

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年5月31日
【計算期間】	第61期中(自 2021年9月1日 至 2022年2月28日)
【発行者名】	ブラックロック・グローバル・ファンズ (BLACKROCK GLOBAL FUNDS)
【代表者の役職氏名】	取締役 バリー・オドワイヤー (Barry O'Dwyer)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 2453、 ユージン・リュペール通り 2 - 4 番 (2-4, rue Eugène Ruppert, L-2453 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 中野 春芽
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【事務連絡者氏名】	弁護士 中野 春芽
【連絡場所】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【電話番号】	03(6775)1000
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

- (注1) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、スターリング・ポンド(以下「英ポンド」という。)、スイス・フラン、ユーロ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ、人民元、シンガポール・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、株式会社三菱UFJ銀行の2022年3月31日現在における対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=122.39円、1英ポンド=160.89円、1スイス・フラン=132.54円、1ユーロ=136.70円、1デンマーク・クローネ=18.38円、1ノルウェー・クローネ=14.27円、1人民元=19.26円、1シンガポール・ドル=90.49円および1ニュージーランド・ドル=85.33円)による。
- (注2) ブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「ファンド」という。)は、ルクセンブルグ大公国(以下「ルクセンブルグ」という。)の法律に基づいて設立されているが、ワールド・ボンド・ファンド(以下「サブ・ファンド」ということがある。)のクラスA無分配投資証券(以下「ファンド証券」という。)は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。
- (注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入して記載してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。したがって、本書の中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。以下、別段の記載がない限り同じ。
- (注4) ファンドの会計年度(以下「計算期間」ということがある。)は、9月1日に始まり、翌年の8月31日に終わる1年である。
- (注5) サブ・ファンドは、アンブレラ・ファンドであるファンドのサブ・ファンドであり、本書において、サブ・ファンドのみが開示される。2022年4月22日現在、ファンドは、サブ・ファンドを含む100個のサブ・ファンドにより構成されている。

1 【外国投資法人の概況】

(1) 【主要な経営指標等の推移】

	第59会計年度中間 (2020年2月末日)	第59会計年度 (2020年8月末日)	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)
(a) 営業収益(注1)	24,856,073米ドル (3,042,135千円)	46,021,093米ドル (5,632,522千円)	17,332,454米ドル (2,121,319千円)	35,658,653米ドル (4,364,263千円)	17,887,070米ドル (2,189,198千円)
(b) 経常利益(損失)金額	14,971,882米ドル (1,832,409千円)	26,770,853米ドル (3,276,485千円)	12,432,020米ドル (1,521,555千円)	26,530,592米ドル (3,247,079千円)	14,249,592米ドル (1,744,008千円)
(c) 当期純利益(損失)金額	26,201,193米ドル (3,206,764千円)	63,709,782米ドル (7,797,440千円)	8,163,957米ドル (999,187千円)	19,330,232米ドル (2,365,827千円)	-2,220,389米ドル (-271,753千円)
(d) 出資総額(注2)	1,323,970,309米ドル (162,040,726千円)	1,365,243,468米ドル (167,092,148千円)	1,408,044,234米ドル (172,330,534千円)	1,365,246,053米ドル (167,092,464千円)	1,300,128,123米ドル (159,122,681千円)
(e) 発行済投資証券総数	□	□	□	□	□
クラスA毎日分配型投資証券	82,930	61,911	129,926	120,012	120,930
クラスA毎月分配型投資証券	409,778	535,286	424,175	357,873	228,735
クラスA人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	350	350	350	5,585	5,699
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	680	680	680	19,715	20,757
クラスA無分配投資証券	1,669,723	1,552,663	1,464,056	1,433,219	1,272,926
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	107,208	111,582	108,144	105,591	98,151
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	277,646	273,976	409,561	472,646	393,087
クラスC毎日分配型投資証券	21,663	23,378	18,002	14,814	14,295
クラスD毎月分配型投資証券	197,300	198,730	126,603	127,436	68,689
クラスD無分配投資証券	1,412,028	1,609,279	1,607,685	1,341,941	1,608,138
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	378,800	378,800	476,900	520,942	526,909
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	24,478	77,936	174,271	85,613	177,570
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,178,517	2,465,236	2,846,050	2,779,397	2,503,135
クラスE無分配投資証券	396,092	444,260	450,243	418,274	436,449
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券(注3)	-	477,175	1,601,506	2,171,307	2,171,315

	第59会計年度中間 (2020年2月末日)	第59会計年度 (2020年8月末日)	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)
クラスI無分配投資証券	814,200	500	500	11,000	421,277
クラスX無分配投資証券	4,429,384	4,395,539	4,672,863	4,698,240	4,581,189
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	2,657,169	2,657,169	8	8	8
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5	5	5	5	5
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	333,113	317,297	317,297	242,391	242,391
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	18,823,004	16,572,480	16,572,480	16,862,335	17,904,636
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	31,741,827	31,741,827	31,741,827	31,741,827	33,142,500
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795	795	795	795	795
(f) 純資産額	1,323,970,309米ドル (162,040,726千円)	1,365,243,468米ドル (167,092,148千円)	1,408,044,234米ドル (172,330,534千円)	1,365,246,053米ドル (167,092,464千円)	1,300,128,123米ドル (159,122,681千円)
(g) 総資産額	1,456,851,363米ドル (178,304,038千円)	1,470,014,810米ドル (179,915,113千円)	1,583,244,700米ドル (193,773,319千円)	1,605,111,413米ドル (196,449,586千円)	1,491,949,760米ドル (182,599,731千円)
(h) 1口当たり純資産額					
クラスA毎日分配型投資証券	60.49米ドル (7,403円)	61.34米ドル (7,507円)	61.26米ドル (7,498円)	61.89米ドル (7,575円)	57.88米ドル (7,084円)
クラスA毎月分配型投資証券	60.34米ドル (7,385円)	61.19米ドル (7,489円)	61.11米ドル (7,479円)	61.73米ドル (7,555円)	57.73米ドル (7,066円)
クラスA人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	106.63人民元 (2,054円)	107.70人民元 (2,074円)	107.29人民元 (2,066円)	108.18人民元 (2,084円)	100.89人民元 (1,943円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	10.62シンガポール・ ドル (961円)	10.63シンガポール・ ドル (962円)	10.54シンガポール・ ドル (954円)	10.60シンガポール・ ドル (959円)	9.86シンガポール・ ドル (892円)
クラスA無分配投資証券	83.49米ドル (10,218円)	85.13米ドル (10,419円)	85.47米ドル (10,461円)	86.91米ドル (10,637円)	81.85米ドル (10,018円)
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	197.30ユーロ (26,971円)	198.89ユーロ (27,188円)	198.78ユーロ (27,173円)	201.30ユーロ (27,518円)	188.78ユーロ (25,806円)
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	12.30英ポンド (1,979円)	12.41英ポンド (1,997円)	12.44英ポンド (2,001円)	12.63英ポンド (2,032円)	11.90英ポンド (1,915円)

	第59会計年度中間 (2020年2月末日)	第59会計年度 (2020年8月末日)	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)
クラスC 毎日分配型投資証券	60.90米ドル (7,454円)	61.70米ドル (7,551円)	61.57米ドル (7,536円)	62.21米ドル (7,614円)	58.18米ドル (7,121円)
クラスD 毎月分配型投資証券	60.41米ドル (7,394円)	61.26米ドル (7,498円)	61.18米ドル (7,488円)	61.80米ドル (7,564円)	57.80米ドル (7,074円)
クラスD 無分配投資証券	87.87米ドル (10,754円)	89.78米ドル (10,988円)	90.32米ドル (11,054円)	92.02米ドル (11,262円)	86.84米ドル (10,628円)
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10.70スイス・フラン (1,418円)	10.80スイス・フラン (1,431円)	10.80スイス・フラン (1,431円)	10.95スイス・フラン (1,451円)	10.27スイス・フラン (1,361円)
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	202.99ユーロ (27,749円)	205.03ユーロ (28,028円)	205.32ユーロ (28,067円)	208.35ユーロ (28,481円)	195.77ユーロ (26,762円)
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	12.35英ポンド (1,987円)	12.48英ポンド (2,008円)	12.54英ポンド (2,018円)	12.76英ポンド (2,053円)	12.04英ポンド (1,937円)
クラスE 無分配投資証券	77.18米ドル (9,446円)	78.50米ドル (9,608円)	78.62米ドル (9,622円)	79.74米ドル (9,759円)	74.91米ドル (9,168円)
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券(注3)	-	10.51ユーロ (1,437円)	10.54ユーロ (1,441円)	10.51ユーロ (1,437円)	9.89ユーロ (1,352円)
クラスI 無分配投資証券	11.39米ドル (1,394円)	11.65米ドル (1,426円)	11.73米ドル (1,436円)	11.97米ドル (1,465円)	11.30米ドル (1,383円)
クラスX 無分配投資証券	94.22米ドル (11,532円)	96.57米ドル (11,819円)	97.43米ドル (11,924円)	99.59米ドル (12,189円)	94.26米ドル (11,536円)
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	15.07スイス・フラン (1,997円)	15.26スイス・フラン (2,023円)	15.31スイス・フラン (2,029円)	15.57スイス・フラン (2,064円)	14.67スイス・フラン (1,944円)
クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	119.77デンマーク・ クローネ (2,201円)	121.99デンマーク・ クローネ (2,242円)	123.10デンマーク・ クローネ (2,263円)	125.88デンマーク・ クローネ (2,314円)	119.19デンマーク・ クローネ (2,191円)
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	213.98ユーロ (29,251円)	216.82ユーロ (29,639円)	217.77ユーロ (29,769円)	221.67ユーロ (30,302円)	208.92ユーロ (28,559円)
クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	13.30英ポンド (2,140円)	13.49英ポンド (2,170円)	13.59英ポンド (2,186円)	13.88英ポンド (2,233円)	13.13英ポンド (2,112円)
クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	14.33ノルウェー・ クローネ (204円)	14.53ノルウェー・ クローネ (207円)	14.64ノルウェー・ クローネ (209円)	14.96ノルウェー・ クローネ (213円)	14.18ノルウェー・ クローネ (202円)
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	12.50ニュージー ランド・ドル (1,067円)	12.73ニュージー ランド・ドル (1,086円)	12.83ニュージー ランド・ドル (1,095円)	13.12ニュージー ランド・ドル (1,120円)	12.43ニュージー ランド・ドル (1,061円)

	第59会計年度中間 (2020年2月末日)	第59会計年度 (2020年8月末日)	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)
(i) 1口当たり当期純利益金額 ^(注4)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	292,096米ドル (35,750千円)	595,426米ドル (72,874千円)	289,780米ドル (35,466千円)	1,050,555米ドル (128,577千円)	204,307米ドル (25,005千円)
(k) 1口当たり分配金額 ^(注4)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	90.88%	92.87%	88.93%	85.06%	87.14%
(m) 自己資本利益率	1.98%	4.67%	0.58%	1.42%	-0.17%

(注1) 営業収益には投資収益を記載している。

(注2) ファンドは、変動資本を有する会社型投資信託(以下「S I C A V」という。)であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(注3) クラスユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券は、2020年4月8日に運用を開始した。以下同じ。

(注4) (i)および(k)は、ファンドの性格上、算定していない。

(注5) ワールド・ボンド・ファンドは、2004年4月2日より運用を開始した。

(2) 【外国投資法人の出資総額】

サブ・ファンドの2022年3月末日現在の発行済投資証券総口数、ならびに下記の各会計年度末現在および2022年3月末日現在の純資産総額およびクラスA無分配投資証券の発行済投資証券総口数は、以下のとおりである。

サブ・ファンドにつき、発行可能投資証券総口数の定めはない。

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
クラスA 毎日分配型投資証券	114,065
クラスA 毎月分配型投資証券	217,905
クラスA 人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	5,720
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	20,910
クラスA 無分配投資証券	1,177,049
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	96,282
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	378,259
クラスC 毎日分配型投資証券	14,297
クラスD 毎月分配型投資証券	68,766
クラスD 無分配投資証券	1,679,215
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	526,909
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	178,613
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,461,695
クラスE 無分配投資証券	430,103
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,171,315
クラスI 無分配投資証券	419,916
クラスX 無分配投資証券	4,636,189
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8
クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	242,391
クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	17,486,363
クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	33,142,500
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795

会計年度	純資産総額	クラスA無分配投資証券 発行済投資証券総口数
第55会計年度末 (2016年8月末日)	1,611,410,206米ドル (197,220,495千円)	4,209,973口
第56会計年度末 (2017年8月末日)	1,501,876,263米ドル (183,814,636千円)	2,589,979口
第57会計年度末 (2018年8月末日)	1,340,682,994米ドル (164,086,192千円)	1,757,513口
第58会計年度末 (2019年8月末日)	1,375,012,111米ドル (168,287,732千円)	1,984,448口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	1,365,243,468米ドル (167,092,148千円)	1,552,663口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	1,365,246,053米ドル (167,092,464千円)	1,433,219口
2022年3月末日	1,261,202,058米ドル (154,358,520千円)	1,177,049口

(3) 【主要な投資主の状況】

サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は、これを開示すると欧州連合(以下「EU」という。)のデータ保護法に基づくファンドの義務に違反することとなるため、開示できない。

(4) 【役員の状況】

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有 投資証券 口数
ポール・フリーマン (Paul Freeman)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 非常勤取締役	0
ジェフリー・ラドクリフ (Geoffrey Radcliffe)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターならびにブラックロック・ルクセンブ ルグ・オフィスおよびインターナシヨナ ル・プロダクト・オーバーサイト・アン ド・ガバナンスのヘッド	0
アースラ・マーキオニ (Ursula Marchioni)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターおよびブラックロック・ポートフォリ オ・アナリシス・アンド・ソリューション ズのヘッド	0
バリー・オドワイヤー (Barry O'Dwyer)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターおよびEMEA・ファンズ・ガバナン スのヘッド	0
デニス・ヴォス (Denise Voss)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 非常勤取締役	0
キース・サルダナ (Keith Saldanha)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターおよびEMEA・ウェルス・プロダク ト・グループのヘッド	0
ダヴィーナ・セイント (Davina Saint)	独立 非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 独立非常勤取締役	0

(注) ファンドに従業員はいない。ファンドの独立監査人は、アーンスト・アンド・ヤング・ソシエテ・アノニムである。

(5) 【その他】

a. 定款の変更

ファンドの定款は、法律に規定された定足数および要件に従って、ファンドの投資主総会の特別決議により変更することができる。

b. 事業譲渡または事業譲受

合併

ルクセンブルグ規制当局(ルクセンブルグ金融監督委員会(Commission de Surveillance du Sector Financier)) (以下「CSSF」という。)の事前承認を条件に、譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託(以下「UCITS」という。)同士の併合による併合が認められている。

併合による併合の結果、吸収されるUCITSは、その資産および債務を相手方のUCITSに拋出し、清算を行わずに解散される。

変動資本を有する会社型投資信託(以下「SICAV」という。)間で併合が行われる場合、ルクセンブルグの投資信託に関する2010年12月17日の法律(以下「2010年法」という。)の規定が適用され、1915年8月10日の法律(改正済)の規定は制限される。

SICAVは、2010年法に基づき契約型投資信託(以下「FCP」という。)および会社型投資信託との併合が可能である。

資産の譲渡

SICAVの投資主またはFCPの管理会社の決定に基づき、UCITSは、その資産のすべてを別のUCITSに譲渡することができ、その後、空のUCITSが清算を行わずに解散される。

UCITSは、特別な状況において、またCSSFおよび適用法により要求される手続に従い(例えば、サブ・ファンドの併合によるかまたは分離により)、その資産の一部を相手方のUCITSに譲渡することができる。

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、訴訟事件その他ファンドに重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

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)

(2022年3月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率(注1) (%)
国債	中国	107,677,789	7.69
	日本	81,826,682	5.84
	英国	28,177,810	2.01
	カナダ	26,565,546	1.90
	ドイツ	25,885,624	1.85
	米国	25,412,305	1.81
	ブラジル	19,816,901	1.42
	メキシコ	18,310,577	1.31
	スペイン	17,507,415	1.25
	イタリア	15,811,673	1.13
	フランス	15,626,579	1.12
	韓国	14,026,255	1.00
	インドネシア	10,786,647	0.77
	ベルギー	8,483,587	0.61
	オーストリア	7,619,492	0.54
	南アフリカ	6,748,303	0.48
	オランダ	5,665,204	0.40
	ポーランド	4,817,542	0.34
	ギリシャ	4,098,228	0.29
	オーストラリア	3,378,183	0.24
	マレーシア	3,165,882	0.23
	ルーマニア	3,127,969	0.22
	ポルトガル	3,106,856	0.22
	フィンランド	2,842,960	0.20
	シンガポール	2,642,931	0.19
	コロンビア	2,275,908	0.16
	タイ	1,922,226	0.14
	サウジアラビア	1,810,213	0.13
	アイルランド	1,752,186	0.13
	スイス	1,738,218	0.12
デンマーク	1,716,223	0.12	
チリ	1,524,448	0.11	
アラブ首長国連邦	1,506,825	0.11	
カタール	1,280,388	0.09	
チェコ共和国	876,453	0.06	
ペルー	822,627	0.06	
ニュージーランド	820,081	0.06	
ドミニカ共和国	817,660	0.06	
スウェーデン	755,743	0.05	

	フィリピン	740,000	0.05
	ノルウェー	732,353	0.05
	スロバキア	627,245	0.04
	パナマ	608,957	0.04
	アルゼンチン	489,174	0.03
	ナイジェリア	480,578	0.03
	ウルグアイ	450,510	0.03
	ハンガリー	409,425	0.03
	カザフスタン	406,714	0.03
	ガーナ	258,420	0.02
	ケイマン諸島	236,846	0.02
	モンゴル	198,000	0.01
	スリランカ	195,500	0.01
	ウクライナ	171,700	0.01
	パキスタン	131,000	0.01
	スロベニア	122,073	0.01
	ロシア連邦	113,278	0.01
	小計	489,119,912	34.93
社債	米国	225,848,242	16.13
	フランス	22,329,523	1.59
	英国	21,450,200	1.53
	オランダ	21,028,974	1.50
	ルクセンブルグ	18,227,053	1.30
	ドイツ	15,601,294	1.11
	メキシコ	11,011,681	0.79
	ケイマン諸島	9,786,352	0.70
	イタリア	7,293,803	0.52
	ノルウェー	7,048,828	0.50
	スペイン	5,725,183	0.41
	日本	4,608,275	0.33
	オーストリア	4,545,206	0.32
	スウェーデン	4,210,306	0.30
	カナダ	3,019,095	0.22
	英領バージン諸島	2,934,447	0.21
	ジャージー	2,620,310	0.19
	スイス	2,189,023	0.16
	インド	2,033,803	0.15
	アイルランド	1,833,842	0.13
	コロンビア	1,707,942	0.12
	バミューダ	1,575,148	0.11
	インドネシア	1,506,440	0.11
	フィンランド	1,289,842	0.09
	シンガポール	1,275,732	0.09
	アルゼンチン	1,149,067	0.08
	ベルギー	1,136,147	0.08

	タイ	1,062,053	0.08
	ガーンジー	943,044	0.07
	韓国	943,028	0.07
	アラブ首長国連邦	930,977	0.07
	ブラジル	750,697	0.05
	モーリシャス	707,176	0.05
	チリ	514,805	0.04
	マレーシア	509,526	0.04
	ペルー	432,140	0.03
	パナマ	429,865	0.03
	カタール	378,411	0.03
	バーレーン	337,343	0.02
	オーストラリア	308,710	0.02
	香港	262,375	0.02
	クウェート	234,693	0.02
	モロッコ	211,882	0.02
	オマーン	198,595	0.01
	南アフリカ	193,759	0.01
	カザフスタン	192,380	0.01
	フィリピン	190,324	0.01
	マン島	187,000	0.01
	パラグアイ	178,788	0.01
	ウクライナ	81,000	0.01
	小計	413,164,329	29.50
政府機関債	米国	296,128,551	21.15
	ケイマン諸島	46,685,643	3.33
	アイルランド	14,160,258	1.01
	英国	5,573,248	0.40
	ルクセンブルグ	555,831	0.04
	オランダ	334,821	0.02
	スペイン	179,940	0.01
	ポルトガル	93,213	0.01
	フランス	83,518	0.01
	小計	363,795,023	25.98
国際機関債	国際機関	3,032,854	0.22
	小計	3,032,854	0.22
	投資資産合計	1,269,112,118	90.63
	現金・その他の資産(負債控除後)	131,210,813	9.37
	資産総額	1,400,322,931	100.00
	負債総額	139,120,873	9.93(注2)
	純資産総額	1,261,202,058 (約154,359百万円)	90.07(注3)

(注1) 投資比率とは、サブ・ファンドの資産総額に対する当該資産の価格の比率をいう。

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。

(2) 【運用実績】

【純資産等の推移】

2022年3月末日および同日前1年以内における各月末のサブ・ファンドの総資産額および純資産総額ならびにクラスA無分配投資証券の1口当たり純資産価格の推移は、以下のとおりである。

	総資産額		純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2021年4月末日	1,527,106	186,903	1,348,992	165,103	85.52	10,467
5月末日	1,536,985	188,112	1,352,155	165,490	85.76	10,496
6月末日	1,607,260	196,713	1,353,837	165,696	86.08	10,535
7月末日	1,593,808	195,066	1,373,692	168,126	86.90	10,636
8月末日	1,605,111	196,450	1,365,246	167,092	86.91	10,637
9月末日	1,617,684	197,988	1,336,513	163,576	85.90	10,513
10月末日	1,628,253	199,282	1,327,500	162,473	85.35	10,446
11月末日	1,562,969	191,292	1,324,546	162,111	85.53	10,468
12月末日	1,542,011	188,727	1,332,014	163,025	85.59	10,475
2022年1月末日	1,512,660	185,134	1,317,446	161,242	84.06	10,288
2月末日	1,491,950	182,600	1,300,128	159,123	81.85	10,018
3月末日	1,400,323	171,386	1,261,202	154,359	80.31	9,829

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所が運営するユーロ多角的取引システム(MTF)に上場されている。同取引所での実質的な取引実績はない。

【分配の推移】

2022年3月末日前1年間におけるサブ・ファンドの分配金の額は、以下のとおりである。

総額 462,230.00米ドル(約56,572千円)

(注)上記金額は、サブ・ファンドの分配金の総額である。クラスA無分配投資証券については、分配金は支払われていない。

【自己資本利益率(収益率)の推移】

下記の期間におけるサブ・ファンドの自己資本利益率は、以下のとおりである。

期間	自己資本利益率(収益率)
(2021年4月1日～ 2022年3月31日)	2.33%

(3) 【投資リスク】

第61会計年度中間期において、2022年2月28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」に記載されたリスク要因について、重要な変更はない。

ファンドが将来にわたって営業活動を継続するとの前提に重要な疑義を生じさせるような事象または状況その他ファンド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。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

名称

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー(BlackRock (Luxembourg) S.A.)(運用会社)

資本金(株主資本)の額

2022年4月30日現在、6,309,670ユーロ(約8億6,253万円)

(2)【大株主の状況】

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、ブラックロック・インコーポレイテッド・グループ内の完全子会社である。運用会社の大株主に関するより詳細な情報は、これを開示するとEUのデータ保護法に基づく運用会社の義務に違反することとなるため、開示できない。

(3)【役員状況】

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式数
ジョナサン・グリフィン (Jonathan Griffin)	取締役会長 および 非常勤取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役会長および非常勤取締役	0
グラハム・バンピング (Graham Bamping)	非常勤取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの非常勤取締役	0
ジェフリー・ラドクリフ (Geoffrey Radcliffe)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクターならびにブラックロック・ルクセンブルグ・オフィスおよびインターナショナル・プロダクト・オーバーサイト・アンド・ガバナンスのヘッド	0
ジョアン・フィッツジェラルド (Joanne Fitzgerald)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役およびEMEA・ファンド・ボード・ガバナンス	0
レオン・シュワブ (Leon Schwab)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役、ブラックロック・グローバル・ファンズ・アドミニストレーション・サービス・グループおよびレギュラトリー・アンド・タックス・サブスタンス・EMEA・オルタナティブのヘッド	0
スヴェトラナ・ブトビナ (Svetlana Butvina)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクターおよびEMEA・ファンズ・リスクのヘッド	0
リチャード・ガードナー (Richard Gardner)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーのマネージング・ディレクター、EMEA・クライアント・コア・ビジネスのCOOおよびブラックロック・ライフ・リミテッドのCOO	0
タレク・マフムード (Tarek Mahmoud)	取締役	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーの取締役	0

(4)【事業の内容及び営業の概況】

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、2010年法第15章に基づき運用会社として行為することを認可されている。運用会社契約に基づきファンドの投資運用、管理およびサブ・ファンドのマーケティングに関するあらゆる運営機能を、直接または委託により遂行する責任とともに、ファンドの日々の運用を行っている。2022年3月末日現在、運用会社は、以下の3本の投資法人(合計純資産総額は、167,500,386,408.66米ドル、4,450,071,315.00英ポンド、2,033,006,647.75カナダ・ドル、1,527,174,554.76スイス・フラン、5,521,918,624.17スウェーデン・クローナ、60,888,746,768.49ユーロ、577.68デンマーク・クローネ、575,687,433.61ノルウェー・クローネ、2,467,477,778.99豪ドル、16,440,608,436.32香港ドル、50,264,564,253.74人民元、4,625,034,647.38シンガポール・ドル、197,867,556.25ニュージーランド・ドル、792,536,091.15南アフリカ・ランド、546,659,320.80ポーランド・ズロチ、235,238,030.87ブラジル・レアルおよび196,563,710,440.40円)を運用、助言および/または管理している。

名称(設立国)	基本的性格	設立年月日	純資産総額(通貨別)
ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	1962年6月14日	148,683,231,147.54 米ドル 3,506,414,195.45 英ポンド 2,033,006,647.75 カナダ・ドル 1,527,174,554.76 スイス・フラン 5,521,918,624.17 スウェーデン・クローナ 48,816,673,467.15 ユーロ 577.68 デンマーク・クローネ 575,687,433.61 ノルウェー・クローネ 2,467,477,778.99 豪ドル 16,440,608,436.32 香港ドル 50,264,564,253.74 人民元 4,625,034,647.38 シンガポール・ドル 197,867,556.25 ニュージーランド・ドル 792,536,091.15 南アフリカ・ランド 546,659,320.80 ポーランド・ズロチ 235,238,030.87 ブラジル・レアル 196,563,710,440.40 円
ブラックロック・ストラテジック・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	2007年5月2日	10,189,363,603.46 米ドル 943,657,119.55 英ポンド 11,533,913,655.80 ユーロ
ブラックロック・グローバル・インデックス・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	2012年8月30日	8,627,791,657.66 米ドル 538,159,645.54 ユーロ

(注)上記投資法人は、アンブレラ型であり、複数のサブ・ファンドおよび複数の投資証券クラスにより構成される。各サブ・ファンドの一単位当たり純資産価格については開示していない。

4【外国投資法人の経理状況】

- (a) サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成されたファンドの原文(英文)の中間財務書類を翻訳したものである(ただし、円換算部分を除く。)。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」(平成5年大蔵省令第22号。その後の改正を含む。)に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号。その後の改正を含む。)第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである(但し、円換算額を除く。)。
- (b) 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。その後の改正を含む。)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。
- (c) ファンドの原文の中間財務書類は、外貨で表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円への換算には、2022年3月31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米ドル=122.39円、1英ポンド=160.89円、1スイス・フラン=132.54円、1ユーロ=136.70円、1デンマーク・クローネ=18.38円、1ノルウェー・クローネ=14.27円、1香港ドル=15.64円、1人民元=19.26円、1シンガポール・ドル=90.49円および1ニュージーランド・ドル=85.33円)が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため、合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。
- (注) ファンドの原文の中間財務書類には、現在ファンドを構成するすべてのサブ・ファンドの情報が掲載されているが、日本語の中間財務書類には、ワールド・ボンド・ファンドの情報のみが掲載されている(ただし、「財務書類に対する注記」を除く。)。

(1) 【資産及び負債の状況】

純資産計算書 2022年2月28日現在(未監査)

	注記	ワールド・ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		1,307,016,320	159,965,727
未実現評価損		(52,429,515)	(6,416,848)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,254,586,805	153,548,879
銀行預金	2 (a)	45,467,866	5,564,812
ブローカーに対する債権	15	5,045,343	617,500
未収利息および未収配当金	2 (a)	9,828,912	1,202,961
売却投資有価証券未収金	2 (a)	65,544,458*	8,021,986
販売投資証券未収金	2 (a)	22,628,823	2,769,542
事後通告証券契約の時価	2 (c)	85,313,806	10,441,557
スワップの時価	2 (c)	2,261,188	276,747
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	1,186,436	145,208
その他の資産	2 (a, c)	86,123	10,541
資産合計		1,491,949,760	182,599,731
負債			
ブローカーに対する債務	15	6,744,764	825,492
未払収益分配金	2 (a)	31,225	3,822
購入投資有価証券未払金	2 (a)	168,135,739*	20,578,133
買戻し投資証券未払金	2 (a)	771,841	94,466
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	1,888,591	231,145
未決済先渡為替予約	2 (c)	11,189,690	1,369,506
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	1,849,769	226,393
その他の負債	5, 6, 7, 8, 9	1,210,018	148,094
負債合計		191,821,637	23,477,050
純資産合計		1,300,128,123	159,122,681

* 事後通告証券を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2022年2月28日現在			
純資産合計	米ドル	1,300,128,123	159,122,681 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	57.88	7,084 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	57.73	7,066 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	100.89	1,943 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	9.86	892 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	81.85	10,018 円
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	188.78	25,806 円
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.90	1,915 円
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	58.18	7,121 円
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	57.80	7,074 円
クラスD無分配投資証券	米ドル	86.84	10,628 円
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.27	1,361 円
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	195.77	26,762 円
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.04	1,937 円
クラスE無分配投資証券	米ドル	74.91	9,168 円
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	9.89	1,352 円
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.30	1,383 円
クラスX無分配投資証券	米ドル	94.26	11,536 円
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	14.67	1,944 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

ワールド・ボンド・ファンド

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2022年2月28日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	119.19	2,191 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	208.92	28,559 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.13	2,112 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.18	202 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	12.43	1,061 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,365,246,053	167,092,464 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	61.89	7,575 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	61.73	7,555 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	108.18	2,084 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポ ール・ドル	10.60	959 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	86.91	10,637 円
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	201.30	27,518 円
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.63	2,032 円
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	62.21	7,614 円
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	61.80	7,564 円
クラスD無分配投資証券	米ドル	92.02	11,262 円
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.95	1,451 円
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	208.35	28,481 円
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.76	2,053 円
クラスE無分配投資証券	米ドル	79.74	9,759 円
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.51	1,437 円
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.97	1,465 円
クラスX無分配投資証券	米ドル	99.59	12,189 円
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.57	2,064 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

ワールド・ボンド・ファンド

	通貨	(円換算額)	
2021年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	125.88	2,314 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	221.67	30,302 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.88	2,233 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.96	213 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	13.12	1,120 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,365,243,468	167,092,148 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	61.34	7,507 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	61.19	7,489 円
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	107.70	2,074 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポ ール・ドル	10.63	962 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	85.13	10,419 円
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	198.89	27,188 円
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.41	1,997 円
クラスC毎日分配型投資証券	米ドル	61.70	7,551 円
クラスD毎月分配型投資証券	米ドル	61.26	7,498 円
クラスD無分配投資証券	米ドル	89.78	10,988 円
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.80	1,431 円
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	205.03	28,028 円
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.48	2,008 円
クラスE無分配投資証券	米ドル	78.50	9,608 円
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.51	1,437 円
クラスI無分配投資証券	米ドル	11.65	1,426 円
クラスX無分配投資証券	米ドル	96.57	11,819 円
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.26	2,023 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

ワールド・ボンド・ファンド

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	121.99	2,242 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	216.82	29,639 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.49	2,170 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.53	207 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	12.73	1,086 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)

(続き)

ワールド・ボンド・ファンド

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2019年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,375,012,111	168,287,732 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	60.26	7,375 円
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	60.11	7,357 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	106.35	2,048 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益 分配型投資証券	英ポンド	9.76	1,570 円
クラスA 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益 分配型投資証券	香港ドル	100.27	1,568 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	10.65	964 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	82.58	10,107 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	197.72	27,028 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.25	1,971 円
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	60.67	7,425 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	60.18	7,365 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	86.74	10,616 円
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.72	1,421 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	203.02	27,753 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.27	1,974 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	76.53	9,367 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	11.23	1,374 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	92.73	11,349 円
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.06	1,996 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2022年2月28日現在(未監査)
(続き)

	通貨	ワールド・ボンド・ファンド	
		(円換算額)	
2019年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デン マーク・クロー ネ	119.15	2,190 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	213.36	29,166 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.18	2,121 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・クロー ネ	14.14	202 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジーラン ド・ドル	12.35	1,054 円

価格は、関連する投資証券クラスの取引通貨で提示されている。投資証券クラスに二つ以上の取引通貨がある場合は、関連する投資証券クラスの基準通貨が表示されている。追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2021年9月1日から2022年2月28日までの期間(未監査)

	注記	ワールド・ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
期首純資産		1,365,246,053	167,092,464
収益			
債券利息(源泉徴収税控除後)	2 (b)	16,604,799	2,032,261
スワップ利息	2 (c)	1,228,951	150,411
有価証券貸付収益	2 (b)	53,320	6,526
収益合計	2 (b)	17,887,070	2,189,198
費用			
銀行利息	2 (b)	29,566	3,619
スワップ利息	2 (c)	1,371,677	167,880
年次サービス料	7	442,053	54,103
ローン・コミットメント・フィー	17	4,544	556
保管および預託報酬	2 (h), 8	173,369	21,219
販売報酬	6	85,953	10,520
税金	9	145,945	17,862
投資運用報酬	5	1,384,371	169,433
費用合計		3,637,478	445,191
純利益		14,249,592	1,744,008
以下に係る実現純評価益/(損):			
投資有価証券	2 (a)	(1,318,280)	(161,344)
事後通告証券契約	2 (c)	(3,542,605)	(433,579)
上場先物取引	2 (c)	2,338,848	286,252
オプション/スワップション契約	2 (c)	116,857	14,302
スワップ取引	2 (c)	(6,809,141)	(833,371)
先渡為替予約	2 (c)	7,566,912	926,114
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(572,980)	(70,127)
当期実現純評価損		(2,220,389)	(271,753)

損益および純資産変動計算書 2021年9月1日から2022年2月28日までの期間(未監査)(続き)

	注記	ワールド・ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
以下に係る未実現評価益/(損)の純変動額:			
投資有価証券	2 (a)	(92,939,894)	(11,374,914)
事後通告証券契約	2 (c)	(1,028,726)	(125,906)
上場先物取引	2 (c)	(2,887,464)	(353,397)
オプション/スワップション契約	2 (c)	(711,526)	(87,084)
スワップ取引	2 (c)	3,677,964	450,146
先渡為替予約	2 (c)	(11,051,998)	(1,352,654)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	19,039	2,330
当期末実現評価益/(損)の純変動		(104,922,605)	(12,841,478)
運用成績による純資産の減少		(92,893,402)	(11,369,223)
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		128,637,945	15,743,998
投資証券買戻しによる正味支払額		(100,658,166)	(12,319,553)
資本の変動による純資産の増加		27,979,779	3,424,445
配当金公表額	16	(204,307)	(25,005)
期末純資産		1,300,128,123	159,122,681

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2021年9月1日から2022年2月28日までの期間(未監査)

	ワールド・ボンド・ファンド			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	120,012	22,867	21,949	120,930
クラスA 毎月分配型投資証券	357,873	32,618	161,756	228,735
クラスA オフショア中国人民元・ ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	5,585	114	-	5,699
クラスA シンガポール・ドル・ ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券	19,715	1,042	-	20,757
クラスA 無分配投資証券	1,433,219	143,158	303,451	1,272,926
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	105,591	2,810	10,250	98,151
クラスA 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	472,646	25,352	104,911	393,087
クラスC 毎日分配型投資証券	14,814	5	524	14,295
クラスD 毎月分配型投資証券	127,436	611	59,358	68,689
クラスD 無分配投資証券	1,341,941	440,720	174,523	1,608,138
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	520,942	9,880	3,913	526,909
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	85,613	113,565	21,608	177,570
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	2,779,397	264,989	541,251	2,503,135
クラスE 無分配投資証券	418,274	80,563	62,388	436,449
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配 型投資証券	2,171,307	8	-	2,171,315
クラスI 無分配投資証券	11,000	441,767	31,490	421,277
クラスX 無分配投資証券	4,698,240	85,000	202,051	4,581,189
クラスX スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	8	-	-	8
クラスX デンマーク・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	5	-	-	5

発行済投資証券口数変動表 2021年9月1日から2022年2月28日までの期間(未監査)(続き)

	ワールド・ボンド・ファンド			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスXユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	242,391	-	-	242,391
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配 投資証券	16,862,335	1,078,757	36,456	17,904,636
クラスXノルウェー・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	31,741,827	1,400,673	-	33,142,500
クラスXニュージーランド・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	795	-	-	795

