)レベル1に含まれる公表価格以外のインプット。当該区分には、類似商品の活発な市場における公表された市場価格、同一または類似商品の活発とはみなされない市場における公表価格、もしくはすべての重要なインプットが市場データから直接または間接的に観察可能なその他の評価手法を用いて評価された商品が該当する。

レベル3：資産または負債のインプットが観察不能(すなわち、市場データが入手不可能)。当該区分には、評価手法に市場データに基づかないインプットが含まれ、これらのインプットによって当該商品の評価が著しく影響を受ける可能性のあるすべての商品が該当する。当該区分には、当該商品と活発な市場が存在しない商品との差異を反映するために重要な事業体が決定した調整または仮定が必要とされる類似商品の公表価格に基づいて評価される商品も該当する。

レベル2および/またはレベル3に分類された金融商品の評価には以下の特定の評価手法が含まれる。

- () 債券および株式については、類似商品の公表市場価格またはディーラー相場
- () 外国株式については、直近の市場の終値と各ファンドの評価時点との差異を反映する独立した公正価値調整要素
- () 債務不履行の負債性金融商品、最近の取引の使用および市場データが入手できない債務不履行の資本性金融商品
- () 金利スワップについては、観測可能なイールドカーブに基づく将来の見積キャッシュ・フローの現在価値
- () 先渡為替契約については、貸借対照表日の先物為替レートに基づく将来キャッシュ・フローの現在価値
- () 通貨オプション、オプション価格算定モデル、および
- () その他の金融商品については、割引キャッシュ・フロー分析

公正価値が現在価値に基づいて決定され、使用された割引率がカウンターパーティーまたは自己の信用リスクに合わせて調整された非上場株式、条件付債権および特定のデリバティブ契約を除き、結果として生じる公正価値の見積りはすべてレベル2に含まれる。

公正価値測定全体が分類される公正価値の階層のレベルは、公正価値測定全体にとって重要なインプットの最低レベルを基準に決定する。そのために、公正価値測定全体に対するインプットの重要性が評価される。公正価値測定で観察可能なインプットを使用しているものの、かかるインプットに観察不能なインプットに基づいて重要な調整が必要とされる場合、その測定はレベル3に分類される。公正価値測定全体に対する特定のインプットの重要性の評価には、資産または負債に固有の要素を考慮に入れた判断が必要となる。

「観測可能な」インプットを構成するものを決定するには重要な判断が必要である。取締役会は、容易に入手でき、定期的に配信または更新され、信頼性が高く検証可能であり、専有情報ではなく、関連する市場に活発に関与している独立した情報源から提供された市場データを観測可能データとみなしている。

以下の表は、2022年1月31日および2021年7月31日現在の、公正価値で測定されるファンドの金融資産および金融負債の分析を表示している。

2022年1月31日	レベル1	レベル2	レベル3	合計
i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
損益を通じて公正価値で測定される金融資産：				
債券	-	3,250,025	-	3,250,025
先渡為替契約に係る未実現利益	-	12,942	-	12,942
合計	-	3,262,967	-	3,262,967
損益を通じて公正価値で測定される金融負債：				
先渡為替契約に係る未実現損失	-	(16,419)	-	(16,419)
合計	-	(16,419)	-	(16,419)
2021年7月31日	レベル1	レベル2	レベル3	合計
i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
損益を通じて公正価値で測定される金融資産：				
債券	-	2,762,087	-	2,762,087
先渡為替契約に係る未実現利益	-	23,349	-	23,349
合計	-	2,785,436	-	2,785,436
損益を通じて公正価値で測定される金融負債：				
先渡為替契約に係る未実現損失	-	(3,975)	-	(3,975)
合計	-	(3,975)	-	(3,975)

5. 買戻可能投資証券保有者への分配金

本投資法人は、本投資法人の分配型クラスの投資証券について分配を宣言し、行うことができる。英文目論見書に従い、その宣言日から12年間請求されていないままの分配金は失効し、本投資法人が投資者に対して負うべきものではなく、関連するファンドの財産となるものとする。

当会計期間中に宣言された分配は以下のとおりである。

該当なし。

6. 税金

2022年1月31日に終了した会計期間

該当なし。

アイルランド税

現行の法律および慣行に基づき、本投資法人は、1997年租税統合法第739条B項（改訂済）に定義される投資事業として適格である。その基準では、収益または利益に対しアイルランド税を課されることはない。ただし、「課税事由」の発生によりアイルランド税が生じる場合がある。課税事由には投資主への分配金の支払い、または投資証券の現金化、買戻し、消却もしくは譲渡ならびにかかる投資証券の取得から8年間の各期末の投資証券の保有が含まれる。

以下の課税事由についてアイルランド税は発生しない。

- a) 課税事由の発生時に課税目的上のアイルランド居住者でもアイルランドの通常居住者でもない投資主は、1997年租税統合法（改訂済）の条項に従って、適切で有効な宣誓書が本投資法人によって保有さ

れている、または適切な宣誓書がない場合に、本投資法人が総額での支払いを行うことをアイルランドの内国歳入庁により認められていることを条件とする。

- b) 必要な署名済み年次宣誓書を本投資法人に提出した特定のアイルランド税が免除される居住者である投資主。

外国税

本投資法人が行った投資に関する配当金、利息およびキャピタル・ゲイン(もしあれば)は、投資収益/利益が受け取られる国によって課される源泉徴収税の対象となり、かかる税金は本投資法人または投資主に還付されない可能性がある。

財務報告目的およびFRS第104号に準拠して、本投資法人は財務書類における未実現利益の課税対象と実際に実現可能な課税対象との重要な時間差異から生じる未払繰延税金について引当金を認識しなければならない。

7. 投資証券資本

授權済投資証券資本

本投資法人の授權済投資証券資本は、額面1.00英ポンドの募集投資証券7口および無額面の参加投資証券500,000,000,000口である。

募集投資証券

7口の募集投資証券は、現在発行済であり、2022年1月31日および2021年7月31日現在、管理会社および管理会社の被任命者によって保有されている。それらは本投資法人の純資産価額の一部を構成していない。したがって、それらは本財務書類において、本注記でのみ開示される。取締役会の意見では、この開示は本投資法人の投資事業の性質を反映している。

議決権

募集投資証券および買戻可能投資証券の保有者は、議決権について、投資証券1口につき、1議決権を有するものとする。

8. 買戻可能投資証券保有者に帰属する純資産

2022年1月31日現在

2022年1月31日 2021年7月31日 2020年7月31日

i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド

クラスD米ドルヘッジ投資証券

純資産価額	千米ドル	936,892	801,541	503,718
発行済口数		82,057,856	67,614,508	42,990,713
1口当たり純資産価格	米ドル	11.42	11.85	11.72

9. 為替レート

2022年1月31日および2021年7月31日現在の実勢為替レートは以下のとおりである。

	2022年1月31日	2021年7月31日
ユーロ = 1		
豪ドル	1.5911	1.6132
カナダドル	1.4257	1.4803
スイスフラン	1.0437	1.0747
人民元	7.1356	7.6559
デンマーク・クローネ	7.4404	7.4384
英ポンド	0.8355	0.8529
香港ドル	8.7411	9.2151
日本円	129.1672	130.1416
ノルウェー・クローネ	9.9949	10.4764
スウェーデン・クローナ	10.4635	10.2027
シンガポール・ドル	1.5158	1.6057
米ドル	1.1210	1.1858
英ポンド = 1		
ユーロ	1.1968	1.1725
米ドル	1.3416	1.3903
米ドル = 1		
アルゼンチン・ペソ	105.0165	96.6927
豪ドル	1.4193	1.3605
ブラジル・リアル	5.3100	5.1471
カナダドル	1.2718	1.2484
スイスフラン	0.9311	0.9063
チリ・ペソ	798.6000	758.9100
人民元	6.3654	6.4563
コロンビア・ペソ	3,941.9950	3,865.1350
チェコ・コルナ	21.6802	21.4847
デンマーク・クローネ	6.6373	6.2729
ドミニカ・ペソ	57.7300	57.0400
ユーロ	0.8921	0.8433
英ポンド	0.7454	0.7192
ハンガリー・フォリント	317.5112	301.6276
インドネシア・ルピア	14,382.0000	14,462.5000
イスラエル・シェケル	3.1778	3.2267
日本円	115.2250	109.7500
韓国ウォン	1,205.5000	1,150.2500
メキシコ・ペソ	20.6490	19.8595
マレーシア・リンギット	4.1855	4.2200
ノルウェー・クローネ	8.9161	8.8349
ニュージーランド・ドル	1.5226	1.4328
ペルー・ヌエボ・ソル	3.8374	4.0514
フィリピン・ペソ	50.9750	49.9850

ポーランド・ズロチ	4.0940	3.8500
ルーマニア・レウ	4.4119	4.1443
セルビア・ディナール	104.9150	99.1450
ロシア・ルーブル	77.4175	73.1482
スウェーデン・クローナ	9.3341	8.6041
シンガポール・ドル	1.3522	1.3541
タイ・バーツ	33.2950	32.8675
トルコ・リラ	13.4155	8.4220
ウルグアイ・ペソ	44.0355	43.7700
南アフリカ・ランド	15.4700	14.6288

会計期間末の平均為替レートは以下のとおりである。

	2022年1月31日	2021年1月31日
米ドル = 1		
ユーロ	1.1529	1.1928
英ポンド	1.3590	1.3229

10. 関連当事者取引

当事者とは、一方の当事者が他の当事者を支配する能力を有し、または財務上もしくは業務上の意思決定において他の当事者に対して重大な影響力を行使することができる場合、関連するとみなされる。

以下の事業体は、2022年1月31日に終了した会計期間における本投資法人の関連当事者であった。

本投資法人の取締役会

管理会社：	ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド
プロモーター、投資運用会社、 販売会社および証券貸付機関：	ブラックロック・アドバイザーズ（UK）リミテッド
スイスにおける代理人：	ブラックロック・アセット・マネジメント・スイス・リミテッド
副投資運用会社：	ブラックロック・フィナンシャル・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

管理会社、プロモーター、投資運用会社、販売会社、証券貸付機関、スイスにおける代理人および副投資運用会社の最終的な持ち株会社は、米国のデラウェア州で法人化されたブラックロック・インクである。

投資運用会社は、以下の表に示す副投資運用会社に一定のポートフォリオ管理機能を委譲している。

ファンド名	副投資運用会社
i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド	ブラックロック（シンガポール）リミテッド

投資運用会社は、投資運用会社自身の報酬から副投資運用会社の報酬および費用を支払うよう手配する。

2022年1月31日現在の取締役は以下の表のとおりである。

取締役	ブラックロック・グループの 従業員	ブラックロックの関係会社 および/またはブラックによって 管理されるその他のファンドの取締役
ポール・マクノートン	×	○
ジェシカ・イルシック	○	○
ポール・マッゴーワン	×	○
パリー・オドワイヤー	○	○
ロス・オシェイ	×	○
ティアドリ・サマーズ	×	○

取締役の報酬総額は、取締役として提供した業務に関するものである。ブラックロック・グループの従業員でもある取締役は、取締役報酬を受け取る権利を有していない。

以下の表のとおり、当会計期間中に本投資法人のファンド間で資産の現物移転により決済する取引が行われた。

移転元ファンド名	移転先ファンド名	千ユーロ
iシェアーズ・ユーロ・クレジット・ボンド ・インデックス・ファンド	iシェアーズ ESG スクリーンド・ユーロ ・コーポレート・ボンド・インデックス・ファンド	125,008
iシェアーズ・ユーロ・インベストメント ・グレード・コーポレート・ボンド ・インデックス・ファンド	iシェアーズ ESG スクリーンド・ユーロ ・コーポレート・ボンド・インデックス・ファン ド	489,325

ブラックロックが管理するその他の保有ファンド

ブラックロック・インクおよびブラックロックの関係会社が管理するファンドへの投資は、以下のとおりであり、関連ファンドの投資有価証券明細表に記載される。投資運用報酬または実績報酬の対象となる投資先ファンドについて、これらはファンドに払戻される。

本投資法人は、管理会社が管理する以下のファンドにも投資する。これらの投資先ファンドへの投資により課される報酬に関する詳細は、以下の表のとおりである。これら開示される報酬は、投資先ファンドの英文目論見書に従い上限とされている最大の報酬であり、実際に課される報酬はより低くなる可能性がある。

投資対象	ファンドが支払う報酬
投資会社 - アイルランド中央銀行によりアイルランドにおいて承認されているUCITS	
ブラックロック ICS ユーロ・リキッド・エンバイロメンタリー・アウェア・ファンド - エージェンシー（無分配型T0）投資証券	年次費用上限、 純資産価額の0.03% ¹
ブラックロック ICS スターリング・リキッド・エンバイロメンタリー・アウェア・ファンド - エージェンシー（分配型）投資証券	年次費用上限、 純資産価額の0.03% ¹
ブラックロック ICS 米ドル・リキッド・エンバイロメンタリー・アウェア・ファンド - エージェンシー（分配型）投資証券	年次費用上限、 純資産価額の0.03% ¹
iシェアーズ・コア € コープ・ボンド UCITS ETF	年次費用上限、 純資産価額の0.20% ²

¹ これら投資対象の管理会社は、その報酬からファンドの年次費用を支払う責任を負う。実際に発生した手数料および費用が管理会社に支払われた金額を超える場合、その超過分は管理会社が自らの資産から支払うことになる。

² 投資先ファンドは「オール・イン・ワン」の報酬体系を採用している。各ファンドは、手数料、運営費用および経費のすべてを単一の定額手数料（TER）として支払う。

すべての関連当事者取引は、通常の事業過程において独立した対等な立場で実行された。関連当事者が投資を行う際の条件および受け取る収益は、同一の投資証券クラスに投資する他の投資者が受け取るものよりも優遇されるものではなかった。

前の表は、投資先ファンドの英文目論見書に従い上限とされている最大の報酬を開示している。以下の表は、本投資法人のファンドが、同じ管理会社または管理会社の関係会社が管理するファンドに投資したことにより当期間中に受領した管理報酬リベート金額を開示している。

ファンド名	通貨	管理報酬リベート	
		2022年1月31日終了期間 単位：千	2021年1月31日終了期間 単位：千
i シェアーズ・グリーンボンド ・インデックス・ファンド	ユーロ	1	1

ファンドが保有する以下の投資対象は関連当事者とみなされる。

ファンド名	投資対象	2022年1月31日現在	2021年7月31日現在
		純資産比率%	純資産比率%
該当なし			

重要な投資者

以下の投資者が

- ブラックロック・グループが管理するファンド、またはブラックロック・インクの関係会社（以下「関連ブラックロック・ファンズ」という。）
- 上記（a）に記載される以外の投資者で、本投資法人の発行済議決権の20%以上を保有し、その結果、本投資法人の関連当事者とみなされる投資者（以下「重要な投資者」という。）

2022年1月31日現在

ファンド名	関連ブラックロック・ファンズが保有する投資証券の総比率%	ブラックロック・グループ またはブラックロック・インクの関係会社ではない重要な 投資者が保有する投資証券の 総比率%		ブラックロック・グループ またはブラックロック・インク の関係会社ではない 重要な投資者数
		総比率%		
i シェアーズ・グリーンボンド ・インデックス・ファンド	- ¹	61.85		1