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

(2)【投資有価証券明細表等】

ワールド・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品							
債券							
	アルゼンチン Argentine Republic Government			EUR 1,460,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.75% 20/10/2026	1,693,194	0.13
USD 944,000	International Bond (Step-up coupon) 1.125% 9/7/2035	278,480	0.02	EUR 690,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 1.5% 2/11/2086*	850,977	0.07
USD 2,248,000	Argentine Republic Government International Bond (Step-up coupon) 1.125% 9/7/2035	663,160	0.05	EUR 2,130,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 2.1% 20/9/2117	3,124,411	0.24
USD 178,000	Capex SA '144A' 6.875% 15/5/2024	169,551	0.02	USD 460,000	Suzano Austria GmbH 3.125% 15/1/2032	406,525	0.03
USD 812,675	Generacion Mediterranea SA / Central Termica Roca SA '144A' 9.625% 1/12/2027	666,393	0.05	USD 98,000	Suzano Austria GmbH 3.125% 15/1/2032	86,608	0.01
USD 138,810	Genneia SA '144A' 8.75% 2/9/2027	129,888	0.01	USD 110,000	Suzano Austria GmbH 3.75% 15/1/2031	103,007	0.01
USD 428,000	YPF SA '144A' 7% 15/12/2047	270,570	0.02	USD 900,000	Suzano Austria GmbH 5% 15/1/2030*	922,846	0.07
		2,178,042	0.17			13,297,865	1.02
AUD 3,270,000	オーストラリア Australia Government Bond 2.75% 21/4/2024	2,448,562	0.19	USD 993,000	バーレーン Bahrain Government International Bond ' 144A' 5.625% 18/5/2034	886,253	0.07
AUD 6,120,000	Australia Government Bond 3% 21/3/2047	4,739,888	0.36	USD 228,000	Bahrain Government International Bond 7% 26/1/2026	244,700	0.02
USD 590,000	Santos Finance Ltd 5.25% 13/3/2029	636,961	0.05	USD 324,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/5/2030	343,870	0.03
		7,825,411	0.60	USD 319,000	Oil and Gas Holding Co BSCC/ The 7.625% 7/11/2024	334,551	0.02
EUR 400,000	オーストラリア BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG 0.375% 3/9/2027*	424,303	0.03			1,809,374	0.14
EUR 600,000	Erste Group Bank AG FRN 10/6/2030	648,738	0.05	EUR 100,000	ベルギー Elia Transmission Belgium SA 0.875% 28/4/2030	107,556	0.01
EUR 100,000	Erste Group Bank AG FRN 8/9/2031	108,704	0.01	EUR 900,000	KBC Group NV FRN 7/12/2031	939,462	0.07
EUR 1,200,000	Erste Group Bank AG FRN 15/11/2032	1,237,960	0.09	EUR 1,000,000	KBC Group NV 1.125% 25/1/2024	1,139,481	0.09
EUR 600,000	Erste Group Bank AG 0.25% 26/6/2024	674,971	0.05	EUR 2,690,000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.1% 22/6/2030	2,934,746	0.22
USD 533,000	Klabn Austria GmbH ' 144A' 3.2% 12/1/2031*	458,114	0.03	EUR 2,660,000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0.8% 22/6/2025	3,082,229	0.24
EUR 300,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 20/10/2040 (Zero Coupon)	284,601	0.02	EUR 1,280,000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.9% 22/6/2038	1,648,153	0.13
EUR 1,460,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.5% 20/2/2029	1,654,367	0.13	EUR 660,000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 2.15% 22/6/2066*	933,090	0.07
EUR 692,000	Republic of Austria Government Bond '144A' 0.7% 20/4/2071	618,539	0.05			10,784,717	0.83
				USD 141,164	バミューダ Digicel Group Holdings Ltd '144A' 8% 1/4/2025*	128,883	0.01
				USD 76,042	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd '144A' 8% 31/12/2026	73,000	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 191,178	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd '144A' 8.75% 25/5/2024	193,876	0.01	USD 400,000	CNOOC Finance 2013 Ltd 4.25% 9/5/2043*	403,613	0.03
USD 108,716	Digicel International Finance Ltd/Digicel international Holdings Ltd '144A' 13% 31/12/2025*	109,260	0.01	USD 330,000	Easy Tactic Ltd 8.125% 27/2/2023	82,500	0.01
USD 200,000	Geopark Ltd '144A' 5.5% 17/1/2027	188,739	0.01	USD 200,000	Fortune Star BVI Ltd 6.85% 2/7/2024	198,900	0.02
USD 250,000	Li & Fung Ltd 4.375% 4/10/2024*	250,196	0.02	USD 82,000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd '144A' 5.125% 15/5/2024	84,668	0.01
USD 13,000	NCL Corp Ltd '144A' 3.625% 15/12/2024	12,219	0.00	USD 200,000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd '144A' 5.125% 15/5/2024	206,507	0.02
USD 200,000	Ooredoo International Finance Ltd 3.75% 22/6/2026	209,599	0.02	USD 200,000	New Metro Global Ltd 6.8% 5/8/2023	127,500	0.01
USD 708,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak '144A' 4.85% 14/10/2038	717,839	0.05	USD 250,000	NWD Finance BVI Ltd (Perpetual) FRN 10/3/2028	237,813	0.02
USD 640,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038	648,894	0.05	USD 200,000	RKPF Overseas 2019 A Ltd 6.7% 30/9/2024	168,500	0.01
		2,532,505	0.19	USD 1,000,000	Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd 3.625% 12/4/2027*	1,045,430	0.08
	ブラジル			USD 167,740	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd 6.75% 24/4/2033	178,747	0.01
USD 600,000	Banco do Brasil SA/Cayman 4.75% 20/3/2024	618,966	0.05	USD 300,000	State Grid Overseas Investment BVI Ltd 4% 4/5/2047*	338,082	0.03
BRL 400,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	7,425,189	0.57	USD 200,000	Wanda Properties International Co Ltd 7.25% 29/1/2024	186,010	0.01
BRL 400,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2031	7,266,975	0.56	USD 280,000	Wheelock MTN BVI Ltd 2.375% 25/1/2026	274,301	0.02
USD 4,300,000	Brazilian Government International Bond 3.75% 12/9/2031*	3,872,150	0.30			3,707,571	0.29
USD 966,000	Brazilian Government International Bond 3.875% 12/6/2030	897,170	0.07		カナダ		
USD 200,000	Brazilian Government International Bond 3.875% 12/6/2030	185,750	0.01	USD 15,000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15/1/2028	14,638	0.00
USD 813,000	Brazilian Government International Bond 4.625% 13/1/2028	824,825	0.06	EUR 500,000	Bank of Montreal 0.2% 26/1/2023	564,050	0.04
USD 200,000	Brazilian Government International Bond 6% 7/4/2026	219,828	0.02	USD 34,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 1/6/2028	32,608	0.00
USD 365,000	BRF SA '144A' 5.75% 21/9/2050	326,348	0.02	USD 48,000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7% 15/1/2028	44,057	0.00
USD 612,000	Itau Unibanco Holding SA/ Cayman Island '144A' 3.25% 24/1/2025	609,203	0.05	USD 16,000	Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.25% 15/9/2027	16,112	0.00
USD 563,000	Oi SA 10% 27/7/2025	459,688	0.04	CAD 5,980,000	Canadian Government Bond 0.5% 1/9/2025	4,518,137	0.35
		22,706,092	1.75	CAD 8,560,000	Canadian Government Bond 0.75% 1/2/2024	6,636,394	0.51
	英領バージン諸島			CAD 6,740,000	Canadian Government Bond 1.5% 1/6/2031	5,124,901	0.39
USD 200,000	Champion Path Holdings Ltd 4.5% 27/1/2026	175,000	0.01	CAD 3,010,000	Canadian Government Bond 2% 1/12/2051	2,271,928	0.18

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
CAD 833,000	Canadian Government Bond 3.5% 1/12/2045	810,133	0.06	USD 400,000	Apidos CLO XX FRN 16/7/2031	397,973	0.03
GBP 3,500,000	CPPIB Capital Inc 1.125% 14/12/2029	4,504,289	0.35	USD 600,000	Apidos CLO XXX '144A' FRN 18/10/2031	596,528	0.05
USD 290,000	Frontera Energy Corp '144A' 7.875% 21/6/2028	272,600	0.02	USD 250,000	Apidos CLO XXXII '144A' FRN 20/1/2033	249,517	0.02
USD 10,000	Masonite International Corp '144A' 5.375% 1/2/2028	10,139	0.00	USD 614,000	Arabian Centres Sukuk II Ltd '144A' 5.625% 7/10/2026	603,255	0.05
USD 52,000	Mattamy Group Corp '144A' 4.625% 1/3/2030	48,764	0.00	USD 491,000	Arabian Centres Sukuk II Ltd '144A' 5.625% 7/10/2026	482,407	0.04
USD 47,000	Mattamy Group Corp '144A' 5.25% 15/12/2027	46,599	0.00	USD 242,000	Arabian Centres Sukuk Ltd 5.375% 26/11/2024	238,370	0.02
USD 425,000	MEGlobal Canada ULC '144A' 5% 18/5/2025	445,953	0.04	USD 1,877,373	Atrium XII '144A' FRN 22/4/2027	1,866,554	0.14
USD 400,000	MEGlobal Canada ULC 5.875% 18/5/2030	454,864	0.04	USD 605,000	Baidu Inc 4.375% 14/5/2024*	628,873	0.05
CAD 4,000	Brunswick Canada 3.05% 14/8/2050	3,074	0.00	USD 1,000,000	Bain Capital Credit CLO 2018-1 'Series 2018-1A A1' '144A' FRN 23/4/2031	994,422	0.08
CAD 3,345,000	Province of Ontario Canada 2.4% 2/6/2026	2,667,884	0.21	USD 500,000	Ballyrock CLO 2020-2 Ltd 'Series 2020-2A A1R' '144A' FRN 20/10/2031	497,375	0.04
CAD 308,000	Province of Saskatchewan Canada 2.95% 2/6/2058	231,210	0.02	USD 250,000	Brookside Mill CLO Ltd 2013-1 FRN 17/1/2028	248,805	0.02
USD 832,448	Stoneway Capital Corp (Defaulted) '144A' 10% 1/3/2027	240,786	0.02	USD 200,000	China Aoyuan Group Ltd 7.95% 19/2/2023	38,000	0.00
EUR 1,170,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	1,309,201	0.10	USD 430,000	China Evergrande Group 8.25% 23/3/2022	74,175	0.01
		30,813,575	2.37	USD 200,000	China SCE Group Holdings Ltd 7% 2/5/2025	123,500	0.01
	ケイマン諸島			USD 500,000	CIFC Funding 2012-II-R Ltd 'Series 2012-2RA A2' '144A' FRN 20/1/2028	498,566	0.04
USD 200,000	ACEN Finance Ltd 4% 8/3/2025 (Perpetual)	177,000	0.01	USD 710,000	CIFC Funding 2014-III Ltd 'Series 2014-3A A1R2' '144A' FRN 22/10/2031	705,803	0.05
USD 200,000	Agile Group Holdings Ltd 5.5% 21/4/2025	76,050	0.01	USD 1,271,953	CIFC Funding 2015-III Ltd 'Series 2015-3A AR' '144A' FRN 19/4/2029	1,260,116	0.10
USD 2,500,000	AGL CLO 3 Ltd 'Series 2020-3A A' '144A' FRN 15/1/2033	2,491,795	0.19	USD 200,000	CIFI Holdings Group Co Ltd 5.95% 20/10/2025	156,500	0.01
USD 500,000	AGL CLO 3 Ltd 'Series 2020-3A B1' '144A' FRN 15/1/2033	499,946	0.04	USD 500,000	Deer Creek Clo Ltd 2017-1 FRN 20/10/2030	500,029	0.04
USD 250,000	AGL CLO 3 Ltd 'Series 2020-3A D' '144A' FRN 15/1/2033	250,979	0.02	USD 1,000,000	Eaton Vance Clo 2015-1 Ltd FRN 20/1/2030	997,985	0.08
USD 500,000	AGL Core CLO 2 Ltd FRN 20/4/2032	498,500	0.04	USD 250,000	Eaton Vance Clo 2015-1 Ltd 'Series 2015-1A BR' '144A' FRN 20/1/2030	248,869	0.02
USD 500,000	AGL Core CLO 4 Ltd 'Series 2020-4A A1R' '144A' FRN 20/4/2033	495,919	0.04	USD 400,000	Emaar Sukuk Ltd 3.635% 15/9/2026	405,937	0.03
USD 200,000	Ahli United Sukuk Ltd FRN 17/6/2026 (Perpetual)	196,044	0.02	USD 186,000	Embraer Overseas Ltd (Restricted) 5.696% 16/9/2023	193,948	0.01
USD 775,000	Alibaba Group Holding Ltd 3.4% 6/12/2027	785,943	0.06				
USD 320,000	Alibaba Group Holding Ltd 4.2% 6/12/2047*	306,833	0.02				
USD 650,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R Ltd 'Series 2018-1RA A1' '144A' FRN 13/4/2031	645,910	0.05				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 10.875% 9/1/2023	45,500	0.00	USD 750,000	Octagon Investment Partners 18-R Ltd ' Series 2018-18A A1A' ' 144A' FRN 16/4/2031	745,321	0.06
USD 200,000	Fantasia Holdings Group Co Ltd 11.875% 1/6/2023	45,500	0.00	USD 1,000,000	Octagon Investment Partners XVII Ltd ' Series 2013-1A A1R2' ' 144A' FRN 25/1/2031	992,750	0.08
USD 1,250,000	Galaxy XXII CLO Ltd ' Series 2016-22A ARR' ' 144A' FRN 16/4/2034	1,251,250	0.10	USD 600,000	OZLM VI Ltd 'Series 2014-6A A2AS' ' 144A' FRN 17/4/2031	600,009	0.05
USD 577,000	Grupo Aval Ltd ' 144A' 4.375% 4/2/2030	512,799	0.04	USD 250,000	OZLM XII Ltd FRN 30/4/2027	249,979	0.02
USD 200,000	Hilong Holding Ltd 9.75% 18/11/2024	161,131	0.01	USD 750,000	Palmer Square CLO 2018-2 Ltd 'Series 2018-2A A1A' ' 144A' FRN 16/7/2031	744,517	0.06
USD 238,000	IHS Holding Ltd ' 144A' 5.625% 29/11/2026	233,835	0.02	USD 800,000	Peace Park CLO Ltd ' Series 2021-1A A' ' 144A' FRN 20/10/2034	797,645	0.06
USD 480,000	JD.com Inc 4.125% 14/1/2050	443,508	0.03	USD 250,000	Pikes Peak Clo 4 ' Series 2019-4A AR' ' 144A' FRN 15/7/2034	248,784	0.02
USD 200,000	Kaisa Group Holdings Ltd (Defaulted) 11.95% 12/11/2023	46,687	0.00	USD 200,000	Redsun Properties Group Ltd 9.7% 16/4/2023	60,000	0.00
USD 1,000,000	KKR Clo 17 Ltd ' 144A' FRN 15/4/2034	997,731	0.08	USD 500,000	Rockford Tower CLO 2018-1 Ltd 'Series 2018-1A A' ' 144A' FRN 20/5/2031	496,625	0.04
USD 400,000	KSA Sukuk Ltd 3.628% 20/4/2027	421,500	0.03	USD 200,000	Ronshine China Holdings Ltd 8.95% 22/1/2023	60,900	0.00
USD 215,146	KVK CLO 2018-1 Ltd FRN 20/5/2029	215,061	0.02	USD 1,250,000	RR 1 LLC 'Series 2017- 1A A2B' ' 144A' FRN 15/7/2035	1,249,800	0.10
USD 200,000	KWG Group Holdings Ltd 7.875% 1/9/2023	94,954	0.01	USD 309,000	RR 3 Ltd 'Series 2018- 3A A1R2' ' 144A' FRN 15/1/2030	307,243	0.02
USD 200,000	Latam Finance Ltd (Defaulted) 6.875% 11/4/2024	185,327	0.01	USD 1,500,000	RR 3 Ltd 'Series 2018- 3A A2R2' ' 144A' FRN 15/1/2030	1,489,093	0.11
USD 1,000,000	Madison Park Funding XIII Ltd 'Series 2014- 13A BR2' ' 144A' FRN 19/4/2030	996,016	0.08	USD 685,000	RR 5 Ltd FRN 15/10/2031	682,239	0.05
USD 750,000	Madison Park Funding XXVI Ltd 'Series 2017- 26A AR' ' 144A' FRN 29/7/2030	751,297	0.06	USD 200,000	SA Global Sukuk Ltd 2.694% 17/6/2031	193,525	0.01
USD 1,000,000	Madison Park Funding XXVII Ltd FRN 20/4/2030	993,334	0.08	USD 570,000	Sands China Ltd 4.375% 18/6/2030*	519,313	0.04
USD 200,000	MAF Sukuk Ltd 3.933% 28/2/2030	206,450	0.02	USD 200,000	Shui On Development Holding Ltd 6.15% 24/8/2024	187,400	0.01
USD 400,000	MAF Sukuk Ltd 4.5% 3/11/2025	419,316	0.03	USD 200,000	Sunac China Holdings Ltd 6.5% 10/1/2025	78,000	0.01
USD 598,000	MAF Sukuk Ltd 4.638% 14/5/2029	641,025	0.05	USD 250,000	Symphony CLO XXIV Ltd 'Series 2020-24A A' ' 144A' FRN 23/1/2032	249,415	0.02
USD 208,000	Melco Resorts Finance Ltd 5.25% 26/4/2026	194,212	0.01	USD 290,000	Tencent Holdings Ltd 2.39% 3/6/2030	268,991	0.02
USD 200,000	MGM China Holdings Ltd 5.875% 15/5/2026*	191,224	0.01	USD 300,000	Tencent Holdings Ltd ' 144A' 3.595% 19/1/2028	306,394	0.02
USD 200,000	Modern Land China Co Ltd 9.8% 11/4/2023	40,000	0.00	USD 200,000	Tencent Holdings Ltd ' 144A' 3.925% 19/1/2038	194,000	0.01
USD 350,000	MP CLO VII Ltd 'Series 2015-1A BRR' ' 144A' FRN 18/10/2028	349,647	0.03				
USD 3,000,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 Ltd ' Series 2019-35A A1' 144A' FRN 19/1/2033	2,985,072	0.23				
USD 500,000	OCP CLO 2020-18 Ltd ' Series 2020-18A AR' ' 144A' FRN 20/7/2032	496,375	0.04				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 285,000	Tencent Holdings Ltd '144A' 3.925% 19/1/2038	276,451	0.02	USD 676,000	Chile Government International Bond 3.5% 25/1/2050	610,159	0.05
USD 500,000	Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd 3.15% 2/6/2026*	513,963	0.04	USD 200,000	Chile Government International Bond 4% 31/1/2052	194,950	0.02
USD 500,000	TIAA CLO IV Ltd FRN 20/1/2032	497,249	0.04	USD 304,000	Colbun SA '144A' 3.15% 19/1/2032	280,932	0.02
USD 500,000	TICP CLO IX Ltd ' Series 2017-9A A' ' 144A' FRN 20/1/2031	496,022	0.04	USD 200,000	Corp Nacional del Cobre de Chile '144A' 4.25% 17/7/2042	195,240	0.02
USD 360,000	Times China Holdings Ltd 5.75% 14/1/2027*	127,800	0.01	USD 331,000	Embotelladora Andina SA '144A' 3.95% 21/1/2050	308,728	0.02
GBP 200,000	Trafford Centre Finance Ltd/The FRN 28/7/2035	212,564	0.02	USD 318,546	GNL Quintero SA 4.634% 31/7/2029	323,237	0.02
USD 1,750,000	Trinitas CLO XIV Ltd 'Series 2020-14A B' '144A' FRN 25/1/2034	1,740,837	0.13	USD 169,000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ' 144A' 3.5% 10/9/2051	143,670	0.01
USD 2,000,000	Trinitas CLO XIV Ltd 'Series 2020-14A C' '144A' FRN 25/1/2034	2,006,311	0.15	USD 454,000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ' 144A' 3.5% 10/9/2051	385,954	0.03
USD 1,000,000	Tryon Park CLO Ltd FRN 15/4/2029	999,868	0.08	USD 550,000	VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15/4/2029	521,125	0.04
EUR 100,000	UPCB Finance VII Ltd 3.625% 15/6/2029	108,671	0.01			5,503,716	0.42
USD 400,000	Vale Overseas Ltd 6.25% 10/8/2026	449,422	0.03		中国		
USD 995,890	Voya CLO 2013-1 Ltd ' Series 2013-1A A1AR' '144A' FRN 15/10/2030	990,957	0.08	CNY 9,000,000	Agricultural Development Bank of China 2.2% 1/4/2023	1,425,099	0.11
USD 835,000	Voya CLO 2014-4 Ltd FRN 14/7/2031	830,726	0.06	CNY 8,790,000	Agricultural Development Bank of China 2.96% 17/4/2030	1,375,184	0.11
USD 300,000	Voya CLO 2018-1 Ltd ' Series 2018-1A A1' ' 144A' FRN 19/4/2031	296,878	0.02	CNY 13,000,000	Agricultural Development Bank of China 3.45% 23/9/2025	2,111,251	0.16
USD 1,000,000	Voya CLO 2018-2 Ltd FRN 15/7/2031	990,713	0.08	CNY 3,500,000	Agricultural Development Bank of China 3.55% 21/11/2023	565,173	0.04
USD 200,000	Wynn Macau Ltd 5.5% 15/1/2026	181,810	0.01	CNY 10,400,000	Agricultural Development Bank of China 3.63% 19/7/2026	1,698,892	0.13
USD 681,000	XP Inc '144A' 3.25% 1/7/2026	634,753	0.05	CNY 11,500,000	Agricultural Development Bank of China 3.74% 12/7/2029	1,896,346	0.15
USD 500,000	York CLO 1 Ltd 'Series 2014-1A DRR' '144A' FRN 22/10/2029	498,368	0.04	CNY 5,000,000	Agricultural Development Bank of China 3.79% 26/10/2030	829,293	0.06
USD 200,000	Yuzhou Group Holdings Co Ltd 7.7% 20/2/2025	34,000	0.00	CNY 10,200,000	Agricultural Development Bank of China 4% 12/11/2025	1,693,013	0.13
		53,960,483	4.15	CNY 8,500,000	Agricultural Development Bank of China 4.65% 11/5/2028	1,469,844	0.11
	チリ			CNY 10,200,000	Agricultural Development Bank of China 4.98% 12/1/2025	1,723,059	0.13
USD 200,000	Chile Government International Bond 2.45% 31/1/2031	187,237	0.01	CNY 12,500,000	China Development Bank 1.86% 9/4/2023	1,971,822	0.15
USD 200,000	Chile Government International Bond 2.55% 27/7/2033	181,200	0.01	CNY 7,000,000	China Development Bank 3.07% 10/3/2030	1,104,012	0.08
USD 1,043,000	Chile Government International Bond 3.1% 7/5/2041	913,407	0.07	CNY 16,100,000	China Development Bank 3.09% 18/6/2030	2,540,879	0.20
USD 200,000	Chile Government International Bond 3.125% 21/1/2026	204,997	0.02	CNY 17,000,000	China Development Bank 3.23% 10/1/2025	2,745,099	0.21
USD 1,070,000	Chile Government International Bond 3.5% 31/1/2034*	1,052,880	0.08				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	China Development Bank 3.375% 24/1/2027	211,192	0.02	CNY 8,900,000	China Government Bond 3.72% 12/4/2051	1,490,256	0.11
CNY 7,000,000	China Development Bank 3.39% 10/7/2027	1,138,979	0.09	CNY 2,950,000	China Government Bond 3.73% 25/5/2070	500,112	0.04
CNY 4,500,000	China Development Bank 3.42% 2/7/2024	727,314	0.06	CNY 2,000,000	China Government Bond 3.74% 22/9/2035	344,877	0.03
CNY 8,300,000	China Development Bank 3.45% 20/9/2029	1,344,466	0.10	CNY 1,950,000	China Government Bond 3.76% 22/3/2071	330,981	0.03
CNY 9,000,000	China Development Bank 3.48% 8/1/2029	1,461,650	0.11	CNY 6,200,000	China Government Bond 3.86% 22/7/2049	1,061,745	0.08
CNY 4,300,000	China Development Bank 3.5% 13/8/2026	699,075	0.05	CNY 8,800,000	China Government Bond 3.97% 23/7/2048	1,533,017	0.12
CNY 2,600,000	China Development Bank 3.5% 4/11/2046	411,891	0.03	CNY 3,000,000	China Government Bond 4% 24/6/2069	537,198	0.04
CNY 19,200,000	China Development Bank 3.76% 14/8/2023	3,103,449	0.24	CNY 4,800,000	China Government Bond 4.03% 21/6/2040	851,043	0.07
CNY 6,000,000	China Development Bank 3.8% 25/1/2036	990,547	0.08	CNY 2,300,000	China Government Bond 4.05% 24/7/2047	404,837	0.03
CNY 4,800,000	China Development Bank 3.85% 9/1/2024	779,843	0.06	CNY 6,000,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	1,061,907	0.08
CNY 2,000,000	China Development Bank 4.01% 9/1/2037	338,294	0.03	CNY 3,000,000	China Government Bond 4.5% 23/6/2041	575,830	0.04
CNY 7,000,000	China Development Bank 4.04% 10/4/2027	1,171,656	0.09	CNY 10,600,000	Export-Import Bank of China/ The 2.93% 2/3/2025	1,695,457	0.13
CNY 21,400,000	China Development Bank 4.04% 6/7/2028	3,590,024	0.28	CNY 12,200,000	Export-Import Bank of China/ The 3.28% 11/2/2024	1,961,910	0.15
CNY 14,000,000	China Development Bank 4.15% 26/10/2025	2,326,619	0.18	CNY 7,000,000	Export-Import Bank of China/ The 3.43% 23/10/2025	1,135,803	0.09
CNY 10,000,000	China Development Bank 4.73% 2/4/2025	1,684,726	0.13	CNY 3,000,000	Export-Import Bank of China/ The 3.74% 16/11/2030	495,801	0.04
CNY 23,200,000	China Government Bond 1.99% 9/4/2025	3,626,827	0.28	CNY 13,700,000	Export-Import Bank of China/ The 3.86% 20/5/2029	2,275,218	0.17
CNY 19,000,000	China Government Bond 2.64% 13/8/2022	3,018,442	0.23	CNY 1,500,000	Export-Import Bank of China/ The 3.88% 12/1/2036	251,346	0.02
CNY 28,000,000	China Government Bond 2.68% 21/5/2030	4,368,878	0.34	CNY 10,600,000	Export-Import Bank of China/ The 4.89% 26/3/2028	1,853,516	0.14
CNY 10,000,000	China Government Bond 2.7% 3/11/2026	1,591,649	0.12				
CNY 10,200,000	China Government Bond 2.75% 1/9/2023	1,629,034	0.13			108,456,023	8.34
CNY 8,000,000	China Government Bond 2.79% 17/11/2023	1,278,852	0.10				
CNY 51,500,000	China Government Bond 2.85% 4/6/2027	8,235,745	0.63				
CNY 8,500,000	China Government Bond 2.94% 17/10/2024	1,367,896	0.10				
CNY 28,660,000	China Government Bond 3.01% 13/5/2028	4,610,633	0.35	USD 200,000	コロンビア Banco Davivienda SA ' 144A' FRN 22/4/2031 (Perpetual)	189,083	0.01
CNY 7,300,000	China Government Bond 3.13% 21/11/2029	1,181,234	0.09	USD 200,000	Banco Davivienda SA ' 144A' FRN 22/4/2031 (Perpetual)	189,082	0.01
CNY 6,700,000	China Government Bond 3.19% 11/4/2024	1,082,507	0.08	USD 695,000	Colombia Government International Bond 3% 30/1/2030	593,414	0.05
CNY 9,400,000	China Government Bond 3.22% 6/12/2025	1,528,188	0.12	USD 320,000	Colombia Government International Bond 3.25% 22/4/2032	265,920	0.02
CNY 16,400,000	China Government Bond 3.25% 6/6/2026	2,671,764	0.21	USD 800,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	766,542	0.06
CNY 16,400,000	China Government Bond 3.25% 22/11/2028	2,679,006	0.21	USD 200,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	191,636	0.02
CNY 18,000,000	China Government Bond 3.29% 18/10/2023	2,902,742	0.22				
CNY 4,500,000	China Government Bond 3.29% 23/5/2029	735,777	0.06				
CNY 28,350,000	China Government Bond 3.39% 16/3/2050	4,457,304	0.34				