¹ 0.005%未満の投資対象は、四捨五入し、ゼロである。

2021年7月31日現在

ファンド名	関連ブラックロック・ファンズが保有する投資証券の総比率%	ブラックロック・グループ またはブラックロック・インクの関係会社ではない重要な 投資者が保有する投資証券の 総比率%		ブラックロック・グループ またはブラックロック・インク の関係会社ではない 重要な投資者数
		総比率%		
i シェアーズ・グリーンボンド ・インデックス・ファンド	- ¹	65.31		1

¹ 0.005%未満の投資対象は、四捨五入し、ゼロである。

証券貸付

証券貸付取引から稼得された収益の総額は、関連ファンドと証券貸付機関との間で分割される。

証券貸付取引を行うファンドは少なくとも62.5%を受け取る一方、証券貸付機関は、かかる収益の上限37.5%を受け取るが、すべての運営費用は証券貸付機関の割り当て分で負担される。

以下の表は、会計期間中に証券貸付取引からファンドが稼得した収益の詳細を表示している。

ファンド名	2022年1月31日	2021年1月31日
	千ユーロ	千ユーロ
i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド	295	160

ファンドは、当会計期間末日現在、関連当事者に対する債権の金額について引当金を認識していない（2021年7月31日：なし）。

関連当事者に対する債務または債権について、当会計期間中に償却された金額はなかった（2021年7月31日：なし）。

当会計期間中に関連当事者と締結した担保、無担保または無保証の契約はなかった（2021年7月31日：なし）。

11. 与信枠

i シェアーズ・中国人民元ボンド・インデックス・ファンドを除くファンドはJPモルガンとの間で与信枠を締結し、JPモルガンはその他のシンジケート・レンダーと共にファンドが利用可能な与信枠3億米ドルの一部を使用した。与信枠3億米ドルの一部は、与信契約に基づき、ファンドに割り当てられる。この与信枠は、投資者の買戻しの資金調達を含むが、それに限定されない、一時的な資金調達目的のためにファンドによって利用される。かかる与信枠からの引き出しに関連する利息および契約手数料は、ファンドの資産から支払われる。新規ファンドは自動的に与信枠の対象とはならず、合同運用プロセスによって追加されることが要求される。このプロセスには、特に、新しいファンドの追加を承認するために貸し手によって実施される必要なデューディリジェンスが含まれる。本年中、当該ファンドはいかなる与信枠の対象とはならず、または与信枠を利用することができない。さらに、与信枠はファンドと与信契約に参加しているその他のブラックロック・ファンズとの間で（公平な配分基準に基づいて）利用可能であることから、新規ファンドの追加が貸し手によって承認される保証も、ファンドが与信枠を利用できるという保証もない。したがって、特定のファンズは与信枠の対象とならず、また同様に手数料を負担することもない。

融資約定手数料は、この与信枠に関連して、未払い残高に対して0.10%で日々請求される。

当期間中に与信枠は使用されなかった。

12. コミットメントおよび偶発債務

2022年1月31日および2021年7月31日現在、重要なコミットメントまたは偶発債務はなかった。

13. 後発事象

2022年3月1日付で、ブラックロック・ユーロ・ガバメント・エンハンスド・インデックス・ファンドのクラスDユーロ無分配型投資証券が設定された。

取締役会の意見では、上記以外に2022年1月31日に終了した会計期間の財務書類に影響を与える可能性のある後発事象はなかった。

14. 承認日

本財務書類は2022年3月30日付で取締役会によって承認された。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

i シェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド

投資有価証券明細表

2022年1月31日現在

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券				
国債 (2021年7月31日 : 33.34%)				
オーストラリア (2021年7月31日 : 0.76%)				
8,150,000	AUD	New South Wales Treasury Corp., 3.00%, 15/11/2028	5,440	0.17
5,900,000	AUD	New South Wales Treasury Corp., 1.25%, 20/11/2030	3,416	0.10
3,150,000	AUD	Queensland Treasury Corp., 3.00%, 22/03/2024	2,060	0.06
7,850,000	AUD	Queensland Treasury Corp., 2.50%, 06/03/2029	5,084	0.15
6,850,000	AUD	Queensland Treasury Corp., 1.25%, 10/03/2031	3,951	0.12
5,400,000	AUD	Queensland Treasury Corp., 1.50%, 02/03/2032	3,140	0.10
		オーストラリア合計	23,091	0.70
ベルギー (2021年7月31日 : 1.91%)				
47,696,199	EUR	Belgium Government Bond, 1.25%, 22/04/2033 ¹	52,483	1.60
		ベルギー合計	52,483	1.60
カナダ (2021年7月31日 : 1.65%)				
1,000,000	CAD	City of Ottawa Ontario, 3.25%, 10/11/2047	717	0.02
2,000,000	CAD	City of Ottawa Ontario, 2.50%, 11/05/2051	1,235	0.04
1,300,000	CAD	City of Toronto Canada, 2.60%, 24/09/2039	852	0.03
2,000,000	CAD	City of Toronto Canada, 3.20%, 01/08/2048	1,418	0.04
2,120,000	CAD	Export Development Canada, 1.80%, 01/09/2022	1,495	0.05
3,000,000	CAD	Export Development Canada, 1.65%, 31/07/2024	2,107	0.06
7,990,000	CAD	Province of Ontario Canada, 1.95%, 27/01/2023	5,654	0.17
18,525,000	CAD	Province of Ontario Canada, 2.65%, 05/02/2025	13,332	0.41
15,400,000	CAD	Province of Ontario Canada, 1.85%, 01/02/2027	10,698	0.33
3,000,000	CAD	Province of Ontario Canada, 1.55%, 01/11/2029	1,993	0.06
2,575,000	CAD	Province of Quebec Canada, 1.65%, 03/03/2022	1,808	0.05
1,900,000	CAD	Province of Quebec Canada, 2.45%, 01/03/2023	1,352	0.04
7,100,000	CAD	Province of Quebec Canada, 2.25%, 22/02/2024	5,059	0.16
1,500,000	CAD	Province of Quebec Canada, 2.60%, 06/07/2025	1,080	0.03
1,500,000	CAD	Province of Quebec Canada, 1.85%, 13/02/2027	1,045	0.03
1,200,000	CAD	Province of Quebec Canada, 2.10%, 27/05/2031	824	0.02
2,800,000	CAD	South Coast British Columbia Transportation Authority, 3.25%, 23/11/2028	2,086	0.06
1,000,000	CAD	South Coast British Columbia Transportation Authority, 2.65%, 29/10/2050	637	0.02
		カナダ合計	53,392	1.62
チリ (2021年7月31日 : 1.06%)				
8,600,000	EUR	Chile Government Bond, 0.83%, 02/07/2031 ¹	8,354	0.25
7,500,000	USD	Chile Government Bond, 2.55%, 27/01/2032 ¹	6,459	0.20
5,900,000	EUR	Chile Government Bond, 1.25%, 29/01/2040 ¹	5,521	0.17
10,200,000	USD	Chile Government Bond, 3.50%, 25/01/2050	8,761	0.26
		チリ合計	29,095	0.88
デンマーク (2021年7月31日 : 0.38%)				
25,000,000	DKK	Denmark Government Bond, 0.00%, 15/11/2031	3,315	0.10
500,000	GBP	Kommunekredit, 0.75%, 15/08/2024	588	0.02
2,250,000	EUR	Kommunekredit, 0.75%, 18/05/2027	2,314	0.07
3,450,000	EUR	Kommunekredit, 0.75%, 05/07/2028 ¹	3,556	0.11
2,040,000	EUR	Kommunekredit, 0.63%, 21/11/2039 ¹	2,007	0.06
2,300,000	EUR	Kommunekredit, 0.13%, 26/09/2040	2,051	0.06
		デンマーク合計	13,831	0.42
フィンランド (2021年7月31日 : 0.32%)				
800,000	GBP	Kuntarahoitus OYJ, 0.88%, 16/12/2024 ¹	943	0.03
2,300,000	EUR	Kuntarahoitus OYJ, 0.75%, 07/09/2027 ¹	2,373	0.07
2,400,000	EUR	Kuntarahoitus OYJ, 0.05%, 06/09/2029	2,358	0.07
2,300,000	EUR	Kuntarahoitus OYJ, 0.00%, 14/10/2030	2,234	0.07
		フィンランド合計	7,908	0.24

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
国債（つづき）				
フランス（2021年7月31日：11.71%）				
5,200,000	EUR	Bpifrance SACA, 0.00%, 25/05/2028	5,134	0.16
2,100,000	EUR	Caisse des Depots et Consignations, 0.20%, 01/03/2022 ¹	2,101	0.06
2,200,000	EUR	Caisse des Depots et Consignations, 0.01%, 15/09/2025	2,208	0.07
3,600,000	EUR	Caisse Francaise de Financement Local, 0.10%, 13/11/2029 ¹	3,530	0.11
140,840,000	EUR	France Government Bond OAT, 1.75%, 25/06/2039 ¹	166,404	5.06
51,354,706	EUR	France Government Bond OAT, 0.50%, 25/06/2044	47,746	1.45
1,700,000	EUR	Region of Ile de France, 3.63%, 27/03/2024	1,839	0.06
4,700,000	EUR	Region of Ile de France, 0.50%, 14/06/2025	4,783	0.14
800,000	EUR	Region of Ile de France, 2.38%, 24/04/2026	877	0.03
3,400,000	EUR	Region of Ile de France, 0.63%, 23/04/2027	3,473	0.10
1,100,000	EUR	Region of Ile de France, 1.38%, 14/03/2029 ¹	1,180	0.03
4,800,000	EUR	Region of Ile de France, 0.10%, 02/07/2030	4,670	0.14
500,000	EUR	Region of Ile de France, 1.38%, 20/06/2033	539	0.02
2,300,000	EUR	SFIL SA, 0.00%, 23/11/2028	2,260	0.07
1,000,000	EUR	SFIL SA, 0.25%, 01/12/2031	972	0.03
7,900,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.13%, 22/10/2028	8,355	0.25
14,100,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.00%, 25/11/2030	13,527	0.41
8,000,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.30%, 25/11/2031	7,779	0.24
9,100,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.13%, 25/05/2034 ¹	9,514	0.29
6,300,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.30%, 02/09/2036 ¹	5,848	0.18
9,600,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.88%, 10/05/2046	9,184	0.28
10,400,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.70%, 25/05/2050 ¹	11,743	0.36
6,300,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.00%, 26/11/2051	5,935	0.18
13,700,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 0.70%, 15/10/2060	11,242	0.34
14,500,000	EUR	Societe Du Grand Paris EPIC, 1.00%, 18/02/2070	12,644	0.38
1,300,000	EUR	Ville de Paris, 1.75%, 25/05/2031	1,437	0.04
		フランス合計	344,924	10.48
ドイツ（2021年7月31日：7.62%）				
23,500,000	EUR	Bundesobligation, 0.00%, 10/10/2025 ¹	23,890	0.73
29,550,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2030 ¹	29,938	0.91
29,250,000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2031	29,394	0.89
26,997,073	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.00%, 15/08/2050	25,400	0.77
33,000,000	SEK	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.13%, 03/06/2022	3,155	0.10
4,115,000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2.00%, 29/09/2022	3,703	0.11
78,700,000	NOK	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.25%, 28/08/2023	7,833	0.24
4,400,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.05%, 30/05/2024 ¹	4,436	0.14
5,324,000	AUD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.50%, 24/07/2024	3,361	0.10
9,000,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.25%, 30/06/2025 ¹	9,121	0.28
20,000,000	NOK	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.13%, 08/08/2025	1,946	0.06
5,000,000	CAD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.75%, 19/02/2026	3,355	0.10
6,550,000	GBP	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.88%, 15/09/2026	7,671	0.23
3,880,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.50%, 28/09/2026 ¹	3,975	0.12
11,000,000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.00%, 01/10/2026 ¹	9,530	0.29
18,150,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.01%, 05/05/2027 ¹	18,128	0.55
37,500,000	SEK	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.38%, 02/02/2028	3,650	0.11
27,850,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 15/09/2028	27,662	0.84
18,170,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 15/06/2029	17,966	0.55
12,550,000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 1.75%, 14/09/2029	11,142	0.34
3,000,000	USD	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.75%, 30/09/2030 ¹	2,448	0.07
18,252,000	EUR	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.00%, 15/09/2031 ¹	17,781	0.54
2,000,000	EUR	State of Hesse, 0.01%, 18/06/2031 ¹	1,940	0.06
		ドイツ合計	267,425	8.13
香港（2021年7月31日：0.09%）				
1,000,000	USD	Hong Kong Government Bond, 2.50%, 28/05/2024	914	0.03
400,000	USD	Hong Kong Government Bond, 0.63%, 02/02/2026	342	0.01
5,500,000	EUR	Hong Kong Government Bond, 0.00%, 24/11/2026	5,407	0.16
1,400,000	USD	Hong Kong Government Bond, 1.38%, 02/02/2031	1,178	0.04

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
国債 (つづき)				
香港 (つづき)				
12,000,000	USD	Hong Kong Government Bond, 1.75%, 24/11/2031	10,393	0.32
2,300,000	EUR	Hong Kong Government Bond, 1.00%, 24/11/2041	2,112	0.06
1,200,000	USD	Hong Kong Government Bond, 2.38%, 02/02/2051	944	0.03
		香港合計	21,290	0.65
ハンガリー (2021年7月31日: 0.26%)				
6,775,000	EUR	Hungary Government Bond, 1.75%, 05/06/2035	6,898	0.21
		ハンガリー合計	6,898	0.21
インドネシア (2021年7月31日: 0.30%)				
1,185,000	USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 3.75%, 01/03/2023	1,087	0.04
5,200,000	USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 3.90%, 20/08/2024 ¹	4,898	0.15
4,000,000	USD	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III, 3.55%, 09/06/2051	3,372	0.10
		インドネシア合計	9,357	0.29
アイルランド (2021年7月31日: 1.13%)				
30,615,383	EUR	Ireland Government Bond, 1.35%, 18/03/2031	33,626	1.02
		アイルランド合計	33,626	1.02
イタリア (2021年7月31日: 1.39%)				
61,125,000	EUR	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.50%, 30/04/2045	56,234	1.71
		イタリア合計	56,234	1.71
ジャージー (2021年7月31日: 0.18%)				
4,500,000	EUR	IDB Trust Services Ltd., 0.04%, 04/12/2024	4,460	0.14
		ジャージー合計	4,460	0.14
オランダ (2021年7月31日: 1.93%)				
49,215,000	EUR	Netherlands Government Bond, 0.50%, 15/01/2040	51,054	1.55
		オランダ合計	51,054	1.55
ニュージーランド (2021年7月31日: 0.00%)				
2,000,000	EUR	Auckland Council, 0.25%, 17/11/2031	1,935	0.06
		ニュージーランド合計	1,935	0.06
ノルウェー (2021年7月31日: 0.31%)				
2,100,000	AUD	Kommunalbanken A/S, 2.70%, 05/09/2023	1,355	0.04
1,000,000	AUD	Kommunalbanken A/S, 0.50%, 08/10/2024	612	0.02
6,400,000	USD	Kommunalbanken A/S, 2.13%, 11/02/2025 ¹	5,820	0.18
16,000,000	SEK	Kommunalbanken A/S, 0.13%, 28/08/2026	1,473	0.04
		ノルウェー合計	9,260	0.28
ポーランド (2021年7月31日: 0.66%)				
4,550,000	EUR	Poland Government Bond, 1.13%, 07/08/2026	4,722	0.14
6,800,000	EUR	Poland Government Bond, 1.00%, 07/03/2029 ¹	7,097	0.22
2,350,000	EUR	Poland Government Bond, 2.00%, 08/03/2049 ¹	2,747	0.08
		ポーランド合計	14,566	0.44
韓国 (2021年7月31日: 0.23%)				
1,700,000	EUR	Export-Import Bank of Korea, 0.00%, 19/10/2024	1,699	0.05
3,200,000	EUR	Export-Import Bank of Korea, 0.83%, 27/04/2025	3,266	0.10
500,000	USD	Export-Import Bank of Korea, 1.75%, 19/10/2028	437	0.01
500,000	USD	Export-Import Bank of Korea, 2.13%, 18/01/2032	436	0.01
2,500,000	USD	Korea Government Bond, 2.00%, 19/06/2024	2,258	0.07
1,500,000	EUR	Korea Government Bond, 0.00%, 15/10/2026	1,486	0.05
		韓国合計	9,582	0.29

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
国債 (つづき)				
スペイン (2021年7月31日 : 0.28%)				
3,175,000	EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 0.83%, 30/07/2027	3,264	0.10
1,500,000	EUR	Autonomous Community of Madrid Spain, 0.16%, 30/07/2028	1,475	0.04
2,300,000	EUR	Instituto de Credito Oficial, 0.20%, 31/01/2024 ¹	2,322	0.07
2,300,000	EUR	Instituto de Credito Oficial, 0.00%, 30/04/2026 ¹	2,293	0.07
1,750,000	EUR	Instituto de Credito Oficial, 0.00%, 30/04/2027	1,731	0.05
22,688,000	EUR	Spain Government Bond, 1.00%, 30/07/2042 ¹	21,569	0.66
		スペイン合計	32,654	0.99
スウェーデン (2021年7月31日 : 1.02%)				
4,000,000	USD	Kommuninvest I Sverige AB, 1.63%, 24/04/2023	3,595	0.11
40,500,000	SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 0.63%, 01/06/2023	3,898	0.12
37,500,000	SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 0.38%, 27/03/2024	3,586	0.11
3,650,000	USD	Kommuninvest I Sverige AB, 0.38%, 19/06/2024 ¹	3,180	0.10
29,000,000	SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 0.38%, 10/06/2026	2,715	0.08
35,000,000	SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 0.25%, 26/11/2027 ¹	3,191	0.10
15,000,000	SEK	Kommuninvest I Sverige AB, 0.88%, 16/05/2029	1,401	0.04
105,550,000	SEK	Sweden Government Bond, 0.13%, 09/09/2030	9,896	0.30
		スウェーデン合計	31,462	0.96
イギリス (2021年7月31日 : 0.08%)				
1,847,000	GBP	Transport for London, 2.13%, 24/04/2025	2,235	0.07
44,870,000	GBP	UK Treasury, 0.88%, 31/07/2033	50,969	1.55
27,155,000	GBP	UK Treasury, 1.50%, 31/07/2053	33,131	1.00
		イギリス合計	86,335	2.62
米国 (2021年7月31日 : 0.07%)				
1,550,000	USD	District of Columbia Water & Sewer Authority, 4.81%, 01/10/2114	1,944	0.06
		米国合計	1,944	0.06
国債への投資合計			1,162,806	35.34
社債 (2021年7月31日 : 55.57%)				
オーストラリア (2021年7月31日 : 0.76%)				
2,800,000	AUD	Lendlease Finance Ltd., REIT, 3.40%, 27/10/2027	1,755	0.05
1,800,000	AUD	Lendlease Finance Ltd., REIT, 3.70%, 31/03/2031	1,116	0.03
1,800,000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.35%, 07/09/2022	1,809	0.06
2,750,000	USD	National Australia Bank Ltd., 3.63%, 20/06/2023	2,534	0.08
3,800,000	EUR	National Australia Bank Ltd., 0.63%, 30/08/2023	3,848	0.12
1,900,000	EUR	Westpac Banking Corp., 0.63%, 22/11/2024	1,926	0.06
4,550,000	EUR	Westpac Banking Corp., FRN, 0.77%, 13/05/2031	4,429	0.13
2,150,000	AUD	Woolworths Group Ltd., 2.85%, 23/04/2024	1,385	0.04
		オーストラリア合計	18,802	0.57
オーストリア (2021年7月31日 : 0.75%)				
800,000	EUR	BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0.01%, 03/09/2029	780	0.02
1,800,000	EUR	CA Immobilien Anlagen AG, REIT, 1.00%, 27/10/2025 ¹	1,781	0.05
2,500,000	EUR	Erste Group Bank AG, 0.13%, 17/05/2028	2,404	0.07
2,800,000	EUR	HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG, 0.38%, 25/06/2024 ¹	2,805	0.09
3,200,000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, 0.38%, 25/09/2026 ¹	3,162	0.10
2,500,000	EUR	Raiffeisen Bank International AG, FRN, 1.37%, 17/06/2033 ¹	2,372	0.07
2,550,000	USD	Suzano Austria GmbH, 5.75%, 14/07/2026 ¹	2,551	0.08
2,400,000	EUR	Verbund AG, 1.50%, 20/11/2024 ¹	2,494	0.08
2,500,000	EUR	Verbund AG, 0.90%, 01/04/2041 ¹	2,471	0.07
		オーストリア合計	20,820	0.63

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券(つづき)				
社債(つづき)				
ベルギー (2021年7月31日: 0.51%)				
800,000	EUR	Aedifica SA, REIT, 0.75%, 09/09/2031 ¹	743	0.02
2,400,000	EUR	Belfius Bank SA, 0.38%, 08/06/2027	2,347	0.07
2,300,000	EUR	Cofinimmo SA, REIT, 0.88%, 02/12/2030 ¹	2,171	0.07
2,800,000	EUR	FLUVIUS System Operator CVBA, 0.25%, 02/12/2030	2,635	0.08
2,300,000	EUR	KBC Group NV, 0.88%, 27/06/2023 ¹	2,336	0.07
2,900,000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.25%, 01/03/2027	2,844	0.09
2,400,000	EUR	KBC Group NV, FRN, 0.38%, 16/06/2027	2,362	0.07
1,000,000	EUR	Proximus SADP, 0.75%, 17/11/2036	950	0.03
600,000	EUR	VGP NV, REIT, 1.63%, 17/01/2027	596	0.02
3,200,000	EUR	VGP NV, REIT, 1.50%, 08/04/2029	3,041	0.09
700,000	EUR	VGP NV, REIT, 2.25%, 17/01/2030	690	0.02
		ベルギー合計	20,715	0.63
バミューダ (2021年7月31日: 0.00%)				
2,000,000	USD	Star Energy Geothermal Darajat II, 4.85%, 14/10/2038	1,867	0.06
		バミューダ合計	1,867	0.06
英国領ヴァージン諸島 (2021年7月31日: 0.24%)				
1,000,000	USD	Amipeace Ltd., 1.75%, 09/11/2026 ¹	871	0.03
		Rail Transit International Development Co. Ltd., 1.63%, 22/06/2022 ¹	2,104	0.06
2,100,000	EUR		785	0.02
1,000,000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd., REIT, 2.70%, 13/01/2025	1,077	0.03
1,365,000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd., REIT, 3.25%, 05/05/2026	2,780	0.09
2,775,000	EUR	Talent Yield Euro Ltd., 1.00%, 24/09/2025 ¹	7,617	0.23
		英領ヴァージン諸島合計		
カナダ (2021年7月31日: 1.72%)				
2,500,000	CAD	Algonquin Power Co., 2.85%, 15/07/2031	1,702	0.05
1,000,000	CAD	Allied Properties Real Estate Investment Trust, 1.73%, 12/02/2026	673	0.02
4,500,000	CAD	Allied Properties Real Estate Investment Trust, 3.10%, 06/02/2032	2,998	0.09
3,300,000	USD	Bank of Nova Scotia (The), 2.38%, 18/01/2023	2,983	0.09
3,600,000	CAD	Brookfield Renewable Partners ULC, 4.25%, 15/01/2029	2,728	0.08
1,000,000	CAD	Brookfield Renewable Partners ULC, 3.33%, 13/08/2050	639	0.02
2,700,000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.95%, 23/10/2025	2,315	0.07
4,550,000	EUR	CPPIB Capital, Inc., 0.25%, 06/04/2027 ¹	4,541	0.14
6,650,000	CAD	CPPIB Capital, Inc., 3.00%, 15/06/2028	4,901	0.15
4,523,000	EUR	CPPIB Capital, Inc., 0.88%, 06/02/2029	4,667	0.14
2,500,000	CAD	Granite REIT Holdings LP, REIT, 3.06%, 04/06/2027	1,777	0.06
1,000,000	CAD	Granite REIT Holdings LP, REIT, 2.19%, 30/08/2028	670	0.02
2,000,000	CAD	Lower Mattagami Energy LP, 2.43%, 14/05/2031	1,372	0.04
3,350,000	CAD	Manulife Financial Corp., FRN, 3.32%, 09/05/2028	2,393	0.07
1,250,000	SGD	Manulife Financial Corp., FRN, 3.00%, 21/11/2029	844	0.03
1,800,000	CAD	Ontario Power Generation, Inc., 2.89%, 08/04/2025	1,291	0.04
4,300,000	CAD	Ontario Power Generation, Inc., 3.22%, 08/04/2030	3,091	0.09
2,800,000	CAD	Ontario Power Generation, Inc., 3.84%, 22/06/2048	2,003	0.06
2,615,000	CAD	Ontario Power Generation, Inc., 4.25%, 18/01/2049	2,007	0.06
3,184,000	EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.05%, 25/11/2030	3,030	0.09
2,150,000	EUR	Ontario Teachers' Finance Trust, 0.95%, 24/11/2051	2,040	0.06
3,800,000	CAD	RioCan Real Estate Investment Trust, 2.36%, 10/03/2027	2,580	0.08
2,300,000	EUR	Royal Bank of Canada, 0.25%, 02/05/2024	2,309	0.07
4,000,000	USD	Royal Bank of Canada, 1.15%, 14/07/2026	3,430	0.11
		カナダ合計	56,984	1.73
ケイマン諸島 (2021年7月31日: 1.08%)				
2,000,000	USD	Baidu, Inc., 2.38%, 23/08/2031 ¹	1,687	0.05
3,425,000	USD	Fibria Overseas Finance Ltd., 5.50%, 17/01/2027	3,357	0.10
3,500,000	USD	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd. (The), REIT, 2.25%, 15/07/2031	2,981	0.09
2,130,000	USD	Link Finance Cayman 2009 Ltd. (The), REIT, 2.88%, 21/07/2026 ¹	1,941	0.06
3,700,000	USD	MAF Sukuk Ltd., REIT, 4.64%, 14/05/2029	3,600	0.11

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
社債（つづき）				
ケイマン諸島（続き）				
3,550,000	USD	MAF Sukuk Ltd., REIT, 3.93%, 28/02/2030 ¹	3,330	0.10
3,720,000	USD	MTR Corp. CI Ltd., 2.50%, 02/11/2026	3,398	0.10
4,200,000	USD	QNB Finance Ltd., 1.63%, 22/09/2025	3,667	0.11
3,900,000	USD	Saudi Electricity Global Sukuk Co. 5, 1.74%, 17/09/2025 ¹	3,410	0.11
3,500,000	USD	Saudi Electricity Global Sukuk Co. 5, 2.41%, 17/09/2030 ¹	3,048	0.09
700,000	GBP	Southern Water Services Finance Ltd., 1.63%, 30/03/2027	813	0.03
2,950,000	EUR	Three Gorges Finance II Cayman Islands Ltd., 1.30%, 21/06/2024	3,007	0.09
		ケイマン諸島合計	34,239	1.04
チリ（2021年7月31日：0.12%）				
3,000,000	USD	Colbun SA, 3.15%, 19/01/2032	2,560	0.08
3,150,000	USD	Inversiones CMPC SA, 4.38%, 04/04/2027 ¹	3,009	0.09
		チリ合計	5,569	0.17
中国（2021年7月31日：2.13%）				
3,000,000	USD	Agricultural Bank of China Ltd., 2.00%, 18/01/2027	2,673	0.08
2,500,000	USD	Bank of China Ltd., 0.95%, 21/09/2023 ¹	2,209	0.07
2,250,000	EUR	Bank of China Ltd., 0.00%, 28/04/2024 ¹	2,242	0.07
2,700,000	USD	Bank of China Ltd., 0.80%, 28/04/2024 ¹	2,363	0.07
1,300,000	USD	Bank of China Ltd., 0.75%, 29/09/2024 ¹	1,132	0.04
2,700,000	USD	Bank of China Ltd., 1.40%, 28/04/2026	2,347	0.07
2,200,000	EUR	China Construction Bank Corp., 0.05%, 22/10/2022	2,202	0.07
2,000,000	USD	China Construction Bank Corp., 1.00%, 04/08/2023	1,769	0.05
3,400,000	EUR	China Construction Bank Corp., 0.00%, 22/04/2024 ¹	3,386	0.10
4,250,000	USD	China Construction Bank Corp., 1.25%, 04/08/2025	3,707	0.11
2,880,000	USD	China Development Bank, 2.75%, 16/11/2022	2,596	0.08
55,000,000	CNY	China Development Bank, 3.10%, 21/11/2022	7,756	0.24
93,300,000	CNY	China Development Bank, 3.07%, 24/03/2024	13,276	0.40
2,300,000	USD	China Development Bank, 0.63%, 09/09/2024	2,006	0.06
2,000,000	USD	China Merchants Bank Co. Ltd., 1.20%, 10/09/2025	1,727	0.05
3,500,000	USD	China Merchants Bank Co. Ltd., 1.25%, 01/09/2026 ¹	3,007	0.09
2,025,000	EUR	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 0.25%, 25/04/2022 ¹	2,026	0.06
2,300,000	USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 2.25%, 16/09/2022	2,061	0.06
2,670,000	USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 2.88%, 12/10/2022 ¹	2,404	0.07
1,000,000	USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 1.00%, 28/10/2024	873	0.03
1,000,000	GBP	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 1.63%, 28/12/2025	1,167	0.04
1,000,000	USD	Industrial & Commercial Bank of China Ltd., 1.63%, 28/10/2026 ¹	875	0.03
1,000,000	USD	Industrial Bank Co. Ltd., 1.13%, 06/11/2023 ¹	880	0.03
		中国合計	64,684	1.97
チェコ共和国（2021年7月31日：0.06%）				
2,200,000	EUR	Ceska sporitelna A/S, FRN, 0.50%, 13/09/2028	2,102	0.06
1,500,000	EUR	Raiffeisenbank A/S, FRN, 1.00%, 09/06/2028	1,456	0.05
		チェコ共和国合計	3,558	0.11
デンマーク（2021年7月31日：0.74%）				
250,000	EUR	AP Moller - Maersk A/S, 0.75%, 25/11/2031	245	0.01
2,400,000	EUR	Danske Bank A/S, 1.63%, 15/03/2024 ¹	2,473	0.07
2,200,000	EUR	Danske Bank A/S, FRN, 0.75%, 09/06/2029	2,140	0.06
2,225,000	EUR	Jyske Bank A/S, FRN, 0.05%, 02/09/2026	2,177	0.07
1,575,000	GBP	Orsted A/S, 2.13%, 17/05/2027	1,919	0.06
3,350,000	EUR	Orsted A/S, 1.50%, 26/11/2029 ¹	3,539	0.11
1,525,000	GBP	Orsted A/S, 2.50%, 16/05/2033	1,895	0.06
2,250,000	EUR	Orsted A/S, FRN, 2.25%, 24/11/3017	2,315	0.07
2,725,000	EUR	Orsted A/S, FRN, 1.75%, 09/12/3019 ¹	2,732	0.08
2,425,000	EUR	Orsted A/S, FRN, 1.50%, 18/02/3021 ¹	2,326	0.07
1,950,000	GBP	Orsted A/S, FRN, 2.50%, 18/02/3021	2,219	0.07
		デンマーク合計	23,980	0.73