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051*	148,551	0.01	USD 1,160,000	Dominican Republic International Bond '144A' 5.5% 22/2/2029	1,156,427	0.09
USD 1,747,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029*	1,676,443	0.13	USD 265,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	278,581	0.02
USD 200,000	Colombia Government International Bond 5% 15/6/2045	164,816	0.01	USD 920,000	Dominican Republic International Bond '144A' 6% 22/2/2033*	907,005	0.07
USD 398,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	439,652	0.03	USD 283,000	Dominican Republic International Bond 6.4% 5/6/2049	268,143	0.02
USD 527,000	Ecopetrol SA 4.625% 2/11/2031	473,462	0.04			4,499,843	0.35
USD 528,000	Ecopetrol SA 5.375% 26/6/2026	541,174	0.04		エジプト		
USD 100,000	Ecopetrol SA 5.875% 28/5/2045	86,375	0.01	USD 336,000	Egypt Government International Bond 5.25% 6/10/2025	322,560	0.02
USD 705,000	Ecopetrol SA 6.875% 29/4/2030	733,693	0.06	USD 252,000	Egypt Government International Bond '144A' 5.25% 6/10/2025	241,920	0.02
USD 226,000	Ecopetrol SA 6.875% 29/4/2030	235,198	0.02	USD 568,000	Egypt Government International Bond 5.875% 11/6/2025	557,350	0.04
USD 200,000	Empresas Publicas de Medellin ESP '144A' 4.25% 18/7/2029	178,236	0.01	USD 371,000	Egypt Government International Bond 7.6% 1/3/2029*	334,827	0.03
USD 200,000	Empresas Publicas de Medellin ESP '144A' 4.375% 15/2/2031	174,301	0.01			1,456,657	0.11
USD 283,000	SURA Asset Management SA '144A' 4.875% 17/4/2024	291,878	0.02		フィンランド		
USD 100,000	SURA Asset Management SA 4.875% 17/4/2024	103,137	0.01	EUR 630,000	Finland Government Bond '144A' 0.125% 15/9/2031	679,075	0.05
		7,442,593	0.57	EUR 1,670,000	Finland Government Bond '144A' 0.5% 15/4/2026	1,916,477	0.15
	チェコ共和国			EUR 80,000	Finland Government Bond '144A' 1.375% 15/4/2047	101,141	0.01
CZK 20,500,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	898,106	0.07	EUR 170,000	Finland Government Bond '144A' 2.625% 4/7/2042	257,917	0.02
	デンマーク			EUR 650,000	Kojamo Oyj 0.875% 28/5/2029	676,653	0.05
DKK 4,800,000	Denmark Government Bond 0.5% 15/11/2027	736,102	0.06	EUR 610,000	OP Corporate Bank plc 0.6% 18/1/2027*	664,072	0.05
DKK 4,300,000	Denmark Government Bond 4.5% 15/11/2039	1,070,111	0.08			4,295,335	0.33
		1,806,213	0.14		フランス		
	ドミニカ共和国			EUR 200,000	Air France-KLM 3.875% 1/7/2026	214,124	0.02
USD 647,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA '144A' 6.75% 30/3/2029	641,633	0.05	EUR 100,000	Altice France SA/France 2.125% 15/2/2025	106,624	0.01
USD 579,000	Dominican Republic International Bond '144A' 4.5% 30/1/2030*	538,447	0.04	EUR 100,000	Altice France SA/France 2.5% 15/1/2025	107,529	0.01
USD 179,000	Dominican Republic International Bond '144A' 4.875% 23/9/2032	164,022	0.01	EUR 200,000	Altice France SA/France 4.25% 15/10/2029	206,978	0.02
USD 401,000	Dominican Republic International Bond '144A' 4.875% 23/9/2032	367,446	0.03	EUR 200,000	Altice France SA/France 5.875% 1/2/2027	230,967	0.02
USD 206,000	Dominican Republic International Bond 5.3% 21/1/2041	178,139	0.02	EUR 100,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 8/6/2026	111,082	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 900,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.75% 8/6/2026	1,000,697	0.08	USD 200,000	Credit Agricole SA 144A' FRN 23/3/2029 (Perpetual)	187,500	0.01
GBP 400,000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.25% 5/12/2025	517,648	0.04	USD 646,000	Credit Agricole SA/London '144A' 2.375% 22/1/2025	646,003	0.05
USD 200,000	BNP Paribas SA FRN 14/3/2022 (Perpetual)*	200,402	0.02	EUR 600,000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA 4.125% 19/1/2024*	725,802	0.06
USD 200,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 19/11/2025	199,373	0.01	EUR 500,000	Dassault Systemes SE 16/9/2022 (Zero Coupon)	561,842	0.04
USD 2,163,000	BNP Paribas SA '144A' FRN 13/1/2027	2,021,956	0.16	EUR 38,113	E-Carat SA FRN 20/12/2028	42,882	0.00
EUR 1,700,000	BNP Paribas SA FRN 13/4/2027	1,819,565	0.14	EUR 400,000	Electricite de France SA FRN 29/1/2025 (Perpetual)*	455,788	0.03
EUR 1,100,000	BNP Paribas SA FRN 20/11/2030*	1,259,793	0.10	EUR 1,800,000	Engie SA 0.875% 19/9/2025	2,027,278	0.16
EUR 200,000	BNP Paribas SA FRN 15/1/2032	212,562	0.02	EUR 100,000	Engie SA 2.125% 30/3/2032	117,785	0.01
EUR 600,000	BNP Paribas SA 0.5% 19/1/2030	617,418	0.05	EUR 305,000	Engie SA 2.625% 20/7/2022	346,006	0.03
EUR 600,000	BPCE SA FRN 2/3/2032	673,250	0.05	EUR 20,974	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	23,471	0.00
EUR 400,000	BPCE SA 0.25% 15/1/2026	436,977	0.03	EUR 20,974	FCT Noria 2018-1 FRN 25/6/2038	23,442	0.00
EUR 300,000	BPCE SA 0.625% 28/4/2025	335,583	0.03	EUR 8,301,000	French Republic Government Bond OAT 25/3/2025 (Zero Coupon)	9,368,828	0.72
EUR 400,000	BPCE SFH SA 0.75% 2/9/2025	454,888	0.03	EUR 2,449,000	French Republic Government Bond OAT '144A' 0.5% 25/5/2040	2,522,567	0.19
EUR 100,000	CAB SELAS 3.375% 1/2/2028	103,259	0.01	EUR 2,180,000	French Republic Government Bond OAT '144A' 1.5% 25/5/2050	2,632,804	0.20
EUR 650,000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA 3.6% 8/3/2024	781,835	0.06	EUR 240,000	French Republic Government Bond OAT '144A' 2% 25/5/2048	322,941	0.02
EUR 300,000	Caisse Francaise de Financement Local 1% 25/4/2028	344,097	0.03	EUR 10,000	French Republic Government Bond OAT 3.25% 25/5/2045	16,186	0.00
EUR 400,000	Caisse Francaise de Financement Local 1.125% 19/1/2033	457,527	0.03	EUR 309,000	French Republic Government Bond OAT 4% 25/4/2060	634,971	0.05
EUR 200,000	Capgemini SE 1.625% 15/4/2026	231,163	0.02	EUR 175,000	Getlink SE 3.5% 30/10/2025	195,255	0.01
EUR 100,000	Chrome Bidco SASU 3.5% 31/5/2028	105,225	0.01	EUR 200,000	Icade Sante SACA 1.375% 17/9/2030	213,813	0.02
EUR 500,000	Cie de Financement Foncier SA 0.325% 12/9/2023	565,246	0.04	EUR 200,000	Iliad Holding SASU 5.125% 15/10/2026	224,095	0.02
EUR 400,000	Cie de Financement Foncier SA 0.875% 11/9/2028	454,742	0.03	GBP 200,000	La Financiere Atalian SASU 6.625% 15/5/2025	252,078	0.02
EUR 200,000	Cie de Financement Foncier SA 1.25% 15/11/2032	231,775	0.02	EUR 100,000	Loxam SAS 3.75% 15/7/2026	109,581	0.01
EUR 100,000	CMA CGM SA 7.5% 15/1/2026	121,320	0.01	EUR 100,000	Orange SA FRN 15/1/2025 (Perpetual)	113,195	0.01
EUR 300,000	Credit Agricole Assurances SA FRN 29/1/2048	330,123	0.02	EUR 100,000	Picard Groupe SAS 3.875% 1/7/2026	108,908	0.01
EUR 400,000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.375% 30/9/2024	450,932	0.03	EUR 200,000	PSA Banque France SA 22/1/2025 (Zero Coupon)	219,678	0.02
EUR 500,000	Credit Agricole Home Loan SFH SA 0.875% 11/8/2028	569,078	0.04				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 100,000	Rubis Terminal Infra SAS 5.625% 15/5/2025	115,053	0.01	EUR 100,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.875% 15/5/2027	111,597	0.01
USD 200,000	Societe Generale SA 144A' FRN 29/9/2025 (Perpetual)	219,707	0.02	EUR 300,000	KION Group AG 1.625% 24/9/2025	341,298	0.03
EUR 200,000	Suez SA FRN 1/6/2026 (Perpetual)	213,359	0.02	EUR 4,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.875% 4/7/2039	4,495	0.00
EUR 210,000	Tereos Finance Groupe I SA 7.5% 30/10/2025	245,368	0.02	EUR 400,000	Landesbank Baden- Wuerttemberg 0.25% 10/1/2025	448,840	0.03
EUR 1,100,000	Thales SA 26/3/2026 (Zero Coupon)*	1,178,495	0.09	EUR 300,000	Merck KGaA FRN 25/6/2079	334,435	0.03
EUR 100,000	Thales SA 0.75% 23/1/2025	111,961	0.01	EUR 200,000	Nidda BondCo GmbH 5% 30/9/2025	203,366	0.02
EUR 1,180,000	TotalEnergies SE FRN 25/10/2027 (Perpetual)	1,222,003	0.09	EUR 500,000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.5% 30/9/2024	525,991	0.04
EUR 50,000	Vallourec SA 8.5% 30/6/2026	56,959	0.00	EUR 100,000	PCF GmbH FRN 15/4/2026	110,897	0.01
EUR 100,000	Veolia Environnement SA 0.8% 15/1/2032	104,281	0.01	EUR 100,000	ProGroup AG 3% 31/3/2026	108,507	0.01
		41,033,623	3.16		Techem		
	ドイツ			EUR 87,920	Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	99,662	0.01
EUR 130,000	BASF SE 2% 5/12/2022	148,372	0.01	EUR 240,000	Tele Columbus AG 3.875% 2/5/2025	252,944	0.02
EUR 900,000	Bayer AG FRN 2/4/2075	1,011,987	0.08	EUR 152,000	thyssenkrupp AG 2.875% 22/2/2024	171,059	0.01
EUR 600,000	Bayer AG 1.375% 6/7/2032	627,085	0.05	EUR 100,000	TK Elevator Midco GmbH FRN 15/7/2027*	111,865	0.01
EUR 100,000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.5% 11/2/2027	107,483	0.01	EUR 173,000	TK Elevator Midco GmbH FRN 15/7/2027*	193,526	0.01
EUR 400,000	Commerzbank AG FRN 9/10/2025 (Perpetual)	460,187	0.03	EUR 115,000	TK Elevator Midco GmbH 4.375% 15/7/2027	129,076	0.01
EUR 1,300,000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	1,343,502	0.10	EUR 240,000	Volkswagen Leasing GmbH 0.375% 20/7/2026	260,390	0.02
EUR 500,000	Commerzbank AG 0.875% 18/4/2028	569,975	0.04	EUR 450,000	Volkswagen Leasing GmbH 0.5% 20/6/2022	506,317	0.04
GBP 1,400,000	Commerzbank AG 1.75% 22/1/2025	1,825,485	0.14	EUR 100,000	Volkswagen Leasing GmbH 0.625% 19/7/2029	103,943	0.01
EUR 210,000	Covestro AG 0.875% 3/2/2026	237,084	0.02	EUR 200,000	ZF Finance GmbH 3% 21/9/2025	222,355	0.02
EUR 700,000	Deutsche Bank AG FRN 23/2/2028	783,451	0.06			16,306,158	1.25
EUR 510,000	Deutsche Bank AG 0.25% 15/5/2023	576,122	0.04		ガーナ		
EUR 1,300,000	Deutsche Bank AG 1.125% 17/3/2025	1,457,647	0.11	USD 708,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/5/2029	483,210	0.04
EUR 100,000	Deutsche Lufthansa AG 2% 14/7/2024	110,585	0.01		ギリシャ		
EUR 100,000	Deutsche Lufthansa AG 2.875% 16/5/2027	106,732	0.01	EUR 504,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 12/2/2026 (Zero Coupon)	535,624	0.04
EUR 300,000	Deutsche Pfandbriefbank AG 0.625% 30/8/2027	337,875	0.03	EUR 1,132,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 1.5% 18/6/2030	1,198,708	0.09
EUR 200,000	DIC Asset AG 2.25% 22/9/2026	201,913	0.01	EUR 460,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 1.75% 18/6/2032	480,522	0.04
EUR 400,000	DZ HYP AG 0.25% 30/6/2023	451,876	0.03	EUR 1,600,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 1.875% 24/1/2052	1,441,577	0.11
EUR 250,000	DZ HYP AG 0.875% 22/3/2028	285,306	0.02	EUR 516,000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 2% 22/4/2027	593,908	0.05
EUR 420,000	E.ON SE 0.875% 18/10/2034	440,932	0.03			4,250,339	0.33
EUR 770,000	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31/3/2028	855,847	0.07				
EUR 113,000	IHO Verwaltungs GmbH 3.625% 15/5/2025	126,149	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	グアテマラ				Indonesia Government		
USD 258,000	Guatemala Government Bond '144A' 4.65% 7/10/2041	236,292	0.02	USD 400,000	International Bond 4.1% 24/4/2028	427,609	0.03
USD 322,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	294,907	0.02	USD 800,000	Indonesia Government International Bond 4.35% 8/1/2027	854,952	0.07
		531,199	0.04	USD 260,000	Indonesia Government International Bond 4.625% 15/4/2043	273,650	0.02
	ガンジー			USD 600,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 8/1/2026*	646,331	0.05
EUR 850,000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd 1.25% 14/4/2022*	955,541	0.07	USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.75% 11/2/2029	222,125	0.02
	香港			USD 400,000	Indonesia Government International Bond 5.125% 15/1/2045	447,000	0.03
USD 250,000	Bank of East Asia Ltd/The FRN 21/10/2025 (Perpetual)	253,906	0.02	IDR 7,535,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	527,088	0.04
USD 200,000	Yango Justice International Ltd 10.25% 15/9/2022	30,000	0.00	IDR 21,943,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/6/2035	1,612,086	0.12
		283,906	0.02	IDR 19,728,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	1,441,804	0.11
	ハンガリー			IDR 17,000,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.125% 15/5/2024	1,279,112	0.10
HUF 168,640,000	Hungary Government Bond 3% 21/8/2030	433,238	0.03	IDR 25,876,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	1,996,488	0.15
USD 305,000	Hungary Government International Bond '144A' 3.125% 21/9/2051*	252,322	0.02	IDR 32,497,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/3/2034	2,552,576	0.20
		685,560	0.05	USD 664,000	Pertamina Persero PT 3.1% 27/8/2030*	637,440	0.05
	インド			USD 350,000	Pertamina Persero PT 4.175% 21/1/2050	324,003	0.03
USD 490,000	Adani Electricity Mumbai Ltd 3.949% 12/2/2030	453,703	0.03	USD 200,000	Pertamina Persero PT 5.625% 20/5/2043	213,201	0.02
USD 186,250	Adani Renewable Energy RJ Ltd/Kodangal Solar Parks Pvt Ltd/Wardha Solar Maharash 4.625% 15/10/2039	175,075	0.01	USD 500,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.55% 29/3/2026*	534,973	0.04
USD 316,750	Adani Transmission Ltd 4.25% 21/5/2036	303,425	0.02	USD 200,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 5.45% 21/5/2028	217,824	0.02
USD 200,000	Axis Bank Ltd/Gift City FRN 8/9/2026 (Perpetual)*	187,500	0.01	USD 200,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.15% 21/5/2048	220,321	0.02
USD 220,000	Bharti Airtel Ltd 3.25% 3/6/2031	207,110	0.02	USD 750,000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 6.25% 25/1/2049	843,189	0.06
USD 300,000	HDFC Bank Ltd FRN 25/8/2026 (Perpetual)	279,975	0.02			15,583,333	1.20
USD 200,000	JSW Steel Ltd 5.375% 4/4/2025	203,500	0.02		国際機関		
USD 200,000	Oil India Ltd 5.125% 4/2/2029	213,639	0.02	EUR 550,000	European Investment Bank 0.25% 15/6/2040	543,395	0.04
USD 200,000	REC Ltd 3.875% 7/7/2027	201,196	0.02	USD 2,920,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 26/8/2030	2,622,222	0.20
USD 200,000	ReNew Power Pvt Ltd 5.875% 5/3/2027	199,500	0.02			3,165,617	0.24
USD 200,000	Shriram Transport Finance Co Ltd 5.1% 16/7/2023	201,650	0.02		アイルランド		
USD 200,000	Summit Digital Infrastructure Pvt Ltd 2.875% 12/8/2031	180,769	0.01	EUR 100,000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc 2.125% 15/8/2026	103,878	0.01
		2,807,042	0.22				
	インドネシア						
USD 301,000	Indonesia Government International Bond 3.5% 11/1/2028*	311,561	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 500,000	Ares European CLO VII DAC FRN 15/10/2030	560,168	0.04	EUR 777,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 DAC FRN 20/1/2033	866,233	0.07
USD 401,000	ASG Finance Designated Activity Co '144A' 7.875% 3/12/2024	395,988	0.03	EUR 763,000	RRE 2 Loan Management DAC FRN 15/7/2035	849,884	0.07
USD 401,000	ASG Finance Designated Activity Co '144A' 7.875% 3/12/2024	390,975	0.03	EUR 250,000	RRE 2 Loan Management DAC FRN 15/7/2035	277,176	0.02
EUR 255,000	Avoca CLO XXII DAC FRN 15/4/2035	281,843	0.02	EUR 1,909,000	RRE 5 Loan Management DAC 1.75% 15/1/2037	2,144,602	0.17
EUR 2,000,000	Avoca CLO XXIV DAC FRN 15/7/2034	2,226,989	0.17	EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding DAC FRN 15/4/2033	278,864	0.02
EUR 630,000	Bilbao CLO II DAC FRN 20/8/2035	703,405	0.06	GBP 577,127	Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	773,630	0.06
EUR 318,000	CVC Cordatus Loan Fund IV DAC FRN 22/2/2034	351,509	0.03	GBP 424,213	Taurus 2019-2 UK DAC FRN 17/11/2029	567,385	0.04
EUR 250,000	CVC Cordatus Loan Fund V DAC FRN 21/7/2030	279,116	0.02	GBP 99,271	Taurus 2021-1 UK DAC FRN 17/5/2031	132,896	0.01
EUR 531,000	Euro-Galaxy VI CLO DAC 'Series 2018-6X A' FRN 11/4/2031	594,213	0.05	GBP 110,191	Taurus 2021-1 UK DAC FRN 17/5/2031	147,549	0.01
EUR 530,000	Fresenius Finance Ireland Plc 0.875% 1/10/2031*	543,360	0.04	GBP 145,928	Taurus 2021-1 UK DAC FRN 17/5/2031	196,017	0.02
EUR 150,000	Henley CLO IV DAC FRN 25/4/2034	164,766	0.01	EUR 500,000	Vesey Park CLO DAC FRN 16/11/2032	557,847	0.04
EUR 1,000,000	Invesco Euro CLO II DAC FRN 15/8/2034	1,117,479	0.09	EUR 1,300,000	Voya Euro CLO II DAC FRN 15/7/2035	1,453,775	0.11
EUR 172,000	Invesco Euro CLO III DAC FRN 15/7/2032	192,108	0.02	EUR 158,000	Voya Euro CLO III DAC FRN 15/4/2033	176,510	0.01
EUR 250,000	Invesco Euro CLO IV DAC FRN 15/4/2033	279,843	0.02	EUR 1,186,000	Voya Euro CLO IV DAC 1.75% 15/10/2034	1,321,926	0.10
EUR 500,000	Invesco Euro CLO V DAC FRN 15/1/2034	563,353	0.04			22,958,124	1.77
EUR 1,490,000	Ireland Government Bond 1.7% 15/5/2037	1,835,189	0.14		マン島		
EUR 151,968	Last Mile Securities PE 2021 DAC FRN 17/8/2031	170,144	0.01	USD 408,000	AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.75% 1/10/2030	386,070	0.03
EUR 136,971	Last Mile Securities PE 2021 DAC FRN 17/8/2031	153,419	0.01		イスラエル		
EUR 300,000	Linde Plc 1% 30/9/2051	275,116	0.02	USD 658,000	Bank Leumi Le-Israel BM '144A' FRN 29/1/2031	630,652	0.05
USD 674,000	Lukoil Capital DAC '144A' 2.8% 26/4/2027	269,600	0.02	USD 304,637	Energear Israel Finance Ltd '144A' 4.5% 30/3/2024	298,163	0.02
USD 670,000	Metalloinvest Finance DAC '144A' 3.375% 22/10/2028	251,250	0.02	USD 279,000	Israel Government International Bond 2.75% 3/7/2030*	284,406	0.02
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro DAC FRN 25/11/2033	278,738	0.02	USD 359,208	Leviathan Bond Ltd '144A' 5.75% 30/6/2023	362,260	0.03
EUR 269,055	Pearl Finance 2020 DAC FRN 17/11/2032	303,265	0.02			1,575,481	0.12
EUR 212,412	Pearl Finance 2020 DAC FRN 17/11/2032	240,070	0.02	EUR 680,000	イタリア ASTM SpA 1% 25/11/2026*	737,992	0.06
EUR 453,000	Penta Clo 9 DAC FRN 25/7/2036	502,537	0.04	EUR 100,000	Autostrade per l'Italia SpA 2% 4/12/2028	107,167	0.01
USD 202,000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC '144A' 3.05% 23/1/2025	75,750	0.01	EUR 200,000	Autostrade per l'Italia SpA 2% 15/1/2030	207,651	0.02
EUR 98,000	River Green Finance 2020 DAC FRN 22/1/2032	109,759	0.01	EUR 100,000	Banco BPM SpA FRN 14/1/2031	109,009	0.01
				EUR 100,000	Brunello Bidco SpA FRN 15/2/2028	111,235	0.01
				EUR 270,000	Centurion Bidco SpA 5.875% 30/9/2026	298,907	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 68,723	Diocle Spa FRN 30/6/2026	76,604	0.01		日本		
EUR 300,000	doValue SpA 3.375% 31/7/2026*	326,096	0.02	EUR 350,000	Asahi Group Holdings Ltd 0.01% 19/4/2024	389,084	0.03
EUR 560,000	Eni SpA FRN 11/2/2030 (Perpetual)	561,015	0.04	EUR 330,000	Asahi Group Holdings Ltd 0.155% 23/10/2024	366,219	0.03
EUR 900,000	Eni SpA 3.625% 29/1/2029	1,154,739	0.09	EUR 500,000	East Japan Railway Co 1.104% 15/9/2039	496,560	0.04
EUR 561,000	FCA Bank SpA/Ireland 0.25% 28/2/2023	631,506	0.05	JPY 100,000,000	Japan Expressway Holding and Debt Repayment Agency 0.306% 31/3/2050	743,176	0.06
EUR 200,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 20/1/2025 (Perpetual)	231,064	0.02	JPY 2,106,600,000	Japan Government Five Year Bond 0.005% 20/6/2026	18,286,233	1.41
EUR 500,000	Intesa Sanpaolo SpA FRN 1/9/2031 (Perpetual)	574,855	0.04	JPY 607,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.5% 20/3/2059	4,624,898	0.36
EUR 360,000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 4/12/2024	403,785	0.03	JPY 560,000,000	Japan Government Forty Year Bond 0.8% 20/3/2058	4,726,097	0.36
EUR 390,000	Intesa Sanpaolo SpA 1.35% 24/2/2031	396,837	0.03	JPY 121,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.9% 20/3/2057	1,056,892	0.08
EUR 1,300,000	Intesa Sanpaolo SpA 3.625% 5/12/2022	1,503,962	0.12	JPY 125,600,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/9/2050	1,017,784	0.08
EUR 7,510,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1/8/2026 (Zero Coupon)	8,118,495	0.62	JPY 73,800,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/6/2048	624,052	0.05
EUR 2,256,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.45% 1/3/2036	2,379,989	0.18	JPY 110,150,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/12/2048	926,606	0.07
EUR 1,620,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.5% 30/4/2045	1,577,266	0.12	JPY 633,400,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/9/2051	5,259,574	0.40
EUR 2,830,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.15% 1/9/2052	2,991,624	0.23	JPY 99,050,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.8% 20/3/2048	859,136	0.07
EUR 1,206,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.45% 1/9/2050	1,368,333	0.10	JPY 552,600,000	Japan Government Thirty Year Bond 2.3% 20/3/2040	6,206,687	0.48
EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.7% 1/3/2047	6,040	0.00	JPY 151,850,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.3% 20/9/2039	1,259,714	0.10
EUR 1,970,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.95% 1/9/2038	2,486,055	0.19	JPY 509,400,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/6/2040	4,268,874	0.33
EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.45% 1/3/2048	6,835	0.00	JPY 489,250,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/9/2036	4,295,577	0.33
EUR 270,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.85% 1/9/2049	393,239	0.03	JPY 278,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/3/2038	2,415,214	0.19
EUR 100,000	Poste Italiane SpA 2.625% 24/6/2170	96,873	0.01	JPY 366,200,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/12/2038	3,161,066	0.24
EUR 130,000	Rekeep SpA 7.25% 1/2/2026	152,913	0.01	JPY 108,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/12/2036	959,748	0.07
EUR 68,750	Sisal SpA/Milano 7% 31/7/2023	77,630	0.01	JPY 122,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/6/2037	1,081,386	0.08
EUR 440,000	Snam SpA 0.75% 20/6/2029	470,993	0.04	JPY 3,500,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/12/2037	30,947	0.00
EUR 100,000	Telecom Italia SpA/Milano 4% 11/4/2024	114,959	0.01				
EUR 400,000	UniCredit SpA FRN 3/6/2025 (Perpetual)*	443,891	0.03				
		28,117,559	2.16				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
JPY 208,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.7% 20/3/2037	1,871,377	0.14	USD 200,000	KazMunayGas National Co JSC 4.75% 19/4/2027	207,003	0.02
JPY 3,042,900,000	Japan Government Two Year Bond 0.005% 1/1/2024	26,428,120	2.03		クウェート Burgan Bank SAK FRN 9/7/2024 (Perpetual)	808,003	0.06
JPY 14,100,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/9/2023	131,128	0.01	USD 242,000	ルクセンブルグ ADLER Group SA 2.75% 13/11/2026	235,660	0.02
USD 352,000	Mizuho Financial Group Inc FRN 10/7/2024	347,495	0.03	EUR 200,000	ADLER Group SA 3.25% 5/8/2025	189,243	0.01
USD 345,000	Mizuho Financial Group Inc FRN 8/9/2024	337,505	0.03	EUR 200,000	Altice Financing SA 2.25% 15/1/2025	195,374	0.01
EUR 200,000	Rakuten Group Inc FRN 22/4/2027 (Perpetual)	197,422	0.01	EUR 235,000	Altice Financing SA 4.25% 15/8/2029	247,392	0.02
USD 400,000	SoftBank Group Corp FRN 19/7/2023 (Perpetual)*	391,122	0.03	EUR 100,000	Atento Luxco 1 SA 144A' 8% 10/2/2026	101,460	0.01
EUR 100,000	SoftBank Group Corp 2.875% 6/1/2027	101,045	0.01	USD 200,000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 4/6/2023	204,121	0.02
EUR 100,000	SoftBank Group Corp 4.75% 30/7/2025	113,625	0.01	EUR 740,000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 12/2/2036	835,309	0.06
EUR 400,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2% 9/7/2040	421,390	0.03	EUR 170,000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.336% 13/8/2041	169,473	0.01
USD 1,650,000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 5% 26/11/2028	1,845,561	0.14	EUR 400,000	BL Consumer Credit 2021 FRN 25/9/2038	373,043	0.03
		95,241,314	7.33	EUR 191,000	BL Consumer Credit 2021 FRN 25/9/2038	213,789	0.02
	ジャージー			EUR 147,000	Cidron Aida Finco Sarl 6.25% 1/4/2028	164,509	0.01
EUR 100,000	Avis Budget Finance Plc 4.125% 15/11/2024	112,852	0.01	GBP 300,000	CSN Resources SA 144A' 5.875% 8/4/2032	372,061	0.03
GBP 100,000	CPUK Finance Ltd 6.5% 28/8/2026	136,672	0.01	USD 291,000	DH Europe Finance II Sarl 1.35% 18/9/2039	280,451	0.02
GBP 240,000	Galaxy Bidco Ltd 6.5% 31/7/2026	322,006	0.02	EUR 300,000	EIG Pearl Holdings Sarl '144A' 3.545% 31/8/2036	301,574	0.02
USD 390,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd '144A' 2.16% 31/3/2034	362,700	0.03	USD 1,554,000	EIG Pearl Holdings Sarl '144A' 4.387% 30/11/2046*	1,524,862	0.12
USD 550,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 2.625% 31/3/2036	498,930	0.04	USD 1,798,000	European Financial Stability Facility 1.75% 17/7/2053	1,757,365	0.14
USD 694,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 2.94% 30/9/2040	638,480	0.05	EUR 2,390,000	FEL Energy VI Sarl 5.75% 1/12/2040	3,184,326	0.24
USD 245,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd '144A' 2.94% 30/9/2040	225,400	0.02	USD 384,960	Garfunkelux Holdco 3 SA 6.75% 1/11/2025	363,787	0.03
GBP 950,000	Heathrow Funding Ltd 2.625% 16/3/2028	1,221,634	0.09	EUR 200,000	Garfunkelux Holdco 3 SA 7.75% 1/11/2025	225,844	0.02
USD 2,000,000	HPS Loan Management 15-2019 Ltd 'Series 15A-19 A1' '144A' FRN 22/7/2032	1,988,996	0.15	GBP 100,000	GoI Finance SA '144A' 7% 31/1/2025	134,962	0.01
GBP 100,000	Kane Bidco Ltd 6.5% 15/2/2027	134,807	0.01	USD 488,000	Highland Holdings Sarl 0.318% 15/12/2026	441,013	0.03
		5,642,477	0.43	EUR 560,000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.125% 19/7/2027*	605,439	0.05
	カザフスタン			EUR 800,000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.5% 3/9/2030	844,153	0.06
USD 200,000	Kazakhstan Government International Bond 4.875% 14/10/2044	205,000	0.01	EUR 130,000	JSM Global Sarl '144A' 4.75% 20/10/2030	129,939	0.01
USD 200,000	Kazakhstan Government International Bond 5.125% 21/7/2025	214,000	0.02	USD 327,000		285,716	0.02
USD 200,000	KazMunayGas National Co JSC '144A' 3.5% 14/4/2033	182,000	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	Kenbourne Invest SA '144A' 4.7% 22/1/2028	186,521	0.01	EUR 800,000	Traton Finance Luxembourg SA 14/6/2024 (Zero Coupon)	887,342	0.07
USD 467,000	Kenbourne Invest SA '144A' 6.875% 26/11/2024	475,044	0.04	EUR 600,000	Traton Finance Luxembourg SA 0.125% 10/11/2024	664,230	0.05
EUR 100,000	Lion/Polaris Lux 4 SA FRN 1/7/2026	111,631	0.01			23,112,495	1.78
EUR 200,000	Lune Holdings Sarl 5.625% 15/11/2028	206,556	0.02		マレーシア		
USD 315,000	MC Brazil Downstream Trading SARL '144A' 7.25% 30/6/2031	293,737	0.02	MYR 2,130,000	Malaysia Government Bond 4.893% 8/6/2038	548,418	0.04
EUR 110,000	Medtronic Global Holdings SCA 0.25% 2/7/2025	121,929	0.01	MYR 5,600,000	Malaysia Government Investment Issue 4.07% 30/9/2026	1,373,826	0.11
EUR 1,100,000	Medtronic Global Holdings SCA 0.375% 7/3/2023	1,239,008	0.10	MYR 5,200,000	Malaysia Government Investment Issue 4.245% 30/9/2030	1,287,462	0.10
EUR 460,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 7/3/2027	519,607	0.04	USD 500,000	Malaysia Sukuk Global Bhd 3.179% 27/4/2026*	521,250	0.04
EUR 101,000	Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 15/10/2040	100,744	0.01			3,730,956	0.29
USD 257,000	Millicom International Cellular SA '144A' 4.5% 27/4/2031	239,579	0.02		モーリシャス		
USD 205,000	Millicom International Cellular SA '144A' 4.5% 27/4/2031	191,104	0.01	USD 200,000	Azure Power Energy Ltd '144A' 3.575% 19/8/2026	193,250	0.01
USD 627,300	Millicom International Cellular SA '144A' 5.125% 15/1/2028	614,611	0.05	USD 200,000	Greenko Mauritius Ltd 6.25% 21/2/2023	202,000	0.02
USD 532,000	Nexa Resources SA '144A' 5.375% 4/5/2027	533,871	0.04	USD 320,000	HTA Group Ltd/Mauritius '144A' 7% 18/12/2025*	325,878	0.03
EUR 125,000	Prologis International Funding II SA 1.625% 17/6/2032	135,965	0.01	USD 243,375	India Cleantech Energy '144A' 4.7% 10/8/2026	238,546	0.02
EUR 315,000	Prologis International Funding II SA 2.375% 14/11/2030	373,654	0.03	USD 200,000	Network i2i Ltd FRN 15/1/2025 (Perpetual)	202,422	0.02
USD 200,000	Puma International Financing SA 5.125% 6/10/2024	197,500	0.02	USD 200,000	UPL Corp Ltd FRN 27/2/2025 (Perpetual)	190,856	0.01
USD 402,000	Puma International Financing SA '144A' 5.125% 6/10/2024*	396,975	0.03	USD 200,000	UPL Corp Ltd 4.625% 16/6/2030	195,403	0.01
EUR 500,000	Repsol Europe Finance Sarl 0.875% 6/7/2033	507,601	0.04			1,548,355	0.12
EUR 118,000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	135,418	0.01		メキシコ		
EUR 87,469	SC Germany SA Compartment Consumer 2020-1 FRN 14/11/2034	98,958	0.01	USD 200,000	Alpek SAB de CV '144A' 3.25% 25/2/2031	183,721	0.01
EUR 87,469	SC Germany SA Compartment Consumer 2020-1 FRN 14/11/2034	99,451	0.01	USD 200,000	America Movil SAB de CV 4.375% 16/7/2042	213,499	0.02
EUR 100,000	SES SA FRN 27/5/2026 (Perpetual)	103,352	0.01	USD 401,000	Axtel SAB de CV '144A' 6.375% 14/11/2024*	413,127	0.03
EUR 630,000	SES SA 2% 2/7/2028*	709,091	0.05	USD 200,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman '144A' FRN 24/1/2032 (Perpetual)	184,554	0.01
USD 440,000	Simpar Europe SA '144A' 5.2% 26/1/2031	370,443	0.03	USD 540,000	Banco Mercantil del Norte SA/ Grand Cayman 5.875% 24/1/2171	497,305	0.04
EUR 400,000	Summer BC Holdco B SARL 5.75% 31/10/2026	453,368	0.03	USD 400,000	BBVA Bancomer SA/Texas FRN 18/1/2033	384,720	0.03
				USD 275,000	Braskem Idesa SAPI '144A' 6.99% 20/2/2032*	263,313	0.02
				USD 205,000	Cemex SAB de CV '144A' FRN 8/6/2026 (Perpetual)	196,751	0.02
				USD 226,000	Cemex SAB de CV '144A' FRN 8/6/2026 (Perpetual)	216,440	0.02
				EUR 100,000	Cemex SAB de CV 3.125% 19/3/2026	113,279	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 234,000	Cemex SAB de CV ' 144A' 5.2% 17/9/2030	229,149	0.02	USD 6,119,000	Petroleos Mexicanos ' 144A' 6.7% 16/2/2032	5,906,671	0.45
USD 292,000	Comision Federal de Electricidad ' 144A' 4.688% 15/5/2029	288,350	0.02	USD 230,000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	188,945	0.02
USD 428,000	Cydsa SAB de CV ' 144A' 6.25% 4/10/2027	421,582	0.03	USD 905,000	Petroleos Mexicanos 6.84% 23/1/2030	902,738	0.07
USD 200,000	Grupo Televisa SAB 5.25% 24/5/2049	228,737	0.02	USD 391,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16/10/2025	416,220	0.03
USD 200,000	Industrias Penoles SAB de CV ' 144A' 4.75% 6/8/2050	188,625	0.01	USD 498,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	526,635	0.04
USD 200,000	Industrias Penoles SAB de CV ' 144A' 4.75% 6/8/2050	188,625	0.01	USD 124,000	Petroleos Mexicanos 6.95% 28/1/2060	102,300	0.01
USD 200,000	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV ' 144A' 2.431% 1/7/2031	183,437	0.01	USD 10,000	Petroleos Mexicanos 6.95% 28/1/2060	8,250	0.00
USD 150,000	Metalsa S A P I De Cv 3.75% 4/5/2031	134,515	0.01	MXN 79,198	Petroleos Mexicanos 7.19% 12/9/2024	373,935	0.03
MXN 1,300,000	Mexican Bonos 7.5% 3/6/2027	6,299,611	0.49	USD 332,000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/1/2050	295,546	0.02
MXN 3,000,000	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	14,634,340	1.13	USD 200,000	Trust Fibra Uno ' 144A' 5.25% 30/1/2026	207,785	0.02
MXN 1,025,750	Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034	4,958,816	0.38			52,223,937	4.02
MXN 340,000	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	1,681,278	0.13		モンゴル		
MXN 790,000	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	4,030,285	0.31	USD 200,000	Mongolia Government International Bond 5.125% 7/4/2026	199,000	0.02
USD 623,000	Mexico City Airport Trust ' 144A' 4.25% 31/10/2026	634,681	0.05		モロッコ		
USD 998,000	Mexico City Airport Trust 5.5% 31/7/2047	903,190	0.07	USD 629,000	Morocco Government International Bond ' 144A' 3% 15/12/2032	551,161	0.05
USD 899,000	Mexico Government International Bond 4.35% 15/1/2047	827,305	0.06	USD 518,000	Morocco Government International Bond ' 144A' 4% 15/12/2050	410,515	0.03
USD 1,455,000	Mexico Government International Bond 4.4% 12/2/2052*	1,326,960	0.10	USD 200,000	Morocco Government International Bond ' 144A' 4% 15/12/2050	158,500	0.01
USD 519,000	Mexico Government International Bond 4.5% 22/4/2029	548,453	0.04			1,120,176	0.09
USD 400,000	Mexico Government International Bond 4.5% 31/1/2050	374,400	0.03		オランダ		
USD 400,000	Mexico Government International Bond 4.6% 23/1/2046	381,600	0.03	EUR 100,000	Abertis Infraestructuras Finance BV FRN 24/11/2025 (Perpetual)	108,297	0.01
USD 308,000	Mexico Government International Bond 4.75% 8/3/2044	301,763	0.02	EUR 235,000	ABN AMRO Bank NV 0.5% 17/7/2023	265,274	0.02
USD 1,193,000	Operadora de Servicios Mega SA de CV Sofom ER ' 144A' 8.25% 11/2/2025*	1,021,781	0.08	EUR 300,000	ABN AMRO Bank NV 0.875% 14/1/2026	342,743	0.03
USD 162,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 27/6/2044	123,444	0.01	EUR 200,000	ABN AMRO Bank NV 1.45% 12/4/2038	235,975	0.02
USD 241,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031*	223,889	0.02	EUR 450,000	ABN AMRO Bank NV 2.5% 5/9/2023	525,408	0.04
USD 482,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027	493,387	0.04	EUR 320,000	Airbus SE 2.375% 9/6/2040	364,988	0.03
				EUR 400,000	Allianz Finance II BV 0.25% 6/6/2023	450,391	0.03
				EUR 160,000	ASML Holding NV 1.375% 7/7/2026	184,416	0.01
				EUR 100,000	ATF Netherlands BV FRN 20/1/2023 (Perpetual)	113,822	0.01
				EUR 100,000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 3.75% 15/1/2025	110,441	0.01
				EUR 280,000	BP Capital Markets BV 1.467% 21/9/2041	259,997	0.02
				USD 377,000	Braskem Netherlands Finance BV ' 144A' FRN 23/1/2081	418,140	0.03

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	Braskem Netherlands Finance BV 4.5% 10/1/2028	200,782	0.01	EUR 100,000	Koninklijke KPN NV FRN 8/11/2024 (Perpetual)	109,042	0.01
USD 200,000	Braskem Netherlands Finance BV '144A' 4.5% 31/1/2030	196,533	0.01	USD 200,000	Lukoil International Finance BV 4.75% 2/11/2026	80,000	0.01
USD 399,000	Braskem Netherlands Finance BV '144A' 5.875% 31/1/2050	394,593	0.03	EUR 160,000	Mondelez International Holdings Netherlands BV 1.25% 9/9/2041	151,495	0.01
EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank UA 1.5% 26/4/2038	238,454	0.02	USD 250,000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.125% 7/5/2029	220,122	0.02
GBP 620,000	Cooperatieve Rabobank UA 4.625% 23/5/2029	909,963	0.07	USD 275,436	MV24 Capital BV '144A' 6.748% 1/6/2034	268,099	0.02
EUR 515,000	Deutsche Telekom International Finance BV 4.25% 13/7/2022*	587,546	0.04	EUR 100,000	Naturgy Finance BV FRN 23/11/2026 (Perpetual)	102,985	0.01
EUR 100,000	Dufry One BV 2% 15/2/2027	101,233	0.01	EUR 1,110,000	Netherlands Government Bond '144A' 15/7/2030 (Zero Coupon)	1,218,404	0.09
EUR 125,000	Dutch Property Finance 2020-2 BV FRN 28/1/2058	141,754	0.01	EUR 1,620,000	Netherlands Government Bond '144A' 0.25% 15/7/2029	1,827,138	0.14
EUR 178,000	Dutch Property Finance 2021-1 BV FRN 28/7/2058	199,914	0.01	EUR 693,000	Netherlands Government Bond '144A' 2.75% 15/1/2047	1,181,996	0.09
USD 220,000	Embraer Netherlands Finance BV 5.05% 15/6/2025	223,951	0.02	EUR 1,040,000	Netherlands Government Bond '144A' 4% 15/1/2037	1,752,123	0.13
USD 132,000	Embraer Netherlands Finance BV 5.4% 1/2/2027	132,908	0.01	EUR 150,000	Nobel Bidco BV 3.125% 15/6/2028	152,346	0.01
USD 200,000	Embraer Netherlands Finance BV '144A' 6.95% 17/1/2028	208,750	0.02	USD 210,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ' 144A' 3.25% 30/11/2051	181,012	0.01
EUR 300,000	Enel Finance International NV 17/6/2024 (Zero Coupon)	333,004	0.03	USD 1,738,000	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc ' 144A' 4.3% 18/6/2029	1,850,657	0.14
EUR 170,000	Enel Finance International NV 0.875% 28/9/2034	167,285	0.01	EUR 90,000	OCI NV 3.625% 15/10/2025	101,958	0.01
USD 204,000	Equate Petrochemical BV '144A' 2.625% 28/4/2028	193,035	0.01	EUR 100,000	OI European Group BV 2.875% 15/2/2025	109,502	0.01
USD 306,000	Equate Petrochemical BV '144A' 4.25% 3/11/2026	317,218	0.02	USD 491,000	Petrobras Global Finance BV 5.299% 27/1/2025	516,654	0.04
EUR 100,000	Ferrovial Netherlands BV FRN 14/2/2023 (Perpetual)	109,799	0.01	EUR 100,000	Phoenix PIB Dutch Finance BV 2.375% 5/8/2025	111,096	0.01
EUR 810,000	Heimstaden Bostad Treasury BV 0.25% 13/10/2024	894,061	0.07	EUR 200,000	Redexis Gas Finance BV 1.875% 28/5/2025	230,693	0.02
EUR 470,000	Imperial Brands Finance Netherlands BV 1.75% 18/3/2033	472,677	0.04	EUR 600,000	Redexis Gas Finance BV 1.875% 27/4/2027	676,056	0.05
EUR 500,000	ING Bank NV 0.875% 11/4/2028	569,781	0.04	EUR 120,000	RELX Finance BV 0.5% 10/3/2028	128,577	0.01
EUR 100,000	ING Groep NV FRN 3/9/2025	109,935	0.01	EUR 100,000	Repsol International Finance BV FRN 11/3/2026 (Perpetual)	112,022	0.01
USD 753,000	ING Groep NV '144A' FRN 1/7/2026	721,364	0.06	EUR 335,000	Shell International Finance BV 0.125% 8/11/2027	358,552	0.03
USD 209,000	ING Groep NV '144A' 4.625% 6/1/2026	224,001	0.02	USD 631,000	Shell International Finance BV 2.375% 7/11/2029	607,173	0.05
EUR 540,000	JDE Peet's NV 0.625% 9/2/2028*	572,370	0.04	EUR 100,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 20/2/2026 (Zero Coupon)	109,562	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 100,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.3% 28/2/2024	112,666	0.01	USD 309,000	オマーン Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047	288,529	0.02
EUR 30,000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 0.5% 5/9/2034	30,528	0.00	USD 300,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048	288,000	0.02
EUR 540,000	Stellantis NV 1.25% 20/6/2033	540,724	0.04	USD 230,000	Oman Government International Bond 7.375% 28/10/2032	256,163	0.02
EUR 1,300,000	Telefonica Europe BV FRN 14/12/2024 (Perpetual)	1,511,950	0.12	USD 200,000	Oman Sovereign Sukuk Co ' 144A' 4.875% 15/6/2030	210,000	0.02
EUR 380,000	TenneT Holding BV 0.875% 16/6/2035	385,225	0.03	USD 856,000	OQ SAOC ' 144A' 5.125% 6/5/2028	854,769	0.07
EUR 100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 9/5/2027	105,555	0.01			1,897,461	0.15
EUR 100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.5% 1/3/2025	111,769	0.01	USD 200,000	パキスタン Pakistan Water & Power Development Authority 7.5% 4/6/2031	168,000	0.01
EUR 370,000	Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18/10/2041	373,775	0.03				
EUR 100,000	United Group BV 4% 15/11/2027	104,285	0.01	USD 259,000	パナマ Aeropuerto Internacional de Tocumen SA ' 144A' 4% 11/8/2041*	238,162	0.02
EUR 300,000	United Group BV 4.875% 1/7/2024	337,319	0.03	USD 451,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA ' 144A' 4% 11/8/2041*	414,829	0.03
USD 232,000	VEON Holdings BV ' 144A' 3.375% 25/11/2027	87,000	0.01	USD 905,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA ' 144A' 5.125% 11/8/2061	829,288	0.06
USD 704,000	VEON Holdings BV ' 144A' 3.375% 25/11/2027	264,000	0.02	USD 641,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA ' 144A' 2.375% 14/9/2025	629,637	0.05
USD 343,000	VEON Holdings BV ' 144A' 4% 9/4/2025	128,625	0.01	USD 228,000	Banco Nacional de Panama ' 144A' 2.5% 11/8/2030	200,948	0.02
EUR 570,000	Viterra Finance BV 0.375% 24/9/2025	618,768	0.05	USD 518,000	Banco Nacional de Panama ' 144A' 2.5% 11/8/2030	456,539	0.04
GBP 200,000	Volkswagen Financial Services NV 1.625% 10/2/2024	265,404	0.02	EUR 120,000	Carnival Corp 10.125% 1/2/2026	150,006	0.01
EUR 700,000	Volkswagen International Finance NV 1.125% 2/10/2023	796,124	0.06	USD 600,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	617,007	0.05
EUR 300,000	Volkswagen International Finance NV 4.125% 16/11/2038	422,849	0.03	USD 790,000	Panama Government International Bond 4.5% 15/5/2047	769,288	0.06
EUR 1,000,000	Vonovia Finance BV 1.625% 7/10/2039	945,970	0.07	USD 200,000	Panama Government International Bond 4.5% 1/4/2056	191,046	0.01
USD 167,000	Ziggo Bond Co BV ' 144A' 6% 15/1/2027	169,925	0.01	USD 200,000	Panama Government International Bond 4.5% 19/1/2063	187,600	0.01
		31,070,528	2.39			4,684,350	0.36
NZD 1,110,000	ニュージーランド New Zealand Government Bond 4.5% 15/4/2027	815,888	0.06	USD 200,000	パラグアイ Frigorifico Concepcion SA ' 144A' 7.7% 21/7/2028	188,125	0.01
EUR 100,000	ノルウェー Adevinta ASA 2.625% 15/11/2025	111,317	0.01				
EUR 290,000	Aker BP ASA 1.125% 12/5/2029	304,932	0.02				
EUR 5,910,000	DNB Boligkreditt AS 1.875% 21/11/2022	6,744,544	0.52				
NOK 6,650,000	Norway Government Bond ' 144A' 1.75% 17/2/2027	744,016	0.06				
		7,904,809	0.61				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 694,000	Paraguay Government International Bond '144A' 2.739% 29/1/2033	605,288	0.05	USD 247,000	SAN Miguel Industrias Pet SA / NG PET R&P Latin America SA '144A' 3.5% 2/8/2028	226,916	0.02
USD 286,000	Paraguay Government International Bond '144A' 4.95% 28/4/2031*	297,305	0.02			3,885,659	0.30
USD 328,000	Paraguay Government International Bond '144A' 4.95% 28/4/2031*	340,965	0.03		フィリピン		
USD 600,000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026	626,574	0.05	USD 200,000	Philippine Government International Bond 2.95% 5/5/2045*	170,500	0.01
USD 200,000	Paraguay Government International Bond '144A' 5.4% 30/3/2050	195,891	0.01	USD 324,000	Philippine Government International Bond 2.95% 5/5/2045*	276,210	0.02
USD 200,000	Paraguay Government International Bond 5.4% 30/3/2050	195,891	0.02	USD 500,000	Philippine Government International Bond 3.7% 1/3/2041	476,250	0.04
USD 150,000	Paraguay Government International Bond '144A' 5.4% 30/3/2050	146,918	0.01	USD 624,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	651,300	0.05
		2,596,957	0.20	USD 200,000	Philippine Government International Bond 6.375% 23/10/2034	255,000	0.02
	ペルー			USD 200,000	Rizal Commercial Banking Corp FRN 27/8/2025 (Perpetual)	194,241	0.02
USD 200,000	InRetail Consumer '144A' 3.25% 22/3/2028	188,250	0.01			2,023,501	0.16
USD 270,000	InRetail Consumer 3.25% 22/3/2028	255,047	0.02		ポーランド		
USD 490,000	Kallpa Generacion SA 4.875% 24/5/2026	502,914	0.04	PLN 5,930,000	Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2026	1,325,766	0.10
USD 245,000	Orazul Energy Egenor SCA '144A' 5.625% 28/4/2027	234,322	0.02	PLN 3,300,000	Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2027	726,392	0.06
USD 281,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032	239,254	0.02	PLN 460,000	Republic of Poland Government Bond 2.75% 25/10/2029	100,263	0.01
USD 260,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	244,930	0.02	PLN 4,945,000	Republic of Poland Government Bond 4% 25/10/2023*	1,184,096	0.09
USD 600,000	Peruvian Government International Bond 2.844% 20/6/2030	575,418	0.04	EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.375% 22/10/2027	567,490	0.04
USD 120,000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034	110,040	0.01	EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.5% 9/9/2025	571,446	0.04
USD 273,000	Peruvian Government International Bond 3.3% 11/3/2041	242,629	0.02	USD 500,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	517,890	0.04
USD 255,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	268,041	0.02			4,993,343	0.38
USD 242,000	Peruvian Government International Bond 7.35% 21/7/2025	277,786	0.02		ポルトガル		
USD 200,000	Petroleos del Peru SA 4.75% 19/6/2032	192,140	0.01	EUR 610,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 1.95% 15/6/2029	743,554	0.06
USD 357,000	SAN Miguel Industrias Pet SA / NG PET R&P Latin America SA '144A' 3.5% 2/8/2028	327,972	0.03	EUR 1,570,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 2.125% 17/10/2028	1,932,401	0.15
				EUR 357,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4.1% 15/4/2037	551,136	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 88,079	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ Volta VII 0.7% 12/2/2024	98,568	0.01	USD 600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 5.625% 4/4/2042	180,000	0.01
		3,325,659	0.26			1,484,894	0.11
	カタール				サウジアラビア		
USD 213,000	Qatar Energy 3.125% 12/7/2041	200,752	0.02	USD 270,000	Saudi Government International Bond 3.25% 22/10/2030	278,775	0.02
USD 200,000	Qatar Energy 3.125% 12/7/2041	188,500	0.01	USD 770,000	Saudi Government International Bond 3.45% 2/2/2061	703,588	0.05
USD 200,000	Qatar Energy 3.3% 12/7/2051	189,000	0.01	USD 696,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028*	736,020	0.06
USD 351,000	Qatar Energy '144A' 3.3% 12/7/2051*	331,695	0.03	USD 210,000	Saudi Government International Bond 4% 17/4/2025	221,340	0.02
USD 500,000	Qatar Government International Bond 3.25% 2/6/2026	518,063	0.04	USD 682,000	Saudi Government International Bond ' 144A' 4.375% 16/4/2029	756,167	0.06
USD 280,000	Qatar Government International Bond 3.75% 16/4/2030	302,225	0.02	USD 200,000	Saudi Government International Bond ' 144A' 4.375% 16/4/2029	221,750	0.02
USD 283,000	Qatar Government International Bond ' 144A' 4% 14/3/2029	308,293	0.02	USD 400,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	449,000	0.03
USD 340,000	Qatar Government International Bond ' 144A' 4% 14/3/2029	370,388	0.03			3,366,640	0.26
USD 600,000	Qatar Government International Bond 4.5% 23/4/2028	666,375	0.05		シンガポール		
USD 200,000	Qatar Government International Bond 4.625% 2/6/2046	235,000	0.02	USD 200,000	ABJA Investment Co Pte Ltd 5.95% 31/7/2024	212,500	0.02
USD 200,000	Qatar Government International Bond 5.103% 23/4/2048	251,500	0.02	USD 518,768	Continuum Energy Levanter Pte Ltd ' 144A' 4.5% 9/2/2027*	506,447	0.04
		3,561,791	0.27	USD 250,000	DBS Group Holdings Ltd FRN 27/2/2025 (Perpetual)	246,875	0.02
	ルーマニア			USD 252,793	LLPL Capital Pte Ltd 6.875% 4/2/2039	266,571	0.02
RON 1,870,000	Romania Government Bond 4.15% 26/1/2028	391,903	0.03	USD 200,000	Medco Oak Tree Pte Ltd 7.375% 14/5/2026	202,500	0.02
EUR 2,530,000	Romanian Government International Bond 2.375% 19/4/2027	2,789,862	0.22	SGD 1,920,000	Singapore Government Bond 2% 1/2/2024	1,435,542	0.11
USD 270,000	Romanian Government International Bond ' 144A' 3% 14/2/2031*	248,400	0.02	SGD 530,000	Singapore Government Bond 2.75% 1/4/2042	430,541	0.03
USD 152,000	Romanian Government International Bond ' 144A' 3% 14/2/2031*	139,840	0.01	SGD 1,050,000	Singapore Government Bond 3.5% 1/3/2027	839,426	0.06
USD 448,000	Romanian Government International Bond ' 144A' 3.625% 27/3/2032	424,480	0.03	USD 250,000	Temasek Financial I Ltd '144A' 3.625% 1/8/2028	270,316	0.02
USD 328,000	Romanian Government International Bond 4% 14/2/2051	278,800	0.02			4,410,718	0.34
		4,273,285	0.33		スロバキア		
	ロシア連邦			EUR 580,000	Slovakia Government Bond 0.75% 9/4/2030	662,799	0.05
RUB 106,798,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.1% 18/7/2035	284,894	0.02		スロベニア		
USD 400,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.25% 23/6/2027	120,000	0.01	EUR 110,000	Slovenia Government Bond 1.75% 3/11/2040	130,213	0.01
USD 3,000,000	Russian Foreign Bond - Eurobond 4.375% 21/3/2029	900,000	0.07		南アフリカ		
				USD 200,000	Eskom Holdings SOC Ltd 7.125% 11/2/2025	197,177	0.01
				ZAR 78,000,000	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031	4,246,830	0.33