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券(つづき)				
社債(つづき)				
		フィンランド (2021年7月31日: 0.71%)		
1,125,000	EUR	Kojamo OYJ, REIT, 0.88%, 28/05/2029	1,087	0.03
2,400,000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.30%, 30/06/2022	2,408	0.07
3,000,000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.38%, 28/05/2026	3,012	0.09
2,300,000	EUR	Nordea Bank Abp, 0.50%, 19/03/2031 ¹	2,238	0.07
2,225,000	EUR	OP Corporate Bank plc, 0.38%, 26/02/2024 ¹	2,242	0.07
3,650,000	EUR	OP Mortgage Bank, 0.05%, 25/03/2031	3,532	0.11
1,525,000	EUR	SATO OYJ, REIT, 1.38%, 24/02/2028	1,526	0.05
3,425,000	EUR	UPM-Kymmene OYJ, 0.13%, 19/11/2028	3,282	0.10
		フィンランド合計	19,327	0.59
		フランス (2021年7月31日: 7.77%)		
5,500,000	EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 1.38%, 17/09/2024	5,721	0.17
4,100,000	EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.00%, 25/03/2025	4,117	0.13
2,200,000	EUR	Agence Francaise de Developpement EPIC, 0.50%, 31/10/2025 ¹	2,239	0.07
2,500,000	EUR	ALD SA, 1.25%, 11/10/2022	2,527	0.08
4,525,000	EUR	AXA SA, FRN, 1.37%, 07/10/2041	4,288	0.13
3,400,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.10%, 08/10/2027	3,293	0.10
3,400,000	EUR	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0.25%, 29/06/2028	3,295	0.10
2,300,000	EUR	BNP Paribas SA, 0.50%, 01/06/2022	2,308	0.07
2,350,000	EUR	BNP Paribas SA, 1.00%, 17/04/2024	2,397	0.07
3,400,000	EUR	BNP Paribas SA, 1.13%, 28/08/2024	3,484	0.11
2,900,000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.50%, 04/06/2026	2,897	0.09
4,500,000	USD	BNP Paribas SA, FRN, 1.68%, 30/06/2027	3,869	0.12
3,800,000	EUR	BNP Paribas SA, FRN, 0.38%, 14/10/2027	3,713	0.11
1,400,000	EUR	BPCE SA, 1.13%, 14/12/2022	1,419	0.04
2,300,000	EUR	BPCE SA, 0.13%, 04/12/2024	2,301	0.07
500,000	EUR	BPCE SA, FRN, 0.50%, 14/01/2028	491	0.01
6,300,000	EUR	BPCE SFH SA, 0.01%, 27/05/2030 ¹	6,104	0.19
6,100,000	EUR	BPCE SFH SA, 0.13%, 03/12/2030	5,944	0.18
3,300,000	EUR	CNP Assurances, FRN, 2.00%, 27/07/2050 ¹	3,308	0.10
2,300,000	EUR	Covivio, REIT, 1.88%, 20/05/2026	2,432	0.07
2,300,000	EUR	Covivio, REIT, 1.13%, 17/09/2031 ¹	2,271	0.07
5,800,000	EUR	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.05%, 06/12/2029	5,662	0.17
4,300,000	EUR	Credit Agricole SA, 0.75%, 05/12/2023 ¹	4,370	0.13
4,200,000	EUR	Credit Agricole SA, 0.38%, 21/10/2025 ¹	4,188	0.13
5,370,000	USD	Electricite de France SA, 3.63%, 13/10/2025	5,019	0.15
7,400,000	EUR	Electricite de France SA, 1.00%, 13/10/2026 ¹	7,568	0.23
8,500,000	EUR	Electricite de France SA, 1.00%, 29/11/2033 ¹	8,135	0.25
1,900,000	EUR	Engie SA, 0.38%, 28/02/2023	1,910	0.06
3,100,000	EUR	Engie SA, 0.88%, 27/03/2024	3,152	0.10
3,500,000	EUR	Engie SA, 0.38%, 21/06/2027 ¹	3,458	0.11
3,400,000	EUR	Engie SA, 1.50%, 27/03/2028	3,570	0.11
3,400,000	EUR	Engie SA, 1.75%, 27/03/2028	3,604	0.11
3,400,000	EUR	Engie SA, 1.38%, 28/02/2029	3,538	0.11
3,500,000	EUR	Engie SA, 0.38%, 26/10/2029	3,378	0.10
4,100,000	EUR	Engie SA, 0.50%, 24/10/2030	3,957	0.12
3,300,000	EUR	Engie SA, 2.13%, 30/03/2032	3,644	0.11
3,500,000	EUR	Engie SA, 1.00%, 26/10/2036	3,355	0.10
3,400,000	EUR	Engie SA, 1.38%, 21/06/2039 ¹	3,361	0.10
4,500,000	EUR	Engie SA, FRN, 3.25%, 28/11/2024 ²	4,791	0.15
3,600,000	EUR	Engie SA, FRN, 1.50%, 30/05/20281 ²	3,510	0.10
3,600,000	EUR	Engie SA, FRN, 1.88%, 01/02/2031 ²	3,465	0.11
1,000,000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 25/01/2033	988	0.03
2,300,000	EUR	Gecina SA, REIT, 0.88%, 30/06/2036	2,175	0.07
2,900,000	EUR	Icade, REIT, 1.50%, 13/09/2027	3,009	0.09
700,000	EUR	ICADE, REIT, 1.00%, 19/01/2030	693	0.02
2,200,000	EUR	Ile-de-France Mobilites, 0.40%, 28/05/2031	2,171	0.07
2,000,000	EUR	Ile-de-France Mobilites, 0.68%, 24/11/2036	1,927	0.06
2,400,000	EUR	Ile-de-France Mobilites, 0.95%, 28/05/2041 ¹	2,358	0.07

3,500,000	EUR	La Banque Postale SA, 1.38%, 24/04/2029 ¹	3,580	0.11
-----------	-----	--	-------	------

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
社債（つづき）				
フランス（つづき）				
2,300,000	EUR	La Poste SA, 1.45%, 30/11/2028	2,432	0.07
1,400,000	EUR	New Immo Holding SA, REIT, 2.75%, 26/11/2026	1,459	0.04
2,100,000	EUR	Regie Autonome des Transports Parisiens, 0.88%, 25/05/2027	2,172	0.07
2,300,000	EUR	Regie Autonome des Transports Parisiens, 0.35%, 20/06/2029	2,293	0.07
500,000	EUR	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 0.75%, 12/01/2034	488	0.01
3,800,000	EUR	SNCF Reseau, 0.88%, 22/01/2029	3,935	0.12
3,800,000	EUR	SNCF Reseau, 1.00%, 09/11/2031	3,951	0.12
4,100,000	EUR	SNCF Reseau, 1.88%, 30/03/2034 ¹	4,630	0.14
7,100,000	EUR	SNCF Reseau, 0.75%, 25/05/2036	7,018	0.21
5,900,000	EUR	SNCF Reseau, 2.25%, 20/12/2047	7,222	0.22
4,600,000	EUR	Societe Generale SA, FRN, 0.88%, 22/09/2028	4,544	0.14
4,600,000	EUR	Societe Generale SFH SA, 0.01%, 02/12/2026	4,563	0.14
4,100,000	EUR	Societe Generale SFH SA, 0.13%, 18/07/2029	4,036	0.12
4,600,000	EUR	Societe Generale SFH SA, 0.01%, 11/02/2030 ¹	4,469	0.14
7,600,000	EUR	Societe Nationale SNCF SA, 0.63%, 17/04/2030	7,676	0.23
2,650,000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 2.50%, 26/02/2024	2,780	0.08
2,300,000	EUR	Unibail-Rodamco-Westfield SE, REIT, 1.00%, 14/03/2025 ¹	2,336	0.07
2,300,000	EUR	Vinci SA, 0.00%, 27/11/2028 ¹	2,216	0.07
		フランス合計	237,174	7.21
ドイツ（2021年7月31日：5.96%）				
1,800,000	EUR	Aareal Bank AG, 0.75%, 18/04/2028	1,771	0.05
3,100,000	EUR	Bayerische Landesbank, 0.13%, 10/02/2028	2,992	0.09
1,500,000	EUR	Bayerische Landesbank, FRN, 1.00%, 23/09/2031	1,468	0.04
2,100,000	EUR	Bayerische Landesbank, FRN, 1.37%, 22/11/2032	2,060	0.06
2,350,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.13%, 05/05/2022	2,354	0.07
2,000,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.50%, 26/09/2023	2,017	0.06
2,300,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.13%, 23/10/2023	2,315	0.07
2,075,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.63%, 22/10/2025	2,116	0.06
600,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.38%, 25/01/2027	598	0.02
2,300,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.01%, 19/07/2027 ¹	2,275	0.07
2,000,000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.13%, 25/10/2027	2,045	0.06
2,075,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.01%, 24/01/2028	2,047	0.06
2,300,000	EUR	Berlin Hyp AG, 1.50%, 18/04/2028 ¹	2,392	0.07
2,475,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.01%, 07/07/2028	2,435	0.07
2,300,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.50%, 05/11/2029	2,267	0.07
2,075,000	EUR	Berlin Hyp AG, 0.01%, 02/09/2030	2,013	0.06
2,200,000	EUR	Commerzbank AG, 1.25%, 23/10/2023	2,243	0.07
2,800,000	EUR	Commerzbank AG, FRN, 0.75%, 24/03/2026	2,815	0.08
5,000,000	USD	Deutsche Bank AG, 1.69%, 19/03/2026	4,362	0.13
2,350,000	EUR	Deutsche Bank AG, FRN, 1.37%, 10/06/2026	2,426	0.08
2,100,000	EUR	Deutsche Hypothekenbank AG, 0.13%, 23/11/2023	2,112	0.06
2,300,000	EUR	Deutsche Hypothekenbank AG, 0.25%, 10/12/2024 ¹	2,316	0.07
2,000,000	EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.75%, 26/09/2024 ¹	2,029	0.06
2,325,000	EUR	Deutsche Kreditbank AG, 0.01%, 23/02/2026	2,289	0.07
600,000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 17/01/2025	598	0.02
2,300,000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.25%, 27/10/2025	2,277	0.07
2,400,000	EUR	Deutsche Pfandbriefbank AG, 0.10%, 02/02/2026	2,356	0.07
		DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank Frankfurt		
1,600,000	EUR	Am Main, 0.40%, 17/11/2028 ¹	1,555	0.05
3,100,000	EUR	E.ON SE, 0.00%, 28/08/2024	3,099	0.09
3,125,000	EUR	E.ON SE, 1.00%, 07/10/2025 ¹	3,205	0.10
4,525,000	EUR	E.ON SE, 0.38%, 29/09/2027	4,506	0.14
3,400,000	EUR	E.ON SE, 0.35%, 28/02/2030 ¹	3,314	0.10
2,275,000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 20/08/2031 ¹	2,302	0.07
3,425,000	EUR	E.ON SE, 0.60%, 01/10/2032 ¹	3,330	0.10
775,000	EUR	E.ON SE, 0.88%, 18/10/2034	756	0.02
2,500,000	EUR	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, FRN, 1.62%, 05/08/2079 ¹	2,444	0.07
2,200,000	EUR	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, FRN, 1.12%, 05/11/2079	2,200	0.07
2,500,000	EUR	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, FRN, 1.88%, 29/06/2080	2,503	0.08

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
社債（つづき）				
ドイツ（つづき）				
1,600,000	EUR	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, FRN, 1.37%, 31/08/2081	1,520	0.05
3,400,000	EUR	Eurogrid GmbH, 1.11%, 15/05/2032	3,447	0.10
2,300,000	EUR	Hamburger Hochbahn AG, 0.13%, 24/02/2031	2,215	0.07
4,500,000	EUR	ING-DiBa AG, 0.01%, 07/10/2028	4,425	0.13
2,100,000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.13%, 27/06/2023 ¹	2,114	0.06
3,000,000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 24/05/2024	3,017	0.09
2,400,000	GBP	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 1.50%, 03/02/2025	2,833	0.09
1,400,000	GBP	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 1.13%, 08/12/2025	1,623	0.05
2,300,000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.38%, 29/07/2026	2,281	0.07
2,300,000	EUR	Landesbank Baden-Wuerttemberg, 0.25%, 21/07/2028 ¹	2,207	0.07
2,500,000	EUR	Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, 0.38%, 04/06/2029 ¹	2,403	0.07
1,900,000	AUD	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.40%, 23/09/2024	1,164	0.04
9,100,000	EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 22/09/2027 ¹	9,039	0.27
4,300,000	EUR	Landwirtschaftliche Rentenbank, 0.00%, 30/06/2031	4,174	0.13
4,550,000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 10/09/2030 ¹	4,553	0.14
4,650,000	EUR	Mercedes-Benz Group AG, 0.75%, 11/03/2033 ¹	4,550	0.14
2,500,000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.25%, 13/12/2023	2,521	0.08
1,100,000	CHF	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.25%, 18/09/2028	1,037	0.03
2,500,000	EUR	Muenchener Hypothekenbank eG, 0.38%, 09/03/2029 ¹	2,420	0.07
2,600,000	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, FRN, 1.00%, 26/05/2042 ¹	2,400	0.07
500,000	EUR	Norddeutsche Landesbank-Girozentrale, 0.01%, 23/09/2026	496	0.02
2,100,000	EUR	NRW Bank, 0.88%, 10/11/2025	2,161	0.07
2,300,000	EUR	NRW Bank, 0.38%, 17/11/2026 ¹	2,322	0.07
2,000,000	EUR	NRW Bank, 0.50%, 13/09/2027	2,030	0.06
2,100,000	EUR	NRW Bank, 0.75%, 30/06/2028	2,164	0.07
2,250,000	EUR	NRW Bank, 0.63%, 02/02/2029	2,300	0.07
2,200,000	EUR	NRW Bank, 0.00%, 15/10/2029	2,145	0.07
2,400,000	EUR	NRW Bank, 0.00%, 18/02/2030	2,337	0.07
1,900,000	EUR	NRW Bank, 0.00%, 03/02/2031 ¹	1,834	0.06
2,300,000	EUR	NRW Bank, 0.00%, 28/07/2031	2,214	0.07
493,000	EUR	NRW Bank, 0.25%, 26/01/2032	486	0.01
3,300,000	EUR	RWE AG, 0.50%, 26/11/2028 ¹	3,251	0.10
2,225,000	EUR	RWE AG, 0.63%, 11/06/2031 ¹	2,135	0.07
2,900,000	EUR	RWE AG, 1.00%, 26/11/2033 ¹	2,815	0.09
2,000,000	EUR	Talanx AG, FRN, 1.75%, 01/12/2042 ¹	1,940	0.06
1,000,000	EUR	UniCredit Bank AG, 0.01%, 28/09/2026	993	0.03
2,800,000	EUR	Vonovia SE, REIT, 0.63%, 24/03/2031	2,674	0.08
		ドイツ合計	182,442	5.54
ガーンジー（2021年7月31日：0.09%）				
1,925,000	EUR	Globalworth Real Estate Investments Ltd., REIT, 2.95%, 29/07/2026	2,004	0.06
		ガーンジー合計	2,004	0.06
香港（2021年7月31日：0.39%）				
1,300,000	USD	Airport Authority, 1.75%, 12/01/2027	1,147	0.04
2,700,000	USD	CGNPC International Ltd., 2.75%, 02/07/2024 ¹	2,442	0.08
2,350,000	EUR	CGNPC International Ltd., 1.63%, 11/12/2024	2,417	0.07
2,200,000	EUR	CGNPC International Ltd., 2.00%, 11/09/2025	2,298	0.07
1,600,000	USD	CMB International Leasing Management Ltd., 1.25%, 16/09/2024	1,389	0.04
930,000	USD	CMB International Leasing Management Ltd., 1.75%, 16/09/2026	795	0.02
3,000,000	USD	ICBCIL Finance Co. Ltd., 2.25%, 02/11/2026	2,622	0.08
3,500,000	USD	MTR Corp. Ltd., 1.63%, 19/08/2030	2,951	0.09
500,000	USD	Pingan Real Estate Capital Ltd., 3.45%, 29/07/2026	409	0.01
600,000	USD	Swire Properties MTN Financing Ltd., REIT, 3.50%, 10/01/2028 ¹	566	0.02
2,000,000	USD	Xiaomi Best Time International Ltd., 4.10%, 14/07/2051	1,737	0.05
		香港合計	18,773	0.57

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
社債 (つづき)				
		アイスランド (2021年7月31日: 0.06%)		
600,000	EUR	Landsbankinn HF, 0.75%, 25/05/2026 ¹	593	0.02
		アイスランド合計	593	0.02
		インド (2021年7月31日: 0.32%)		
3,000,000	USD	Indian Railway Finance Corp. Ltd., 3.84%, 13/12/2027 ¹	2,805	0.09
2,560,000	USD	Power Finance Corp. Ltd., 3.75%, 06/12/2027 ¹	2,350	0.07
2,000,000	EUR	Power Finance Corp. Ltd., 1.84%, 21/09/2028	1,975	0.06
1,975,000	USD	REC Ltd., 3.88%, 07/07/2027	1,811	0.05
2,550,000	USD	State Bank of India, 4.50%, 28/09/2023	2,370	0.07
		インド合計	11,311	0.34
		アイルランド (2021年7月31日: 0.47%)		
3,175,000	EUR	AIB Group plc, FRN, 0.50%, 17/11/2027	3,104	0.10
3,475,000	EUR	Bank of Ireland Group plc, FRN, 0.38%, 10/05/2027	3,384	0.10
3,425,000	EUR	ESB Finance DAC, 1.13%, 11/06/2030	3,501	0.11
825,000	EUR	ESB Finance DAC, 1.00%, 19/07/2034	820	0.02
2,300,000	EUR	Russian Railways, 2.20%, 23/05/2027	2,205	0.07
		アイルランド合計	13,014	0.40
		イタリア (2021年7月31日: 2.12%)		
1,850,000	EUR	A2A SpA, 1.00%, 16/07/2029	1,868	0.06
2,175,000	EUR	A2A SpA, 1.00%, 02/11/2033	2,087	0.06
1,375,000	EUR	ACEA SpA, 0.00%, 28/09/2025	1,359	0.04
2,750,000	EUR	ACEA SpA, 0.25%, 28/07/2030 ¹	2,581	0.08
1,375,000	EUR	Aeroporti di Roma SpA, 1.63%, 02/02/2029	1,399	0.04
3,675,000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.12%, 01/10/2030 ¹	3,753	0.11
2,750,000	EUR	Assicurazioni Generali SpA, 2.43%, 14/07/2031	2,824	0.09
2,500,000	EUR	Credit Agricole Italia SpA, 0.13%, 15/03/2033	2,384	0.07
2,400,000	EUR	ERG SpA, 1.88%, 11/04/2025	2,495	0.08
2,750,000	EUR	ERG SpA, 0.50%, 11/09/2027 ¹	2,691	0.08
2,125,000	EUR	ERG SpA, 0.88%, 15/09/2031 ¹	2,038	0.06
3,150,000	EUR	Ferrovie dello Stato Italiane SpA, 0.88%, 07/12/2023 ¹	3,207	0.10
1,000,000	EUR	Ferrovie dello Stato Italiane SpA, 1.13%, 09/07/2026	1,032	0.03
6,500,000	EUR	Ferrovie dello Stato Italiane SpA, 0.38%, 25/03/2028 ¹	6,395	0.20
1,900,000	EUR	Hera SpA, 0.88%, 05/07/2027	1,917	0.06
2,300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.88%, 27/06/2022	2,312	0.07
2,300,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 1.50%, 10/04/2024 ¹	2,365	0.07
5,600,000	EUR	Intesa Sanpaolo SpA, 0.75%, 16/03/2028	5,474	0.17
2,250,000	EUR	Iren SpA, 1.95%, 19/09/2025 ¹	2,360	0.07
2,300,000	EUR	Iren SpA, 1.50%, 24/10/2027	2,384	0.07
2,375,000	EUR	Iren SpA, 0.88%, 14/10/2029 ¹	2,340	0.07
2,125,000	EUR	Iren SpA, 0.25%, 17/01/2031 ¹	1,947	0.06
2,350,000	EUR	Leasys SpA, 0.00%, 22/07/2024	2,338	0.07
2,350,000	EUR	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA, 1.00%, 08/09/2027 ¹	2,352	0.07
4,550,000	EUR	UniCredit SpA, FRN, 0.80%, 05/07/2029	4,435	0.14
		イタリア合計	66,337	2.02
		日本 (2021年7月31日: 0.95%)		
2,000,000	USD	Central Nippon Expressway Co. Ltd., 0.89%, 10/12/2025 ¹	1,712	0.05
1,600,000	USD	Marubeni Corp., 1.58%, 17/09/2026 ¹	1,379	0.04
2,300,000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.68%, 26/01/2023	2,322	0.07
2,400,000	USD	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 2.53%, 13/09/2023	2,178	0.07
1,900,000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.98%, 09/10/2023	1,933	0.06
2,400,000	EUR	Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc., 0.85%, 19/07/2029	2,383	0.07
100,000,000	JPY	Mitsui Fudosan Co. Ltd., REIT, 0.09%, 12/09/2024	773	0.02
1,500,000	USD	Mitsui Fudosan Co. Ltd., REIT, 2.57%, 21/01/2032	1,337	0.04
2,300,000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.96%, 16/10/2024	2,346	0.07
2,275,000	EUR	Mizuho Financial Group, Inc., 0.21%, 07/10/2025	2,252	0.07
2,400,000	EUR	Nidec Corp., 0.05%, 30/03/2026	2,356	0.07

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券(つづき)				
社債(つづき)				
日本(つづき)				
4,000,000	USD	Norinchukin Bank (The), 2.08%, 22/09/2031	3,433	0.11
2,000,000	USD	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.51%, 12/01/2024	1,747	0.05
2,425,000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.47%, 30/05/2024	2,444	0.07
2,100,000	EUR	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 0.93%, 11/10/2024	2,142	0.07
1,760,000	USD	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., 2.47%, 14/01/2029	1,558	0.05
1,000,000	USD	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd., 1.55%, 25/03/2026	872	0.03
		日本合計	33,167	1.01
リヒテンシュタイン (2021年7月31日: 0.00%)				
2,625,000	EUR	Swiss Life Finance I Ltd., 0.50%, 15/09/2031	2,485	0.07
		リヒテンシュタイン合計	2,485	0.07
リトアニア (2021年7月31日: 0.12%)				
1,400,000	EUR	AB Ignitis Grupe, 2.00%, 14/07/2027 ¹	1,486	0.05
1,600,000	EUR	AB Ignitis Grupe, 1.88%, 10/07/2028	1,693	0.05
		リトアニア合計	3,179	0.10
ルクセンブルグ (2021年7月31日: 0.85%)				
2,000,000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 0.75%, 14/06/2028	1,929	0.06
2,375,000	EUR	Acef Holding SCA, REIT, 1.25%, 26/04/2030	2,311	0.07
1,000,000	EUR	AXA Logistics Europe Master SCA, REIT, 0.38%, 15/11/2026	976	0.03
700,000	EUR	AXA Logistics Europe Master SCA, REIT, 0.88%, 15/11/2029	673	0.02
475,000	EUR	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.63%, 20/04/2030	463	0.01
		CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan		
2,450,000	EUR	European Core Fund, 0.90%, 12/10/2029	2,366	0.07
3,400,000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, 2.75%, 12/05/2026	3,602	0.11
3,475,000	EUR	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 1.63%, 23/04/2027	3,467	0.11
1,825,000	GBP	CPI Property Group SA, REIT, FRN, 2.75%, 22/01/2028	2,136	0.07
1,875,000	EUR	Logicor Financing Sarl, REIT, 2.00%, 17/01/2034	1,828	0.06
1,300,000	EUR	NORD/LB Luxembourg SA Covered Bond Bank, 0.05%, 28/01/2025	1,293	0.04
450,000	EUR	P3 Group Sarl, REIT, 0.88%, 26/01/2026	446	0.01
425,000	EUR	P3 Group Sarl, REIT, 1.63%, 26/01/2029	420	0.01
1,375,000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 1.75%, 15/03/2028 ¹	1,453	0.04
2,000,000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 0.88%, 09/07/2029	1,980	0.06
1,110,000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 2.38%, 14/11/2030	1,220	0.04
2,025,000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 1.63%, 17/06/2032	2,065	0.06
2,300,000	EUR	Prologis International Funding II SA, REIT, 0.75%, 23/03/2033 ¹	2,134	0.06
2,100,000	EUR	Segro Capital Sarl, REIT, 0.50%, 22/09/2031 ¹	1,977	0.06
2,080,000	EUR	SELP Finance Sarl, REIT, 0.88%, 27/05/2029 ¹	2,000	0.06
		ルクセンブルグ合計	34,739	1.05
オランダ (2021年7月31日: 9.53%)				
1,650,000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.63%, 31/05/2022	1,656	0.05
3,600,000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.88%, 22/04/2025	3,679	0.11
3,675,000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 15/04/2026	3,702	0.11
4,100,000	EUR	ABN AMRO Bank NV, 0.50%, 23/09/2029 ¹	3,936	0.12
5,000,000	USD	ABN AMRO Bank NV, FRN, 2.47%, 13/12/2029	4,321	0.13
1,100,000	EUR	Alliander NV, 0.88%, 22/04/2026	1,125	0.03
1,925,000	EUR	Alliander NV, 0.38%, 10/06/2030 ¹	1,880	0.06
1,450,000	EUR	Alliander NV, 0.88%, 24/06/2032	1,456	0.04
1,800,000	EUR	Citycon Treasury BV, REIT, 1.63%, 12/03/2028 ¹	1,701	0.05
3,400,000	EUR	Cooperatieve Rabobank UA, 0.25%, 30/10/2026	3,368	0.10
4,800,000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 1.00%, 24/09/2026	4,101	0.12
4,500,000	USD	Cooperatieve Rabobank UA, FRN, 1.11%, 24/02/2027	3,832	0.12
1,900,000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/11/2023	1,917	0.06
2,475,000	EUR	CTP NV, REIT, 0.50%, 21/06/2025 ¹	2,443	0.07
4,000,000	EUR	CTP NV, REIT, 0.88%, 20/01/2026	3,971	0.12
2,475,000	EUR	CTP NV, REIT, 0.63%, 27/09/2026	2,411	0.07
2,375,000	EUR	CTP NV, REIT, 0.75%, 18/02/2027 ¹	2,291	0.07

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
社債（つづき）				
		オランダ（つづき）		
2,000,000	EUR	CTP NV, REIT, 1.25%, 21/06/2029	1,923	0.06
2,250,000	EUR	CTP NV, REIT, 1.50%, 27/09/2031	2,129	0.06
2,300,000	EUR	de Volksbank NV, 0.01%, 16/09/2024	2,296	0.07
1,300,000	EUR	de Volksbank NV, 0.25%, 22/06/2026	1,274	0.04
2,700,000	EUR	de Volksbank NV, 0.38%, 03/03/2028	2,595	0.08
2,700,000	EUR	de Volksbank NV, FRN, 1.75%, 22/10/2030	2,760	0.08
2,700,000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 0.63%, 15/07/2025	2,706	0.08
3,900,000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.50%, 15/03/2030	3,928	0.12
3,375,000	EUR	Digital Dutch Finco BV, REIT, 1.00%, 15/01/2032	3,160	0.10
4,475,000	EUR	Digital Intrepid Holding BV, REIT, 0.63%, 15/07/2031	4,081	0.12
3,850,000	EUR	E.ON International Finance BV, 1.25%, 19/10/2027	4,007	0.12
2,550,000	EUR	EDP Finance BV, 1.88%, 13/10/2025	2,698	0.08
2,700,000	EUR	EDP Finance BV, 0.38%, 16/09/2026	2,686	0.08
5,400,000	USD	EDP Finance BV, 1.71%, 24/01/2028	4,528	0.14
2,425,000	EUR	EnBW International Finance BV, 1.88%, 31/10/2033	2,601	0.08
5,250,000	EUR	Enel Finance International NV, 1.00%, 16/09/2024	5,365	0.16
4,525,000	EUR	Enel Finance International NV, 1.50%, 21/07/2025	4,698	0.14
5,650,000	EUR	Enel Finance International NV, 1.13%, 16/09/2026	5,794	0.18
2,300,000	EUR	Enexis Holding NV, 0.63%, 17/06/2032	2,245	0.07
2,325,000	EUR	Enexis Holding NV, 0.38%, 14/04/2033 ¹	2,191	0.07
3,200,000	EUR	Global Switch Finance BV, 1.38%, 07/10/2030	3,100	0.09
3,000,000	EUR	Iberdrola International BV, 0.38%, 15/09/2025	3,021	0.09
4,800,000	EUR	Iberdrola International BV, 1.13%, 21/04/2026 ¹	4,978	0.15
4,600,000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.88%, 22/02/2023 ²	4,666	0.14
3,300,000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 2.63%, 26/03/2024 ²	3,434	0.11
3,600,000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 3.25%, 11/12/2024 ²	3,821	0.12
4,500,000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.45%, 11/09/2026 ²	4,416	0.13
4,600,000	EUR	Iberdrola International BV, FRN, 1.83%, 08/09/2029 ^{1/2}	4,462	0.14
6,950,000	USD	ING Groep NV, 4.63%, 06/01/2026	6,768	0.21
6,600,000	EUR	ING Groep NV, 2.50%, 15/11/2030 ¹	7,400	0.23
4,500,000	USD	ING Groep NV, FRN, 1.40%, 01/07/2026	3,908	0.12
3,200,000	GBP	ING Groep NV, FRN, 1.12%, 07/12/2028	3,578	0.11
2,700,000	EUR	ING Groep NV, FRN, 0.88%, 09/06/2032 ¹	2,623	0.08
2,250,000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 1.38%, 07/03/2024	2,308	0.07
2,550,000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 3.50%, 09/04/2025	2,796	0.09
4,550,000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 23/02/2026	4,473	0.14
4,325,000	EUR	LeasePlan Corp. NV, 0.25%, 07/09/2026	4,220	0.13
2,200,000	EUR	Nationale-Neder landen Bank NV (The) Netherlands, 0.50%, 21/09/2028	2,142	0.07
3,900,000	EUR	Naturgy Finance BV, 0.88%, 15/05/2025	3,983	0.12
2,275,000	EUR	NE Property BV, REIT, 3.38%, 14/07/2027 ¹	2,455	0.07
500,000	EUR	NE Property BV, REIT, 2.00%, 20/01/2030	488	0.01
4,200,000	USD	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 2.75%, 20/02/2024	3,856	0.12
3,500,000	USD	Nederlandse Waterschapsbank NV, 3.13%, 05/12/2022	3,181	0.10
2,900,000	SEK	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.70%, 25/01/2023	279	0.01
4,100,000	EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 1.00%, 03/09/2025 ¹	4,240	0.13
5,610,000	USD	Nederlandse Waterschapsbank NV, 2.38%, 24/03/2026	5,146	0.15
2,400,000	EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.00%, 02/10/2034 ¹	2,243	0.07
2,811,000	EUR	Nederlandse Waterschapsbank NV, 0.50%, 26/04/2051	2,729	0.08
3,500,000	EUR	NIBC Bank NV, 0.25%, 09/09/2026	3,407	0.10
1,325,000	EUR	PostNL NV, 0.63%, 23/09/2026	1,332	0.04
1,350,000	EUR	Ren Finance BV, 0.50%, 16/04/2029	1,319	0.04
2,925,000	EUR	Royal Schiphol Group NV, 2.00%, 06/04/2029 ¹	3,175	0.10
2,400,000	EUR	Royal Schiphol Group NV, 1.50%, 05/11/2030	2,535	0.08
2,300,000	EUR	Royal Schiphol Group NV, 0.88%, 08/09/2032 ¹	2,233	0.07
950,000	EUR	Stedin Holding NV, 0.00%, 16/11/2026 ¹	930	0.03
2,225,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.75%, 26/06/2025 ¹	2,265	0.07