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
ZAR 146,800,000	Republic of South Africa Government Bond 8.25% 31/3/2032	8,551,948	0.66	EUR 200,000	CaixaBank SA FRN 18/7/2022 (Perpetual)	227,500	0.02
ZAR 39,232,500	Republic of South Africa Government Bond 8.5% 31/1/2037	2,167,125	0.17	EUR 200,000	CaixaBank SA FRN 19/9/2023 (Perpetual)	233,301	0.02
USD 200,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.875% 14/4/2026	205,215	0.01	EUR 200,000	CaixaBank SA 1.125% 17/5/2024	226,400	0.02
USD 337,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.75% 30/9/2049	290,771	0.02	EUR 1,200,000	CaixaBank SA 4.125% 24/3/2036*	1,881,302	0.14
		15,659,066	1.20	EUR 69,472	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 FRN 20/3/2033	78,845	0.01
	韓国			EUR 100,000	International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/3/2025	108,304	0.01
USD 440,000	Heungkuk Life Insurance Co Ltd FRN 9/11/2022 (Perpetual)	441,375	0.03	EUR 140,000	Lorca Telecom Bondco SA 4% 18/9/2027	151,419	0.01
USD 530,000	Kookmin Bank FRN 2/7/2024 (Perpetual)	539,209	0.04	EUR 1,000,000	Merlin Properties Socimi SA 1.875% 4/12/2034*	994,741	0.08
USD 200,000	Korea Gas Corp 2.25% 18/7/2026*	199,467	0.01	EUR 3,600,000	Spain Government Bond 31/1/2027 (Zero Coupon)	3,938,955	0.30
USD 600,000	Korea International Bond 2.75% 19/1/2027	617,793	0.05	EUR 5,900,000	Spain Government Bond '144A' 0.1% 30/4/2031	6,093,061	0.47
KRW 743,530,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2025	591,998	0.05	EUR 10,000	Spain Government Bond 0.4% 30/4/2022	11,240	0.00
KRW 2,190,680,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2039	1,424,600	0.11	EUR 1,030,000	Spain Government Bond '144A' 0.5% 31/10/2031	1,093,286	0.08
KRW 2,686,940,000	Korea Treasury Bond 1.25% 10/3/2026	2,131,540	0.16	EUR 3,800,000	Spain Government Bond '144A' 0.85% 30/7/2037	3,887,453	0.30
KRW 3,290,120,000	Korea Treasury Bond 1.5% 10/3/2025	2,672,151	0.21	EUR 634,000	Spain Government Bond '144A' 1% 31/10/2050	582,272	0.04
KRW 3,055,840,000	Korea Treasury Bond 1.875% 10/6/2029	2,423,475	0.19	EUR 960,000	Spain Government Bond '144A' 1.4% 30/7/2028	1,127,413	0.09
KRW 1,200,000,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2046	880,659	0.07	EUR 212,000	Spain Government Bond '144A' 2.35% 30/7/2033	267,090	0.02
KRW 1,614,570,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2049	1,179,972	0.09	EUR 3,460,000	Spain Government Bond '144A' 3.45% 30/7/2066	5,277,191	0.41
KRW 420,000,000	Korea Treasury Bond 2.125% 10/3/2047	315,830	0.02	EUR 28,000	Spain Government Bond '144A' 5.15% 31/10/2044	52,569	0.00
KRW 2,169,270,000	Korea Treasury Bond 2.25% 10/12/2025	1,792,438	0.14			29,189,268	2.25
KRW 530,000,000	Korea Treasury Bond 2.375% 10/9/2038	422,057	0.03		スリランカ		
USD 250,000	Shinhan Financial Group Co Ltd FRN 12/5/2026 (Perpetual)	236,875	0.02	USD 200,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	97,888	0.01
		15,869,439	1.22	USD 200,000	Sri Lanka Government International Bond 7.85% 14/3/2029	90,043	0.00
	スペイン					187,931	0.01
EUR 700,000	Amadeus IT Group SA 2.875% 20/5/2027	845,561	0.06		スウェーデン		
EUR 100,000	Autonoria Spain 2021 FT FRN 31/1/2039	112,006	0.01	EUR 200,000	Heimstaden Bostad AB FRN 1/2/2027 (Perpetual)	191,922	0.01
EUR 400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN 29/3/2024 (Perpetual)	462,894	0.04	EUR 100,000	Heimstaden Bostad AB FRN 29/10/2027 (Perpetual)	96,095	0.01
EUR 700,000	Banco de Sabadell SA FRN 7/11/2025*	772,213	0.06	EUR 100,000	Intrum AB 3.5% 15/7/2026	107,982	0.01
EUR 400,000	Banco de Sabadell SA FRN 11/3/2027	443,033	0.03				
EUR 100,000	Banco de Sabadell SA FRN 15/4/2031	105,148	0.01				
EUR 200,000	Banco Santander SA FRN 14/1/2026 (Perpetual)	216,071	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 100,000	Intrum AB 4.875% 15/8/2025	112,462	0.01	USD 200,000	ウクライナ NPC Ukrenergo '144A' 6.875% 9/11/2026	80,800	0.01
SEK 7,400,000	Nordea Hypotek AB 1.25% 20/9/2023	794,518	0.06	USD 400,000	Ukraine Government International Bond '144A' 7.253% 15/3/2033	140,000	0.01
EUR 350,000	Stadshypotek AB 0.5% 11/7/2025	395,014	0.03	USD 200,000	Ukraine Government International Bond '144A' 7.375% 25/9/2032	70,000	0.01
SEK 11,000,000	Stadshypotek AB 1.5% 1/3/2024	1,187,085	0.09	USD 198,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2027	68,261	0.00
SEK 11,000,000	Swedbank Hypotek AB 1% 20/12/2023	1,175,983	0.09	USD 200,000	Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2024	76,000	0.01
SEK 4,110,000	Sweden Government Bond 0.75% 12/5/2028*	441,573	0.03	USD 200,000	Ukraine Government International Bond 9.75% 1/11/2028	69,000	0.00
SEK 2,300,000	Sweden Government Bond 3.5% 30/3/2039	350,990	0.03				
EUR 351,000	Verisure Holding AB 3.5% 15/5/2023*	395,309	0.03				
		5,248,933	0.40			504,061	0.04
	スイス				アラブ首長国連邦		
USD 400,000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN 18/12/2024 (Perpetual)	413,000	0.03	USD 440,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC 4.6% 2/11/2047*	482,989	0.04
EUR 140,000	Credit Suisse Group AG FRN 2/4/2026	165,143	0.01	USD 670,000	Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 16/4/2030	699,313	0.05
EUR 975,000	Credit Suisse Group AG FRN 24/6/2027	1,060,267	0.08	USD 760,000	Abu Dhabi Government International Bond 4.125% 11/10/2047	845,500	0.07
USD 329,000	Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 9/1/2028	341,560	0.03	USD 391,000	Emirates NBD Bank PJSC FRN 20/3/2025 (Perpetual)	404,196	0.03
CHF 1,420,000	Swiss Confederation Government Bond 26/6/2034 (Zero Coupon)	1,487,234	0.11	USD 321,000	NBK Tier 1 Ltd '144A' FRN 24/8/2026 (Perpetual)	309,163	0.02
CHF 200,000	Swiss Confederation Government Bond 2% 25/6/2064	376,042	0.03			2,741,161	0.21
USD 380,000	UBS Group AG '144A' FRN 31/1/2024 (Perpetual)	399,686	0.03		英国		
EUR 1,000,000	UBS Group AG FRN 17/4/2025	1,135,665	0.09	USD 200,000	Antofagasta Plc '144A' 2.375% 14/10/2030*	178,708	0.01
		5,378,597	0.41	GBP 186,000	Arqiva Broadcast Finance Plc 6.75% 30/9/2023	249,897	0.02
	タイ			GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 Plc FRN 25/7/2058	134,406	0.01
USD 200,000	Bangkok Bank PCL/Hong Kong FRN 25/9/2034	194,686	0.01	USD 521,021	Avianca Midco 2 Ltd ' 144A' 9% 1/12/2028	518,727	0.04
USD 200,000	GC Treasury Center Co Ltd 2.98% 18/3/2031	191,887	0.01	GBP 165,000	Azure Finance No 2 Plc FRN 20/7/2030	224,406	0.02
USD 200,000	Kasikornbank PCL/Hong Kong FRN 14/10/2025 (Perpetual)	198,845	0.01	EUR 300,000	Barclays Plc FRN 2/4/2025	354,284	0.03
THB 12,800,000	Thailand Government Bond 1.585% 17/12/2035	348,226	0.03	GBP 400,000	Barclays Plc FRN 3/11/2026*	518,555	0.04
THB 25,320,000	Thailand Government Bond 2.875% 17/6/2046	762,275	0.06	EUR 430,000	Barclays Plc FRN 9/8/2029	444,616	0.03
THB 10,510,000	Thailand Government Bond 3.3% 17/6/2038	343,455	0.03	GBP 1,700,000	Barclays Plc 3.125% 17/1/2024*	2,315,447	0.18
THB 17,060,000	Thailand Government Bond 3.775% 25/6/2032	594,030	0.05	USD 1,400,000	Barclays Plc 4.337% 10/1/2028	1,472,556	0.11
USD 740,000	Thaioil Treasury Center Co Ltd 3.75% 18/6/2050	604,861	0.05	USD 222,000	Barclays Plc 4.375% 12/1/2026	233,712	0.02
USD 200,000	TMBThanachart Bank PCL FRN 2/12/2024 (Perpetual)	196,050	0.01	EUR 335,000	BAT International Finance Plc 1.25% 13/3/2027	361,505	0.03
		3,434,315	0.26				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 515,000	BAT International Finance Plc 2.25% 16/1/2030	548,302	0.04	GBP 100,000	Heathrow Finance Plc (Step-up coupon) 4.375% 1/3/2027	127,983	0.01
GBP 300,000	Bellis Acquisition Co Plc 3.25% 16/2/2026	367,484	0.03	GBP 99,997	Hops Hill No 1 Plc FRN 27/5/2054	135,543	0.01
EUR 934,000	BP Capital Markets Plc FRN 22/3/2026 (Perpetual)	1,040,700	0.08	GBP 99,996	Hops Hill No 1 Plc FRN 27/5/2054	135,479	0.01
EUR 600,000	British American Tobacco Plc FRN 27/9/2026 (Perpetual)	609,943	0.05	USD 1,122,000	HSBC Holdings Plc FRN 22/11/2027	1,076,223	0.08
EUR 530,000	British American Tobacco Plc FRN 27/6/2029 (Perpetual)	509,127	0.04	EUR 560,000	Informa Plc 2.125% 6/10/2025	642,088	0.05
USD 200,000	British Telecommunications Plc '144A' FRN 23/11/2081	191,793	0.02	GBP 100,000	InterContinental Hotels Group Plc 3.375% 8/10/2028	135,351	0.01
GBP 700,000	British Telecommunications Plc 3.125% 21/11/2031	920,434	0.07	EUR 100,000	International Game Technology Plc 3.5% 15/6/2026	111,671	0.01
GBP 115,000	Canada Square Funding 17/1/2059 (Zero Coupon)	154,612	0.01	GBP 100,000	Iron Mountain UK Plc 3.875% 15/11/2025	133,556	0.01
GBP 130,000	Canada Square Funding 17/1/2059 (Zero Coupon)	174,692	0.01	EUR 140,000	Jaguar Land Rover Automotive Plc 4.5% 15/7/2028	150,610	0.01
EUR 1,162,000	Chanel Ceres Plc 0.5% 31/7/2026	1,271,270	0.10	GBP 100,000	Jerrold Finco Plc 4.875% 15/1/2026	130,910	0.01
EUR 350,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	393,268	0.03	GBP 100,000	Jerrold Finco Plc 5.25% 15/1/2027	130,631	0.01
EUR 550,000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 30/6/2050	618,878	0.05	GBP 200,000	Ladbrokes Group Finance Plc 5.125% 8/9/2023	274,306	0.02
GBP 110,000	CMF 2020-1 Plc FRN 16/1/2057	147,411	0.01	GBP 140,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 Plc FRN 12/6/2057	188,596	0.02
EUR 415,000	Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.125% 26/5/2024	473,220	0.04	USD 400,000	Liquid Telecommunications Financing Plc '144A' 5.5% 4/9/2026	393,500	0.03
GBP 100,000	Constellation Automotive Financing Plc 4.875% 15/7/2027	123,773	0.01	EUR 591,000	Lloyds Banking Group Plc FRN 18/3/2030	709,726	0.06
EUR 111,000	eG Global Finance Plc 4.375% 7/2/2025*	119,653	0.01	GBP 50,000	Mitchells & Butlers Finance Plc FRN 15/6/2036	55,007	0.00
GBP 366,000	Finsbury Square 2018-2 Plc FRN 12/9/2068	491,511	0.04	GBP 100,000	Mortimer BTL 2021-1 Plc FRN 23/6/2053	130,603	0.01
GBP 99,982	Finsbury Square 2020-1 Plc FRN 16/3/2070	134,178	0.01	EUR 170,000	Motability Operations Group Plc 0.125% 20/7/2028	178,186	0.01
USD 585,000	Fresnillo Plc '144A' 4.25% 2/10/2050	533,636	0.04	GBP 75,388	Motor 2016-1 Plc ' Series 2016-1 C' 3.75% 25/11/2025	101,279	0.01
GBP 99,977	Gemgarto 2018-1 Plc FRN 16/9/2065	134,281	0.01	GBP 103,000	Motor 2016-1 Plc ' Series 2016-1 D' 4.25% 25/11/2025	139,257	0.01
GBP 100,000	Gemgarto 2021-1 Plc FRN 16/12/2067	133,340	0.01	GBP 105,000	Motor 2016-1 Plc ' Series 2016-1 E' 5.25% 25/11/2025	141,636	0.01
GBP 384,511	Greene King Finance Plc FRN 15/12/2033	515,024	0.04	EUR 889,000	National Grid Electricity Transmission Plc 0.19% 20/1/2025	985,879	0.08
GBP 206,572	Greene King Finance Plc 4.064% 15/3/2035	287,659	0.02	EUR 500,000	Nationwide Building Society 1.125% 31/5/2028	576,380	0.05
GBP 181,000	Harben Finance 28/9/2055 (Zero Coupon)	239,458	0.02	USD 200,000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15/5/2025	202,560	0.02
GBP 179,000	Harben Finance 28/9/2055 (Zero Coupon)	236,851	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
GBP 128,000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-1 FRN 15/3/2029	172,358	0.01	GBP 100,000	Twin Bridges 2018-1 Plc 'Series 2018-1 D' FRN 12/9/2050	134,304	0.01
GBP 136,000	Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-3 1.589% 15/11/2029	182,258	0.01	GBP 110,000	Twin Bridges 2019-2 Plc FRN 12/6/2053	148,242	0.01
EUR 59,144	Paragon Mortgages No 12 Plc FRN 15/11/2038	63,638	0.01	GBP 115,000	Twin Bridges 2020-1 Plc FRN 12/12/2054	155,607	0.01
GBP 120,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	160,632	0.01	GBP 125,000	Twin Bridges 2020-1 Plc FRN 12/12/2054	169,389	0.01
GBP 100,000	Paragon Mortgages No 25 Plc FRN 15/5/2050	134,050	0.01	GBP 138,000	Twin Bridges 2021-1 Plc FRN 12/3/2055	185,208	0.01
GBP 100,000	PCL Funding IV Plc FRN 15/9/2024	134,224	0.01	GBP 100,000	Twin Bridges 2021-1 Plc FRN 12/3/2055	134,470	0.01
GBP 100,000	PCL Funding V Plc FRN 15/10/2025	133,627	0.01	GBP 612,205	Unique Pub Finance Co Plc/ The 5.659% 30/6/2027	896,382	0.07
GBP 100,000	Pinewood Finance Co Ltd 3.25% 30/9/2025	130,624	0.01	GBP 2,510,000	United Kingdom Gilt 0.125% 31/1/2024*	3,305,621	0.25
GBP 100,000	Premier Foods Finance Plc 3.5% 15/10/2026	127,406	0.01	GBP 9,884,000	United Kingdom Gilt 0.375% 22/10/2026*	12,807,995	0.99
GBP 100,000	Residential Mortgage Securities 32 Plc FRN 20/6/2070	135,625	0.01	GBP 430,000	United Kingdom Gilt 0.375% 22/10/2030*	532,681	0.04
EUR 100,000	Rolls-Royce Plc 1.625% 9/5/2028	97,626	0.01	GBP 4,980,000	United Kingdom Gilt 0.625% 7/6/2025*	6,586,312	0.51
GBP 150,000	Sage AR Funding No 1 Plc FRN 17/11/2030	200,873	0.02	GBP 2,115,000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	2,633,296	0.20
EUR 380,000	Santander UK Plc 0.5% 10/1/2025	428,528	0.03	GBP 1,738,000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/1/2049	2,393,683	0.18
EUR 100,000	Sherwood Financing Plc 4.5% 15/11/2026	107,298	0.01	USD 750,000	Vedanta Resources Finance II Plc '144A' 8.95% 11/3/2025*	703,125	0.05
GBP 100,000	Sherwood Financing Plc 6% 15/11/2026	127,706	0.01	USD 300,000	Vedanta Resources Finance II Plc 13.875% 21/1/2024	306,251	0.02
GBP 600,000	SSE Plc FRN 16/9/2077	807,275	0.06	GBP 100,000	Very Group Funding Plc/The 6.5% 1/8/2026	129,013	0.01
GBP 100,000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 8% 13/7/2025	136,076	0.01	EUR 200,000	Vmed O2 UK Financing I Plc 3.25% 31/1/2031	204,939	0.02
GBP 200,000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 8.25% 31/7/2025	273,887	0.02			61,355,513	4.72
GBP 147,596	Tesco Property Finance 1 Plc 7.623% 13/7/2039	269,488	0.02		米国		
GBP 210,445	Tesco Property Finance 3 Plc 5.744% 13/4/2040	343,060	0.03	USD 840,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 'Series 2015-1211 C' '144A' FRN 10/8/2035	852,279	0.07
GBP 113,843	Tesco Property Finance 4 Plc 5.801% 13/10/2040	185,219	0.01	USD 750,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 'Series 2015-1211 D' '144A' FRN 10/8/2035	741,251	0.06
GBP 168,000	Thames Water Kemble Finance Plc 4.625% 19/5/2026	221,406	0.02	USD 881,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 'Series 2015-1211 A1A2' '144A' 3.901% 10/8/2035	905,570	0.07
GBP 100,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc FRN 20/9/2063	136,090	0.01	USD 870,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P C' '144A' FRN 5/6/2037	854,031	0.07
GBP 100,000	Tower Bridge Funding 2020-1 Plc FRN 20/9/2063	135,685	0.01	USD 750,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 'Series 2017-245P D' '144A' FRN 5/6/2037	689,082	0.05
GBP 106,000	Tower Bridge Funding 2021-1 Plc FRN 21/7/2064	142,259	0.01				
GBP 124,000	Tower Bridge Funding 2021-1 Plc FRN 21/7/2064	166,730	0.01				
GBP 305,000	Turbo Finance 9 Plc FRN 20/8/2028	411,070	0.03				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 613,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P ' Series 2017-245P E' ' 144A' FRN 5/6/2037	552,593	0.04	USD 7,395	American Airlines 2015-2 Class AA Pass Through Trust 3.6% 22/9/2027	7,459	0.00
USD 820,000	280 Park Avenue 2017- 280P Mortgage Trust ' ' Series 2017-280P D' ' 144A' FRN 15/9/2034	810,027	0.06	USD 193,729	American Airlines 2016-3 Class AA Pass Through Trust 3% 15/10/2028	191,014	0.01
USD 1,437,000	AbbVie Inc 4.25% 21/11/2049	1,503,359	0.12	USD 49,238	American Airlines 2017-1 Class AA Pass Through Trust 3.65% 15/2/2029	50,196	0.00
USD 346,000	AbbVie Inc 4.3% 14/5/2036	373,043	0.03	USD 432,413	American Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 3.15% 15/2/2032	422,182	0.03
USD 20,000	Acadia Healthcare Co Inc ' 144A' 5.5% 1/7/2028	20,083	0.00	USD 1,249,333	American Homes 4 Rent 2015-SFR2 Trust ' ' Series 2015-SFR2 A' ' 144A' 3.732% 17/10/2052	1,280,032	0.10
USD 241,000	Activision Blizzard Inc 2.5% 15/9/2050	197,742	0.02	EUR 440,000	American Tower Corp 0.4% 15/2/2027	463,635	0.04
USD 80,000	ADT Security Corp/The ' 144A' 4.875% 15/7/2032	74,554	0.01	EUR 800,000	American Tower Corp 0.45% 15/1/2027	846,856	0.07
USD 170,000	AEP Transmission Co LLC 3.15% 15/9/2049	153,375	0.01	USD 760,000	American Tower Corp 1.3% 15/9/2025	725,174	0.06
USD 305,000	AEP Transmission Co LLC 3.8% 15/6/2049	306,476	0.02	USD 317,000	American Tower Corp 2.1% 15/6/2030	286,449	0.02
USD 140,000	Alabama Power Co 4.15% 15/8/2044	144,828	0.01	USD 45,000	American Tower Corp 2.95% 15/1/2051	35,962	0.00
USD 9,000	Alabama Power Co 6% 1/3/2039	11,272	0.00	USD 1,350,000	Amgen Inc 2.45% 21/2/2030	1,291,115	0.10
USD 186,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New	172,980	0.01	USD 42,000	Amgen Inc 4.2% 22/2/2052	43,147	0.00
USD 23,000	Albertsons LP / Albertsons LLC ' 144A' 3.5% 15/3/2029	23,865	0.00	USD 14,000	AMN Healthcare Inc ' ' 144A' 4% 15/4/2029	13,319	0.00
USD 18,000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New	19,015	0.00	USD 417,000	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.7% 1/2/2036	458,058	0.04
EUR 100,000	Allied Universal Holdco LLC/ Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 3.625% 1/6/2028	106,202	0.01	USD 896,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.5% 1/6/2050	969,143	0.07
EUR 600,000	Altria Group Inc 3.125% 15/6/2031	682,688	0.05	USD 365,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.6% 15/4/2048	391,043	0.03
USD 644,000	Altria Group Inc 3.7% 4/2/2051*	515,894	0.04	USD 875,000	Anthem Inc 3.6% 15/3/2051	836,371	0.06
USD 1,047,000	Altria Group Inc 3.7% 4/2/2051*	838,728	0.06	USD 1,150,000	Aon Corp 2.8% 15/5/2030	1,119,961	0.09
USD 582,000	Altria Group Inc 5.375% 31/1/2044	596,409	0.05	USD 2,750,000	Apidos CLO XXXVII 1.259% 22/10/2034	2,740,292	0.21
USD 20,000	AMC Networks Inc 4.75% 1/8/2025	19,879	0.00	USD 385,000	Apple Inc 1.2% 8/2/2028	359,356	0.03
USD 10,000	AMC Networks Inc 5% 1/4/2024	9,989	0.00	USD 1,520,000	Apple Inc 1.65% 8/2/2031	1,400,612	0.11
USD 310,000	Ameren Illinois Co 3.25% 15/3/2050	287,728	0.02	USD 1,241,000	Apple Inc 2.65% 8/2/2051	1,083,069	0.08
USD 2,000	Ameren Illinois Co 4.15% 15/3/2046	2,151	0.00	USD 230,000	Apple Inc 2.65% 8/2/2051	200,730	0.02
				USD 1,350,000	Apple Inc 4.25% 9/2/2047	1,513,464	0.12
				USD 77,000	Aramark Services Inc ' 144A' 5% 1/2/2028	77,492	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 54,000	Arconic Corp '144A' 6.125% 15/2/2028	55,493	0.00	USD 1,563,000	Bank of America Corp FRN 22/7/2027	1,480,080	0.11
USD 535,000	Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/5/2031	508,385	0.04	USD 55,000	Bank of America Corp FRN 4/2/2028	53,846	0.00
USD 2,000,000	AT&T Inc '144A' 27/11/2022 (Zero Coupon)	1,979,814	0.15	USD 166,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2028	170,228	0.01
USD 594,000	AT&T Inc 3.5% 15/9/2053	530,201	0.04	USD 366,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2029	387,211	0.03
USD 976,000	AT&T Inc 3.5% 15/9/2053	871,172	0.07	USD 2,485,000	Bank of America Corp FRN 23/7/2031	2,223,486	0.17
USD 350,000	AT&T Inc 3.55% 15/9/2055	310,783	0.02	EUR 290,000	Bank of America Corp FRN 26/10/2031	295,113	0.02
USD 315,000	AT&T Inc 3.8% 1/12/2057	288,847	0.02	USD 868,000	Bank of America Corp FRN 22/4/2032	822,982	0.06
USD 6,292,000	AT&T Inc 4.3% 15/2/2030	6,791,860	0.52	USD 1,100,000	Bank of America Corp FRN 21/7/2032	1,010,683	0.08
GBP 300,000	AT&T Inc 4.375% 14/9/2029	444,725	0.03	USD 706,000	Bank of America Corp FRN 20/10/2032	660,750	0.05
USD 206,000	Azul Investments LLP '144A' 5.875% 26/10/2024	190,390	0.01	USD 31,000	Bank of America Corp FRN 4/2/2033	30,080	0.00
USD 230,000	Azul Investments LLP '144A' 7.25% 15/6/2026	207,849	0.02	USD 724,000	Bank of America Corp FRN 24/4/2038	785,914	0.06
USD 53,000	B&G Foods Inc 5.25% 15/9/2027	52,710	0.00	USD 985,000	Bank of America Corp FRN 19/6/2041	854,473	0.07
USD 60,000	BAE Systems Holdings Inc '144A' 3.85% 15/12/2025	62,551	0.01	USD 857,000	Bank of America Corp FRN 20/3/2051	903,436	0.07
USD 500,000	Baltimore Gas and Electric Co 3.5% 15/8/2046	482,478	0.04	EUR 375,000	Bank of America Corp 0.694% 22/3/2031	388,563	0.03
USD 730,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P '144A' FRN 14/4/2033	700,112	0.05	USD 108,000	Bank of America Corp 3.95% 21/4/2025	111,688	0.01
USD 1,000,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P '144A' 3.49% 14/4/2033	998,382	0.08	USD 1,000	Bank of New York Mellon Corp/ The 3.25% 11/9/2024	1,027	0.00
USD 710,000	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2015-200P '144A' 3.49% 14/4/2033	708,851	0.05	USD 53,000	Bausch Health Americas Inc '144A' 9.25% 1/4/2026	54,576	0.00
USD 922,024	BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust 2018-DSNY 'Series 2018-DSNY D' '144A' FRN 15/9/2034	900,766	0.07	USD 1,748,000	Baxter International Inc 2.6% 15/8/2026	1,739,455	0.13
USD 545,000	BANK 2017-BNK8 'Series 2017-BNK8 B' FRN 15/11/2050	553,210	0.04	USD 1,801,884	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 'Series 2006-1A A1' '144A' FRN 25/4/2036	1,711,179	0.13
USD 1,425,000	BANK 2018-BNK14 'Series 2018-BN14 A4' FRN 15/9/2060	1,525,185	0.12	USD 613,003	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 'Series 2007-4A A1' '144A' FRN 25/9/2037	588,536	0.05
USD 638,000	Bank of America Corp FRN 22/10/2025	634,562	0.05	USD 730,000	BBCMS 2017-DEL Mortgage Trust FRN 15/8/2036	721,761	0.06
USD 1,931,000	Bank of America Corp FRN 19/6/2026	1,839,025	0.14	USD 2,035,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust FRN 15/3/2037	1,998,810	0.15
				USD 424,000	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 'Series 2018- C2 B' FRN 15/12/2051	453,297	0.04
				USD 590,000	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 'Series 2018- C2 A5' 4.314% 15/12/2051	637,125	0.05
				USD 1,456,792	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 'Series 2007-1 1A1' FRN 25/1/2047	1,376,515	0.11

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 3,900,000	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2007-HE5 ' Series 2007-HE5 1A4' FRN 25/6/2047	3,809,851	0.29	USD 1,220,000	BXP Trust 2017-GM ' Series 2017-GM C' ' 144A' FRN 13/6/2039	1,199,461	0.09
EUR 400,000	Becton Dickinson and Co 1.401% 24/5/2023	454,991	0.04	USD 730,000	BXP Trust 2017-GM ' Series 2017-GM D' ' 144A' FRN 13/6/2039	706,153	0.05
EUR 200,000	Belden Inc 4.125% 15/10/2026	224,235	0.02	USD 440,000	BXP Trust 2017-GM 3.379% 13/6/2039	445,058	0.03
USD 704,000	Benchmark 2018-B2 Mortgage Trust ' Series 2018-B2 B' FRN 15/2/2051	727,094	0.06	USD 42,000	Caesars Entertainment Inc ' 144A' 4.625% 15/10/2029	39,696	0.00
USD 2,801,000	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust ' Series 2018-B5 A4' 4.208% 15/7/2051	2,988,127	0.23	USD 315,000	Caesars Entertainment Inc ' 144A' 6.25% 1/7/2025	326,401	0.03
USD 655,682	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust ' Series 2018-B5 B' 4.57% 15/7/2051	686,514	0.05	USD 53,000	Calpine Corp ' 144A' 4.5% 5/2/2028	51,929	0.00
USD 1,130,000	Benchmark 2018-B8 Mortgage Trust ' Series 2018-B8 A5' 4.232% 15/1/2052	1,208,454	0.09	USD 840,000	Cameron LNG LLC ' 144A' 3.302% 15/1/2035	818,481	0.06
USD 382,000	Boeing Co/The 2.6% 30/10/2025	377,316	0.03	USD 280,000	Cameron LNG LLC ' 144A' 3.402% 15/1/2038	263,733	0.02
EUR 670,000	Booking Holdings Inc 0.1% 8/3/2025	739,272	0.06	EUR 345,000	Capital One Financial Corp 1.65% 12/6/2029	379,222	0.03
EUR 560,000	BorgWarner Inc 1% 19/5/2031	568,538	0.04	USD 80,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp ' 144A' 4.75% 1/3/2030	78,350	0.01
EUR 100,000	Boxer Parent Co Inc 6.5% 2/10/2025	115,065	0.01	USD 505,000	CCUBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 ' Series 2017-C1 B' FRN 15/11/2050	514,938	0.04
USD 508,000	BP Capital Markets America Inc 2.939% 4/6/2051	421,335	0.03	USD 13,000	Cedar Fair LP 5.25% 15/7/2029	12,940	0.00
USD 61,000	Bristol-Myers Squibb Co 3.7% 15/3/2052	61,986	0.01	USD 15,000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15/4/2027	15,131	0.00
USD 215,000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15/1/2027	222,645	0.02	USD 228,000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op ' 144A' 5.5% 1/5/2025	234,540	0.02
USD 3,849,000	Broadcom Inc ' 144A' 3.419% 15/4/2033	3,702,943	0.29	USD 37,000	CenterPoint Energy Houston Electric LLC 3.95% 1/3/2048	38,471	0.00
USD 208,000	Broadcom Inc 3.459% 15/9/2026	212,949	0.02	USD 33,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	30,501	0.00
USD 1,573,000	Broadcom Inc ' 144A' 3.75% 15/2/2051	1,437,961	0.11	USD 909,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.85% 1/4/2061	740,921	0.06
USD 152,000	Broadcom Inc 4.11% 15/9/2028	158,124	0.01	USD 985,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.9% 1/6/2052*	842,062	0.07
USD 238,000	Broadcom Inc 4.75% 15/4/2029	255,143	0.02				
USD 3,133,000	Broadcom Inc 5% 15/4/2030	3,430,789	0.26				
USD 96,000	Burlington Northern Santa Fe LLC 2.875% 15/6/2052	83,444	0.01				
USD 1,045,000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3.3% 15/9/2051	985,396	0.08				
USD 690,000	BX Trust 2018-BILT ' Series 2018-BILT D' ' 144A' FRN 15/5/2030	676,033	0.05				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 1,020,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 23/10/2045	1,188,772	0.09	USD 1,020,000	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc ' Series 2007-WFH4 M3A' FRN 25/7/2037	1,077,675	0.08
EUR 100,000	Chemours Co/The 4% 15/5/2026	109,264	0.01	USD 878,833	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 ' Series 2007-A5 1A1' 6% 25/5/2037	864,791	0.07
USD 398,000	Cheniére Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31/3/2025	428,614	0.03	USD 594,397	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 ' Series 2007-A5 1A6' 6% 25/5/2037	584,578	0.05
USD 6,808	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-29 ' Series 2004-29 1A1' FRN 25/2/2035	6,664	0.00	USD 80,000	CNX Resources Corp ' 144A' 7.25% 14/3/2027	84,376	0.01
EUR 820,000	Chubb INA Holdings Inc 1.55% 15/3/2028	927,959	0.07	EUR 800,000	Comcast Corp 0.25% 14/9/2029	826,218	0.06
USD 15,000	Churchill Downs Inc ' 144A' 4.75% 15/1/2028	14,668	0.00	USD 35,000	Comcast Corp 2.65% 1/2/2030	34,266	0.00
USD 16,000	Churchill Downs Inc ' 144A' 5.5% 1/4/2027	16,260	0.00	USD 960,000	Comcast Corp ' 144A' 2.887% 1/11/2051	812,597	0.06
USD 325,000	Citgo Holding Inc ' 144A' 9.25% 1/8/2024	325,694	0.03	USD 276,000	Comcast Corp 3.4% 15/7/2046	259,550	0.02
USD 387,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 ' Series 2014-GC19 A4' 4.023% 10/3/2047	398,014	0.03	USD 907,000	Comcast Corp 3.45% 1/2/2050	848,844	0.07
USD 706,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 ' Series 2014-GC25 C' FRN 10/10/2047	714,520	0.06	USD 457,000	Comcast Corp 3.969% 1/11/2047	468,006	0.04
USD 204,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3.176% 10/8/2049	198,407	0.02	USD 606,000	Comcast Corp 4.25% 15/10/2030	657,612	0.05
USD 990,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 2.941% 10/10/2049	994,040	0.08	USD 1,275,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust FRN 10/8/2030	1,264,303	0.10
USD 509,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P6 FRN 10/12/2049	520,101	0.04	USD 1,090,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust FRN 10/8/2049	1,110,656	0.09
USD 807,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-B2 ' Series 2018-B2 B' FRN 10/3/2051	834,254	0.06	USD 1,000,000	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust ' Series 2015-CR23 B' FRN 10/5/2048	1,009,491	0.08
USD 915,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5 FRN 10/6/2051	971,678	0.08	USD 951,000	COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust ' Series 2015-CR26 B' FRN 10/10/2048	979,539	0.08
USD 4,216,000	Citigroup Inc FRN 5/11/2030	4,128,346	0.32	USD 1,950,000	COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust ' Series 2015-CR26 A4' 3.63% 10/10/2048	2,009,718	0.15
USD 813,000	Citigroup Inc FRN 29/1/2031	777,548	0.06	USD 1,837,717	COMM 2015-CCRE27 Mortgage Trust FRN 10/10/2048	1,877,765	0.14
USD 35,000	Citigroup Inc FRN 3/11/2032	32,609	0.00	USD 635,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust ' Series 2015-LC19 B' FRN 10/2/2048	638,507	0.05
USD 251,183	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-FX1 (Step-up coupon) ' Series 2006-FX1 A7' 5.775% 25/10/2036	209,397	0.02	USD 1,190,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust ' Series 2017-COR2 A3' 3.51% 10/9/2050	1,232,118	0.10
USD 3,522,336	Citigroup Mortgage Loan Trust Inc ' Series 2006-WFH2 M3' FRN 25/8/2036	3,474,680	0.27	USD 1,685,000	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust 3.803% 10/9/2050	1,745,095	0.13

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 378,000	COMM 2017-PANW Mortgage Trust FRN 10/10/2029	374,807	0.03	USD 885,000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust ' Series 2018-C14 B' FRN 15/11/2051	955,140	0.07
USD 107,000	Commercial Metals Co 4.375% 15/3/2032	102,345	0.01	USD 458,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.742% 15/8/2051	475,913	0.04
USD 953,101	Conseco Finance Corp ' Series 1997-7 M1' FRN 15/7/2028	938,704	0.07	USD 24,000	CSX Corp 5.5% 15/4/2041	29,042	0.00
USD 73,000	Consumers Energy Co 3.5% 1/8/2051	71,655	0.01	USD 1,946,000	CVS Health Corp 5.05% 25/3/2048	2,230,760	0.17
USD 15,000	Consumers Energy Co 3.75% 15/2/2050	15,363	0.00	USD 304,000	CVS Health Corp 5.125% 20/7/2045	346,266	0.03
USD 41,000	Consumers Energy Co 3.75% 15/2/2050	41,992	0.00	USD 485,000	Daimler Trucks Finance North America LLC ' 144A' 2% 14/12/2026	464,924	0.04
EUR 200,000	Coty Inc 3.875% 15/4/2026	219,401	0.02	USD 955,000	DaVita Inc ' 144A' 4.625% 1/6/2030	917,650	0.07
USD 357,923	Countrywide Asset- Backed Certificates ' Series 2006-26 1A' FRN 25/6/2037	340,196	0.03	USD 30,000	Dayton Power & Light Co/The 3.95% 15/6/2049	30,738	0.00
USD 4,227,460	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp 6.5% 25/1/2036	3,225,351	0.25	USD 700,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust ' Series 2017-BRBK D' ' 144A' FRN 10/10/2034	683,609	0.05
USD 115,000	Crown Castle International Corp 3.1% 15/11/2029	111,714	0.01	USD 110,000	Diamondback Energy Inc 3.125% 24/3/2031	105,836	0.01
USD 33,000	Crown Castle International Corp 3.1% 15/11/2029	32,057	0.00	EUR 900,000	Discovery Communications LLC 1.9% 19/3/2027	1,013,424	0.08
USD 1,050,000	Crown Castle International Corp 3.65% 1/9/2027	1,080,011	0.08	USD 116,000	Discovery Communications LLC 4.95% 15/5/2042	118,098	0.01
USD 300,000	Crown Castle International Corp 4% 15/11/2049	288,618	0.02	USD 71,000	DISH DBS Corp 7.75% 1/7/2026	71,688	0.01
USD 15,000	Crown Castle International Corp 4.3% 15/2/2029	15,833	0.00	USD 174,000	DTE Electric Co 3.65% 1/3/2052	174,242	0.01
USD 196,000	Crown Castle International Corp 4.45% 15/2/2026	207,247	0.02	USD 35,000	DTE Electric Co 3.95% 1/3/2049	36,332	0.00
USD 70,000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc ' 144A' 5.625% 15/10/2025	70,896	0.01	USD 138,000	DTE Electric Co 4.05% 15/5/2048	146,796	0.01
USD 351,000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust ' Series 2015-C4 D' FRN 15/11/2048	332,858	0.03	USD 323,000	Duke Energy Carolinas LLC 2.45% 1/2/2030	309,835	0.02
USD 232,000	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust ' Series 2016-C5 C' FRN 15/11/2048	234,149	0.02	USD 108,000	Duke Energy Carolinas LLC 2.45% 1/2/2030	103,598	0.01
USD 220,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust ' Series 2017- CX10 A5' FRN 15/11/2050	224,688	0.02	USD 174,000	Duke Energy Carolinas LLC 3.75% 1/6/2045	171,771	0.01
USD 2,020,000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust ' Series 2018-C14 A4' FRN 15/11/2051	2,175,003	0.17	USD 50,000	Duke Energy Carolinas LLC 3.875% 15/3/2046	51,040	0.00
				USD 5,000	Duke Energy Carolinas LLC 3.95% 15/3/2048	5,131	0.00
				USD 416,000	Duke Energy Florida LLC 2.5% 1/12/2029	402,809	0.03
				USD 706,000	Duke Energy Florida LLC 2.5% 1/12/2029	683,613	0.05
				USD 84,000	Duke Energy Progress LLC 3.45% 15/3/2029	86,879	0.01
				USD 161,000	Duke Energy Progress LLC 4.2% 15/8/2045	169,724	0.01
				USD 43,000	Eastern Gas Transmission & Storage Inc 4.8% 1/11/2043	45,901	0.00
				EUR 310,000	Eli Lilly & Co 1.375% 14/9/2061	260,220	0.02
				EUR 220,000	Encore Capital Group Inc 4.875% 15/10/2025	250,092	0.02

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 57,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.75% 30/1/2028	59,018	0.00	USD 370,994	Fannie Mae Pool ' AX7241' 3.5% 1/11/2029	383,949	0.03
USD 75,000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 6.625% 15/7/2025	78,101	0.01	USD 767,904	Fannie Mae Pool ' BC1873' 2.5% 1/6/2031	777,499	0.06
USD 873,000	Energy Transfer LP 4.75% 15/1/2026	922,099	0.07	USD 164,376	Fannie Mae Pool ' BH9277' 3.5% 1/2/2048	169,666	0.01
USD 244,000	Equinix Inc 1% 15/9/2025	230,283	0.02	USD 18,060	Fannie Mae Pool ' BK7642' 4% 1/9/2033	18,962	0.00
USD 1,100,000	Exelon Corp 4.7% 15/4/2050	1,217,818	0.09	USD 788,854	Fannie Mae Pool ' BM3537' 3% 1/1/2031	812,093	0.06
EUR 275,000	Exxon Mobil Corp 1.408% 26/6/2039	269,572	0.02	USD 2,667,434	Fannie Mae Pool ' BM3961' 3% 1/3/2047	2,734,853	0.21
USD 483,000	Exxon Mobil Corp 3.452% 15/4/2051	469,166	0.04	USD 217,605	Fannie Mae Pool ' BN8997' 2% 1/3/2051	207,449	0.02
USD 909,000	Exxon Mobil Corp 3.452% 15/4/2051	882,964	0.07	USD 119,109	Fannie Mae Pool ' BN9004' 2% 1/3/2051	113,569	0.01
USD 1,464,290	Fannie Mae Pool ' 735893' 5% 1/10/2035	1,629,619	0.13	USD 113,864	Fannie Mae Pool ' BR7241' 2% 1/4/2051	108,668	0.01
USD 7,068	Fannie Mae Pool ' 735989' 5.5% 1/2/2035	7,889	0.00	USD 673,386	Fannie Mae Pool ' BU1428' 2.5% 1/1/2052	665,911	0.05
USD 352,673	Fannie Mae Pool ' 995023' 5.5% 1/8/2037	394,834	0.03	USD 735,775	Fannie Mae Pool ' BU2109' 2.5% 1/10/2051	727,148	0.06
USD 506,354	Fannie Mae Pool ' 995024' 5.5% 1/8/2037	566,464	0.04	USD 733,637	Fannie Mae Pool ' BU6585' 2.5% 1/11/2051	723,761	0.06
USD 467,970	Fannie Mae Pool ' AL4228' 6% 1/5/2041	534,651	0.04	USD 8,285	Fannie Mae Pool ' CA0789' 3.5% 1/11/2032	8,664	0.00
USD 41,585	Fannie Mae Pool ' AL5930' 4.5% 1/1/2043	44,999	0.00	USD 51,136	Fannie Mae Pool ' CA2527' 4% 1/10/2033	54,045	0.00
USD 101,079	Fannie Mae Pool ' AL7207' 4.5% 1/8/2045	109,840	0.01	USD 171,494	Fannie Mae Pool ' CA7070' 4% 1/9/2050	182,210	0.01
USD 109,045	Fannie Mae Pool ' AL7366' 4.5% 1/8/2042	118,338	0.01	USD 54,967	Fannie Mae Pool ' CA7073' 4% 1/9/2050	57,608	0.00
USD 66,006	Fannie Mae Pool ' AL9381' 3% 1/6/2030	67,947	0.01	USD 282,994	Fannie Mae Pool ' CB2601' 2% 1/1/2052	270,069	0.02
USD 738,975	Fannie Mae Pool ' AR8678' 3% 1/3/2028	759,068	0.06	USD 146,341	Fannie Mae Pool ' CB2836' 2% 1/2/2052	139,734	0.01
USD 264,824	Fannie Mae Pool ' AS3604' 3% 1/10/2029	271,834	0.02	USD 333,433	Fannie Mae Pool ' CB2837' 2% 1/2/2052	318,072	0.02
USD 160,528	Fannie Mae Pool ' AS4816' 4% 1/4/2045	171,362	0.01	USD 738,727	Fannie Mae Pool ' CB2838' 2% 1/2/2052	704,405	0.05
USD 336,790	Fannie Mae Pool ' AS5982' 3.5% 1/10/2030	351,170	0.03	USD 119,460	Fannie Mae Pool ' CB2854' 2.5% 1/2/2052	118,134	0.01
USD 322,283	Fannie Mae Pool ' AS8405' 2% 1/11/2031	319,772	0.02	USD 425,088	Fannie Mae Pool ' CB2855' 2.5% 1/2/2052	419,843	0.03
USD 995,820	Fannie Mae Pool ' AT2059' 2.5% 1/4/2028	1,007,250	0.08	USD 507,294	Fannie Mae Pool ' CB2856' 2.5% 1/2/2052	500,133	0.04
USD 50,908	Fannie Mae Pool ' AW1281' 3% 1/7/2029	52,228	0.00	USD 82,889	Fannie Mae Pool ' CB2863' 2.5% 1/2/2052	82,123	0.01
USD 292,251	Fannie Mae Pool ' AW4229' 3% 1/7/2029	300,923	0.02	USD 333,440	Fannie Mae Pool ' FM5176' 2% 1/12/2050	317,963	0.02
USD 118,555	Fannie Mae Pool ' AX6435' 3% 1/1/2030	121,999	0.01	USD 478,495	Fannie Mae Pool ' FM5292' 3% 1/8/2050	483,696	0.04
				USD 103,996	Fannie Mae Pool ' FM5305' 2% 1/12/2050	99,172	0.01

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 3,048,866	Fannie Mae Pool ' FM7599' 3.5% 1/1/2051	3,127,948	0.24	USD 165,000	FirstEnergy Corp 2.65% 1/3/2030	154,437	0.01
USD 136,179	Fannie Mae Pool ' FM9730' 2% 1/12/2051	129,843	0.01	USD 241,000	FirstEnergy Corp 3.4% 1/3/2050	207,148	0.02
USD 205,242	Fannie Mae Pool ' FM9925' 2% 1/12/2051	195,868	0.02	USD 198,000	FirstEnergy Corp 5.35% 15/7/2047	209,355	0.02
USD 206,051	Fannie Mae Pool ' FS0026' 2.5% 1/11/2051	203,405	0.02	USD 784,000	FirstEnergy Transmission LLC ' 144A' 4.35% 15/1/2025	802,016	0.06
USD 294,154	Fannie Mae Pool ' FS0173' 2% 1/1/2052	280,631	0.02	USD 492,000	FirstEnergy Transmission LLC ' 144A' 4.55% 1/4/2049	503,773	0.04
USD 3,116,254	Fannie Mae Pool ' FS0193' 2.5% 1/1/2052	3,061,853	0.24	USD 2,000	FirstEnergy Transmission LLC ' 144A' 5.45% 15/7/2044	2,249	0.00
USD 313,052	Fannie Mae Pool ' FS0211' 2% 1/12/2051	298,123	0.02	EUR 500,000	Fiserv Inc 1.625% 1/7/2030	557,240	0.04
USD 318,671	Fannie Mae Pool ' FS0212' 2% 1/12/2051	303,597	0.02	USD 2,000,000	Fiserv Inc 2.25% 1/6/2027	1,940,220	0.15
USD 250,158	Fannie Mae Pool ' FS0290' 2% 1/1/2052	238,749	0.02	USD 235,000	Florida Power & Light Co 2.875% 4/12/2051	208,237	0.02
USD 169,229	Fannie Mae Pool ' FS0378' 2.5% 1/1/2052	167,351	0.01	USD 955,000	Florida Power & Light Co 3.15% 1/10/2049	897,765	0.07
USD 390,958	Fannie Mae Pool ' FS0497' 2% 1/1/2052	373,431	0.03	USD 155,000	Florida Power & Light Co 3.99% 1/3/2049	165,999	0.01
USD 64,000	Fannie Mae Pool ' FS0598' 2% 1/12/2051	61,230	0.00	USD 32,000	Ford Motor Co 3.25% 12/2/2032	29,762	0.00
USD 64,000	Fannie Mae Pool ' FS0599' 2% 1/4/2051	61,032	0.00	USD 58,846	Freddie Mac Gold Pool ' A61557' 5% 1/10/2036	64,949	0.01
USD 175,000	Fannie Mae Pool ' FS0646' 2% 1/2/2052	167,018	0.01	USD 274,154	Freddie Mac Gold Pool ' A88491' 4.5% 1/9/2039	297,898	0.02
USD 356,285	Fannie Mae Pool ' MA3182' 3.5% 1/11/2047	368,516	0.03	USD 88,142	Freddie Mac Gold Pool ' A91182' 4.5% 1/2/2040	95,785	0.01
USD 356,296	Fannie Mae Pool ' MA3210' 3.5% 1/12/2047	368,538	0.03	USD 698	Freddie Mac Gold Pool ' G01443' 6.5% 1/8/2032	773	0.00
USD 215,932	Fannie Mae Pool ' MA3238' 3.5% 1/1/2048	222,560	0.02	USD 1,260,755	Freddie Mac Gold Pool ' G07787' 4% 1/8/2044	1,350,820	0.10
USD 285,000	Fannie Mae-Aces ' Series 2019-M1 A2' FRN 25/9/2028	305,691	0.02	USD 484,687	Freddie Mac Gold Pool ' G07924' 3.5% 1/1/2045	507,176	0.04
USD 1,000,000	FBR Securitization Trust ' Series 2005-5 M2' FRN 25/11/2035	988,519	0.08	USD 675,322	Freddie Mac Gold Pool ' G08620' 3.5% 1/12/2044	704,288	0.05
USD 3,000	Federal Home Loan Mortgage Corp 6.25% 15/7/2032	4,098	0.00	USD 428,753	Freddie Mac Gold Pool ' G60080' 3.5% 1/6/2045	448,436	0.03
EUR 520,000	FedEx Corp 0.45% 4/5/2029	548,198	0.04	USD 363,895	Freddie Mac Gold Pool ' G60081' 4% 1/6/2045	389,744	0.03
USD 8,000	FedEx Corp 4.1% 15/4/2043	7,982	0.00	USD 926,434	Freddie Mac Gold Pool ' J21439' 2.5% 1/12/2027	937,006	0.07
EUR 510,000	Fidelity National Information Services Inc 0.75% 21/5/2023	576,172	0.04	USD 557,093	Freddie Mac Gold Pool ' Q31644' 4% 1/2/2045	593,171	0.05
USD 1,600,000	Fidelity National Information Services Inc 1.65% 1/3/2028	1,471,250	0.11	USD 66,950	Freddie Mac Pool ' QB2296' 2% 1/8/2050	63,844	0.01
EUR 360,000	Fidelity National Information Services Inc 2.95% 21/5/2039	429,559	0.03	USD 278,309	Freddie Mac Pool ' QD4857' 2% 1/1/2052	265,176	0.02
USD 97,000	FirstEnergy Corp 2.05% 1/3/2025	94,701	0.01	USD 810,851	Freddie Mac Pool ' RA3282' 3% 1/8/2050	821,373	0.06

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 170,316	Freddie Mac Pool ' RA3313' 3% 1/8/2050	171,810	0.01		FREMF 2018-K72		
USD 554,085	Freddie Mac Pool ' RA5077' 2.5% 1/5/2051	546,075	0.04	USD 1,265,000	Mortgage Trust ' Series 2018-K72 B' ' 144A' FRN 25/12/2050	1,308,094	0.10
USD 672,317	Freddie Mac Pool ' RA6071' 2% 1/10/2051	639,853	0.05	EUR 130,000	General Mills Inc 0.45% 15/1/2026	143,900	0.01
USD 262,827	Freddie Mac Pool ' RA6388' 2.5% 1/12/2051	259,040	0.02	EUR 310,000	General Motors Financial Co Inc 0.6% 20/5/2027	326,810	0.03
USD 92,155	Freddie Mac Pool ' RA6768' 2% 1/2/2052	87,719	0.01	USD 3,000,000	General Motors Financial Co Inc 2.75% 20/6/2025	2,982,690	0.23
USD 378,336	Freddie Mac Pool ' SC0063' 3.5% 1/5/2035	392,967	0.03	USD 1,113,000	General Motors Financial Co Inc 3.5% 7/11/2024	1,137,316	0.09
USD 2,748,000	Freddie Mac Pool ' SD0486' 3.5% 1/9/2046	2,846,085	0.22	USD 1,113,000	Gilead Sciences Inc 4.75% 1/3/2046	713,696	0.06
USD 688,313	Freddie Mac Pool ' SD0490' 4% 1/1/2045	736,091	0.06	USD 645,000	Ginnie Mae I Pool ' 437096' 6.5% 15/7/2031	4,146	0.00
USD 866,159	Freddie Mac Pool ' SD0716' 2% 1/7/2051	827,275	0.06	USD 3,820	Ginnie Mae I Pool ' 781276' 6.5% 15/4/2031	1,278	0.00
USD 53,187	Freddie Mac Pool ' SD0730' 2% 1/9/2051	50,671	0.00	USD 1,148	Ginnie Mae II Pool ' 5055' 4.5% 20/5/2041	828,675	0.06
USD 243,612	Freddie Mac Pool ' SD0732' 2% 1/9/2051	231,995	0.02	USD 756,051	Ginnie Mae II Pool ' 783050' 5% 20/7/2040	347,870	0.03
USD 80,566	Freddie Mac Pool ' SD0783' 2% 1/12/2051	76,818	0.01	USD 311,704	Ginnie Mae II Pool ' BD0560' 4.5% 20/9/2048	71,625	0.01
USD 175,549	Freddie Mac Pool ' SD0785' 2% 1/12/2051	167,382	0.01	USD 67,189	Ginnie Mae II Pool ' MA2444' 3% 20/12/2044	856,489	0.07
USD 218,775	Freddie Mac Pool ' SD0786' 2% 1/12/2051	208,783	0.02	USD 836,519	Ginnie Mae II Pool ' MA4069' 3.5% 20/11/2046	3,796,429	0.29
USD 33,840	Freddie Mac Pool ' SD0789' 2% 1/12/2051	32,321	0.00	USD 951,937	Ginnie Mae II Pool ' MA4511' 4% 20/6/2047	999,968	0.08
USD 513,000	Freddie Mac Pool ' SD0892' 2% 1/1/2052	488,834	0.04	USD 373,664	Ginnie Mae II Pool ' MA4838' 4% 20/11/2047	393,566	0.03
USD 384,000	Freddie Mac Pool ' SD0894' 2% 1/1/2052	366,746	0.03	USD 180,312	Ginnie Mae II Pool ' MA4901' 4% 20/12/2047	189,911	0.01
USD 105,053	Freddie Mac Pool ' SD7528' 2% 1/11/2050	100,179	0.01	USD 269,127	Ginnie Mae II Pool ' MA5818' 4.5% 20/3/2049	283,174	0.02
USD 238,531	Freddie Mac Pool ' SD7534' 2.5% 1/2/2051	235,675	0.02	USD 122,903	Ginnie Mae II Pool ' MA6599' 3% 20/4/2050	124,639	0.01
USD 184,897	Freddie Mac Pool ' SD7541' 2% 1/5/2051	176,296	0.01	USD 24,826	Ginnie Mae II Pool ' MA6602' 4.5% 20/4/2050	26,036	0.00
USD 814,325	Freddie Mac Pool ' SD7549' 2% 1/1/2052	777,739	0.06	USD 152,910	Ginnie Mae II Pool ' MA6656' 3% 20/5/2050	155,100	0.01
USD 219,105	Freddie Mac Pool ' ZS4751' 3.5% 1/1/2048	226,550	0.02	USD 1,238,415	Ginnie Mae II Pool ' MA6818' 2% 20/8/2050	1,206,077	0.09
USD 13,344	Freddie Mac Pool ' ZS4778' 4% 1/7/2048	13,962	0.00	USD 824,634	Ginnie Mae II Pool ' MA6994' 2% 20/11/2050	803,021	0.06
USD 99,415	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2 ' Series 2021-HQA2 B1' ' 144A' FRN 25/12/2033	104,618	0.01	USD 1,203,479	Ginnie Mae II Pool ' MA7649' 2.5% 20/10/2051	1,196,475	0.09
USD 404,933	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 ' Series 2022-DNA1 M1B' ' 144A' FRN 25/1/2042	409,365	0.03	USD 2,252,447	Ginnie Mae II Pool ' MA7767' 2.5% 20/12/2051	2,239,322	0.17

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 1,044,000	Global Payments Inc 2.15% 15/1/2027	1,002,609	0.08		GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP3 'Series 2005-RP3 2A1' ' 144A' FRN 25/9/2035	662,594	0.05
USD 1,492,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 12/2/2026	1,419,981	0.11	USD 677,952	Harsco Corp ' 144A' 5.75% 31/7/2027	52,457	0.00
USD 727,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 15/5/2026	737,192	0.06	USD 53,000	HCA Inc 5.25% 15/4/2025	2,189,862	0.17
USD 2,700,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1/5/2029	2,833,744	0.22	USD 2,048,000	Herc Holdings Inc ' 144A' 5.5% 15/7/2027	234,988	0.02
USD 355,000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 27/1/2032	316,286	0.02	USD 229,000	Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15/1/2030	26,718	0.00
USD 140,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 23/1/2025	143,607	0.01	USD 26,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR ' Series 2015-HGLR D' ' 144A' 3.982% 5/3/2037	664,568	0.05
USD 392,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 1/4/2025	401,546	0.03	USD 700,000	Howard Hughes Corp/The ' 144A' 5.375% 1/8/2028*	81,317	0.01
USD 349,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.5% 1/4/2025	357,499	0.03	USD 80,000	HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-NC1 FRN 25/4/2037	1,729,965	0.13
USD 978,000	Goldman Sachs Group Inc/The 3.75% 22/5/2025	1,008,633	0.08	USD 2,260,787	Humana Inc 1.35% 3/2/2027	919,249	0.07
USD 490,879	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 'Series 2021- 5CS A' ' 144A' 2.31% 20/10/2048	474,528	0.04	USD 980,000	Humana Inc 3.95% 15/3/2027	363,319	0.03
USD 222,000	Gray Television Inc ' 144A' 7% 15/5/2027	233,414	0.02	USD 345,000	Huntington Ingalls Industries Inc 3.844% 1/5/2025	294,516	0.02
USD 1,260,000	GS Mortgage Securities Corp II Series 2005- ROCK 'Series 2005-ROCK F' ' 144A' 5.515% 3/5/2032	1,336,089	0.10	USD 285,000	Hyundai Capital America ' 144A' 2.375% 10/2/2023	1,231,662	0.10
USD 100,000	GS Mortgage Securities Trust 2012-GCJ9 ' Series 2012-GCJ9 C' ' 144A' FRN 10/11/2045	100,557	0.01	USD 1,226,000	iHeartCommunications Inc ' 144A' 4.75% 15/1/2028	57,120	0.00
USD 280,000	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC22 ' Series 2014-GC22 B' FRN 10/6/2047	283,075	0.02	USD 59,000	iHeartCommunications Inc ' 144A' 5.25% 15/8/2027	22,704	0.00
USD 775,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32 4.422% 10/7/2048	780,171	0.06	USD 23,000	iHeartCommunications Inc 6.375% 1/5/2026	19,856	0.00
USD 253,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC34 FRN 10/10/2048	259,117	0.02	USD 19,376	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.763% 10/7/2035	1,545,975	0.12
USD 1,311,363	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC34 ' Series 2015-GC34 B' FRN 10/10/2048	1,343,070	0.10	USD 1,534,500	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 ' Series 2006-AR15 A1' FRN 25/7/2036	676,688	0.05
USD 690,000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC34 3.506% 10/10/2048	708,276	0.05	USD 360,000	Intel Corp 3.2% 12/8/2061	313,489	0.02
USD 1,162,000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS2 'Series 2016-GS2 B' FRN 10/5/2049	1,164,094	0.09	USD 241,000	International Business Machines Corp 3.43% 9/2/2052	226,658	0.02
USD 1,380,000	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS7 'Series 2017-GS7 A4' 3.43% 10/8/2050	1,418,740	0.11	USD 225,000	IQVIA Inc ' 144A' 5% 15/5/2027	229,205	0.02
USD 894,340	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 'Series 2005-RP1 2A1' ' 144A' FRN 25/1/2035	907,833	0.07	USD 74,000	IRB Holding Corp ' 144A' 7% 15/6/2025	76,867	0.01
				USD 232,000	Iron Mountain Inc ' 144A' 4.875% 15/9/2027	229,039	0.02
				USD 280,000	Iron Mountain Inc ' 144A' 5% 15/7/2028	276,322	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 208,000	Iron Mountain Inc ' 144A' 5.25% 15/7/2030	205,005	0.02	USD 1,850,000	JPMorgan Chase & Co FRN 1/2/2028	1,920,386	0.15
USD 5,151,675	IXIS Real Estate Capital Trust 2006-HE2 ' Series 2006-HE2 A4' FRN 25/8/2036	1,837,802	0.14	USD 1,401,000	JPMorgan Chase & Co FRN 24/2/2028	1,399,906	0.11
USD 1,410,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE ' Series 2016-NINE A' ' 144A' FRN 6/9/2038	1,403,870	0.11	USD 2,000,000	JPMorgan Chase & Co FRN 4/2/2032	1,800,256	0.14
USD 509,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-AON ' Series 2018-AON A' ' 144A' 4.128% 5/7/2031	519,039	0.04	USD 1,892,000	JPMorgan Chase & Co FRN 22/2/2048	2,014,110	0.16
USD 27,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc (Restricted) ' 144A' 6.75% 15/2/2028	28,586	0.00	USD 68,000	JPMorgan Chase & Co FRN 15/11/2048	70,557	0.01
USD 35,000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc ' 144A' 6.5% 15/4/2029	37,380	0.00	USD 281,000	JPMorgan Chase & Co FRN 23/1/2049	287,216	0.02
USD 690,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1 ' Series 2015-JP1 C' FRN 15/1/2049	704,340	0.05	EUR 1,980,000	JPMorgan Chase & Co 0.625% 25/1/2024	2,235,315	0.17
USD 125,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-JP2 3.46% 15/8/2049	122,507	0.01	USD 231,000	Kaiser Aluminum Corp ' 144A' 4.625% 1/3/2028	218,834	0.02
USD 577,611	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 ' Series 2017-2 B3' ' 144A' FRN 25/5/2047	574,997	0.04	USD 358,000	Lam Research Corp 4% 15/3/2029	384,042	0.03
USD 1,010,285	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4 ' Series 2018-4 B4' ' 144A' FRN 25/10/2048	991,358	0.08	USD 15,000	Lamar Media Corp 3.75% 15/2/2028	14,462	0.00
USD 845,000	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C1 4.232% 17/3/2049	813,611	0.06	USD 1,310,000	LCCM 2017-LC26 ' Series 2017-LC26 A4' ' 144A' 3.551% 12/7/2050	1,335,344	0.10
USD 1,000,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C2 ' Series 2016-C2 A4' 3.144% 15/6/2049	1,014,065	0.08	USD 455,000	Level 3 Financing Inc ' 144A' 4.25% 1/7/2028	413,932	0.03
USD 1,377,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2017-C5 ' Series 2017-C5 A5' 3.694% 15/3/2050	1,424,957	0.11	USD 24,000	Level 3 Financing Inc ' 144A' 4.625% 15/9/2027	22,981	0.00
USD 1,680,000	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8 ' Series 2018-C8 B' 4.522% 15/6/2051	1,758,460	0.14	USD 35,000	Level 3 Financing Inc 5.25% 15/3/2026	35,147	0.00
USD 271,000	JPMorgan Chase & Co FRN 4/2/2027	252,300	0.02	EUR 100,000	Liberty Mutual Group Inc FRN 23/5/2059	111,452	0.01
				USD 931,000	Lowe's Cos Inc 3% 15/10/2050	788,336	0.06
				USD 233,000	Lumen Technologies Inc ' 144A' 4% 15/2/2027	220,550	0.02
				USD 79,000	Lumen Technologies Inc ' 144A' 5.125% 15/12/2026*	73,648	0.01
				EUR 100,000	Marsh & McLennan Cos Inc 1.979% 21/3/2030	114,658	0.01
				USD 55,000	Mastercard Inc 2.95% 1/6/2029	56,070	0.00
				USD 1,210,053	Mastr Asset Backed Securities Trust 2004-OPT2 ' Series 2004-OPT2 A1' FRN 25/9/2034	1,182,938	0.09
				USD 312,324	Mastr Asset Backed Securities Trust 2005-WF1 ' Series 2005-WF1 M7' FRN 25/6/2035	309,376	0.02
				USD 883,235	Mastr Asset Backed Securities Trust 2005-WF1 ' Series 2005-WF1 M8' FRN 25/6/2035	886,439	0.07
				USD 20,000	Matador Resources Co 5.875% 15/9/2026	20,341	0.00
				USD 130,000	McDonald's Corp 4.45% 1/3/2047	138,820	0.01
				USD 370,000	McDonald's Corp 4.875% 9/12/2045	412,651	0.03
				EUR 100,000	Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 9/4/2024	112,109	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 40,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co- Issuer Inc (Restricted) 4.5% 1/9/2026	41,131	0.00	USD 2,243,000	Morgan Stanley 3.875% 27/1/2026	2,326,647	0.18
USD 80,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co- Issuer Inc (Restricted) ' 144A' 4.625% 15/6/2025	82,497	0.01	USD 1,227,000	Morgan Stanley 4% 23/7/2025	1,281,402	0.10
USD 81,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co- Issuer Inc (Restricted) ' 144A' 4.625% 15/6/2025	83,528	0.01	USD 3,874,336	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2007-HE6 ' Series 2007- HE6 A2' FRN 25/5/2037	3,535,306	0.27
USD 59,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co- Issuer Inc (Restricted) 5.625% 1/5/2024	61,325	0.01	USD 2,150,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2012-C5 ' Series 2012-C5 B' FRN 15/8/2045	2,159,466	0.17
USD 46,000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co- Issuer Inc (Restricted) 5.75% 1/2/2027	49,880	0.00	USD 180,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 ' Series 2015-C23 D' ' 144A' FRN 15/7/2050	170,379	0.01
USD 13,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	13,044	0.00	USD 700,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 ' Series 2016-C31 C' FRN 15/11/2049	682,858	0.05
USD 43,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	44,304	0.00	USD 555,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 ' Series 2016-C32 AS' FRN 15/12/2049	573,810	0.04
USD 171,000	MGM Resorts International 6.75% 1/5/2025	177,094	0.01	USD 845,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 ' Series 2016-C32 A4' 3.72% 15/12/2049	877,371	0.07
USD 345,000	Microsoft Corp 2.921% 17/3/2052	319,825	0.02	USD 1,365,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 ' Series 2017-C33 A5' 3.599% 15/5/2050	1,407,185	0.11
USD 20,000	MidAmerican Energy Co 3.1% 1/5/2027	20,475	0.00	USD 1,000,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 FRN 15/12/2050	1,039,735	0.08
USD 200,000	MidAmerican Energy Co 3.15% 15/4/2050	182,202	0.01	USD 900,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E FRN 9/9/2032	888,133	0.07
USD 177,000	Molina Healthcare Inc ' 144A' 4.375% 15/6/2028	177,348	0.01	USD 852,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 3.912% 9/9/2032	869,491	0.07
USD 332,000	Moody's Corp 3.1% 29/11/2061	275,046	0.02	USD 1,991,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS ' Series 2017-CLS E' ' 144A' FRN 15/11/2034	1,968,078	0.15
USD 108,000	Moody's Corp 3.75% 25/2/2052	105,952	0.01	USD 848,700	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 ' Series 2017-H1 A5' 3.53% 15/6/2050	876,141	0.07
USD 502,000	Morgan Stanley FRN 10/12/2026	468,166	0.04	USD 1,449,748	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 B' FRN 15/7/2051	1,528,549	0.12
USD 1,725,000	Morgan Stanley FRN 4/5/2027	1,632,961	0.13	USD 425,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 ' Series 2018-H3 A5' 4.177% 15/7/2051	452,265	0.04
USD 1,100,000	Morgan Stanley FRN 23/1/2030	1,177,243	0.09				
USD 248,000	Morgan Stanley FRN 21/7/2032	225,054	0.02				
USD 197,000	Morgan Stanley FRN 20/10/2032	183,711	0.01				
USD 913,000	Morgan Stanley FRN 25/1/2052	778,967	0.06				

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 1,400,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 4.864% 15/7/2051	1,464,799	0.11	USD 898,000	Norfolk Southern Corp 3% 15/3/2032	903,377	0.07
USD 455,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 ' Series 2018-H4 C' FRN 15/12/2051	468,966	0.04	USD 218,000	Northern States Power Co/MN 2.9% 1/3/2050	192,731	0.02
USD 1,100,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 ' Series 2018-H4 A4' 4.31% 15/12/2051	1,191,186	0.09	USD 19,000	Northern States Power Co/MN 4% 15/8/2045	19,745	0.00
USD 289,971	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 ' Series 2018-L1 B' FRN 15/10/2051	306,859	0.02	USD 947,000	Northwest Pipeline LLC 4% 1/4/2027	992,077	0.08
USD 634,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP ' Series 2018-MP A' ' 144A' FRN 11/7/2040	667,602	0.05	USD 18,000	NRG Energy Inc 5.75% 15/1/2028	18,445	0.00
USD 1,305,278	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2007-1 ' Series 2007-1 A3' FRN 25/12/2036	805,158	0.06	USD 8,000	NRG Energy Inc 6.625% 15/1/2027	8,264	0.00
USD 158,007	Mosaic Solar Loan Trust 2020-1 3.1% 20/4/2046	158,319	0.01	USD 100,000	NuStar Logistics LP 5.75% 1/10/2025	104,425	0.01
USD 417,960	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 ' Series 2020-2A A' ' 144A' 1.44% 20/8/2046	386,015	0.03	USD 2,750,000	NVIDIA Corp 1.55% 15/6/2028	2,579,121	0.20
USD 253,517	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 ' Series 2020-2A B' ' 144A' 2.21% 20/8/2046	239,626	0.02	USD 600,000	NVIDIA Corp 3.5% 1/4/2050	610,685	0.05
USD 115,000	Motorola Solutions Inc 5.5% 1/9/2044	132,859	0.01	USD 690,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ' Series 2017-OT D' ' 144A' FRN 10/5/2039	623,600	0.05
USD 284,000	Mozart Debt Merger Sub Inc ' 144A' 3.875% 1/4/2029	269,122	0.02	USD 1,010,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust ' Series 2017-OT A' ' 144A' 3.566% 10/5/2039	1,001,109	0.08
EUR 620,000	National Grid North America Inc 0.41% 20/1/2026	684,064	0.05	USD 684,000	Oncor Electric Delivery Co LLC 3.1% 15/9/2049	618,446	0.05
USD 850,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-C FRN 15/11/2068	862,265	0.07	USD 37,000	Oncor Electric Delivery Co LLC 3.8% 30/9/2047	37,681	0.00
USD 875,437	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B ' Series 2005-B M1' FRN 25/10/2035	867,882	0.07	USD 138,810	OneMain Financial Issuance Trust 2016-3 ' Series 2016-3A A' ' 144A' 3.83% 18/6/2031	139,143	0.01
USD 1,310,494	Newcastle Mortgage Securities Trust 2007-1 ' Series 2007-1 2A3' FRN 25/4/2037	1,291,248	0.10	USD 150,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 ' Series 2021-1A C' ' 144A' 2.22% 16/6/2036	143,042	0.01
USD 53,000	Nexstar Media Inc ' 144A' 5.625% 15/7/2027	53,685	0.00	USD 170,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 ' Series 2021-1A D' ' 144A' 2.47% 16/6/2036	159,808	0.01
USD 2,426,000	NextEra Energy Capital Holdings Inc 1.9% 15/6/2028	2,286,135	0.18	USD 500,000	Oracle Corp 3.6% 1/4/2040	443,249	0.03
USD 401,000	NGPL PipeCo LLC ' 144A' 7.768% 15/12/2037	524,671	0.04	USD 698,000	Oracle Corp 3.6% 1/4/2050	593,649	0.05
				USD 927,000	Oracle Corp 3.6% 1/4/2050	788,414	0.06
				USD 1,745,000	Oracle Corp 3.8% 15/11/2037	1,622,243	0.13
				USD 15,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ' 144A' 4.625% 15/3/2030	14,169	0.00
				USD 23,000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp ' 144A' 5% 15/8/2027	22,703	0.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 460,000	Paramount Global 4.2% 19/5/2032	475,344	0.04	USD 2,100,000	QUALCOMM Inc 2.15% 20/5/2030	1,994,550	0.15
USD 28,000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co- Issuer ' 144A' 5.875% 1/10/2028	28,315	0.00	USD 53,000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc ' 144A' 4.5% 15/9/2026	50,243	0.00
USD 14,000	PDC Energy Inc 5.75% 15/5/2026	14,230	0.00	USD 6,000	RELX Capital Inc 3% 22/5/2030	5,957	0.00
USD 174,000	PennyMac Financial Services Inc ' 144A' 5.375% 15/10/2025	172,480	0.01	USD 60,000	RELX Capital Inc 3.5% 16/3/2023	61,076	0.00
USD 710,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A' 2.7% 1/11/2024	713,485	0.06	USD 297,000	RELX Capital Inc 4% 18/3/2029	315,250	0.02
USD 31,000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp ' 144A' 4% 15/7/2025	32,178	0.00	USD 329,096	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-3 (Step-up coupon) ' Series 2005-3 AF4' 5.14% 25/11/2035	342,153	0.03
USD 146,000	PG&E Corp 5% 1/7/2028	144,069	0.01	USD 21,000	Renewable Energy Group Inc ' 144A' 5.875% 1/6/2028	21,103	0.00
EUR 300,000	Philip Morris International Inc 2% 9/5/2036	304,504	0.02	USD 743,000	Reynolds American Inc 5.85% 15/8/2045	786,680	0.06
EUR 225,000	Philip Morris International Inc 3.125% 3/6/2033	265,848	0.02	USD 14,000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.75% 15/10/2027	13,701	0.00
USD 80,000	Post Holdings Inc ' 144A' 4.625% 15/4/2030	75,407	0.01	USD 200,000	Roche Holdings Inc ' 144A' 2.607% 13/12/2051	173,443	0.01
EUR 915,000	PPG Industries Inc 1.4% 13/3/2027	1,049,763	0.08	USD 88,000	Rockies Express Pipeline LLC ' 144A' 4.95% 15/7/2029	85,159	0.01
USD 51,000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc ' 144A' 3.375% 31/8/2027	47,393	0.00	USD 19,000	RPM International Inc 5.25% 1/6/2045	22,896	0.00
USD 79,000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc ' 144A' 6.25% 15/1/2028	76,204	0.01	USD 113,000	Ryder System Inc 2.875% 1/6/2022	113,360	0.01
EUR 380,000	Procter & Gamble Co/The 0.9% 4/11/2041*	369,967	0.03	USD 315,000	Ryder System Inc 4.625% 1/6/2025	333,742	0.03
EUR 280,000	Prologis Euro Finance LLC 0.625% 10/9/2031	282,491	0.02	USD 45,000	Ryder System Inc 4.625% 1/6/2025	47,677	0.00
EUR 300,000	Prologis Euro Finance LLC 1.5% 8/2/2034*	320,228	0.02	USD 155,000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 1/3/2025	166,807	0.01
USD 666,000	Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC ' 144A' 3.75% 16/10/2029	598,105	0.05	USD 200,000	Sasol Financing USA LLC 4.375% 18/9/2026	194,750	0.02
USD 203,000	Promigas SA ESP / Gases del Pacifico SAC 3.75% 16/10/2029	182,305	0.01	USD 375,000	Sasol Financing USA LLC 5.5% 18/3/2031	359,531	0.03
USD 9,000	Public Service Electric and Gas Co 3.6% 1/12/2047	8,952	0.00	USD 330,000	Sasol Financing USA LLC 5.5% 18/3/2031	316,388	0.02
USD 60,000	Public Service Electric and Gas Co 5.5% 1/3/2040	73,735	0.01	USD 205,000	Sasol Financing USA LLC 5.875% 27/3/2024	209,100	0.02
USD 693,000	QUALCOMM Inc 1.65% 20/5/2032	616,058	0.05	USD 200,000	Sasol Financing USA LLC 6.5% 27/9/2028	207,750	0.02
				USD 126,000	Scientific Games International Inc ' 144A' 5% 15/10/2025	127,894	0.01
				EUR 100,000	SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 4.375% 1/11/2026	109,677	0.01
				USD 578,000	Select Medical Corp ' 144A' 6.25% 15/8/2026	580,046	0.04
				USD 484,000	Service Properties Trust 5% 15/8/2022	482,328	0.04
				USD 76,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	79,895	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 507,000	Sesac Finance LLC ' Series 2019-1 A2' ' 144A' 5.216% 25/7/2049	515,998	0.04	USD 230,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	223,102	0.02
USD 144,000	Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed ' 144A' 4.625% 1/3/2029	133,309	0.01	USD 420,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A ' Series 2021-A D1' ' 144A' 3.86% 15/1/2053	409,163	0.03
USD 32,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A' 5% 1/8/2027	32,551	0.00	USD 255,000	Southern California Edison Co 1.2% 1/2/2026	241,399	0.02
USD 28,000	Sirius XM Radio Inc ' 144A' 5.5% 1/7/2029	28,696	0.00	USD 205,000	Southern California Edison Co 2.75% 1/2/2032	195,674	0.02
USD 27,000	Six Flags Entertainment Corp ' 144A' 4.875% 31/7/2024	27,231	0.00	USD 300,000	Southern Copper Corp 5.25% 8/11/2042*	346,730	0.03
USD 15,000	Six Flags Entertainment Corp ' 144A' 5.5% 15/4/2027	14,995	0.00	USD 78,000	Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp ' 144A' 6.375% 30/9/2026	78,668	0.01
USD 226,000	Six Flags Theme Parks Inc ' 144A' 7% 1/7/2025	237,280	0.02	USD 21,000	SRS Distribution Inc ' 144A' 4.625% 1/7/2028	19,925	0.00
USD 673,715	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A ' Series 2004-A A3' FRN 15/6/2033	665,646	0.05	USD 23,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A' 4.75% 15/1/2028	22,534	0.00
USD 2,050,572	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B ' Series 2005-B A4' FRN 15/6/2039	2,004,547	0.15	USD 14,000	Standard Industries Inc/NJ ' 144A' 5% 15/2/2027	14,096	0.00
USD 2,440,239	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A ' Series 2006-A A5' FRN 15/6/2039	2,371,285	0.18	USD 1,862,986	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2006-BC2 ' Series 2006-BC2 A1' FRN 25/9/2036	1,451,847	0.11
USD 505,316	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B ' Series 2006-BW A5' FRN 15/12/2039	493,078	0.04	USD 212,000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp ' 144A' 5.25% 15/1/2029	213,166	0.02
USD 1,336,474	SLM Private Education Loan Trust 2010-C FRN 15/10/2041	1,483,655	0.11	USD 59,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp ' 144A' 4.5% 30/4/2030	56,281	0.00
USD 266,000	SM Energy Co ' 144A' 10% 15/1/2025	290,061	0.02	USD 15,000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6% 15/4/2027	15,457	0.00
USD 680,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C ' Series 2015-C B' ' 144A' 3.5% 15/9/2043	680,386	0.05	USD 10,000	Tampa Electric Co 4.3% 15/6/2048	10,854	0.00
USD 885,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A ' Series 2020-A B' ' 144A' 3% 15/8/2045	869,103	0.07	USD 19,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5% 15/1/2028	19,609	0.00
USD 1,595,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTA ' Series 2020-PTA B' ' 144A' 2.5% 15/9/2054	1,559,647	0.12	USD 14,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 1/2/2027	14,411	0.00
USD 1,090,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB ' Series 2020-PTB B' ' 144A' 2.5% 15/9/2054	1,040,910	0.08	USD 25,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15/4/2026	25,905	0.00
USD 2,450,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A ' Series 2021-A A2A1' ' 144A' FRN 15/1/2053	2,449,300	0.19				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