1,900,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.00%, 13/06/2026 ¹	1,951	0.06
2,925,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.13%, 09/12/2027	2,861	0.09
2,300,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.38%, 05/06/2028	2,411	0.07

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
社債 (つづき)				
オランダ (つづき)				
2,700,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.38%, 26/06/2029	2,829	0.09
2,050,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.88%, 03/06/2030	2,067	0.06
2,175,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.50%, 09/06/2031	2,110	0.06
2,750,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.13%, 30/11/2032 ¹	2,514	0.08
2,350,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.25%, 24/10/2033	2,410	0.07
3,375,000	EUR	TenneT Holding BV, 2.00%, 05/06/2034 ¹	3,714	0.11
3,950,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.88%, 16/06/2035	3,802	0.12
2,300,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.88%, 13/06/2036 ¹	2,484	0.08
3,675,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.50%, 03/06/2039	3,769	0.11
3,995,000	EUR	TenneT Holding BV, 0.50%, 30/11/2040 ¹	3,436	0.10
2,725,000	EUR	TenneT Holding BV, 1.13%, 09/06/2041	2,605	0.08
2,500,000	EUR	TenneT Holding BV, FRN, 1.75%, 04/06/2027 ¹	2,673	0.08
1,950,000	EUR	Vesteda Finance BV, REIT, 1.50%, 24/05/2027 ¹	2,028	0.06
2,600,000	EUR	Vesteda Finance BV, REIT, 0.75%, 18/10/2031	2,522	0.08
2,600,000	EUR	VIA Outlets BV, REIT, 1.75%, 15/11/2028	2,550	0.08
5,200,000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 0.88%, 22/09/2028 ¹	5,201	0.16
3,400,000	EUR	Volkswagen International Finance NV, 1.25%, 23/09/2032 ¹	3,440	0.10
2,175,000	EUR	Wabtec Transportation Netherlands BV, 1.25%, 03/12/2027	2,161	0.07
		オランダ合計	288,903	8.78
ノルウェー (2021年7月31日: 1.55%)				
1,550,000	EUR	DNB Bank ASA, FRN, 0.38%, 18/01/2028	1,538	0.05
33,000,000	SEK	DNB Boligkreditt A/S, 0.75%, 31/01/2024	3,179	0.10
6,300,000	EUR	DNB Boligkreditt A/S, 0.63%, 19/06/2025 ¹	6,414	0.19
6,800,000	EUR	DNB Boligkreditt A/S, 0.01%, 21/01/2031 ¹	6,550	0.20
2,000,000	EUR	Eika Boligkreditt A/S, 0.13%, 16/06/2031	1,936	0.06
4,175,000	EUR	SpareBank 1 Boligkreditt A/S, 0.50%, 30/01/2025	4,231	0.13
4,700,000	EUR	SpareBank 1 Boligkreditt A/S, 0.01%, 22/09/2027	4,634	0.14
2,100,000	EUR	Sparebank 1 Oestlandet, 0.13%, 03/03/2028 ¹	2,030	0.06
825,000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, 0.25%, 09/11/2026	813	0.02
1,275,000	EUR	SpareBank 1 SR-Bank ASA, FRN, 0.38%, 15/07/2027 ¹	1,248	0.04
2,300,000	EUR	Sparebanken Soer Boligkreditt A/S, 0.01%, 26/10/2026 ¹	2,277	0.07
2,500,000	EUR	Sparebanken Vest Boligkreditt A/S, 0.01%, 11/11/2026	2,475	0.08
2,800,000	EUR	Sparebanken Vest Boligkreditt A/S, 0.01%, 28/06/2027	2,763	0.08
2,550,000	EUR	SR-Boligkreditt A/S, 0.01%, 08/10/2026	2,524	0.08
1,600,000	EUR	Storebrand Livsforsikring A/S, FRN, 1.88%, 30/09/2051 ¹	1,502	0.04
		ノルウェー合計	44,114	1.34
フィリピン (2021年7月31日: 0.03%)				
1,000,000	USD	Bank of the Philippine Islands, 2.50%, 10/09/2024	911	0.03
		フィリピン合計	911	0.03
ポーランド (2021年7月31日: 0.03%)				
2,000,000	EUR	mBank SA, FRN, 0.97%, 21/09/2027	1,940	0.06
		ポーランド合計	1,940	0.06
ポルトガル (2021年7月31日: 0.14%)				
3,100,000	EUR	EDP - Energias de Portugal SA, 1.63%, 15/04/2027	3,254	0.10
		ポルトガル合計	3,254	0.10
シンガポール (2021年7月31日: 0.05%)				
1,500,000	USD	Vena Energy Capital Pte. Ltd., 3.13%, 26/02/2025	1,351	0.04
		シンガポール合計	1,351	0.04
スロバキア (2021年7月31日: 0.05%)				
1,500,000	EUR	Tatra Banka A/S, FRN, 0.50%, 23/04/2028	1,439	0.04
		スロバキア合計	1,439	0.04

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券（つづき）				
社債（つづき）				
韓国（2021年7月31日：0.87%）				
2,550,000	CHF	Hyundai Capital Services, Inc., 0.75%, 06/07/2023	2,469	0.08
500,000	USD	Hyundai Capital Services, Inc., 1.25%, 08/02/2026	427	0.01
1,000,000	USD	Kia Corp., 1.00%, 16/04/2024	877	0.03
1,000,000	USD	Kia Corp., 1.75%, 16/10/2026 ¹	868	0.03
500,000	EUR	Kookmin Bank, 0.05%, 19/10/2026	494	0.01
4,000,000	USD	Korea Development Bank (The), 0.40%, 19/06/2024 ¹	3,481	0.11
2,310,000	EUR	Korea Development Bank (The), 0.00%, 10/07/2024	2,307	0.07
1,500,000	USD	Korea Development Bank (The), 0.75%, 25/01/2025	1,302	0.04
1,750,000	USD	Korea Electric Power Corp., 2.50%, 24/06/2024	1,596	0.05
2,400,000	USD	Korea Electric Power Corp., 1.13%, 15/06/2025	2,089	0.06
1,600,000	USD	Korea Electric Power Corp., 1.13%, 24/09/2026	1,371	0.04
2,700,000	USD	Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd., 3.75%, 25/07/2023	2,491	0.08
2,100,000	EUR	LG Chem Ltd., 0.50%, 15/04/2023	2,110	0.06
2,250,000	USD	LG Chem Ltd., 3.25%, 15/10/2024	2,083	0.06
2,900,000	USD	LG Chem Ltd., 3.63%, 15/04/2029	2,766	0.08
1,000,000	USD	Mirae Asset Securities Co. Ltd., 1.38%, 07/07/2024	876	0.03
		韓国合計	27,607	0.84
スペイン（2021年7月31日：3.04%）				
2,000,000	EUR	Abanca Corp. Bancaria SA, FRN, 0.50%, 08/09/2027	1,934	0.06
2,100,000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 0.38%, 07/10/2027 ¹	2,045	0.06
300,000	EUR	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1.38%, 26/01/2032 ¹	301	0.01
2,900,000	EUR	Adif Alta Velocidad, 0.80%, 05/07/2023	2,946	0.09
2,700,000	EUR	Adif Alta Velocidad, 1.25%, 04/05/2026	2,823	0.09
2,900,000	EUR	Adif Alta Velocidad, 0.95%, 30/04/2027	2,996	0.09
2,700,000	EUR	Adif Alta Velocidad, 0.55%, 30/04/2030	2,683	0.08
2,300,000	EUR	Adif Alta Velocidad, 0.55%, 31/10/2031	2,233	0.07
4,200,000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.38%, 14/05/2025 ¹	4,326	0.13
4,600,000	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 1.00%, 21/06/2026	4,663	0.14
2,400,000	EUR	Banco de Sabadell SA, FRN, 1.12%, 11/03/2027	2,415	0.07
4,400,000	EUR	Banco Santander SA, 0.30%, 04/10/2026	4,350	0.13
4,600,000	EUR	Banco Santander SA, 1.13%, 23/06/2027	4,651	0.14
4,800,000	EUR	Banco Santander SA, FRN, 0.63%, 24/06/2029 ¹	4,653	0.14
3,400,000	EUR	Bankinter SA, 0.63%, 06/10/2027	3,328	0.10
4,700,000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.38%, 18/11/2026	4,632	0.14
2,000,000	GBP	CaixaBank SA, FRN, 1.50%, 03/12/2026	2,311	0.07
4,200,000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 0.50%, 09/02/2029	4,032	0.12
4,700,000	EUR	CaixaBank SA, FRN, 1.25%, 18/06/2031	4,622	0.14
3,400,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2024	3,468	0.11
4,000,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.00%, 07/03/2025	4,101	0.12
4,000,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 0.88%, 16/06/2025	4,088	0.12
3,400,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 28/10/2026	3,549	0.11
3,400,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, 1.25%, 13/09/2027 ¹	3,572	0.11
3,300,000	EUR	Iberdrola Finanzas SA, FRN, 1.58%, 16/11/2027 ²	3,209	0.10
2,000,000	EUR	Kutxabank SA, FRN, 0.50%, 14/10/2027	1,957	0.06
1,800,000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.75%, 22/07/2026 ¹	1,820	0.06
1,300,000	EUR	Lar Espana Real Estate Socimi SA, REIT, 1.84%, 03/11/2028	1,291	0.04
3,300,000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.38%, 24/07/2028 ¹	3,296	0.10
2,600,000	EUR	Red Electrica Financiaciones SAU, 0.50%, 24/05/2033 ¹	2,534	0.08
		スペイン合計	94,829	2.88
スウェーデン（2021年7月31日：1.13%）				
6,000,000	SEK	Landshypotek Bank AB, 0.75%, 25/05/2023	578	0.02
20,000,000	SEK	Landshypotek Bank AB, 0.62%, 18/11/2025	1,893	0.06
2,500,000	EUR	SBAB Bank AB, 0.50%, 13/05/2025	2,526	0.08
2,050,000	EUR	SBAB Bank AB, 0.13%, 27/08/2026 ¹	2,020	0.06
350,000	EUR	SBAB Bank AB, 0.50%, 08/02/2027	349	0.01
2,400,000	EUR	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0.30%, 17/02/2022	2,401	0.07
2,275,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.38%, 03/07/2023 ¹	2,294	0.07

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
社債 (つづき)				
スウェーデン (つづき)				
2,300,000	EUR	Svenska Handelsbanken AB, 0.01%, 02/12/2027	2,213	0.07
4,000,000	SEK	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB, 0.75%, 28/03/2024	386	0.01
2,150,000	EUR	Swedbank AB, 0.25%, 07/11/2022	2,162	0.07
5,000,000	USD	Swedbank AB, 1.54%, 16/11/2026	4,348	0.13
4,275,000	EUR	Swedbank AB, FRN, 0.30%, 20/05/2027 ¹	4,194	0.13
1,875,000	GBP	Swedbank AB, FRN, 1.37%, 08/12/2027	2,162	0.06
2,700,000	EUR	Vattenfall AB, 0.05%, 15/10/2025 ¹	2,675	0.08
1,900,000	EUR	Vattenfall AB, 0.50%, 24/06/2026 ¹	1,910	0.06
2,200,000	EUR	Vattenfall AB, 0.13%, 12/02/2029 ¹	2,108	0.06
		スウェーデン合計	34,219	1.04
スイス (2021年7月31日: 0.10%)				
2,425,000	EUR	Credit Suisse AG, 0.45%, 19/05/2025	2,430	0.07
2,350,000	EUR	UBS AG, 0.01%, 29/06/2026	2,303	0.07
		スイス合計	4,733	0.14
アラブ首長国連邦 (2021年7月31日: 0.00%)				
1,500,000	USD	Sweihaan PV Power Co. PJSC, 3.63%, 31/01/2049	1,290	0.04
		アラブ首長国連邦合計	1,290	0.04
イギリス (2021年7月31日: 1.96%)				
1,350,000	GBP	Aster Treasury plc, REIT, 1.41%, 27/01/2036	1,439	0.04
2,350,000	EUR	Barclays plc, FRN, 0.63%, 14/11/2023	2,364	0.07
1,873,000	GBP	Barclays plc, FRN, 1.70%, 03/11/2026	2,190	0.07
1,350,000	GBP	Bazalgette Finance plc, 2.38%, 29/11/2027	1,658	0.05
1,650,000	GBP	Berkeley Group plc (The), 2.50%, 11/08/2031	1,838	0.06
1,875,000	GBP	Canary Wharf Group Investment Holdings plc, REIT, 2.63%, 23/04/2025	2,227	0.07
1,350,000	EUR	Canary Wharf Group Investment Holdings plc, REIT, 1.75%, 07/04/2026 ¹	1,353	0.04
1,625,000	GBP	Canary Wharf Group Investment Holdings plc, REIT, 3.38%, 23/04/2028	1,914	0.06
1,300,000	GBP	Clarion Funding plc, REIT, 1.25%, 13/11/2032	1,415	0.04
1,700,000	GBP	Clarion Funding plc, REIT, 1.88%, 22/01/2035	1,929	0.06
1,200,000	GBP	Clarion Funding plc, REIT, 1.88%, 07/09/2051	1,255	0.04
1,000,000	GBP	Derwent London plc, REIT, 1.88%, 17/11/2031	1,135	0.04
1,299,033	GBP	Greater Gabbard OFTO plc, 4.14%, 29/11/2032	1,730	0.05
1,371,304	GBP	Gwynt y Mor OFTO plc, 2.78%, 17/02/2034 ¹	1,661	0.05
1,300,000	EUR	Hitachi Capital UK plc, 0.00%, 29/10/2024	1,287	0.04
5,725,000	EUR	HSBC Holdings plc, FRN, 1.50%, 04/12/2024	5,871	0.18
1,100,000	GBP	Just Group plc, FRN, 7.00%, 15/04/2031	1,470	0.05
2,450,000	EUR	National Grid Electricity Transmission plc, 0.19%, 20/01/2025	2,443	0.07
475,000	EUR	National Grid plc, 0.25%, 01/09/2028	459	0.01
1,100,000	USD	NatWest Group plc, FRN, 2.36%, 22/05/2024	989	0.03
1,500,000	GBP	NatWest Group plc, FRN, 2.06%, 09/11/2028	1,751	0.05
1,650,000	GBP	Northern Powergrid Northeast plc, 1.88%, 16/06/2062	1,684	0.05
1,000,000	GBP	Notting Hill Genesis, REIT, 2.00%, 03/06/2036	1,135	0.04
1,800,000	GBP	Paragon Treasury plc, REIT, 2.00%, 07/05/2036	2,057	0.06
1,000,000	GBP	Platform HG Financing plc, REIT, 1.93%, 15/09/2041	1,110	0.03
1,300,000	GBP	Scottish Hydro Electric Transmission plc, 1.50%, 24/03/2028	1,494	0.05
1,700,000	GBP	Scottish Hydro Electric Transmission plc, 2.25%, 27/09/2035	1,950	0.06
1,150,000	GBP	Scottish Hydro Electric Transmission plc, 2.13%, 24/03/2036	1,304	0.04
2,900,000	EUR	SSE plc, 0.88%, 06/09/2025	2,947	0.09
2,950,000	EUR	SSE plc, 1.38%, 04/09/2027 ¹	3,070	0.09
700,000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 0.88%, 31/01/2028	696	0.02
600,000	EUR	Thames Water Utilities Finance plc, 1.25%, 31/01/2032	589	0.02
1,150,000	GBP	Tritax Big Box REIT plc, REIT, 1.50%, 27/11/2033	1,245	0.04
2,000,000	EUR	Tritax EuroBox plc, REIT, FRN, 0.95%, 02/06/2026	1,979	0.06
1,600,000	GBP	United Utilities Water Finance plc, 0.88%, 28/10/2029	1,765	0.05
1,400,000	GBP	Workspace Group plc, REIT, 2.25%, 11/03/2028	1,615	0.05
		イギリス合計	63,018	1.92