投資有価証券明細表 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 19,000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.5% 15/7/2027	20,162	0.00	USD 1,395,115	Tricon American Homes 2019-SFR1 Trust 'Series 2019-SFR1 A' '144A' 2.75% 17/3/2038	1,373,284	0.11
USD 14,000	Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15/6/2027	14,667	0.00	EUR 100,000	UGI International LLC 2.5% 1/12/2029	100,375	0.01
USD 58,000	TEGNA Inc 4.625% 15/3/2028	58,092	0.00	USD 510,000	Union Pacific Corp 2.75% 1/3/2026	514,780	0.04
USD 24,000	TEGNA Inc 5% 15/9/2029	24,124	0.00	USD 276,000	Union Pacific Corp 2.973% 16/9/2062	230,233	0.02
USD 86,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15/1/2030	82,345	0.01	USD 42,000	Union Pacific Corp 3% 15/4/2027	42,930	0.00
USD 17,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 1/9/2024	17,259	0.00	USD 305,000	Union Pacific Corp 3.839% 20/3/2060	306,336	0.02
USD 19,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15/6/2028	18,588	0.00	USD 106,757	United Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust 3.1% 7/7/2028	107,605	0.01
USD 53,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 1/1/2026	53,154	0.00	USD 644,009	United Airlines 2018-1 Class AA Pass Through Trust 3.5% 1/3/2030	656,655	0.05
USD 34,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 1/11/2027	34,425	0.00	USD 967,287	United Airlines 2019-2 Class A Pass Through Trust 2.9% 1/5/2028	923,844	0.07
USD 30,000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6.25% 1/2/2027	30,712	0.00	USD 32,000	United Rentals North America Inc 4.875% 15/1/2028	32,548	0.00
USD 318,000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 3.5% 15/1/2028	322,810	0.03	USD 4,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	5,393	0.00
USD 122,000	Texas Eastern Transmission LP '144A' 4.15% 15/1/2048	123,571	0.01	USD 5,100,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2031†	5,851,149	0.45
USD 1,350,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.6% 1/10/2029	1,316,085	0.10	USD 1,004,000	United States Treasury Note/ Bond 0.25% 30/6/2025	952,761	0.07
USD 212,000	Thermo Fisher Scientific Inc 2.8% 15/10/2041	191,893	0.02	USD 111,000	United States Treasury Note/ Bond 1.125% 15/2/2031†	103,284	0.01
USD 136,000	Time Warner Cable LLC 6.55% 1/5/2037	160,595	0.01	USD 2,725,000	United States Treasury Note/ Bond 1.375% 15/11/2040†	2,306,564	0.18
USD 972,000	T-Mobile USA Inc 3.3% 15/2/2051	828,585	0.06	USD 219,000	UnitedHealth Group Inc 3.85% 15/6/2028	232,734	0.02
USD 615,000	T-Mobile USA Inc 3.3% 15/2/2051	524,259	0.04	USD 963,000	UnitedHealth Group Inc 3.875% 15/12/2028	1,030,778	0.08
USD 100,000	T-Mobile USA Inc '144A' 3.4% 15/10/2052	86,688	0.01	USD 225,000	US Foods Inc '144A' 6.25% 15/4/2025	233,439	0.02
USD 1,236,000	T-Mobile USA Inc 3.875% 15/4/2030	1,264,805	0.10	USD 53,000	Vail Resorts Inc '144A' 6.25% 15/5/2025	54,661	0.00
USD 955,000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 4% 15/3/2028	1,001,432	0.08	USD 5,144,000	Verizon Communications Inc 1.5% 18/9/2030	4,541,502	0.35
USD 686,000	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC 7.85% 1/2/2026	806,587	0.06	USD 1,000,000	Verizon Communications Inc 1.68% 30/10/2030	891,131	0.07
USD 115,000	Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31/7/2026	122,678	0.01	USD 1,950,000	Verizon Communications Inc 2.1% 22/3/2028	1,867,305	0.14
USD 25,000	Tri Pointe Homes Inc 5.7% 15/6/2028	25,349	0.00	EUR 900,000	Verizon Communications Inc 2.875% 15/1/2038	1,110,053	0.09
				USD 743,000	Verizon Communications Inc 2.987% 30/10/2056	623,801	0.05
				USD 224,000	Verizon Communications Inc 3% 20/11/2060	181,253	0.01

† 当該有価証券の全額または一部は、差入れたまたは保証として引渡した有価証券である。詳細については注記14を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

事後通告証券契約 2022年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
TBA	米国				Fannie Mae or Freddie		
USD 4,521,000	Mac ' 1.5 3/22' 1.5%	4,374,068	0.34	USD (1,049,000)	Mac ' 3.5 3/22' 3.5%	(1,075,061)	(0.08)
	TBA				TBA		
USD 3,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 1.5 4/22' 1.5%	2,750,694	0.21	USD 100,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 3/22' 4%	104,156	0.01
	TBA			USD 2,916,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4 4/22' 4%	3,033,551	0.23
USD 1,614,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 1.5 3/22' 1.5%	1,481,286	0.11	USD 923,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 4.5 3/22' 4.5%	973,404	0.08
	TBA				TBA		
USD 6,738,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2 3/22' 2%	6,649,564	0.51	USD 5,122,600	Ginnie Mae ' 2 3/22' 2%	4,963,919	0.38
	TBA				TBA		
USD 2,503,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2 3/22' 2%	2,378,046	0.18	USD 600,000	Ginnie Mae ' 2 4/22' 2%	580,359	0.05
	TBA				TBA		
USD 19,389,700	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2 4/22' 2%	18,394,149	1.42	USD 200,000	Ginnie Mae ' 2.5 4/22'	198,055	0.02
	TBA				2.5% TBA		
USD 1,083,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 3/22' 2.5%	1,090,699	0.08	USD 3,906,000	Ginnie Mae ' 2.5 3/22'	3,875,179	0.30
	TBA				2.5% TBA		
USD 4,700,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 3/22' 2.5%	4,599,023	0.35	USD 4,453,000	Ginnie Mae ' 3 3/22' 3%	4,501,531	0.35
	TBA				TBA		
USD 15,570,967	Fannie Mae or Freddie Mac ' 2.5 4/22' 2.5%	15,209,420	1.17	USD 300,000	Ginnie Mae ' 3 4/22' 3%	302,566	0.02
	TBA				TBA		
USD 18,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 3/22' 3%	18,386	0.00	USD 397,000	Ginnie Mae ' 3.5 3/22'	407,483	0.03
	TBA				3.5% TBA		
USD 8,744,737	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3 4/22' 3%	8,755,326	0.67	USD 300,000	Ginnie Mae ' 3.5 4/22'	306,914	0.02
	TBA				3.5% TBA		
USD 1,049,000	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 4/22' 3.5%	1,072,643	0.08	USD 529,000	Ginnie Mae ' 4 3/22' 4%	548,342	0.04
	TBA				TBA		
USD (38,000)	Fannie Mae or Freddie Mac ' 3.5 3/22' 3.5%	(39,158)	0.00	USD (775,000)	Ginnie Mae ' 4.5 3/22'	(810,661)	(0.06)
	TBA				4.5% TBA		
				USD 631,000	Ginnie Mae ' 5 3/22' 5%	669,923	0.05
					TBA		
				TBA合計		85,313,806	6.56

事後通告(TBA)契約は、主にパス・スルー代理人の発行体の所在国により分類される。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2022年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
EUR	694,875	AUD	1,110,000	Royal Bank of Canada	3/3/2022	(23,680)
EUR	4,742,000	USD	5,318,817	Standard Chartered Bank	3/3/2022	3,611
GBP	1,579,000	USD	2,118,465	Standard Chartered Bank	3/3/2022	(848)
TRY	164,000	USD	11,885	UBS	3/3/2022	(26)
USD	156,734	AUD	220,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	(2,539)
USD	121,981	AUD	170,000	Morgan Stanley	3/3/2022	(1,094)
USD	6,933,350	AUD	9,928,185	State Street	3/3/2022	(254,371)
USD	285,000	AUD	408,100	Royal Bank of Canada	3/3/2022	(10,452)
USD	6,425,158	CAD	8,160,000	Morgan Stanley	3/3/2022	3,713
USD	117,955	CAD	150,000	RBS Plc	3/3/2022	(86)
USD	94,675	CAD	120,000	Royal Bank of Canada	3/3/2022	242
USD	17,475,326	CAD	22,336,227	UBS	3/3/2022	(101,985)
USD	2,220,913	CHF	2,066,000	Royal Bank of Canada	3/3/2022	(28,608)
USD	99,246,117	CNH	633,513,072	JP Morgan	3/3/2022	(1,040,255)
USD	1,629,759	CNH	10,400,000	Deutsche Bank	3/3/2022	(16,581)
USD	1,291,528	CZK	28,460,000	Goldman Sachs	3/3/2022	11,553
USD	1,970,105	DKK	13,151,000	BNP Paribas	3/3/2022	(13,715)
USD	248,518,527	EUR	222,768,598	BNP Paribas	3/3/2022	(1,517,290)
USD	1,415,991	EUR	1,260,000	State Street	3/3/2022	1,765
USD	62,197,034	GBP	46,464,980	BNY Mellon	3/3/2022	(117,739)
USD	2,895,269	GBP	2,150,000	State Street	3/3/2022	11,877
USD	514,593	GBP	380,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	4,971
USD	731,475	GBP	540,000	Morgan Stanley	3/3/2022	7,274
USD	538,420	HUF	173,790,000	Goldman Sachs	3/3/2022	13,200
USD	68,317	JPY	7,860,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	119
USD	661,277	JPY	76,200,000	Morgan Stanley	3/3/2022	119
USD	85,124,999	JPY	9,805,974,264	Goldman Sachs	3/3/2022	42,423
USD	815,412	MXN	17,086,212	RBS Plc	3/3/2022	(24,348)
USD	1,398,962	MXN	28,740,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	(13,563)
USD	1,736,705	MXN	35,780,000	UBS	3/3/2022	(21,824)
USD	22,911,281	MXN	479,899,693	Bank of America	3/3/2022	(675,017)
USD	747,497	NOK	6,730,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	(12,917)
USD	926,689	NZD	1,418,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	(30,937)
USD	3,460,038	PLN	14,270,000	Goldman Sachs	3/3/2022	45,704
USD	4,335,118	SEK	40,965,000	HSBC Bank Plc	3/3/2022	1,120
USD	2,763,903	SGD	3,750,000	Standard Chartered Bank	3/3/2022	2,102
USD	1,834,610	THB	61,371,000	RBS Plc	3/3/2022	(43,622)
USD	1,064,383	ZAR	16,510,000	Standard Chartered Bank	3/3/2022	(4,424)
USD	1,187,831	ZAR	18,247,761	UBS	3/3/2022	6,527
USD	12,384,813	ZAR	194,539,292	BNP Paribas	3/3/2022	(209,061)
THB	13,455,000	USD	400,000	Barclays	15/3/2022	11,804
BRL	4,656,300	USD	874,915	UBS	16/3/2022	25,313
BRL	29,415,000	USD	5,137,542	Morgan Stanley	16/3/2022	549,429
BRL	25,440,000	USD	4,469,038	Deutsche Bank	16/3/2022	449,422
BRL	900,000	USD	155,213	Bank of America	16/3/2022	18,789
CHF	1,021,122	USD	1,110,000	BNP Paribas	16/3/2022	2,532
CHF	4,313,392	USD	4,703,102	Barclays	16/3/2022	(3,579)
CHF	2,271,644	USD	2,486,898	Morgan Stanley	16/3/2022	(11,898)
CHF	615,920	USD	670,000	RBS Plc	16/3/2022	1,057
CNH	7,371,000	USD	1,164,243	UBS	16/3/2022	1,377
CNH	130,686,000	USD	20,372,990	Goldman Sachs	16/3/2022	293,175
CNH	51,280,000	USD	8,013,126	Deutsche Bank	16/3/2022	96,089
EUR	19,150,000	JPY	2,457,418,005	RBS Plc	16/3/2022	177,783
EUR	4,045,000	USD	4,624,920	Bank of America	16/3/2022	(82,271)
EUR	4,617,222	USD	5,233,141	Barclays	16/3/2022	(47,870)
EUR	19,985,920	USD	22,657,487	Morgan Stanley	16/3/2022	(212,733)
EUR	10,930,000	USD	12,446,120	Goldman Sachs	16/3/2022	(171,420)
EUR	7,860,000	USD	8,945,319	UBS	16/3/2022	(118,317)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2022年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
EUR	2,470,000	USD	2,797,931	RBS Plc	16/3/2022	(24,051)
EUR	9,730,000	USD	11,006,399	BNP Paribas	16/3/2022	(79,335)
EUR	7,390,000	USD	8,357,375	JP Morgan	16/3/2022	(58,193)
EUR	14,391,858	USD	16,322,481	Deutsche Bank	16/3/2022	(160,019)
EUR	240,000	USD	272,578	Standard Chartered Bank	16/3/2022	(3,052)
EUR	180,000	USD	204,684	State Street	16/3/2022	(2,539)
EUR	130,000	USD	148,125	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(2,131)
EUR	1,900,000	USD	2,153,177	Citibank	16/3/2022	(19,424)
EUR	2,890,000	USD	3,284,404	Toronto Dominion	16/3/2022	(38,852)
GBP	12,811,506	EUR	14,970,000	State Street	16/3/2022	372,052
GBP	3,270,000	USD	4,425,091	Morgan Stanley	16/3/2022	(39,114)
GBP	1,630,000	USD	2,207,169	JP Morgan	16/3/2022	(20,886)
GBP	1,590,000	USD	2,148,596	Barclays	16/3/2022	(15,965)
GBP	130,000	USD	175,089	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(723)
GBP	120,000	USD	160,976	State Street	16/3/2022	(23)
GBP	250,000	USD	332,207	Deutsche Bank	16/3/2022	3,112
IDR	19,914,409	USD	1,392	Goldman Sachs	16/3/2022	(9)
IDR	17,317,547,179	USD	1,206,559	Bank of America	16/3/2022	(3,205)
IDR	8,163,190,000	USD	569,062	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(1,821)
IDR	23,030,000,000	USD	1,589,372	Barclays	16/3/2022	10,927
INR	4,940,000	USD	64,817	Citibank	16/3/2022	584
JPY	151,000,000	USD	1,311,486	Barclays	16/3/2022	(940)
JPY	30,000,000	USD	262,003	Deutsche Bank	16/3/2022	(1,630)
JPY	12,645,767,797	USD	111,614,594	RBS Plc	16/3/2022	(1,860,543)
KRW	590,000,000	USD	500,085	Citibank	16/3/2022	(9,696)
MXN	33,231,000	USD	1,601,378	JP Morgan	16/3/2022	27,939
MXN	81,290,000	USD	3,821,491	Citibank	16/3/2022	164,161
MXN	444,704,107	USD	20,902,851	RBS Plc	16/3/2022	901,009
MYR	1,085,000	USD	259,290	Morgan Stanley	16/3/2022	(975)
MYR	1,615,000	USD	385,773	Barclays	16/3/2022	(1,275)
NOK	1,100,000	USD	124,224	JP Morgan	16/3/2022	52
NOK	2,840,000	USD	316,030	Goldman Sachs	16/3/2022	4,827
PHP	67,805,000	USD	1,336,601	Deutsche Bank	16/3/2022	(16,108)
PHP	15,700,000	USD	302,738	Bank of America	16/3/2022	3,017
PHP	33,900,000	USD	677,526	Barclays	16/3/2022	(17,328)
PHP	33,895,000	USD	676,344	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(16,244)
RUB	159,134,000	USD	2,050,035	BNY Mellon	16/3/2022	(596,172)
RUB	281,400,000	USD	3,750,584	Goldman Sachs	16/3/2022	(1,179,687)
RUB	9,500,000	USD	126,117	Bank of America	16/3/2022	(39,324)
SEK	3,950,000	USD	434,106	JP Morgan	16/3/2022	(16,053)
SGD	4,450,000	USD	3,260,472	RBS Plc	16/3/2022	16,665
THB	97,900,000	USD	2,923,915	Citibank	16/3/2022	72,430
TWD	44,400,000	USD	1,611,762	Morgan Stanley	16/3/2022	(27,988)
USD	5,290,814	AUD	7,370,000	Morgan Stanley	16/3/2022	(45,923)
USD	1,298,993	BRL	7,520,000	Credit Suisse	16/3/2022	(154,891)
USD	1,324,657	BRL	7,430,000	Deutsche Bank	16/3/2022	(111,827)
USD	2,019	BRL	11,573	Citibank	16/3/2022	(219)
USD	2,069,319	BRL	11,938,427	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(238,805)
USD	40,199	BRL	230,000	BNP Paribas	16/3/2022	(4,268)
USD	1,728,332	BRL	9,791,000	State Street	16/3/2022	(164,618)
USD	13,430,181	BRL	76,832,000	Standard Chartered Bank	16/3/2022	(1,424,187)
USD	5,700,000	CAD	7,245,466	Morgan Stanley	16/3/2022	(2,102)
USD	745,970	CHF	692,638	UBS	16/3/2022	(8,673)
USD	4,990,000	CHF	4,594,861	JP Morgan	16/3/2022	(16,190)
USD	2,564,030	CHF	2,383,840	Morgan Stanley	16/3/2022	(33,210)
USD	659,200	CNH	4,220,000	Goldman Sachs	16/3/2022	(8,134)
USD	8,419,495	CNH	53,890,000	Deutsche Bank	16/3/2022	(102,456)
USD	1,346,875	CNH	8,620,000	UBS	16/3/2022	(16,258)
USD	19,888,596	CNH	127,590,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(287,979)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2022年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,977,292	EUR	1,770,000	Toronto Dominion	16/3/2022	(10,468)
USD	128,233	EUR	115,000	Royal Bank of Canada	16/3/2022	(916)
USD	2,632,395	EUR	2,320,000	Standard Chartered Bank	16/3/2022	26,969
USD	4,610,011	EUR	4,070,000	UBS	16/3/2022	39,285
USD	1,513,858	EUR	1,330,000	Goldman Sachs	16/3/2022	20,230
USD	124,327	EUR	110,000	BNY Mellon	16/3/2022	794
USD	28,765,580	EUR	25,383,000	State Street	16/3/2022	259,752
USD	13,802,564	EUR	12,187,860	Morgan Stanley	16/3/2022	115,252
USD	8,656,754	EUR	7,603,774	Barclays	16/3/2022	117,501
USD	1,079,713	EUR	950,000	Citibank	16/3/2022	12,836
USD	2,149,378	EUR	1,892,140	BNP Paribas	16/3/2022	24,451
USD	8,808,396	EUR	7,755,769	Bank of America	16/3/2022	98,448
USD	19,989,676	EUR	17,690,458	Deutsche Bank	16/3/2022	122,792
USD	2,296,844	EUR	2,040,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	5,866
USD	7,875,341	EUR	6,970,000	JP Morgan	16/3/2022	47,835
USD	3,067,413	GBP	2,280,000	Deutsche Bank	16/3/2022	9,300
USD	3,399,443	GBP	2,502,743	Morgan Stanley	16/3/2022	42,570
USD	638,641	GBP	469,578	HSBC Bank Plc	16/3/2022	8,807
USD	2,324,977	GBP	1,720,000	JP Morgan	16/3/2022	17,979
USD	23,582	GBP	17,680	Goldman Sachs	16/3/2022	(131)
USD	17,537,117	GBP	13,250,000	RBS Plc	16/3/2022	(234,811)
USD	1,799,822	IDR	26,048,038,010	BNP Paribas	16/3/2022	(10,192)
USD	346,415	IDR	4,966,210,000	Deutsche Bank	16/3/2022	1,326
USD	9,109,537	IDR	131,991,435,595	Barclays	16/3/2022	(62,226)
USD	1,372,359	IDR	19,605,520,000	Bank of America	16/3/2022	10,019
USD	534,593	IDR	7,685,840,000	Goldman Sachs	16/3/2022	522
USD	668,603	IDR	9,597,790,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	1,676
USD	3,465,158	INR	265,130,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(44,880)
USD	66,387	INR	4,940,000	BNP Paribas	16/3/2022	986
USD	1,565,989	JPY	181,000,000	Deutsche Bank	16/3/2022	(4,931)
USD	95,259,295	JPY	10,792,716,182	Goldman Sachs	16/3/2022	1,588,089
USD	13,980,573	KRW	16,509,397,395	Goldman Sachs	16/3/2022	258,508
USD	3,262	KRW	3,893,605	Standard Chartered Bank	16/3/2022	25
USD	283,351	KRW	340,010,000	BNP Paribas	16/3/2022	747
USD	2,154,667	KRW	2,544,990,000	Citibank	16/3/2022	39,356
USD	303,905	KRW	364,625,000	Bank of America	16/3/2022	841
USD	16,940	MXN	350,000	UBS	16/3/2022	(220)
USD	1,964,294	MXN	40,600,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(26,325)
USD	2,630,785	MXN	54,600,000	State Street	16/3/2022	(46,255)
USD	1,327,744	MXN	28,000,000	JP Morgan	16/3/2022	(45,097)
USD	19,649,581	MXN	418,147,606	Goldman Sachs	16/3/2022	(852,212)
USD	1,326,553	MXN	27,300,000	Morgan Stanley	16/3/2022	(11,967)
USD	3,251,052	MYR	13,750,000	Barclays	16/3/2022	(22,529)
USD	439,417	NOK	3,940,000	JP Morgan	16/3/2022	(5,716)
USD	2,985,668	PHP	151,300,000	Deutsche Bank	16/3/2022	39,122
USD	122,766	RUB	9,500,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	35,974
USD	3,179,085	RUB	238,455,050	Goldman Sachs	16/3/2022	1,000,538
USD	311,273	SEK	2,820,000	Bank of America	16/3/2022	12,814
USD	2,850,000	SEK	25,793,728	RBS Plc	16/3/2022	120,089
USD	124,712	SEK	1,130,000	JP Morgan	16/3/2022	5,117
USD	517,401	SGD	695,000	Deutsche Bank	16/3/2022	5,578
USD	130,116	SGD	175,000	Barclays	16/3/2022	1,240
USD	672,424	THB	21,800,000	Barclays	16/3/2022	5,210
USD	983,978	THB	33,035,000	Bank of America	16/3/2022	(27,098)
USD	638,831	THB	21,535,000	HSBC Bank Plc	16/3/2022	(20,273)
USD	637,831	THB	21,530,000	Deutsche Bank	16/3/2022	(21,120)
USD	4,023,698	ZAR	64,200,000	Barclays	16/3/2022	(124,968)
USD	1,949,817	ZAR	30,900,000	Morgan Stanley	16/3/2022	(46,970)
USD	1,197,689	ZAR	19,400,000	Toronto Dominion	16/3/2022	(55,958)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2022年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ZAR	68,650,000	USD	4,203,162	Barclays	16/3/2022	233,066
ZAR	41,490,000	USD	2,560,349	UBS	16/3/2022	120,775
BRL	2,690,168	USD	520,000	Goldman Sachs	18/3/2022	(193)
BRL	3,443,941	USD	650,000	Barclays	18/3/2022	15,455
CLP	526,571,500	USD	650,000	Citibank	18/3/2022	9,699
COP	1,574,400,000	USD	400,000	Barclays	18/3/2022	2,820
CZK	11,188,570	USD	520,000	Deutsche Bank	18/3/2022	(17,634)
CZK	11,310,744	USD	520,000	Goldman Sachs	18/3/2022	(12,149)
EUR	690,000	USD	783,585	UBS	18/3/2022	(8,629)
HUF	211,759,340	USD	650,000	Bank of America	18/3/2022	(11,033)
HUF	213,501,312	USD	640,000	UBS	18/3/2022	4,223
MXN	21,536,706	USD	1,040,000	BNY Mellon	18/3/2022	15,553
MXN	13,727,040	USD	670,000	UBS	18/3/2022	2,787
PLN	3,282,562	USD	780,000	BNY Mellon	18/3/2022	4,471
SEK	8,590,268	USD	920,000	Goldman Sachs	18/3/2022	(10,788)
USD	650,000	BRL	3,396,575	Barclays	18/3/2022	(6,302)
USD	650,000	CLP	523,250,000	Barclays	18/3/2022	(5,538)
USD	790,000	COP	3,110,862,000	Barclays	18/3/2022	(5,933)
USD	520,000	CZK	11,187,704	JP Morgan	18/3/2022	17,673
USD	770,052	EUR	690,000	JP Morgan	18/3/2022	(4,904)
USD	510,000	HUF	160,542,543	JP Morgan	18/3/2022	25,576
USD	780,000	HUF	245,695,008	UBS	18/3/2022	38,635
USD	1,190,000	MXN	24,561,511	UBS	18/3/2022	(13,805)
USD	520,000	MXN	10,664,082	Goldman Sachs	18/3/2022	(2,666)
USD	780,000	PLN	3,144,647	BNP Paribas	18/3/2022	28,488
USD	390,000	RUB	32,818,500	Citibank	18/3/2022	91,048
USD	920,000	SEK	8,677,995	Citibank	18/3/2022	1,502
USD	400,000	THB	12,840,000	Goldman Sachs	18/3/2022	7,013
USD	400,000	ZAR	6,105,017	BNP Paribas	18/3/2022	5,597
EUR	711,694	AUD	1,110,000	State Street	6/4/2022	(4,082)
TRY	164,000	USD	11,261	Citibank	6/4/2022	(156)
USD	7,735,045	AUD	10,712,849	State Street	6/4/2022	(24,606)
USD	855,000	CAD	1,088,964	Standard Chartered Bank	6/4/2022	(2,063)
USD	23,293,771	CAD	29,673,402	BNP Paribas	6/4/2022	(60,512)
USD	2,230,773	CHF	2,066,000	Standard Chartered Bank	6/4/2022	(22,327)
USD	101,680,627	CNH	643,913,072	BNP Paribas	6/4/2022	20,525
USD	1,290,931	CZK	28,460,000	UBS	6/4/2022	15,737
USD	1,990,939	DKK	13,151,000	HSBC Bank Plc	6/4/2022	4,365
USD	987,157	EUR	880,000	Morgan Stanley	6/4/2022	(1,941)
USD	6,031,911	EUR	5,380,000	State Street	6/4/2022	(15,070)
USD	4,107,736	EUR	3,644,641	HSBC Bank Plc	6/4/2022	11,254
USD	242,875,100	EUR	215,603,423	UBS	6/4/2022	542,412
USD	64,212,665	GBP	47,953,280	HSBC Bank Plc	6/4/2022	(114,442)
USD	534,709	HUF	173,790,000	UBS	6/4/2022	11,342
USD	92,422,974	JPY	10,685,095,462	Goldman Sachs	6/4/2022	(355,960)
USD	815,412	MXN	16,730,256	Goldman Sachs	6/4/2022	(1,724)
USD	26,554,986	MXN	544,419,693	Citibank	6/4/2022	(35,450)
USD	760,400	NOK	6,730,000	HSBC Bank Plc	6/4/2022	192
USD	954,410	NZD	1,418,000	Morgan Stanley	6/4/2022	(2,733)
USD	3,454,564	PLN	14,270,000	BNP Paribas	6/4/2022	49,309
USD	4,348,379	SEK	40,965,000	BNP Paribas	6/4/2022	10,424
USD	2,769,279	SGD	3,750,000	HSBC Bank Plc	6/4/2022	7,864
USD	15,026,409	ZAR	229,095,032	Citibank	6/4/2022	263,845
USD	1,887,955	THB	61,371,000	Standard Chartered Bank	7/4/2022	9,477
USD	1,668,938	IDR	24,080,766,400	Citibank	18/4/2022	846
CNH	29,176,538	USD	4,580,031	BNP Paribas	24/5/2022	12,914
USD	10,930,591	CNH	69,632,021	BNP Paribas	24/5/2022	(30,821)
USD	367,571	MXN	7,608,566	BNP Paribas	24/5/2022	(734)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済先渡為替予約 2022年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	1,125,707	RUB	87,025,000	JP Morgan	24/5/2022	383,403
未実現純評価損						(4,706,974)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	5,514,053	USD	5,966,817	BNY Mellon	15/3/2022	40,531
USD	73,983	CHF	68,191	BNY Mellon	15/3/2022	(308)
未実現純評価益						40,223
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	587,378	USD	92,159	BNY Mellon	15/3/2022	735
USD	1,255	CNY	7,950	BNY Mellon	15/3/2022	(2)
未実現純評価益						733
ヘッジを使用したデンマーク・クローネ建投資証券クラス						
DKK	598	USD	92	BNY Mellon	15/3/2022	(2)
USD	1	DKK	3	BNY Mellon	15/3/2022	-
未実現純評価損						(2)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	127,519,832	USD	145,374,247	BNY Mellon	15/3/2022	(2,170,804)
USD	1,631,280	EUR	1,440,053	BNY Mellon	15/3/2022	14,121
未実現純評価損						(2,156,683)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	275,012,257	USD	373,091,447	BNY Mellon	15/3/2022	(4,226,652)
USD	4,686,150	GBP	3,461,946	BNY Mellon	15/3/2022	42,758
未実現純評価損						(4,183,894)
ヘッジを使用したノルウェー・クローネ建投資証券クラス						
NOK	477,780,288	USD	54,156,831	BNY Mellon	15/3/2022	(177,856)
USD	551,034	NOK	4,907,926	BNY Mellon	15/3/2022	(3,457)
未実現純評価損						(181,313)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	10,048	USD	6,729	BNY Mellon	15/3/2022	56
USD	72	NZD	108	BNY Mellon	15/3/2022	(1)
未実現純評価益						55
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	208,818	USD	155,629	BNY Mellon	15/3/2022	(1,848)
USD	1,748	SGD	2,355	BNY Mellon	15/3/2022	13
未実現純評価損						(1,835)
未実現純評価損合計						(11,189,690)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

未決済上場先物取引 2022年2月28日現在

取引数	通貨	取引 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
203	AUD	Australian 3 Year Bond	2022年3月	(172,293)
149	AUD	Australian 10 Year Bond	2022年3月	(566,834)
90	EUR	Euro Bund	2022年3月	100,874
86	EUR	Euro-OAT	2022年3月	60,080
79	EUR	Short-Term Euro-BTP	2022年3月	(33,547)
60	EUR	Euro Schatz	2022年3月	15,398
(50)	EUR	Euro BUXL	2022年3月	207,572
(144)	EUR	Euro-BTP	2022年3月	(165,008)
(269)	EUR	Euro BOBL	2022年3月	(179,408)
42	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年3月	(524,836)
227	CAD	Canadian 10 Year Bond	2022年6月	175,495
13	GBP	Long Gilt	2022年6月	14,470
1,018	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年6月	582,296
398	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年6月	319,124
77	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年6月	78,409
(38)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年6月	(68,918)
(473)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年6月	(346,221)
(1,318)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年6月	(1,581,091)
24	EUR	3 Month EURIBOR	2022年9月	(2,020)
44	GBP	3 Month SONIA	2022年12月	(76,158)
(97)	USD	90 Day Euro \$	2022年12月	274,025
合計				(1,888,591)

スワップ 2022年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (816,276)	ファンドはITRAXX.X0.34.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2025	(37,968)	67,464
CDS	USD 380,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	204	5,628
CDS	USD 380,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	204	5,628
CDS	USD 382,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	205	5,658
CDS	USD 384,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	309	5,687
CDS	USD 230,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	185	3,406
CDS	USD 540,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	435	7,998
CDS	USD 395,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	1,941	22,069
CDS	USD 400,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	2,135	22,349
CDS	USD 395,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	1,941	22,069
CDS	USD 390,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	752	21,790
CDS	USD 396,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	(406)	22,125
CDS	USD 395,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	2,445	22,069
CDS	USD 949,000	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	4,317	(6,817)
CDS	USD 708,496	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	5,799	40,233
CDS	USD 2,686,320	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2026	35,799	150,088
CDS	USD 636,045	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2026	5,343	36,119

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2022年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 580,000	ファンドはITRAXX.EUR.36.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	3,267	(8,436)
CDS	USD 1,333,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	45,319	74,163
CDS	USD 2,481,258	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	29,382	140,902
CDS	USD 2,823,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	96,007	157,060
CDS	USD (830,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(476)	(90,789)
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(20,918)	74,566
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(148,768)	(133,299)
CDS	USD 350,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2026	1,109	19,555
CDS	USD 4,369,000	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2026	77,081	31,355
CDS	USD 3,181,102	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2026	71,488	(6,453)
CDS	USD 360,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2026	1,597	20,114
CDS	USD 360,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2026	1,064	20,114
CDS	USD 8,650,441	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2026	79,842	65,621
CDS	USD 2,466,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2026	22,761	18,707
CDS	USD 343,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2026	724	19,164
CDS	USD (402,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	62,614	(43,973)
CDS	USD (1,315,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	113,377	(143,841)
CDS	USD (705,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(8,241)	(77,116)
IFS	GBP 5,070,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、3.4275%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2025	798,042	798,042
IFS	GBP 670,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、4.585%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2027	24,767	24,767
IFS	GBP 5,070,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.51%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/11/2030	(1,182,253)	(1,182,253)
IFS	GBP 210,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.535%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/12/2030	(48,893)	(48,893)
IFS	GBP 200,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.735%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/5/2031	(40,919)	(40,919)
IFS	GBP 540,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.81%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/7/2031	(95,827)	(95,827)
IFS	EUR 780,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.955%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/1/2032	(32,490)	(32,490)
IFS	EUR 1,000,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.9125%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/2/2032	(39,785)	(39,785)
IFS	GBP 670,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、4.285%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/2/2032	(28,511)	(28,511)
IFS	GBP 535,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.85%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	15/7/2031	(91,414)	(91,414)
IFS	GBP 542,500	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、4.11%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	16/9/2031	(62,248)	(62,248)
IRS	CLP 2,530,916,000	ファンドはCLP 6ヶ月Sinacofi Chile Interbankの変動金利を受け取り、1.42%の固定金利を支払う	Bank of America	1/4/2023	263,703	263,703
IRS	CLP 2,530,916,000	ファンドは1.65%の固定金利を受け取り、CLP 6ヶ月Sinacofi Chile Interbankの変動金利を支払う	Bank of America	28/5/2023	(276,538)	(276,538)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2022年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 13,835,000	ファンドは-0.435%の固定金利を受け取り、EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/10/2023	(64,717)	(64,717)
IRS	EUR 22,860,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.44%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2024	(58,927)	(58,927)
IRS	EUR 23,040,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.4485%の固定金利を支払う	Bank of America	20/2/2024	(59,815)	(59,815)
IRS	EUR 18,570,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.3125%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2024	(16,490)	(16,490)
IRS	USD 93,530,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.395%の固定金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	2,273,520	2,280,528
IRS	NZD 8,060,577	ファンドは2.7%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2024	(10,310)	(10,310)
IRS	NZD 1,938,038	ファンドは2.7175%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2024	(2,034)	(2,034)
IRS	NZD 1,938,038	ファンドは2.785%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2024	(316)	(316)
IRS	MYR 42,840,000	ファンドはMYR 3ヶ月KLIB3Mの変動金利を受け取り、2.605%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2024	17,024	17,024
IRS	USD 12,500,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.442%の固定金利を支払う	Bank of America	19/3/2024	297,395	297,395
IRS	EUR 17,100,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.75%の固定金利を支払う	Bank of America	13/2/2025	(50,078)	(50,078)
IRS	USD 7,980,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.999%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	(28,661)	(28,661)
IRS	EUR 11,390,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.6425%の固定金利を支払う	Bank of America	20/2/2025	(19,986)	(19,106)
IRS	USD 22,760,000	ファンドは0.83%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/3/2026	(852,013)	(853,453)
IRS	USD 43,000,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.618%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2026	2,077,626	2,077,626
IRS	USD 64,904,966	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.629%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2026	3,108,726	3,108,726
IRS	USD 21,500,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.839%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2026	844,487	844,487
IRS	USD 3,060,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.93%の固定金利を支払う	Bank of America	14/10/2026	117,873	118,935
IRS	USD 13,720,859	ファンドは1.412%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/1/2027	(255,825)	(255,825)
IRS	USD 3,040,000	ファンドは1.4615%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/1/2027	(49,691)	(49,691)
IRS	JPY 2,416,000,000	ファンドは0.035%の固定金利を受け取り、JPY 1日TONARの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2027	(32,078)	(32,078)
IRS	EUR 5,800,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.462%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2027	8,141	8,141
IRS	USD 30,000,000	ファンドは1.6205%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/2/2027	(274,858)	(274,858)
IRS	PLN 8,167,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、4.12%の固定金利を支払う	Bank of America	11/2/2027	2,322	2,322
IRS	NZD 542,146	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、2.82%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	3,160	3,160
IRS	NZD 1,618,044	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、2.835%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	8,673	8,673
IRS	NZD 6,729,675	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、2.8375%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	35,546	35,546
IRS	NZD 1,618,044	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、2.9%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	5,389	5,389
IRS	MXN 44,370,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、5.885%の固定金利を支払う	Bank of America	22/10/2030	269,711	269,711
IRS	USD 1,830,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.1825%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2031	110,354	110,354
IRS	EUR 3,270,000	ファンドは0.6009%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(64,062)	(64,062)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2022年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 3,260,000	ファンドは0.767%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(10,486)	(10,486)
IRS	EUR 3,495,000	ファンドは0.7895%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(3,490)	(3,490)
IRS	EUR 3,255,000	ファンドは0.8162%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	5,317	5,317
IRS	USD 36,255,812	ファンドは1.3755%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2031	(1,646,424)	(1,646,424)
IRS	USD 7,492,962	ファンドは1.3755%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/4/2031	(340,373)	(340,373)
IRS	USD 1,010,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.5195%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2031	34,495	34,495
IRS	USD 7,230,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.14%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2031	(34,036)	(34,036)
IRS	USD 14,670,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.118%の固定金利を支払う	Bank of America	18/6/2031	(54,606)	(54,606)
IRS	USD 6,813,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.36%の固定金利を支払う	Bank of America	14/10/2031	339,517	341,840
IRS	MXN 28,174,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.6%の固定金利を支払う	Bank of America	1/1/2032	(24,481)	(24,481)
IRS	MXN 32,784,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.565%の固定金利を支払う	Bank of America	12/1/2032	(32,703)	(32,703)
IRS	MXN 19,408,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.53%の固定金利を支払う	Bank of America	23/1/2032	(21,701)	(21,701)
IRS	NZD 429,494	ファンドは2.7895%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	(6,150)	(6,150)
IRS	NZD 1,786,326	ファンドは2.8169%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	(22,741)	(22,741)
IRS	NZD 429,494	ファンドは2.852%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	(4,594)	(4,594)
IRS	USD 3,200,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.562%の固定金利を支払う	Bank of America	1/2/2051	311,132	311,132
IRS	USD 1,860,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.666%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2051	137,096	137,096
IRS	USD 400,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.949%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2051	3,675	3,675
IRS	USD 1,285,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.15%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2051	246,230	246,230
IRS	GBP 11,660,000	ファンドは0.70116116%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	13/9/2051	(2,229,746)	(2,218,228)
IRS	USD 4,250,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.9355%の固定金利を支払う	Bank of America	21/1/2052	45,651	45,651
IRS	CNY 21,630,000	ファンドは2.24%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月CNRRの変動金利を支払う	BNP Paribas	15/6/2024	(1,703)	(1,703)
IRS	EUR 11,520,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.62%の固定金利を支払う	BNP Paribas	16/2/2025	(16,580)	(16,580)
IRS	CNY 9,025,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.427%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/6/2027	3,076	3,076
IRS	CNY 21,630,000	ファンドは2.2375%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月CNRRの変動金利を支払う	Citibank	15/6/2024	(1,869)	(1,869)
IRS	CNY 9,025,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.42%の固定金利を支払う	Citibank	15/6/2027	3,544	3,544
IRS	EUR 17,340,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	6/2/2025	(3,359)	(1,918)
IRS	EUR 2,840,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.52%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/2/2025	(578)	(805)
IRS	EUR 5,680,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.60376%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/2/2025	(5,055)	(7,024)
IRS	EUR 292,400	ファンドは0.222%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Credit Suisse	19/10/2031	(18,794)	(18,863)
IRS	GBP 250,000	ファンドは1.0945%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Credit Suisse	25/2/2072	(5,806)	(5,806)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

スワップ 2022年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 18,957,933	ファンドは11.32%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Deutsche Bank	2/1/2024	(36,625)	(36,625)
IRS	BRL 9,631,250	ファンドは11.77%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Deutsche Bank	2/1/2024	(4,611)	(4,611)
IRS	BRL 32,800,000	ファンドは10.585%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Deutsche Bank	4/1/2027	(167,669)	(167,669)
IRS	BRL 18,140,769	ファンドは11.47%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	2/1/2024	(26,225)	(26,225)
IRS	EUR 22,840,000	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、0.355%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	14/2/2024	(40,463)	(37,626)
IRS	USD 18,770,000	ファンドは1.5638%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/10/2031	(601,905)	(601,905)
IRS	BRL 35,100,000	ファンドは8.675%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	4/1/2027	(647,833)	(647,833)
合計					2,097,716	2,261,188

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレ・スワップ

IRS: 金利スワップ

買建オプション 2022年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
7,360,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1566	10/3/2022	(28,829)	226
8,823,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.135	16/3/2022	84,828	128,449
202,500	プット	OTC USD/RUB	Bank of America	USD 66	18/4/2022	10,666	29,857
11,500,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.185	5/8/2022	(39,282)	61,339
17,890,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.1225	8/3/2022	(32,248)	86,285
3,240,000	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 0.9303	8/3/2022	(2,079)	2,104
3,240,000	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 0.9298	22/3/2022	(3,245)	6,691
6,770,000	コール	OTC EUR/USD	Credit Suisse	EUR 1.21	10/8/2022	(9,547)	20,801
8,824,000	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.13	13/4/2022	79,496	145,110
11,380,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.15	27/5/2022	16,362	84,109
13,000,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.16	7/4/2022	(63,855)	26,695
6,780,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.21	10/8/2022	(10,111)	20,832
合計						2,156	612,498

売建オプション 2022年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(7,360,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.168	10/3/2022	12,624	(14)
(8,823,000)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.115	16/3/2022	(25,207)	(36,870)
(8,945,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.1075	8/3/2022	13,433	(11,248)
(3,240,000)	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 0.9349	8/3/2022	767	(1,115)
(3,240,000)	コール	OTC USD/CHF	Citibank	USD 0.9391	22/3/2022	1,211	(2,699)
(8,824,000)	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.105	13/4/2022	(40,349)	(59,952)
(13,000,000)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.185	7/4/2022	20,890	(5,993)
合計						(16,631)	(117,891)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

買建スワップション 2022年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
JPY 557,619,569	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはJPY 1日TONAの固定金利を2023年8月10日から毎年受け取り、0.42%の固定金利を2023年8月10日から毎年支払う	BNP Paribas	8/8/2022	(8,829)	7,834
JPY 278,809,784	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはJPY 1日TONAの変動金利を2023年8月10日から毎年受け取り、0.42%の固定金利を2023年8月10日から毎年支払う	BNP Paribas	8/8/2022	(5,300)	3,917
USD 2,094,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは1.7%の固定金利を2022年10月19日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2022年7月19日から四半期ごとに支払う	Citibank	13/4/2022	(47,832)	15,093
USD 4,187,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは1.7%の固定金利を2022年10月19日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2022年7月19日から四半期ごとに支払う	Citibank	13/4/2022	(102,131)	30,178
USD 10,970,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を2023年3月8日から毎年受け取り、1.64%の固定金利を2022年9月8日から半期ごとに支払う	Deutsche Bank	4/3/2022	2,535	82,067
USD 5,300,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは1.3%の固定金利を2022年10月22日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2022年7月22日から四半期ごとに支払う	Deutsche Bank	20/4/2022	(59,738)	2,509
USD 2,150,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは1.6%の固定金利を2022年10月22日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2022年7月22日から四半期ごとに支払う	Goldman Sachs	20/4/2022	(54,174)	11,302
EUR 3,635,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を2022年12月10日から半期ごとに受け取り、0.45%の固定金利を2023年6月10日から毎年支払う	Goldman Sachs	8/6/2022	138,193	186,727
EUR 3,635,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を2022年12月10日から半期ごとに受け取り、0.45%の固定金利を2023年6月10日から毎年支払う	Goldman Sachs	8/6/2022	141,866	186,728
USD 3,658,895	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは1.55%の固定金利を2023年1月8日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2022年10月8日から四半期ごとに支払う	Goldman Sachs	6/7/2022	(52,905)	47,583
合計				(48,315)	573,938

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ワールド・ボンド・ファンド(続き)

売建スワップション 2022年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (21,900,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.04%の固定金利を2026年12月17日から半期ごとに受け取り、USD 3ヶ月SOFR BBAの変動金利を2026年9月17日から四半期ごとに支払う	Bank of America	15/6/2026	4,811	(360,919)
USD (14,640,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.56%の固定金利を2022年9月7日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2023年3月7日から毎年支払う	Citibank	3/3/2022	(17,005)	(41,667)
USD (29,280,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.13%の固定金利を2022年9月7日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2023年3月7日から毎年支払う	Citibank	3/3/2022	(142,271)	(171,551)
USD (10,970,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.84%の固定金利を2022年9月8日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2023年3月8日から毎年支払う	Deutsche Bank	4/3/2022	27,380	(4,744)
USD (43,880,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.13%の固定金利を2022年9月8日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2023年3月8日から毎年支払う	Deutsche Bank	4/3/2022	(224,100)	(259,204)
USD (58,000,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.08%の固定金利を2022年9月18日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2023年3月18日から毎年支払う	Goldman Sachs	16/3/2022	(362,237)	(414,437)
EUR (3,635,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは0.75%の固定金利を2023年6月10日から半期ごとに受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を2022年12月10日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	8/6/2022	(72,205)	(93,092)
EUR (3,635,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは0.75%の固定金利を2023年6月10日から半期ごとに受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を2022年12月10日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	8/6/2022	(70,685)	(93,092)
USD (28,410,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは2.7%の固定金利を2023年8月17日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2024年2月17日から毎年支払う	Goldman Sachs	15/2/2023	17,788	(83,068)
USD (28,412,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは2.6%の固定金利を2023年8月17日から半期ごとに受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を2024年2月17日から毎年支払う	Goldman Sachs	15/2/2023	30,490	(93,102)
USD (28,412,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を2024年2月17日から毎年受け取り、1.4%の固定金利を2023年8月17日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	15/2/2023	(20,402)	(117,002)
合計				(828,436)	(1,731,878)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

財務書類に対する注記

1. 組織

ブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「当社」という。)は、オープンエンド型の変動資本投資法人(変動資本を有する会社型投資信託)としてルクセンブルク大公国の法律に基づき設立された公開有限責任会社(société anonyme)である。当社は、金融監督委員会(Commission de Surveillance du Secteur Financier、以下「CS SF」という。)により、2010年12月17日付の法律(随時、改正される)パートの規定に準拠した譲渡可能な有価証券への集団投資事業(以下「UCITS」という。)として認可され、当該法律によって規制されている。

当社は、分離された負債を有する個別の構成要素からなるアンブレラ構造である。各構成要素は他の構成要素から分離された負債を有し、当社は各構成要素の負債について第三者に対し全体として責任を負わない。各構成要素は、構成要素に該当する投資目的に従い管理され投資される個別の投資有価証券の組合せによって組成されている。

2022年2月28日現在、当社は97のサブファンド(以下それぞれを「ファンド」という。)における投資証券を発行しており、以下総称して「当ファンド」という。各ファンドは、それぞれ個別の資産プールである。各ファンドは、アペンディクスに詳述のとおり投資証券クラスに分類されており、それぞれ個別の投資証券により表象されている。

各投資証券クラスは当社に対して同等の権利を有しているが、特徴および手数料体系はそれぞれ異なる。これについては当社の英文目論見書において詳述されている。

当期に生じた重要な事象

スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドは、今後も継続して新規および既存の投資主に対する投資証券販売を以後の通知があるまで中止する。投資主は、従来通り払戻しはできる。

2021年9月16日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2021年9月16日付で、チャイナ・A株式・ファンドはチャイナ・インパクト・ファンドに、グローバル・ボンド・インカム・ファンドはESGグローバル・ボンド・インカム・ファンドに、またUSガバメント・モーゲージ・ファンドはUSガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンドに名称を変更した。

2021年11月23日付で、英文目論見書の補遺が発行された。

2021年12月9日付で、ユーロ建のクライメイト・アクション・マルチアセット・ファンドが設定された。

2021年12月9日付で、米ドル建のクライメイト・アクション・エクイティ・ファンドが設定された。

2021年12月15日付で、英文目論見書の補遺が発行された。

2021年12月15日付で、米ドル建のESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンドおよびESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンドが設定された。

2022年1月27日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2022年1月27日付で、米ドル建のESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンドが設定された。

一部の金融市場は、主にロシアのウクライナへの侵攻に起因する地政学的緊張と、その後の一連のロシアの有価証券の正常な取引を毀損する制裁、規制、およびその他の措置による影響により下落した。取締役会および投資顧問会社は、ファンドの投資目的に沿った投資パフォーマンスを引き続き監視しており、財務書類に対する注記19「後発事象」で詳述されているように、重大な影響を受けたBGFエマージング・ヨーロッパ・ファンドを除いて、ファンドの運用および純資産価額の公表は継続されている。

2. 重要な会計方針の要約

この財務書類は、ルクセンブルグの投資法人のためにルクセンブルグの関係官庁が規定した財務書類の作成に関連する法律および規制上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針を含む。

(a) 投資有価証券およびその他の資産の評価

当社の投資有価証券およびその他の資産は以下のとおり評価されている。

- ・ 公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券は、評価日における最新の入手可能な市場価格に基づき評価される。評価時点後に終了した市場で取引された有価証券については、評価時点またはそれに相応する時点での最新の価格を使うことができる。当該投資有価証券またはその他の資産が複数の証券取引所または規制市場で上場または取引されている場合、取締役会はその裁量により、評価目的でかかる証券取引所または規制市場のいずれか1つを選択することができる。一部のファンドの純資産価額の計算時に該当する市場が終了している場合、または政府が外国投資に財務上の費用または取引費用を課す場合に有価証券価額の相違が生じることがある。そのため、取締役は、これらの投資有価証券の公正価値を見積るために公正価値の評価技法を利用した。かかる有価証券およびデリバティブは、適格者(取締役)が決定する実現性の高い価額で評価される。公正価値評価プロセスに固有の不確実性により、これらの見積価額は、当該有価証券にとっての整備された市場が存在する場合に使用されたであろう価額や最終的に回収されうる価額と著しく異なる可能性がある。
- ・ 上場されていない有価証券、またはいかなる証券取引所もしくはその他の規制市場において売買もしくは取引されていない有価証券(クローズドエンド型ファンドの有価証券を含む)および評価額が入手できないその他の市場における上場または非上場有価証券、または取締役が、市場価格が公正市場価格を反映していないと判断した有価証券に関しては、取締役が、処分価格または取得価格の予測額に基づき、慎重かつ誠実に価値を決定する。
- ・ 証券取引所に上場していない、またはその他の規制市場で売買されていない債券は、1社以上のディーラーまたは価格提供サービス会社から取得した入手可能な最終の仲値または利回り相当額で評価される。OTC市場で売買されている有価証券は、入手可能な最終の買呼値で評価される。有価証券が複数の取引所で売買されている場合は、運用会社の取締役会によってまたはその指示において主たる市場として指定された取引所で評価される。OTC市場と証券取引所の両方で売買されているポートフォリオ有価証券は、最も広範囲で最も代表的な市場に従って評価される。
- ・ 有価証券貸付：有価証券は貸付代理店の指示により第三者ブローカーに受渡しされるが、当ファンドのポートフォリオの一部として引き続き評価される。
- ・ 短期金融商品は、額面金額に利息を加えた金額が償却原価に基づいて評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドで保有されている短期金融商品は、時価基準で評価される。これが不可能な場合、資産は評価モデルによる評価基準を用いて保守的に評価される。
- ・ 定期預金は、償却原価で評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ 現金、預金、要求払手形およびその他の債務ならびに前払費用は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未収利息および未収配当金、売却投資有価証券未収金ならびに販売投資証券未収金を含む資産は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未払費用、未払収益分配金、購入投資有価証券未払金および買戻し投資証券未払金を含む負債は、これらの額面金額で評価される。

投資の処分による実現損益は平均原価法を用いて計算され、損益および純資産変動計算書に反映される。

(b) 投資有価証券からの収益 / 費用

当社は以下の方法で投資有価証券からの収益を会計処理している。

- ・ 受取利息は毎日発生し、定額法によるプレミアムの償却およびディスカウントの増価を含む。

- ・ 預金利息、定期預金、集団投資スキームによる収益および短期金融預金の利息は、発生主義で認識されている。
- ・ 受取配当金は、配当落ち日に発生し、源泉徴収税が控除された額で表示されている。
- ・ 有価証券貸付収益は、発生主義で認識されている。
- ・ 社債がデフォルトしていることが確認された場合、デフォルトした有価証券に係る利息の計上はその時点で停止される。関連当事者からデフォルトの確認をとった上で、未収金は償却される。
- ・ 源泉徴収税の還付は、現金受領基準で会計処理される。
- ・ 投資有価証券明細表において、永久債の銘柄に含まれる日付は、当該債券の次の繰上償還可能日である。投資有価証券明細表の銘柄の欄に開示されている利率は期末における適用利率であるが、これらの債券は変動利付債であるため、情報提供の目的のみで表示されている。

保有資産のマイナス実効金利により生じる利息に関連するマイナス利回りに係る費用は、毎日計上され、基礎となる商品の残存期間にわたって損益および純資産変動計算書において認識される。

(c) デリバティブ商品

当期において、当ファンドは複数の先渡為替予約・先物取引を締結している。未決済の先渡為替予約・先物取引は、評価日に当該取引を決済した場合の金額で評価される。当該未決済取引から生じる利益/損失は未実現評価益/(損)に計上され、純資産計算書の資産または負債に(適宜)含められる。

当ファンドはカバード・コール・オプションおよびプット・オプションの売却、コール・オプションおよびプット・オプションの購入を実施できる。当ファンドはまたスプレッド・オプションおよびシンセティック・キャップ・オプションにも投資することができる。スプレッド・オプションは、2つ以上の資産の価格の差異から価値が生じる種類のオプションである。シンセティック・キャップ・オプションは、購入者に金利上限または利払上限を提供する二者間の契約である。レート・キャップ自体は、参照インデックス・レートが行使レートを上回るプラスの金額に基づいて定期的に支払われる。当ファンドがオプションを売却および/または購入する時点で、当ファンドによる受取または支払プレミアムと同額が負債または資産として反映される。その後、売建オプションに係る負債および買建オプションに係る資産は、現在価値を反映するよう時価評価される。見積実現価額を最もよく反映する方法として、取締役は最終取引価格ではなく仲値または決済値に基づいて、市場で取引されるオプションを評価することに合意している。上場されていないオプションは第三者の値付機関から入手する日次価格に基づいて評価する。有価証券がオプション行使によって売却される場合、受取(支払)プレミアムが売却有価証券から控除(に加算)される。オプションが失効する場合(または当ファンドが決済取引を行った場合)、当ファンドはオプションに係る損益を、受取または支払プレミアムの分だけ(もしくは決済取引のコストが受取または支払プレミアムを超過する分だけ)実現する。

2022年2月28日現在、当ファンドは差金決済取引契約(以下「CFD」という。)を締結している。CFDにより、投資家は変動証拠金でシンセティック・ロングポジションまたはシンセティック・ショートポジションを取ることができる。株式と違い、CFDにおいては、購入者は証拠金として支払った金額を大幅に上回る金額について責任を負う可能性がある。そのため、当ファンドは取引相手から受け取った現金を様々な金融機関に預け入れており、これは英文目論見書にも記載されている。締結されたCFDポジションには、該当するベンチマーク以上またはそれ以下の事前に合意されたレートを適用する金融費用が日々、課される。関連する受取配当金または支払配当金は、損益および純資産変動計算書に源泉徴収税控除後の金額で開示される。

CFDの時価は、原証券や原資産が取引されるまたは取引を認められる証券取引所における最終の取引価格により決定される。評価時刻後に終了する市場で取引される原証券については、その時点またはその他の時点における最終の周知の価格が使用される場合がある。時価の変動は(もしあれば)、損益および純資産変動計算書に未実現評価益/(損)の純変動額として計上される。CFDの満期または解約時における実現損益は損益および純資産変動計算書上に表示される。

CFDの売却損益は先入先出法(以下「FIFO」という。)を用いた原価法に基づき決定されている。

当ファンドは1つの商品から発生する利益を他の投資より発生する利益と交換するために、スワップ契約を締結している。クレジット・デフォルト・スワップの場合、信用事由の発生による偶発的な支払い(当該契約にあらかじめ定義されている)と引き換えに、一連のプレミアムがプロテクションの売り手に支払われる。スワップは可能な限り、第三者の値付機関から入手し、実際のマーケット・メーカーに確認した日々の価格に基づいて時価評価される。こうした時価が入手できない場合、スワップはマーケット・メーカーから入手する日々の相場に基づいて値付される。いずれの場合も、価格の変動は損益および純資産変動計算書に未実現評価益/(損)の純変動額として計上される。スワップの満期または解約時における実現損益およびスワップに関連して稼得または負担した利息は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

当期において、当ファンドはスワップ取引を開始した。スワップ取引によって、買い手は一定期間内に予め設定された利率で金利スワップ取引を行う権利(義務ではない)を得る。スワップ取引の買い手は当該権利について売り手にプレミアムを支払う。売建スワップ取引により買い手は変動金利を支払い、固定金利を受け取る権利を得る。買建スワップ取引により買い手は固定金利を支払い、変動金利を受け取る権利を得る。ファンドがスワップ取引を売る、または買う場合、ファンドが受け取る、または支払うプレミアムと同額の負債または資産が純資産計算書において計上される。

当期において、アジア・マルチアセット・インカム・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンドおよびグローバル・マルチアセット・インカム・ファンドは複数の株式連動債への投資を行っている。一度または複数回の固定クーポンの支払いと引き換えに、原株式の約定日付の市場価格で元本をブローカーに支払う。満期時に、ファンドは当該元本に原株式の価値の変動を加減算した金額(契約書に定められた約定キャップ・レベルを上限として)を受け取ることになる。

事後通告証券(To Be Announced Securities)(以下「TBA」という。)は、米国政府系機関が発行するモーゲージ担保証券に関連するものである。これらの機関は通常、モーゲージ・ローンプールを組成されたプールの持分を販売する。TBAは、将来の決済に関して購入または売却される、これらの機関の将来のプールに関連しており、金利または償還日のいずれかが確定していない。TBAは、投資有価証券明細表に個別に開示されている。

当ファンドは、適切と思われる場合は決済前に契約を処分することがある。TBAの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。TBA売却契約が残存している間、当該取引をカバーするために、相応の交付可能有価証券または相殺対象となる(売却契約日以前に交付可能な)TBA購入契約を保有する。二者の取引相手が同一のTBA契約に対して相殺対象となる取引を行っている場合、これらの取引は相殺される。決済日において売り手は、約定日の2日前に指定された有価証券を引渡し、約定日に指定された現金を受け取る。ただし実務上は、ほとんどのTBA取引において、最終的に不動産担保証券現物の引渡しは行われず、売り手は、現物を決済するのではなく、満期前に残存取引を解消または「ロール」する。

TBA売却契約が、相殺対象である購入契約の取得により終了する場合、ファンドは、裏付けとなる有価証券の未実現利益または損失にかかわらず契約の利益または損失を実現する。ファンドが、契約に基づき有価証券を交付する場合、ファンドは、契約が締結された日に設定された価格で有価証券の売却による利益または損失を実現する。

2022年2月28日現在、当ファンドは未決済のTBAを有していた。これは、純資産計算書の「売却投資有価証券未収金」および「購入投資有価証券未払金」に含まれている。

TBAの時価は純資産計算書上に表示される。TBAの未実現評価損益の純変動額およびTBAの売却に係る実現評価損益は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

(d) 為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、2022年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートで換算されている。

(e) 結合財務書類

各ファンドの財務書類はファンドの基準通貨で表示されている。

当社の結合数値は米ドルで表示されており、各ファンドの財務書類の合計を含んでいる。純資産計算書の換算レートは、2022年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民幣
米ドル	0.8910	0.7457	115.2550	0.9185	6.3165

損益および純資産変動計算書の換算レートは、期中にわたり算定された平均レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民幣
米ドル	0.8728	0.7382	113.5041	0.9214	6.3904

これらの数値は情報提供の目的のみで表示されており、小数第5位を四捨五入している。財務書類においては、小数第9位までの為替レートを適用している。

損益および純資産変動計算書の結合数値は、期中の平均為替レートをを用いて算定されている。その結果生じる為替換算調整額(2,201,522,947)米ドルは、2021年8月31日と2022年2月28日の間の為替レートの変動を表す。これは想定金額であり、個々のファンドの純資産に対する影響はない。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2022年2月28日現在、当ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産ならびにその他の負債を換算するために使用された。

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民幣
UAEディルハム	0.2030	0.2723	0.2426	31.3784	0.2501	1.7197
アルゼンチン・ペソ (公式レート)	0.0069	0.0093	0.0083	1.0731	0.0086	0.0588
豪ドル	0.5398	0.7240	0.6450	83.4400	0.6649	4.5729
ブラジル・リアル	0.1447	0.1941	0.1730	22.3724	0.1783	1.2261
カナダ・ドル	0.5868	0.7869	0.7012	90.6986	0.7228	4.9707
スイス・フラン	0.8119	1.0888	0.9701	125.4869	1.0000	6.8773
チリ・ペソ	0.0009	0.0013	0.0011	0.1447	0.0012	0.0079
オフショア中国人民幣	0.1180	0.1583	0.1411	18.2466	0.1454	1.0000
中国人民幣	0.1182	0.1585	0.1412	18.2624	0.1455	1.0009
コロンビア・ペソ	0.0002	0.0003	0.0002	0.0295	0.0002	0.0016

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民幣
チェコ・コルナ	0.0335	0.0450	0.0401	5.1841	0.0413	0.2841
デンマーク・クローネ	0.1125	0.1508	0.1344	17.3854	0.1385	0.9528
エジプト・ポンド	0.0475	0.0637	0.0567	7.3364	0.0585	0.4021
ユーロ	0.8369	1.1224	1.0000	129.3569	1.0308	7.0894
英ポンド	1.0000	1.3411	1.1949	154.5685	1.2317	8.4711
ガーナ・セディ	0.1105	0.1481	0.1320	17.0748	0.1361	0.9358
香港ドル	0.0954	0.1280	0.1140	14.7489	0.1175	0.8083

ハンガリー・フォリント	0.0023	0.0030	0.0027	0.3484	0.0028	0.0191
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0080	0.0001	0.0004
イスラエル・シェケル	0.2325	0.3117	0.2778	35.9299	0.2863	1.9691
インド・ルピー	0.0099	0.0133	0.0118	1.5296	0.0122	0.0838
アイスランド・クローナ	0.0059	0.0079	0.0070	0.9110	0.0073	0.0499
日本円	0.0065	0.0087	0.0077	1.0000	0.0080	0.0548
ケニア・シリング	0.0065	0.0088	0.0078	1.0123	0.0081	0.0555
韓国ウォン	0.0006	0.0008	0.0007	0.0959	0.0008	0.0053
クウェート・ディナール	2.4624	3.3024	2.9424	380.6169	3.0331	20.8596
カザフスタン・テング	0.0015	0.0020	0.0018	0.2352	0.0019	0.0129
スリランカ・ルピー	0.0037	0.0050	0.0044	0.5706	0.0045	0.0313
メキシコ・ペソ	0.0367	0.0492	0.0438	5.6656	0.0451	0.3105
マレーシア・リングgit	0.1776	0.2382	0.2122	27.4515	0.2188	1.5045
ナイジェリア・ナイラ	0.0018	0.0024	0.0021	0.2772	0.0022	0.0152
ノルウェー・クローネ	0.0843	0.1130	0.1007	13.0226	0.1038	0.7137
ニュージーランド・ドル	0.5036	0.6753	0.6017	77.8369	0.6203	4.2658
ペルー・新ソル	0.1963	0.2632	0.2345	30.3370	0.2418	1.6626
フィリピン・ペソ	0.0145	0.0195	0.0174	2.2480	0.0179	0.1232
ポーランド・ズロチ	0.1784	0.2393	0.2132	27.5789	0.2198	1.5115
カタール・リヤル	0.2048	0.2746	0.2447	31.6547	0.2523	1.7348
ルーマニア・レイ	0.1691	0.2268	0.2021	26.1413	0.2083	1.4327
ロシア・ルーブル	0.0070	0.0093	0.0083	1.0746	0.0086	0.0589
サウジ・リアル	0.1988	0.2665	0.2375	30.7208	0.2448	1.6836
スウェーデン・クローネ	0.0789	0.1058	0.0943	12.1934	0.0972	0.6683
シンガポール・ドル	0.5492	0.7365	0.6562	84.8834	0.6764	4.6520
タイ・バーツ	0.0228	0.0306	0.0273	3.5273	0.0281	0.1933
新トルコ・リラ	0.0540	0.0725	0.0646	8.3512	0.0666	0.4577
台湾ドル	0.0266	0.0357	0.0318	4.1111	0.0328	0.2253
ウクライナ・フリヴニャ	0.0249	0.0334	0.0298	3.8549	0.0307	0.2113
米ドル	0.7457	1.0000	0.8910	115.2550	0.9185	6.3165
ウルグアイ・ペソ	0.0176	0.0236	0.0210	2.7151	0.0216	0.1488
ベトナム・ドン	0.0000	0.0000	0.0000	0.0051	0.0000	0.0003
南アフリカ・ランド	0.0483	0.0647	0.0577	7.4623	0.0595	0.4090
ザンビア・クワチャ	0.0420	0.0563	0.0502	6.4896	0.0517	0.3557

人民元は、外国為替制限を受けており、自由に換金できる通貨ではない。チャイナ・ボンド・ファンドに使用されている為替レートは、オフショア中国人民元(以下「CNH」という。)に関連するものであり、オンショア中国人民元(以下「CNY」という。)に関連するものではない。CNHの価値は、中国政府により随時適用される外国為替管理政策および還流制限ならびにその他外部の市場原理を含むがこれらに限定されない複数の要因により、CNYの価値と大幅に異なる可能性もある。CNHとCNYの相違は、投資家に悪影響を与える可能性がある。

(g) 希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引および仲介手数料、税金および関税、市場の動き、原資産の購入価格と売却価格間のスプレッド等の要因により、当該ファンドにおける原資産の帳簿価額を逸脱している場合に生じる。希薄化は、ファンドの価値に悪影響を及ぼし、その結果投資主に影響を与える可能性がある。投資証券1口当たり純資産価額を調整することにより、この影響を軽減または回避して、投資主を希薄化による影響から保護することができる。いずれかの取引日におい

て、当該ファンドの全投資証券クラスの総取引の価値によって、当該ファンドに対して取締役が設定する1つ以上の基準値を超える投資証券の純増減が生じた場合、取締役は当該ファンドの純資産価額を調整することがある。ある取引日にファンドの純資産価額を調整できる金額は、当該ファンドの市場取引の予想コストに関連している。このような状況において、関連するファンドの純資産価額は、純資産価額の1.50%（債券ファンドの場合は3%）を超えない金額で調整されることがある。例外的な状況において取締役は、投資主の利益のため、上記の最大変動要因を一時的に引き上げ、その旨を投資家に通知する場合がある。純変動により当該ファンドの全投資証券の価値が増加した場合は加算調整となり、価値が減少した場合には減算調整となる。特定の株式市場および管轄区域においては、特に関税および税金に関して、買い手側と売り手側で課金構造が異なる場合があるため、結果として生じる調整は、販売純額（流入）と買戻し純額（流出）で異なることがある。さらに、取締役は、調整額に特別な財務上の費用を含めることに同意することもある。これらの特別な財務上の費用は市場ごとに異なり、現時点ではその純資産価額の2.5%を超えないものと予想されている。ファンドが主に国債や短期金融証券などの特定の資産タイプに投資する場合、取締役はそのような調整を行うことが適切でないと判断する可能性がある。

英文目論見書のアペンディクスBの17.3（訳注：原文の参照番号）に従い、2022年2月28日現在、かかる希薄化調整はエマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ESGエマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、ナチュラル・リソース・グロス・アンド・インカム・ファンド、ユナイテッド・キングダム・ファンドおよびワールド・エネルギー・ファンドに適用されていた。2022年2月28日に終了した期間において、かかる希薄化調整は、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ユーロ・リザーブ・ファンド、フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、サステイナブル・グローバル・インフラストラクチャー・ファンド、スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドを除くすべてのファンドに適用された。

投資証券1口当たりの公表/取引純資産価額は、3会計年度末における純資産価額の概要に開示されており、希薄化調整が含まれている場合がある。この調整は、純資産計算書または損益および純資産変動計算書では認識されていない。

(h) 取引費用

取引費用は有価証券の取得、発行または処分に直接帰属する増分コストである。増分コストは事業体が有価証券を取得、発行または処分しなかった場合には発生していなかったであろうコストである。有価証券の当初認識時に、有価証券は、その取得または発行に直接帰属する取引費用を加えた時価で測定される。

有価証券の購入または売却に係る取引費用は、預託銀行の取引手数料を除いて、各ファンドの損益および純資産変動計算書の実現純評価益/(損)または未実現評価益/(損)の純変動額に含まれる。預託銀行の取引手数料はファンドの損益および純資産変動計算書の預託報酬に含まれている。

(i) その他の取引に係る外国通貨

その他の取引に係る外国通貨は、現金残高およびスポット取引に係る実現評価損益および未実現評価損益に関連している。

(j) 公正価値評価

特定の価値が上記の方法で確認できない場合、または、当社の取締役会が、当該目的上、その他の評価方法が該当する有価証券またはその他の資産の公正価値をより正確に反映すると考える場合、当該証券または資産の評価方法は当社の取締役会が完全な裁量権をもって決定した評価方法となる。例えば、特定のファンドの純資産価額を算定する際に、対象となる市場が取引終了となっている場合、または、政府が外国投資に係る財政上の費用または取引費用を課すことを選択した場合には、証券の価値が異なる可能性がある。当社の取締役会は特定の基準値を設定することができ、それを超えると、特定のインデックス調整を適用することにより、当該証券の公正価値への調整が行われる場合がある。

公正価値評価された証券は、投資有価証券明細表において「**」と示されている。

2022年2月28日現在、以下のとおり公正価値調整が行われた。

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
アジアン・ドラゴン・ファンド	米ドル	16,933,465	1.70
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
チャイナ・ボンド・ファンド ^(注)	オフショア 中国人民元	-	0.00
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド ^{(注)(1)}	ユーロ	-	0.00
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	7,686,009	0.22
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	36,227,633	13.43
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	1	0.00
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	42,438,587	1.46
ESGエマージング・マーケット・コーポレート・ ボンド・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
ESGフィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	386,678	0.04
ESGグローバル・ボンド・インカム・ファンド ⁽²⁾	米ドル	115,384	0.09
ESGマルチアセット・ファンド ^(注)	ユーロ	-	0.00
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	140,877	0.03
フィンテック・ファンド	米ドル	22	0.00
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	48,310,303	0.46
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	米ドル	12,482,591	0.65
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	428,793,778	2.46
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	2,349	0.00
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	14,415,499	2.69
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,855,872	0.12
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	11,537,175	0.18
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	115,536	0.01
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	142,314,866	3.72
ニュートリション・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
サステイナブル・エネルギー・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
システムティック・グローバル・スモールキャップ・ ファンド	米ドル	4,466	0.00
ユナイテッド・キングダム・ファンド ^(注)	英ポンド	-	0.00
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	1,608,292	0.23
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	6,912,643	0.23
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ ファンド	米ドル	103,781	0.00
ワールド・エネルギー・ファンド ^(注)	米ドル	-	0.00
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	129	0.00

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	22,528,120	0.43
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	1,737,735	0.01
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	40,045,969	0.54
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	291,773,837	2.81

③ 当該ファンドは時価がゼロで公正価値評価された証券を保有している。

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(k) 特別買収目的会社に関するコミットメント

特別買収目的会社(以下「SPAC」という。)とは、事業を有さずに、SPACの新規株式公開による調達資金を用いて他の企業の合併または買収を行うこと目的として株式公開される会社をいう。当ファンドは、SPACとの間で、上場企業の私募増資(以下「PIPE」という。)取引に関するコミットメントを締結することがあり、SPACが合併または買収を完了した時点で当該コミットメントを履行する。PIPE取引を通じて購入された証券は、有価証券届出書が提出され有効であると宣言されるまで取引が制限され、流動性が低いものとみなされる。

SPACに対する未履行のPIPEコミットメントは時価評価され、当該コミットメントから生じる利益/損失は、純資産計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)」、ならびに損益および純資産変動計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)の純変動」に計上される。

3. 子会社

インディア・ファンドは、その投資目的および投資方針に従い、直接および当社の完全所有子会社であるブラックロック・インディア・エクイティズ(モーリシャス)リミテッド(以下「子会社」という。)を通じて、その総資産の少なくとも70%を在インド企業または主たる経済活動をインドで営んでいる企業の株式に投資している。

子会社の資産および負債、収益および費用はすべて、当社の純資産計算書ならびに損益および純資産変動計算書において連結されている。子会社が保有する投資有価証券はすべて、インディア・ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。子会社は、モーリシャス法に基づいて2004年9月1日に設立された。

子会社は有価証券に投資しており、その大部分はインド市場で取引されている。

子会社は、2017年4月1日以降に取得した在インド法人の株式の売却から生じるキャピタル・ゲインに対するキャピタル・ゲイン税が課されている。2017年4月1日より前に取得した株式はインドにおける課税権から保護される。

2018年4月1日以降の公開株式の売却については、長期キャピタル・ゲインに対して10%の税金が課される。

2022年2月28日現在、子会社は60.5百万米ドルの長期未実現利益を有していた。

子会社については、英文目論見書および4ページ(訳注:原文のページ)で詳述される。

4. 運用会社

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、運用会社として従事するよう当社により任命されている。運用会社はルクセンブルグの公開有限責任会社(société anonyme)であり、2010年法第15章に従い、ファンドの運用会社として従事するよう権限を与えられている。

当社は、運用会社との間で運用会社契約を締結した。当該契約に基づき、運用会社は当社の日々の管理を委任されており、これにより当社による当ファンドの投資運用、管理事務およびマーケティングに関連するすべての業務を直接または委任して行う責任を有する。

当社の合意のもと、運用会社は、英文目論見書に詳述されているとおり、その業務の一部を委任することを決定した。

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、ブラックロック・グループ内の完全所有子会社である。同社は、C S S Fにより規制されている。

5. 投資運用報酬

当期において、当社は運用会社であるブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーに対して投資運用報酬を支払った。