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券(つづき)				
社債(つづき)				
米国 (2021年7月31日: 9.17%)				
4,100,000	USD	AES Corp. (The), 1.38%, 15/01/2026	3,500	0.11
4,000,000	USD	AES Corp. (The), 2.45%, 15/01/2031	3,364	0.10
850,000	USD	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT, 3.80%, 15/04/2026	810	0.02
4,425,000	USD	Alexandria Real Estate Equities, Inc., REIT, 2.00%, 18/05/2032	3,660	0.11
4,785,000	USD	Apple, Inc., 2.85%, 23/02/2023	4,344	0.13
7,090,000	USD	Apple, Inc., 3.00%, 20/06/2027	6,629	0.20
2,400,000	USD	Arizona Public Service Co., 2.65%, 15/09/2050	1,813	0.05
3,000,000	USD	AvalonBay Communities, Inc., REIT, 1.90%, 01/12/2028	2,574	0.08
1,670,000	USD	AvalonBay Communities, Inc., REIT, 2.05%, 15/01/2032	1,411	0.04
2,480,000	USD	Avangrid, Inc., 3.15%, 01/12/2024	2,278	0.07
4,250,000	USD	Avangrid, Inc., 3.20%, 15/04/2025	3,921	0.12
3,100,000	USD	Avangrid, Inc., 3.80%, 01/06/2029	2,959	0.09
9,600,000	USD	Bank of America Corp., FRN, 2.46%, 22/10/2025	8,638	0.26
5,900,000	USD	Boston Properties LP, REIT, 4.50%, 01/12/2028	5,817	0.18
5,500,000	USD	Boston Properties LP, REIT, 3.40%, 21/06/2029	5,074	0.15
2,000,000	USD	Boston Properties LP, REIT, 2.55%, 01/04/2032	1,717	0.05
2,000,000	USD	Boston Properties LP, REIT, 2.45%, 01/10/2033	1,662	0.05
7,000,000	USD	Citigroup, Inc., FRN, 1.68%, 15/05/2024	6,268	0.19
2,700,000	USD	Consolidated Edison Co. of New York, Inc., 3.35%, 01/04/2030	2,529	0.08
4,950,000	USD	Consolidated Edison Co. of New York, Inc., 3.95%, 01/04/2050	4,798	0.15
2,000,000	USD	Consolidated Edison Co. of New York, Inc., 3.60%, 15/06/2061	1,780	0.05
4,375,000	EUR	Digital Euro Finco LLC, REIT, 2.50%, 16/01/2026	4,667	0.14
3,530,000	USD	Dominion Energy, Inc., 2.25%, 15/08/2031	2,994	0.09
3,000,000	USD	DTE Electric Co., 1.90%, 01/04/2028	2,600	0.08
2,200,000	USD	DTE Electric Co., 4.05%, 15/05/2048	2,248	0.07
2,920,000	USD	DTE Electric Co., 3.95%, 01/03/2049	2,933	0.09
2,000,000	USD	DTE Electric Co., 3.25%, 01/04/2051	1,812	0.05
1,000,000	USD	Duke Energy Carolinas LLC, 3.35%, 15/05/2022	899	0.03
2,265,000	USD	Duke Energy Carolinas LLC, 3.95%, 15/11/2028	2,204	0.07
3,845,000	USD	Duke Energy Florida LLC, 2.50%, 01/12/2029	3,419	0.10
4,550,000	USD	Duke Energy Progress LLC, 3.45%, 15/03/2029	4,290	0.13
1,350,000	USD	Duke Realty LP, REIT, 2.88%, 15/11/2029	1,227	0.04
3,500,000	USD	Duke Realty LP, REIT, 1.75%, 01/02/2031	2,872	0.09
1,000,000	USD	Duke Realty LP, REIT, 2.25%, 15/01/2032	848	0.03
3,000,000	USD	Equinix, Inc., REIT, 1.00%, 15/09/2025	2,563	0.08
2,150,000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 0.25%, 15/03/2027	2,082	0.06
5,500,000	USD	Equinix, Inc., REIT, 1.55%, 15/03/2028	4,590	0.14
2,885,000	USD	Equinix, Inc., REIT, 2.50%, 15/05/2031	2,462	0.07
2,650,000	EUR	Equinix, Inc., REIT, 1.00%, 15/03/2033	2,480	0.08
2,350,000	USD	ERP Operating LP, REIT, 4.15%, 01/12/2028	2,309	0.07
2,250,000	USD	ERP Operating LP, REIT, 1.85%, 01/08/2031	1,885	0.06
455,000	USD	Energy Kansas Central, Inc., 2.55%, 01/07/2026	414	0.01
2,000,000	USD	Federal Realty Investment Trust, REIT, 1.25%, 15/02/2026	1,720	0.05
2,000,000	USD	Fifth Third Bancorp, FRN, 1.71%, 01/11/2027	1,729	0.06
790,000	USD	Georgia Power Co., 3.25%, 01/04/2026	732	0.02
1,400,000	USD	Hanwha Energy USA Holdings Corp., 2.38%, 30/07/2022	1,255	0.04
2,000,000	USD	Healthpeak Properties, Inc., REIT, 1.35%, 01/02/2027	1,708	0.05
2,530,000	USD	Healthpeak Properties, Inc., REIT, 2.13%, 01/12/2028	2,203	0.07
2,000,000	USD	Host Hotels & Resorts LP, REIT, 3.38%, 15/12/2029	1,777	0.05
1,200,000	USD	Host Hotels & Resorts LP, REIT, 2.90%, 15/12/2031	1,007	0.03
4,000,000	USD	Host Hotels & Resorts LP, REIT, FRN, 3.50%, 15/09/2030	3,547	0.11
1,450,000	USD	Interstate Power and Light Co., 4.10%, 26/09/2028	1,404	0.04
1,750,000	USD	Interstate Power and Light Co., 3.60%, 01/04/2029	1,657	0.05
950,000	USD	Interstate Power and Light Co., 3.50%, 30/09/2049	862	0.03
5,300,000	USD	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.65%, 16/09/2024	4,667	0.14
5,000,000	USD	JPMorgan Chase & Co., FRN, 0.77%, 09/08/2025	4,335	0.13
3,789,000	USD	Kaiser Foundation Hospitals, 3.15%, 01/05/2027	3,533	0.11
3,500,000	USD	Kaiser Foundation Hospitals, 2.81%, 01/06/2041	2,986	0.09
2,818,000	USD	Kilroy Realty LP, REIT, 4.75%, 15/12/2028	2,817	0.09
3,000,000	USD	Kilroy Realty LP, REIT, 2.50%, 15/11/2032	2,506	0.08

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
社債 (つづき)				
米国 (つづき)				
3,250,000	USD	Kimco Realty Corp., REIT, 2.70%, 01/10/2030	2,865	0.09
4,000,000	USD	Liberty Utilities Finance GP 1, 2.05%, 15/09/2030	3,326	0.10
1,503,000	USD	Massachusetts Institute of Technology, 3.96%, 01/07/2038	1,540	0.05
4,000,000	USD	Metropolitan Life Global Funding I, 0.95%, 02/07/2025	3,464	0.11
3,020,000	USD	MidAmerican Energy Co., 3.10%, 01/05/2027	2,820	0.09
4,200,000	USD	MidAmerican Energy Co., 3.65%, 15/04/2029	4,050	0.12
1,485,000	USD	MidAmerican Energy Co., 3.95%, 01/08/2047	1,465	0.04
4,390,000	USD	MidAmerican Energy Co., 3.65%, 01/08/2048	4,174	0.13
4,450,000	USD	MidAmerican Energy Co., 4.25%, 15/07/2049	4,631	0.14
3,950,000	USD	MidAmerican Energy Co., 3.15%, 15/04/2050	3,485	0.11
2,000,000	USD	MidAmerican Energy Co., 2.70%, 01/08/2052	1,626	0.05
4,510,000	USD	NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 1.90%, 15/06/2028	3,891	0.12
4,250,000	USD	Niagara Mohawk Power Corp., 1.96%, 27/06/2030	3,563	0.11
1,380,000	USD	Northern States Power Co., 2.25%, 01/04/2031	1,208	0.04
2,550,000	USD	Northern States Power Co., 2.90%, 01/03/2050	2,176	0.07
1,450,000	USD	Northern States Power Co., 2.60%, 01/06/2051	1,160	0.04
2,555,000	USD	Northern States Power Co., 3.20%, 01/04/2052	2,302	0.07
1,750,000	USD	NSTAR Electric Co., 3.25%, 15/05/2029	1,637	0.05
2,200,000	USD	NSTAR Electric Co., 3.95%, 01/04/2030	2,157	0.07
1,250,000	USD	NSTAR Electric Co., 3.10%, 01/06/2051	1,109	0.03
1,000,000	USD	Pacific Life Global Funding II, 1.38%, 14/04/2026	870	0.03
3,750,000	USD	PacifiCorp, 2.90%, 15/06/2052	3,106	0.09
2,500,000	USD	Piedmont Operating Partnership LP, REIT, 3.15%, 15/08/2030	2,225	0.07
3,815,000	USD	PNC Financial Services Group, Inc. (The), 2.20%, 01/11/2024	3,450	0.10
3,000,000	USD	Principal Life Global Funding II, 1.25%, 16/08/2026	2,566	0.08
2,575,000	EUR	Prologis Euro Finance LLC, REIT, 0.38%, 06/02/2028	2,509	0.08
4,300,000	USD	Prologis LP, REIT, 1.25%, 15/10/2030	3,456	0.10
3,700,000	USD	Prudential Financial, Inc., 1.50%, 10/03/2026	3,254	0.10
1,550,000	USD	Public Service Co. of Colorado, 3.70%, 15/06/2028	1,488	0.04
1,750,000	USD	Public Service Co. of Colorado, 4.10%, 15/06/2048	1,761	0.05
3,000,000	USD	Public Service Co. of Colorado, 3.20%, 01/03/2050	2,639	0.08
2,500,000	USD	Public Service Co. of Colorado, 2.70%, 15/01/2051	2,026	0.06
2,000,000	USD	Public Service Co. of Oklahoma, 2.20%, 15/08/2031	1,701	0.05
2,000,000	USD	Public Service Co. of Oklahoma, 3.15%, 15/08/2051	1,705	0.05
1,500,000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.13%, 13/07/2027	1,703	0.05
1,000,000	GBP	Realty Income Corp., REIT, 1.75%, 13/07/2033	1,114	0.03
2,250,000	USD	Rexford Industrial Realty LP, REIT, 2.15%, 01/09/2031	1,849	0.06
3,000,000	USD	Seattle Children's Hospital, 2.72%, 01/10/2050	2,529	0.08
600,000	USD	SK Battery America, Inc., 1.63%, 26/01/2024	527	0.02
4,000,000	USD	SK Battery America, Inc., 2.13%, 26/01/2026	3,440	0.10
1,444,602	USD	Solar Star Funding LLC, 5.38%, 30/06/2035	1,459	0.04
2,000,000	USD	Southern California Edison Co., 2.50%, 01/06/2031	1,743	0.05
1,000,000	USD	Southern California Edison Co., 3.65%, 01/06/2051	896	0.03
2,850,000	EUR	Southern Power Co., 1.00%, 20/06/2022	2,865	0.09
2,525,000	USD	Southern Power Co., 4.15%, 01/12/2025	2,399	0.07
2,500,000	USD	Southern Power Co., 0.90%, 15/01/2026	2,127	0.06
2,250,000	EUR	Southern Power Co., 1.85%, 20/06/2026	2,349	0.07
3,000,000	USD	Southwestern Electric Power Co., 3.25%, 01/11/2051	2,502	0.08
1,500,000	USD	Southwestern Public Service Co., 3.75%, 15/06/2049	1,448	0.04
3,400,000	USD	Southwestern Public Service Co., 3.15%, 01/05/2050	2,988	0.09
4,695,000	USD	Toyota Motor Credit Corp., 2.15%, 13/02/2030	4,102	0.12
2,160,000	USD	Tucson Electric Power Co., 1.50%, 01/08/2030	1,763	0.05
2,000,000	USD	UDR, Inc., REIT, 1.90%, 15/03/2033	1,592	0.05
3,750,000	USD	Union Electric Co., 2.63%, 15/03/2051	3,035	0.09
2,250,000	USD	Verizon Communications, Inc., 3.88%, 08/02/2029	2,163	0.07
5,495,000	USD	Verizon Communications, Inc., 1.50%, 18/09/2030	4,438	0.13
4,820,000	USD	Verizon Communications, Inc., 2.85%, 03/09/2041	4,014	0.12
1,000,000	USD	Vornado Realty LP, REIT, 2.15%, 01/06/2026	878	0.03
1,000,000	USD	Vornado Realty LP, REIT, 3.40%, 01/06/2031	888	0.03
2,575,000	USD	Welltower, Inc., REIT, 2.70%, 15/02/2027	2,350	0.07