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年率の投資運用報酬を支払っている。投資運用報酬の水準は0.00%から1.75%の間であり、投資家が購入するファンドおよび投資証券クラスに応じて異なる。これらの報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき(該当する場合、アペンディクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号))に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。投資顧問会社への報酬を含む特定の費用および報酬は、投資運用報酬より支払われる。クラスJおよびクラスX投資証券について請求される投資運用報酬はない。クラスS R投資証券については、継続的経費(ongoing charge)の金額の一部を構成する単一の報酬(投資運用報酬と年次サービス料から構成される)が請求される。

リザーブ・ファンド(ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンド)の投資目的達成に貢献するため、特定の状況下において、例えば、市況がファンドの原投資にマイナス利回りを引き起こす場合には、運用会社は、特定の日付または特定の日数にわたって支払われる投資運用報酬全額を受け取る権利を放棄することができる。運用会社は自由裁量で権利を放棄することができ、これにより将来発生する投資運用報酬全額を受け取る権利が損なわれることはない。

投資運用報酬の減額は、損益および純資産変動計算書の投資運用報酬から別掲で開示されている。当期において、アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドは投資運用報酬が減額された。

当期において、ブラックロックが運用するターゲット・ファンドに対する投資に関連して投資運用報酬レポートの対象になっているファンドは以下のとおりである。

クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、ESGマルチアセット・ファンド、ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド、ユーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド、USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドおよびUSドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

2022年2月28日現在の未払投資運用報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

6. 販売報酬

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年間販売報酬を支払っている。販売報酬の水準は、0.00%から1.25%の間である。クラスA、D、I、J、S、XおよびZ投資証券では、販売報酬を支払わない。ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドのクラスC投資証券では、販売報酬

を支払わない。当該報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき(該当する場合、アペンディクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号)に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。

当社は、損益および純資産変動計算書において詳述されているとおり、販売報酬を支払う。2022年2月28日現在の未払販売報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

7. 年次サービス料

当社は年次サービス料を運用会社に支払っている。

年次サービス料の水準は、運用会社との合意に基づく取締役の裁量によって変更される場合があり、当社が発行する様々なファンドと投資証券クラスのそれぞれに異なる比率で適用されることになる。ただし、取締役と運用会社の間で、現在支払われている年次サービス料の上限を年率0.25%とすることが合意されている。年次サービス料は、該当する投資証券クラスの純資産価額に基づき(該当する場合、アペンディクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号)に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。

取締役および運用会社は、各ファンドの市場部門および競合他社と比較したファンドの業績といった複数の基準を考慮に入れ、ファンドの投資家が入手可能な類似する投資商品の市場全体について比較した場合に各ファンドの継続的経費(ongoing charge)が確実に競争優位性を保てることを目標とした料率で、年次サービス料の水準を設定している。

継続的経費(ongoing charge)は、投資証券クラスごとの総費用(銀行利息、取引費用および金融資産に係るマイナス利回りの費用を除き、年次サービス料補助金を含む)を各投資証券クラスの平均純資産で除した額に基づいて計算され、パーセンテージで表示される。

アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド、チャイナ・インパクト・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ESGアジアン・ボンド・ファンド、ESGエマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド、ESGエマージング・マーケット・ボンド・ファンド、ESGエマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、ESGエマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、ESGフィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ヨーロッパ・フォーカス・ファンド、ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド、フィンテック・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド、ニュートリション・ファンド、システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド、システムティック・グローバル・スモールキャップ・ファンド、システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド、USドル・ボンド・ファンドおよびUSサステイナブル・エクイティ・ファンドの継続的経費(ongoing charge)は、損益および純資産変動計算書の年次サービス料と相殺される差額に上限が定められている。

年次サービス料は、預託報酬、販売報酬、有価証券貸付手数料、借入金から生じるすべての手数料(疑義を避けるために明記すると、貸し手に支払う可能性のあるコミットメント報酬を含む。)、欧州連合(以下「EU」という。))および非EUの源泉徴収税還付請求に関連する費用とその税金またはその利息、ならびに投資レベル

または会社のレベルで課される税金を除き、当社が負担したすべての固定および変動の営業費用および管理費に充てる目的で運用会社が使用する。

当社は、欧州連合の源泉徴収税還付請求に関連する専門家費用を支払っている。源泉徴収税還付請求に関連するすべての費用は該当ファンドに均等かつ公正に配分される。当社のEUにおける(当社が支払った)源泉徴収税還付請求は今まで認められる確率が高く、非EUの源泉徴収税還付請求に関連する費用については年次サービス料から負担されなくなり、現在では当社が支払い、該当ファンドに均等かつ公正に配分されている。

また、年次サービス料は、監査ならびに投資家による報告およびその他の税金に係る順守事項に関連するサービスに対してアーンスト・アンド・ヤングS.A.に支払われる報酬に充てるために使われる。

これらの営業費用および管理費には、すべての第三者費用と、当社が、または当社が代行して随時負担したその他の回収可能な費用が含まれる。この費用には、ファンド経理報酬、名義書換事務代行報酬(副名義書換事務代行会社および関連するプラットフォームとの取引費用を含む)、コンサルタント、法律、税金および監査報酬等のすべての専門家費用、取締役報酬(ブラックロック・グループの従業員でない取締役に対する報酬)、交通費、合理的な範囲の立替経費、印刷費、公告費、翻訳費用および投資主への報告に関連するその他すべての費用、規則当局への届出およびライセンス手数料、コルレスおよびその他の銀行手数料、ソフトウェアのサポートおよびメンテナンス、インベスター・サービス・チームおよび様々なブラックロック・グループ会社によって提供されたその他のグローバル管理サービスに帰属する運用費用が含まれるが、これらに限定されない。

運用会社は、ファンドの継続的経費(ongoing charge)の競争優位性を確実に維持するという財務リスクを負っている。したがって、すべての期間において当社が運用会社に支払った年次サービス料の金額のうち、期中に発生した実際の費用を超える額について運用会社は返還する義務を負わず、一方で期中に発生した実際の費用のうち、当社が運用会社に支払った年次サービス料を超える額については、運用会社または他のブラックロック・グループ会社が負担しなければならない。

ブラックロック・グループの従業員でない取締役は、遂行した業務の報酬として税込みで年間60,000ユーロを受領した。ブラックロック・グループの従業員である取締役は、取締役報酬を受ける権利を有していない。

特定の管轄地域に適用される税金も、ファンドに直接請求される(注記9参照)。

年次サービス料は、損益および純資産変動計算書において開示されている。

2022年2月28日現在の未払年次サービス料は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

8. 預託報酬

当期における当社の預託銀行は、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌブイ、ルクセンブルグ支店であった。預託銀行は、英文目論見書において詳述される取引手数料に加えて、有価証券の価額に基づき毎日発生する年間報酬を受領する。両カテゴリーの報酬および手数料の料率は、投資先の国によって異なり、場合によっては資産クラスに応じて異なる。債券や先進国の株式市場に対する投資は上記の幅の下限となり、新興市場または開発途上国市場に対する一部の投資は、上記の幅の上限となる。そのため、各ファンドの保管費用は、その時点における資産配分により左右されることになる。

預託報酬はファンドに直接請求される。2022年2月28日現在の未払保管および預託報酬は純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

9. 税金

ルクセンブルグ

現在のルクセンブルグの法律および慣習に基づき、当社はルクセンブルグにおける所得税もしくはキャピタル・ゲイン税が課されず、また、当社が支払う配当金はルクセンブルグの源泉徴収税の対象となっていない。しかし、当社は、純資産価額に対して年率0.05%のルクセンブルグにおける税金、またはリザーブ・ファンド、クラスI、クラスJおよびクラスXの投資証券の場合には純資産価額に対して年率0.01%の税金が課される。当該税金は、各ファンドの該当四半期末(暦年)の純資産価額に基づき、四半期毎に支払われる。ルクセンブルグに

において、投資証券の発行に伴う印紙税またはその他の税金は支払われない。2022年2月28日に終了した期間において、ルクセンブルグの税金に関連して39,051,518米ドルが費用計上された。

ベルギー

当社は金融市場に関する2012年8月3日法第154条に基づき、ベルギーの金融サービス市場機構に登録されている。ベルギーにおいて一般向け販売のために登録されたファンドには、前年の12月31日現在、ベルギーの仲介業者を通じてベルギーで販売された口数の純資産価額に対して年率0.0925%の税金が課される。2022年2月28日に終了した期間において、ベルギーの税金に関連する費用はなかった。

英国

報告型ファンド(Reporting Funds)

当社では英国報告型ファンドの形態が適用されている。このファンド形態に基づき、英国報告型ファンドの投資家は、分配のあるなしにかかわらずその保有高に応じた英国報告型ファンドの収益持分について課税されるが、その保有高の売却益にはキャピタル・ゲイン税が課される。現在、英国報告型ファンドであるファンドのリストは、<https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>より入手可能である。

その他の取引税

他の管轄地域において、当ファンドが保有する特定の資産に対し、金融取引税(以下「FTT」という。)またはその他の取引税といった税金が課される場合がある(例えば、英国の印紙税、フランスのFTT)。

源泉徴収税

当社が受け取る投資に係るキャピタル・ゲイン、配当金および利息は、その支払元の国において源泉徴収税が課せられる場合がある。当社が所得税を免除されているため、かかる源泉徴収税は通常、回収できない。しかしながら、最近の欧州連合における判例法によって、欧州連合諸国においてそのような回収不能の税金が減額される可能性が出てきた。市民権を有する国、居住国、または住所を登録している国の法律に基づいて、投資証券の販売、購入、保有、買戻し、転換、売却において課せられる可能性がある税金について、投資家は熟知するとともに、専門家に適時に相談すべきである。投資家は、課税の水準および課税の標準ならびに課税の軽減が変更される可能性があることに留意する必要がある。源泉徴収税の負担の可能性については、英文目論見書においてさらに説明されている。

10. 投資顧問会社

運用会社であるブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、英文目論見書に記載のとおり、同社の投資運用機能を以下の投資顧問会社(以下それぞれを「投資顧問会社」という。)に委託している。ブラックロック・フィナンシャル・マネジメント・インク(US)(以下「BFM」という。)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー(US)(以下「BIMLLC」という。)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(以下「BIMUK」という。)およびブラックロック(シンガポール)リミテッド(以下「BSL」という。)

すべての投資顧問会社は、ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーにより直接任命されている。すべての副投資顧問会社は関連する投資顧問会社により任命されている。これらのうちの数社は、投資顧問会社として以下の会社に業務の一部を再委託している。ブラックロック・ジャパン株式会社(以下「BLKJapan」という。)、ブラックロック・アセット・マネジメント・ノースアジア・リミテッド(以下「BAMNA」という。)およびブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(以下「BLKAus」という。)。

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	B I M U K	B A M N A
アジア・ドラゴン・ファンド	B I M U K	B A M N A
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	B I M U K	B A M N A
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	B S L	-
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	B I M U K、B S L、 B I M L L C	B A M N A、 B L K A u s
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K	B A M N A
チャイナ・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K	B A M N A
チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンド	B I M U K	B A M N A
チャイナ・ファンド	B I M U K	B A M N A
チャイナ・インパクト・ファンド*(1)	B I M U K	B A M N A
サーキュラー・エコノミー・ファンド	B I M U K	-
クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド*(2)	B I M U K	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド*(2)	B I M U K	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	B I M U K	-
ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ ファンド*	B I M U K	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	B A M N A、 B L K A u s
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	B I M U K	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	B I M U K、 B I M L L C	B A M N A
エマージング・マーケット・ファンド	B I M U K、 B I M L L C	B A M N A
エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド*	B I M U K、 B F M	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ ボンド・ファンド	B S L、B I M U K、 B F M	B A M N A
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ ファンド*	B I M U K	B A M N A
E S Gアジア・ボンド・ファンド*	B S L	-
E S Gエマージング・マーケット・ブレンデッド・ ボンド・ファンド*	B I M U K、B F M	-
E S Gエマージング・マーケット・ボンド・ファンド*	B I M U K、B F M	-
E S Gエマージング・マーケット・コーポレート・ ボンド・ファンド*	B I M U K、B F M	-
E S Gエマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ ボンド・ファンド*	B I M U K、B F M	-
E S Gフィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド*	B I M U K	B L K A u s、 B S L、B F M

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド ⁽²⁾	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド ⁽²⁾	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド ⁽²⁾	BIMUK	BAMNA
ESGグローバル・ボンド・インカム・ファンド ⁽¹⁾	BIMUK、BFM	-
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド*	BIMUK、BFM	-
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド* ⁽²⁾	BIMLLC、BIMUK、BFM、BSL	BAMNA
ESGマルチアセット・ファンド	BIMLLC、BIMUK、BFM、BSL	-
ユーロ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	-
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	-
ユーロ・マーケット・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	BIMUK	-
フィンテック・ファンド	BIMUK	-
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	BSL、BIMUK、BFM	BLKAus
フューチャー・コンシューマー・ファンド*	BIMUK	-
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC、BSL	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、BFM	-
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、BFM	-
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、BFM	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	-
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	BSL、BIMUK、BFM	BAMNA、BLKAus
インド・ファンド	BIMUK	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA、BLKJap
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	BLKJap

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMLLC	-
マルチテマ・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ナチュラル・リソース・グロス・アンド・インカム・ファンド	BIMLLC、 BIMUK	-
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド*	BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-
ニュートリション・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・グローバル・インフラストラクチャー・ ファンド*	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BLKAus
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・ オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	-
システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ ファンド	BIMLLC	-
システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ ファンド	BIMUK	-
システムティック・グローバル・スモールキャップ・ファンド	BIMLLC	-
システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ ファンド*	BIMLLC、BIMUK、 BFM	-
ユナイテッド・キングダム・ファンド	BIMUK	-
USベシック・バリュー・ファンド	BIMLLC	-
USDollar・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
USDollar・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BFM	-
USDollar・リザーブ・ファンド	BFM	-
USDollar・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BFM	-
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド ⁽¹⁾	BFM	-
USグロス・ファンド	BIMLLC	-
USスモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ ファンド	BIMLLC	-
USサステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ワールド・ボンド・ファンド	BSL、BIMUK、 BFM	-
ワールド・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ゴールド・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	BIMLLC	-
ワールド・マイニング・ファンド	BIMUK	-
ワールド・リアル・エスレート・セキュリティーズ・ファンド	BSL、BIMUK、 BIMLLC	BLKAus
ワールド・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-

(1) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

* 当該ファンドは香港では認可されておらず、2022年2月28日現在、香港では一般に公開されていない。

11. 関連当事者との取引

運用会社、主販売会社、投資顧問会社および副投資顧問会社の最終的な持株会社は、米国デラウェア州で設立されたブラックロック・インクである。当期において、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社または当社の取締役の関連当事者であるブローカーを通じて当社に影響を及ぼす取引はなかった。当期において当社は、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社または当社の取締役、もしくはこれらの関連当事者との間で、これらが本人となる取引を行わなかった。

投資顧問会社、または共通管理・支配により投資顧問会社と関係している会社、もしくは実質的な直接・間接保有により投資顧問会社と関係している会社が直接または委任により管理するその他のUCITSおよび/またはその他の集団投資事業（以下「UCI」という。）のユニットに当ファンドが投資している場合、かかるその他のUCITSおよび/またはUCIのユニットに対する投資について、当社は発行手数料または買戻し手数料を請求されることはない。当ファンドは、可能な場合、投資運用報酬の対象ではないクラスX投資証券に投資する。これらの投資は、当ファンドの投資有価証券明細表において「~」と示されている。

ファンドがその純投資の大部分をその他のUCITSおよび/またはその他のUCIに投資している場合、投資顧問会社は、当該ファンドに対して費用計上された投資運用報酬合計（パフォーマンス報酬がある場合は、それを除く。）（当該ファンドが投資しているその他のUCITSおよびUCIからの投資運用報酬を含む。）が当該ファンドの純資産価額の1.50%を超過しない旨保証する。

当期において、当社、運用会社、投資顧問会社、副投資顧問会社、当社の取締役、預託銀行、またはこれらの者もしくはこれらの関連当事者が重要な利害関係を有する企業との間で、通常の業務範囲外のまたは標準的な取引条件外の取引は行われていない。

当期末において、当社の取締役であるキース・サルダニャおよびその関連当事者が、以下の投資証券を保有していた。

ファンド	投資証券クラス	投資証券口数	金額
チャイナ・ボンド・ファンド	クラスD英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	493	4,496英ポンド
チャイナ・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	593	11,314ユーロ
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスD英ボンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	644	9,222英ポンド
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスD無分配投資証券	1,228	24,842米ドル
サステナブル・エネルギー・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	409	5,100英ポンド
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	クラスD無分配英国報告型投資証券	225	9,170米ドル
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	クラスD無分配投資証券	127	8,675米ドル
ワールド・マイニング・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	249	12,004英ポンド
ワールド・テクノロジー・ファンド	クラスD無分配投資証券	241	13,458英ポンド

他の取締役による当ファンドの投資証券の保有はなかった。

有価証券貸付契約に従って任命された有価証券貸付の代理人は、当社の関連当事者であるブラックロック・アドバイザーズ（UK）リミテッドである。ブラックロック・アドバイザーズ（UK）リミテッドは有価証券貸付取引に直接関連するすべての運用費用を負担する。

当ファンドは、ブラックロック・インクが提供している借手のデフォルトに対する補償から利益を得ている。当該補償により、全貸付有価証券の差替えが可能となる。ブラックロック・インクは、借手のデフォルトに対する補償費用を負担する。

ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッドは、ブラックロック（チャンネル・アイランズ）リミテッドに一部の管理事務代行を任命した。

ファンドの中にはクロス・インベストメント・テクニクを使用しているものもあり、ファンドがアンブレラ構造の他のファンドに投資することを意味している。

結合後の純資産計算書と結合後の損益および純資産変動計算書は、クロス・インベストメントの影響を排除するために調整されていない。

2022年2月28日現在、以下のファンドは、当ファンドの投資有価証券明細表において「 」と示されており、クロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.10%に相当する。

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	通貨	時価	純資産比率 (%)
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・ボンド・ファンド	米ドル	4,078,291	5.05
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - インディア・ファンド	米ドル	642,077	0.79
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	8,182,615	0.23
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	61,739,600	5.33
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド ⁽¹⁾	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	米ドル	9,721,076	4.87
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	39,399,955	0.59
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サークュラー・エコノミー・ファンド	米ドル	18,725,568	9.86
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フィンテック・ファンド	米ドル	14,287,389	7.52
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	米ドル	5,683,607	2.99
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	3,657,421	1.93
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ニュートリション・ファンド	米ドル	3,825,903	2.02
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	29,624,303	15.60

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

2022年2月28日に終了した期間において、預託銀行の関連当事者である、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌブイは、外国為替取引および通貨管理/ヘッジ・プログラムにおける当ファンドの保管銀行であった。これらの取引に関連して支払った手数料合計は7,773,868米ドルであり、関連当事者に支払われた平均手数料率は0.16bpsであった。預託銀行の関連当事者との総取引価額は4,980億米ドルであり、当ファンドが行ったこれら取引の合計価額の71%を占める。預託銀行の関連当事者との取引はすべて、通常の業務過程において標準的な取引条件に基づいて行われた。

12. コミッションの使用

適用される規制により認められている場合(疑義を避けるために明記すると、MiFIDの対象ファンドを除く。)、ファンドの投資顧問会社を務めているブラックロック・グループの一部の会社は、一定の管轄区域の特定のブローカーと株式を取引するときに発生するコミッションを受け取ることができる。コミッションは適格なりサーチ・サービスを購入するために再配分することができる。リサーチに資金提供した人だけでなく広範な顧客もリサーチの利用が可能のため、かかる取り決めにより1つのファンドだけでなく他のファンドも恩恵を受けることができる。ブラックロック・グループは、適格なサービスのみを購入し、過度のコミッションは適格

なサービス提供者に再配分する(該当があれば)ようにするため、コミッションの使用に関する方針を設定している。当期に締結したソフト・ダラー契約はなかった。

13. デリバティブ商品

当ファンドは、英文目論見書に詳述されているとおり、デリバティブ商品を売買することがある。2022年2月28日現在において保有しているデリバティブ商品についてはファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

14. 差入れた有価証券または保証として引渡した有価証券および保証として受取った有価証券

当ファンドが担保として差入れた、または保証として引渡した有価証券は当ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当該有価証券はファンドの投資有価証券明細表において「†」と示されており、2022年2月28日現在、その評価額は397,728,423米ドルである。

システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンドについて、売建コール・オプションの担保は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド、メリルリンチ・インターナショナルおよびバンク・オブ・ニューヨーク・メロン(インターナショナル)リミテッドの三者間契約に基づき差入れられる。担保はファンドの投資有価証券明細表において「^」と示されており、2022年2月28日現在、その評価額は7,522,028米ドルである。

2022年2月28日現在、ファンドが保証として受取った有価証券はなかった。

15. 現金担保

当ファンドは様々な取引相手とデリバティブの取引を行っている。デリバティブの取引相手は、投資有価証券明細表に示されている。デリバティブの取引相手は以下のとおりである。オーストラリア・ニュージーランド銀行、バンク・オブ・アメリカ、バークレイズ、BNPパリバ、BNYメロン、シティバンク、シティグループ、コモンウェルス・バンク・オブ・オーストラリア、クレディ・スイス、ドイツ銀行、ゴールドマン・サックス、香港上海銀行Plc、JPモルガン、モルガン・スタンレー、野村、RBS Plc、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、ソシエテ・ジェネラル、スタンダードチャータード銀行、ステート・ストリート、トロント・ドミニオン、UBSおよびウエストパックである。スワップ契約、CFD、先物取引、売建オプション(プットおよびコール)、買建オプション(プットおよびコール)およびスワップ取引に係る担保/証拠金について、取引相手が当社へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が支払われ、当社が取引相手へのエクスポージャーを補う場合、担保/証拠金が受取られる。「ブローカーに対する債権」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよび様々な取引相手に支払った現金担保からなる。「ブローカーに対する債務」は、ポートフォリオのクリアリング・ブローカーおよび様々な取引相手から受取った現金担保からなる。先物取引現金は、純資産計算書の「銀行預金」の一部を構成する。

2022年2月28日現在の保有CFD、スワップ契約および店頭オプション取引に関連するブローカーからの/(に対する)現金担保残高は、以下の表のとおりである。先物取引現金残高は、ブローカーが保有する現金に関連しており、2022年2月28日現在、証拠金要件を満たすために一部使用されている。

ファンド	通貨	ブローカーからのCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーに対するCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーからの先物取引	ブローカーに対する先物取引
アジア・グロス・リーダーズ・ファンド	米ドル	410,000	-	23	-
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	380,000	(870,000)	1,333,000	(336,569)
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	-	-	196,302	(20)
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	5,659,000	(480,000)	491,835	(5)

チャイナ・ボンド・ファンド	オンショア 中国人民元	15,392,964	-	63,676,951	(19,315,903)
チャイナ・ファンド	米ドル	-	(1,160,000)	-	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド(1)	ユーロ	-	-	208,355	-
コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンド	ユーロ	-	-	5,111,000	(2,237,323)
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	610,000	-	39,813,827	(22,203)
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	-	-	-	(4)
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	270,000	(9,840,000)	3,218,000	(3,515,076)
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	4,360,000	-	29	-
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	6,930,000	-	2,848,003	(1,358,310)
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	11,213,758	(6,532,335)	2,508,000	(1,398,141)
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	65,000	(15,941)
ESGアジア・ボンド・ファンド	米ドル	-	-	39,613	-
ESGエマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド	米ドル	738,914	(105,376)	124,024	(28,213)

ファンド	通貨		ブローカーからのCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーに対するCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーからの先物取引	ブローカーに対する先物取引
ESGエマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	-	(2,580,000)	1,223,000	(1,271,220)	
ESGエマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	2,878,000	(184,952)	580,000	(309,319)	
ESGフィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	5,781,021	(8,900,953)	9,243,582	(3,129,848)	
ESGグローバル・ボンド・インカム・ファンド(2)	米ドル	161,967	(5,976)	581,000	(308,696)	
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド	ユーロ	-	-	14,625,361	(1,823,190)	
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド(1)	米ドル	-	-	1,282,000	(183,586)	
ESGマルチアセット・ファンド	ユーロ	16,110,780	(33,828,895)	27,384,194	(3,121,925)	
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	25,536,806	(1,080,267)	17,658,706	(426,282)	
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	20,780,336	(6,285,124)	3,899,308	(3,305,789)	
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	ユーロ	51,551,259	(4,375,398)	32,784,217	(21,783,607)	
ヨーロピアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	-	-	-	(260)	
ヨーロピアン・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	ユーロ	-	-	5	-	
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	91,065,886	(89,841,978)	77,058,255	(13,845,791)	
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	58,999,128	(61,256,378)	86,730,270	(82,867,773)	
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	4,229,042	(2,180,000)	4,366,400	(3,431,650)	
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	-	(270,000)	3,126,621	(219,534)	

グローバル・ガバメント・ボンド・ ファンド	米ドル	2,511,945	(372,110)	3,691,823	(2,474)
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	4,192,000	(2,570,974)	16,714	(1,264)
グローバル・インフレーション・リンクド・ ボンド・ファンド	米ドル	3,241,865	(1,154,245)	1,003,904	(273,563)
グローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	3,769,000	(3,559)	14,235,256	(2,217,428)
システムティック・チャイナ・A株式・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	-	-	331,747	(3)
システムティック・グローバル・ エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	190,619,232	-
システムティック・グローバル・ スモールキャップ・ファンド	米ドル	-	-	240,166	-
システムティック・マルチ・アローケーショ ン・クレジット・ファンド	米ドル	-	-	163,027	(5,890)

ファンド	通貨	ブローカーからのCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーに対するCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーからの先物取引	ブローカーに対する先物取引
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	2,162,554	-	2,040,245	-
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	5,118,000	(1,088,082)	85,428	(26,819)
USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	米ドル	1,159,000	(203,201)	4,714,336	(675,399)
USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド ⁽²⁾	米ドル	-	-	171,700	(41,490)
ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	5,045,343	(6,744,764)	6,553,880	(586,383)
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	米ドル	50,000	-	-	-

(1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

(2) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

16. 配当金

配当金の支払いに関連する取締役の現行の方針は投資証券クラスによって異なる。無分配投資証券クラスに関する現行の方針はすべての純投資利益を留保し再投資することである。そのため、当該利益は純資産価額に留保され、該当クラスの投資証券1口当たり純資産価額に反映される。分配型投資証券クラスの場合、当期の投資収益の純額または全額を分配する投資証券クラスについては当期の費用控除後のほぼすべての投資収益(入手可能な場合)を分配する方針であり、総額を分配する投資証券クラスについては分配到費用控除前の資本金の一部が含まれることがある。各分配型投資証券クラスの分配方針に関する詳細については、英文目論見書の「Calculation of Dividends」の項(訳注:原文の項)を参照のこと。取締役は、実現および未実現キャピタル・ゲイン(純額)の両方からの配当を含めて配当を行うか否か、またどの程度含めるかについて決定することもできる。当ファンドの一部および/または投資証券クラスの一部(例えば、安定分配型投資証券、金利差分配型投資証券、トータル・リターン分配型投資証券および基準額以上分配型投資証券)は、収益、実現および未実現キャピタル・ゲイン(純額)だけでなく資本金からも配当を行うことができる。分配型投資証券クラスが実現もしくは未実現キャピタル・ゲイン(純額)からの配当を含めて配当を行う場合、または費用控除前の総収益を分配するファンドの場合は、配当金に当初の資本金が含まれる可能性がある。ファンドの資本金から配当金が支払われる場合、資本金が減額されることになり、追加の増資が必要になる可能性がある。

ファンドが英国報告型であり報告収益が分配額を超過する場合は、当該剰余金がみなし配当金として処理され、投資家の税務上の立場に応じて課税されることになる。

分配型投資証券を発行するファンドについては、ファンドの種類により、配当金の支払頻度が決定される。配当金の支払に関する詳細については、英文目論見書に記載されている。

配当金の公表および支払ならびに投資主が利用可能な再投資の選択肢については、英文目論見書に記載されている。

17. 信用供与

JPMorgan・チェース銀行・エヌ・イー(以下「JPMorgan」という。)によって設定された20億米ドルの信用供与により、当社は約定済み12.3億米ドルのトランシェにこれを利用することができる。信用供与枠の一部である12.25億米ドルが、2021年4月23日付の割当通知に基づき当ファンドに割り当てられる予定である。

当ファンドは、この信用供与枠を一時的な資金調達目的で利用し、その目的には、例えば、投資家からの買戻しの資金を含むがこれに限定されない。かかる信用供与枠からの引出に関連する利息や未使用枠の手数料は、関

連するファンドの資産により支払われる。新規設定ファンドには自動的に信用枠が供与されないため、併合プロセスにより合算しなければならない。かかるプロセスにおいては、新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するため、特に信用供与者が必要なデューデリジェンスを行う。当期において新規設定ファンドは信用枠を供与されず、引出すこともなかった。さらに、信用供与者が必ずしも新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するとは限らず、また、信用枠は当ファンドと信用契約に参加しているその他のブラックロックのファンドとの間で(公正な配分で)使用可能かどうかにかかっているため、ファンドがかかる信用枠を使用することができるとは限らない。したがって、一部のファンドはかかる信用供与を受けない場合があり、それに関連する費用も発生しない。

この信用供与に関してローン・コミットメント・フィーが請求され、損益および純資産変動計算書において「ローン・コミットメント・フィー」の科目に含まれている。ローン・コミットメント・フィーは、未使用残高に対して0.10%で請求される。

2021年9月1日から2022年2月28日までの会計期間において使用した信用供与枠はなかった。

18. 下引受けに係る収益

当社は、保管銀行の同意のもと下引受契約を締結することがある。下引受契約により、当社は報酬と引き換えに他の引受人による投資に先立ち、投資証券発行が担保される。当期において、下引受契約に係る収益を受け取ったファンドはなかった。

19. 後発事象

取締役会および投資顧問会社は、ロシアのウクライナへの侵攻に起因する地政学的緊張を考慮して、ファンドの投資目的に沿った投資パフォーマンスを引き続き監視している。当ファンドの運用および純資産価額の公表は、BGFエマージング・ヨーロッパ・ファンド(本パラグラフの残りの部分では「ファンド」という。)を除いて継続されている。ロシアに対するファンドの重大な投資エクスポージャーにより、ファンドの取引条件は重大な影響を受けた。したがって、取締役会は、ファンドのすべての投資証券クラスの販売、買戻し、転換、および純資産価額の決定については、英文目論見書に基づくファンドの裁量に基づき、2022年3月1日からそれ以降の通知までの期間、一時的に停止されることが、ファンドおよびその投資家の利益になると考えている。2022年3月3日、取締役会は、ファンドが保有するロシアの有価証券の価値をさらに大幅に評価減することを決定した。2022年3月9日、取締役会は、ファンドの評価、販売および買戻しについて、ブラックロックのウェブサイトを通じてさらなる通知がなされるまで停止する一方で、ファンドに関連する投資運用報酬および年次サービス料を放棄する(2022年3月1日発効)という追加の例外的な決定を下した。

2022年3月29日付で、米ドル建のアジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンドが設定された。

2022年4月11日付で、ダヴィーナ・セイントは当社の取締役会に任命された。

[次へ](#)

アペンディクス - 投資証券クラス

投資証券クラスの設定および再開

以下に開示されている設定日は、投資証券のファンドの各クラスにおける初回発行日を示している。当該設定日より前にクラスの販売開始が可能な場合がある。

設定日	ファンド	種類
2021年9月1日	エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2021年9月1日	フューチャー・コンシューマー・ファンド	クラスIユーロ無分配投資証券
2021年9月1日	ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	クラスIユーロ無分配投資証券
2021年9月1日	システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド	クラスA1ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2021年9月1日	システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2021年9月1日	システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2021年9月22日	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスA米ドル毎四半期分配型投資証券
2021年9月22日	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券
2021年9月22日	アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2021年9月22日	エマージング・マーケット・ファンド	クラスS1米ドル無分配投資証券
2021年9月22日	エマージング・マーケット・ファンド	クラスX豪ドル無分配投資証券
2021年9月22日	システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2021年9月22日	システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2021年9月22日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスX豪ドル無分配投資証券
2021年9月29日	インド・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSRオフショア中国人民元安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSRユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSR香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSRシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSR米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2021年10月8日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスSR米ドル無分配英国報告型投資証券
2021年10月20日	フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスAユーロ毎年分配型投資証券
2021年10月20日	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスAユーロ毎年分配型投資証券
2021年10月27日	フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスAユーロ無分配投資証券
2021年10月27日	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスAユーロ無分配投資証券
2021年11月24日	コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

設定日	ファンド	種類
2021年11月24日	ESGグローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスAユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスAIユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスDユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスD英ポンド無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスEユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスAユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスAIユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスCユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスDユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスEユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスIユーロ無分配投資証券
2021年12月9日	クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	クラスXユーロ無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券
2021年12月15日	ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル・ヘッジ無分配投資証券
2021年12月22日	システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド	クラスX英ポンド無分配投資証券
2021年12月29日	サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスD米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスD香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券

設定日	ファンド	種類
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスD米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスD香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン 分配型投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスD米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年1月18日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスD香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン 分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月25日	ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスAユーロ毎月総収益分配型投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型 投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスX英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配型 投資証券
2022年1月27日	ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券

発行済投資証券クラス

2022年2月28日現在、当社は以下の投資証券クラスを発行している。二つ以上の取引通貨があるファンドの場合、追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

クラスA

クラスA 毎年総収益分配型投資証券	クラスA 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA スイス・フラン・ヘッジ 毎年総収益分配型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 毎年総収益分配型投資証券	クラスA カナダ・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 毎年分配型投資証券	クラスA オフショア 中国人民元・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 毎年分配型投資証券	クラスA ユーロ・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 毎年分配 英国報告型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 英ポンド・ヘッジ 毎年分配 英国報告型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 米ドル・ヘッジ 毎年分配 英国報告型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA 毎日分配型投資証券	クラスA 米ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 毎日分配型投資証券	クラスA 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA 毎日分配 英国報告型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 毎日分配 英国報告型投資証券	クラスA カナダ・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA 毎月総収益分配型投資証券	クラスA ユーロ・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA 毎月分配型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA 豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA カナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配 英国報告型投資証券
クラスA 英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA 基準額以上 每四半期総収益分配型投資証券
クラスA 香港ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ 基準額以上 每四半期総収益分配型投資証券
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 基準額以上 每四半期総収益分配型投資証券
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	クラスA 無分配投資証券
クラスA 每四半期総収益分配型投資証券	クラスA 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA 豪ドル・ヘッジ 每四半期総収益分配型投資証券	クラスA カナダ・ドル・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 每四半期総収益分配型投資証券	クラスA スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 每四半期総収益分配型投資証券	クラスA オフショア 中国人民元・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA 米ドル・ヘッジ 每四半期総収益分配型投資証券	クラスA ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA 每四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスA 英ポンド・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA スイス・フラン・ヘッジ 每四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスA 香港ドル 無分配投資証券
クラスA 每四半期分配型投資証券	クラスA 香港ドル・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA ユーロ・ヘッジ 每四半期分配型投資証券	クラスA 円ヘッジ 無分配投資証券
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 每四半期分配型投資証券	クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA 豪ドル・ヘッジ 金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスA ポーランド・ズロチ・ヘッジ 無分配投資証券
クラスA カナダ・ドル・ヘッジ 金利差 毎月総収益分配型投資証券	クラスA スウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差
毎月総収益分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型
投資証券

クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型
投資証券

クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ金利差
毎月総収益分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ金利差
毎月総収益分配型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差
毎月総収益分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差
毎月総収益分配型英国報告型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ無分配投資証券

クラスA無分配英国報告型投資証券

クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA1

クラスA1毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA1毎四半期分配型投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスA1無分配投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC

クラスC毎日分配型投資証券

クラスCユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券

クラスC毎月分配型投資証券

クラスC毎四半期総収益分配型投資証券

クラスCシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期
総収益分配型投資証券

クラスC毎四半期分配型投資証券

クラスC安定毎月総収益分配型投資証券

クラスC無分配投資証券

クラスCユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスC無分配英国報告型投資証券

クラスD

クラスD毎年総収益分配型投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型
投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券

クラスD毎年総収益分配英国報告型投資証券

クラスD毎年分配型投資証券

クラスDカナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスD毎年分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD毎月分配型投資証券

クラスD豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD毎月分配英国報告型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD毎四半期総収益分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月
総収益分配型投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスDトータル・リターン分配型投資証券

クラスD香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン
分配型投資証券

クラスD基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスD無分配投資証券

クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスDオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスD香港ドル無分配投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期 総収益分配型投資証券	クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスD毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスD米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスD無分配英国報告型投資証券
クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配 英国報告型投資証券	クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスD毎四半期分配型投資証券	クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスD米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスE	
クラスE毎四半期総収益分配型投資証券	クラスEユーロ・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型 投資証券
クラスEユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスE無分配投資証券
クラスE毎四半期分配型投資証券	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスEユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスE英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスEユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスEポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスE安定毎月総収益分配型投資証券	クラスE米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスE基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券	
クラスI*	
クラスI毎年総収益分配型投資証券	クラスI安定毎月総収益分配型投資証券
クラスI毎年分配型投資証券	クラスIユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月 総収益分配型投資証券
クラスI毎年分配英国報告型投資証券	クラスI米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI無分配投資証券
クラスI米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI毎月総収益分配型投資証券	クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI毎月分配型投資証券	クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスI毎四半期総収益分配型投資証券	クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスI円ヘッジ無分配投資証券
クラスI毎四半期分配型投資証券	クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスI米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスI円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスI無分配英国報告型投資証券
クラスI毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスIスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配 英国報告型投資証券	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型 投資証券	クラスI米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスJ*	
クラスJ毎月分配型投資証券	クラスJ無分配投資証券
クラスS	

クラスS 毎年分配型投資証券	クラスS 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスS ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスS シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスS 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスS 無分配英国報告型投資証券
クラスS 毎四半期分配型投資証券	クラスS スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS 無分配投資証券	クラスS ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	クラスS 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	
クラスSI	
クラスSI 無分配投資証券	クラスSI 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスSR	
クラスSR 毎年総収益分配英国報告型投資証券	クラスSR ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスSR 毎年分配英国報告型投資証券	クラスSR 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスSR 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスSR シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスSR 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスSR 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスSR 毎月分配英国報告型投資証券	クラスSR 無分配英国報告型投資証券
クラスSR 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスSR ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスSR 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券	クラスSR 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスX*	
クラスX 毎年分配型投資証券	クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスX 無分配投資証券
クラスX 毎年分配英国報告型投資証券	クラスX 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスX カナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎月分配型投資証券	クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスX 円ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎四半期分配型投資証券	クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスX 無分配英国報告型投資証券
クラスZ	
クラスZ 無分配投資証券	クラスZ 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	クラスZ 無分配英国報告型投資証券
クラスZ ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

* 機関投資家が購入可能

5【販売及び買戻しの実績】

2022年3月末日前1年間におけるファンド証券の販売および買戻しの実績ならびに2022年3月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

クラスA無分配投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2021年4月1日～ 2022年3月31日	351,634 (351,634)	572,216 (572,216)	1,174,145 (1,158,765)

(注1) ()内の数は、本邦外における販売、買戻しおよび発行済口数である。

(注2) 上記の各数値は、未決済の取引を含まず、また小数点以下を四捨五入して記載している。これらの理由により、上記の各数値が本書の中の他の箇所に記載された数値と一致しない場合がある。