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
社債 (つづき)				
米国 (つづき)				
2,555,000	USD	Wisconsin Power and Light Co., 1.95%, 16/09/2031	2,160	0.07
1,850,000	USD	Wisconsin Public Service Corp., 2.85%, 01/12/2051	1,525	0.05
2,000,000	USD	WP Carey, Inc., REIT, 2.45%, 01/02/2032	1,693	0.05
3,000,000	USD	Xylem, Inc., 1.95%, 30/01/2028	2,602	0.08
2,500,000	USD	Xylem, Inc., 2.25%, 30/01/2031	2,133	0.06
		米国合計	320,468	9.74
社債への投資合計				
			1,771,456	53.84
モーゲージ証券 (2021年7月31日: 0.01%)				
米国 (2021年7月31日: 0.01%)				
Federal National Mortgage Association, FRN, Series 2017-M15 'A2',				
370,000	USD	2.96%, 25/09/2027	349	0.01
		米国合計	349	0.01
モーゲージ証券への投資合計				
			349	0.01
国際機関債 (2021年7月31日: 9.10%)				
5,000,000	USD	Arab Petroleum Investments Corp., 1.48%, 06/10/2026	4,345	0.13
945,000	USD	Asian Development Bank, 1.88%, 10/08/2022	849	0.03
10,000,000	SEK	Asian Development Bank, 0.37%, 26/06/2023	958	0.03
5,100,000	AUD	Asian Development Bank, 2.45%, 17/01/2024	3,286	0.10
3,310,000	USD	Asian Development Bank, 2.13%, 19/03/2025	3,012	0.09
2,500,000	EUR	Asian Development Bank, 0.35%, 16/07/2025	2,527	0.08
4,500,000	CAD	Asian Development Bank, 0.75%, 10/02/2026	3,019	0.09
1,910,000	USD	Asian Development Bank, 1.75%, 14/08/2026	1,712	0.05
1,350,000	GBP	Asian Development Bank, 0.63%, 15/09/2026	1,563	0.05
2,855,000	USD	Asian Development Bank, 2.38%, 10/08/2027	2,631	0.08
5,350,000	USD	Asian Development Bank, 3.13%, 26/09/2028 ¹	5,169	0.16
3,900,000	EUR	Asian Development Bank, 0.00%, 24/10/2029	3,804	0.12
2,200,000	EUR	EUROFIMA, 0.25%, 09/02/2024 ¹	2,217	0.07
1,500,000	EUR	EUROFIMA, 0.00%, 28/07/2026	1,487	0.04
1,750,000	EUR	EUROFIMA, 0.01%, 23/06/2028	1,713	0.05
3,400,000	EUR	EUROFIMA, 0.10%, 20/05/2030 ¹	3,308	0.10
5,800,000	EUR	EUROFIMA, 0.15%, 10/10/2034 ¹	5,446	0.16
4,900,000	EUR	European Bank for Reconstruction & Development, 0.00%, 10/01/2024 ¹	4,923	0.15
3,000,000	SEK	European Bank for Reconstruction & Development, 0.48%, 18/01/2024	287	0.01
6,000,000	USD	European Bank for Reconstruction & Development, 1.50%, 13/02/2025	5,361	0.16
15,500,000	SEK	European Investment Bank, 0.50%, 19/07/2022	1,485	0.04
3,150,000	AUD	European Investment Bank, 2.70%, 12/01/2023	2,019	0.06
7,270,000	CAD	European Investment Bank, 2.38%, 18/01/2023	5,163	0.16
32,000,000	NOK	European Investment Bank, 0.63%, 24/04/2023	3,171	0.10
8,550,000	EUR	European Investment Bank, 0.50%, 15/11/2023 ¹	8,686	0.26
3,200,000	USD	European Investment Bank, 2.50%, 15/10/2024 ¹	2,941	0.09
7,825,000	GBP	European Investment Bank, 0.75%, 15/11/2024	9,213	0.28
3,859,000	AUD	European Investment Bank, 1.70%, 15/11/2024	2,443	0.07
2,500,000	CAD	European Investment Bank, 1.90%, 22/01/2025	1,763	0.05
20,000,000	SEK	European Investment Bank, 0.88%, 30/01/2025	1,924	0.06
3,450,000	CHF	European Investment Bank, 1.63%, 04/02/2025	3,496	0.11
6,880,000	USD	European Investment Bank, 2.88%, 13/06/2025 ¹	6,414	0.19
7,680,000	USD	European Investment Bank, 2.13%, 13/04/2026	6,993	0.22
5,700,000	EUR	European Investment Bank, 0.38%, 15/05/2026	5,799	0.18
9,450,000	EUR	European Investment Bank, 1.25%, 13/11/2026 ¹	10,016	0.30
16,000,000	SEK	European Investment Bank, 1.50%, 02/03/2027	1,575	0.05
3,090,000	USD	European Investment Bank, 2.38%, 24/05/2027 ¹	2,850	0.09

6,290,000 AUD

European Investment Bank, 0.75%, 15/07/2027

3,687

0.11

保有高	通貨	投資対象	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
債券 (つづき)				
国際機関債 (つづき)				
4,045,000	EUR	European Investment Bank, 0.00%, 15/11/2027	4,041	0.12
7,650,000	AUD	European Investment Bank, 3.30%, 03/02/2028	5,126	0.16
8,595,000	USD	European Investment Bank, 1.63%, 09/10/2029	7,557	0.23
662,000	EUR	European Investment Bank, 0.05%, 15/11/2029	657	0.02
14,060,000	SEK	European Investment Bank, 0.38%, 17/09/2030	1,257	0.04
12,500,000	USD	European Investment Bank, 0.75%, 23/09/2030	10,206	0.31
5,250,000	EUR	European Investment Bank, 0.01%, 15/11/2030	5,138	0.16
6,000,000	DKK	European Investment Bank, 0.00%, 14/11/2031	773	0.02
5,100,000	EUR	European Investment Bank, 1.13%, 15/11/2032 ¹	5,510	0.17
10,450,000	EUR	European Investment Bank, 0.01%, 15/11/2035	9,754	0.30
5,350,000	EUR	European Investment Bank, 0.50%, 13/11/2037 ¹	5,343	0.16
7,890,000	EUR	European Investment Bank, 1.00%, 14/11/2042	8,567	0.26
7,875,000	EUR	European Investment Bank, 1.50%, 15/11/2047	9,509	0.29
63,498,000	EUR	European Union, 0.40%, 04/02/2037 ¹	62,467	1.90
3,000,000	SEK	International Bank for Reconstruction & Development, 0.38%, 17/07/2023	287	0.01
2,380,000	USD	International Bank for Reconstruction & Development, 2.13%, 03/03/2025	2,167	0.07
7,245,000	USD	International Bank for Reconstruction & Development, 3.13%, 20/11/2025 ¹	6,834	0.21
3,550,000	AUD	International Bank for Reconstruction & Development, 2.90%, 26/11/2025	2,326	0.07
4,000,000	EUR	International Bank for Reconstruction & Development, 0.63%, 22/11/2027 ¹	4,110	0.12
3,495,000	USD	International Finance Corp., 2.00%, 24/10/2022 ¹	3,148	0.10
2,300,000	GBP	International Finance Corp., 1.25%, 15/12/2023	2,751	0.08
6,985,000	USD	International Finance Corp., 2.13%, 07/04/2026	6,352	0.19
2,000,000	EUR	Nordic Investment Bank, 0.38%, 19/09/2022	2,012	0.06
4,600,000	EUR	Nordic Investment Bank, 0.13%, 10/06/2024	4,630	0.14
2,450,000	EUR	Nordic Investment Bank, 0.50%, 03/11/2025	2,494	0.08
4,100,000	EUR	Nordic Investment Bank, 0.00%, 30/04/2027	4,078	0.12
8,000,000	DKK	Nordic Investment Bank, 0.13%, 28/01/2030	1,065	0.03
国際機関債への投資合計			315,414	9.59
債券への投資合計			3,250,025	98.78

詳細	取引相手方	満期日 (日-月-年)	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
先渡為替契約 ³				
Buy EUR 1,464,632; Sell AUD 2,285,000	RBC	02/02/2022	29	-
Buy JPY 484,370,000; Sell EUR 3,713,953	RBC	02/02/2022	36	-
未実現利益合計 (2021年7月31日: 0.00%) ⁴			65	-

クラスD米ドル投資証券

Buy CAD 20,093; Sell USD 15,756 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy CHF 3,375; Sell USD 3,624 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy CNY 134,411; Sell USD 21,030 ⁵	State Street	09/02/2022	-	-
Buy DKK 7,594; Sell USD 1,137 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy EUR 961,106; Sell USD 1,071,557	State Street	02/02/2022	5	-
Buy GBP 65,996; Sell USD 88,381 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy HKD 1,929; Sell USD 247 ⁵	State Street	07/02/2022	-	-
Buy JPY 985,163; Sell USD 8,517 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-

Buy NOK 121,114; Sell USD 13,478 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy SEK 262,169; Sell USD 27,991 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy SGD 3,316; Sell USD 2,448 ⁵	State Street	04/02/2022	-	-
Buy USD 16,179,415; Sell AUD 22,257,730	State Street	02/02/2022	446	0.01
Buy USD 30,560,647; Sell CAD 38,600,458	State Street	02/02/2022	188	0.01
Buy USD 2,174,818; Sell CHF 1,980,412	State Street	02/02/2022	42	-

詳細	取引相手方	満期日 (日-月-年)	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
先渡為替契約 ³ (つづき)				
クラスD米ドルヘッジ投資証券 (つづき)				
Buy USD 121,636; Sell CNY 773,385 ⁵	State Street	09/02/2022	-	-
Buy USD 684,496; Sell DKK 4,474,562	State Street	02/02/2022	9	-
Buy USD 644,079,166; Sell EUR 566,085,604	State Street	02/02/2022	8,475	0.25
Buy USD 53,352,364; Sell GBP 39,389,931	State Street	02/02/2022	452	0.01
Buy USD 370,138; Sell HKD 2,885,493 ⁵	State Street	07/02/2022	-	-
Buy USD 1,626,465; Sell JPY 187,230,035	State Street	02/02/2022	1	-
Buy USD 3,594,578; Sell NOK 31,712,492	State Street	02/02/2022	33	-
Buy USD 16,938,146; Sell SEK 153,344,813	State Street	02/02/2022	457	0.02
Buy USD 447,220; Sell SGD 603,021	State Street	04/02/2022	1	-
未実現利益合計 (2021年7月31日: 0.04%)			10,109	0.30
先渡為替契約未実現利益合計 (2021年7月31日: 0.83%)			12,942	0.39
先渡為替契約 ³				
Buy DKK 9,640,000; Sell EUR 1,296,264	Bank of America	02/02/2022	(1)	-
Buy EUR 1,325,090; Sell DKK 9,860,000 ⁵	Bank of America	02/02/2022	-	-
Buy SEK 58,887,800; Sell EUR 5,742,388	Toronto-Dominion Bank	02/02/2022	(115)	(0.01)
未実現損失合計 (2021年7月31日: (0.01)%)			(116)	(0.01)
クラスD米ドルヘッジ投資証券				
Buy AUD 1,182,006; Sell USD 855,556	State Street	02/02/2022	(20)	-
Buy CAD 1,918,049; Sell USD 1,519,660	State Street	02/02/2022	(11)	-
Buy CHF 55,700; Sell USD 60,829 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy CNY 731,866; Sell USD 114,894 ⁵	State Street	09/02/2022	-	-
Buy DKK 146,142; Sell USD 22,309 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy EUR 19,414,776; Sell USD 22,050,863	State Street	02/02/2022	(258)	-
Buy GBP 1,532,082; Sell USD 2,082,397	State Street	02/02/2022	(24)	-
Buy HKD 102,363; Sell USD 13,1355	State Street	07/02/2022	-	-
Buy JPY 3,123,753; Sell USD 27,237 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy NOK 573,377; Sell USD 65,059 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy SEK 4,245,658; Sell USD 467,039	State Street	02/02/2022	(12)	-
Buy SGD 9,590; Sell USD 7,113 ⁵	State Street	04/02/2022	-	-
Buy USD 88,383; Sell CAD 112,711 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 2,058; Sell CHF 1,917 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 6,247,294; Sell CNY 39,991,818	State Street	09/02/2022	(17)	-
Buy USD 646; Sell DKK 4,313 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 608,555; Sell EUR 545,828	State Street	02/02/2022	(3)	-
Buy USD 50,193; Sell GBP 37,480 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 400; Sell HKD 3,122 ⁵	State Street	07/02/2022	-	-
Buy USD 12,917; Sell JPY 1,494,249 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 15,502; Sell NOK 139,516 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 15,897; Sell SEK 148,890 ⁵	State Street	02/02/2022	-	-
Buy USD 4,350; Sell SGD 5,902 ⁵	State Street	04/02/2022	-	-
未実現損失合計 (2021年7月31日: (0.01)%)			(345)	-
先渡為替契約未実現損失合計 (2021年7月31日: (0.14)%)			(16,419)	(0.50)

	公正価値 千ユーロ	純資産 比率%
損益を通じて公正価値で測定される金融資産合計	3,262,967	99.17
損益を通じて公正価値で測定される金融負債合計	(16,419)	(0.50)
現金および現金担保	17,509	0.53
現金等価物		
保有高		
通貨		
投資先集団投資スキーム (2021年7月31日: 0.49%)		
BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund - Agency		
75,471 EUR (AccTO) Shares ⁶	7,429	0.23
BlackRock ICS Sterling Liquid Environmentally Aware Fund - Agency		
14,636 GBP (Dis) Shares ⁶	1,752	0.05
BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund - Agency		
88,359 USD (Dis) Shares ⁶	7,884	0.24
現金等価物合計	17,065	0.52
その他の資産および負債	9,029	0.28
買戻可能投資証券保有者に帰属する純資産	3,290,151	100.00

	総資産 比率%
総資産の分析	
公認の証券取引所への上場を認可されている譲渡性のある証券	90.78
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある証券	6.73
集団投資スキーム	0.51
店頭金融デリバティブ商品	0.39
その他の資産	1.59
資産合計	100.00

- 1 証券の全部または一部が貸付中である。
- 2 証券は永久債であり、明確な満期日をもたない。表示日（もしあれば）は、次回コール日である。
- 3 同一の購入通貨、売却通貨および満期日を有する取引相手方で保有する先渡為替契約は、該当する場合、総額ベースで表示される。資産および負債ポジションの相殺はない。
- 4 前年の純資産価額に対する割合は0.00%に四捨五入される。
- 5 500ユーロ未満の投資は切り捨てゼロである。
- 6 ファンドの関係当事者である。

	利益 千ユーロ	損失 千ユーロ
対象エクスポージャー		
先渡為替契約	1,217,579	1,831,739

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2022年1月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年1月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

(ブラックロック・フィクスト・インカム・ダブリン・ファンズ plc - iシェアーズ・グリーンボンド・インデックス・ファンド)

	販売口数 (口)	買戻し口数 (口)	発行済口数 (口)
クラスD米ドルヘッジ 投資証券	53,227,460 (2,049,750)	50,324,063 (5,700)	82,009,261 (2,044,050)

(注1) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数である。

(注2) 上記の販売口数、買戻し口数および発行済口数には、未処理の販売および買戻しは含まれていないため、財務書類上に記載されている口数とは数値が異なる。