

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和4年7月29日

【発行者名】 フォーカス・シキャブ
(Focused SICAV)

【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ロバート・スティンガー (Robert Sütinger)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)

【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 - 2010、B.P.91、L - 1855、
J.F.ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, B.P.91, L-2010
Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
フォーカス・シキャブ
- グローバル・ボンド
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル
(Focused SICAV
- Global Bond
- High Grade Bond USD
- High Grade Long Term Bond USD)

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券
グローバル・ボンド
クラス米ドルF - acc投資証券
クラス円ヘッジF - acc投資証券
ハイ・グレード・ボンド・米ドル
クラスF - acc投資証券
クラス円ヘッジF - acc投資証券
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル
クラスF - acc投資証券
クラス円ヘッジF - acc投資証券
上限見込額は以下のとおりである。

グローバル・ボンド

クラス米ドルF - acc投資証券：15億8,880万米ドル（約1,836億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：1,073億2,000万円を上限とする。

ハイ・グレード・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：15億4,640万米ドル（約1,787億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：1,010億4,000万円を上限とする。

ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：19億8,860万米ドル（約2,298億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：1,044億3,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2022年2月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている(グローバル・ボンド - クラス米ドルF - acc投資証券については158.88米ドル(約18,359円)に1,000万口を、グローバル・ボンド - クラス円ヘッジF - acc投資証券については10,732円に1,000万口を、ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券については154.64米ドル(約17,869円)に1,000万口を、ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券については10,104円に1,000万口を、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券については198.86米ドル(約22,978円)に1,000万口を、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券については10,443円に1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。)

(注2) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=115.55円)による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2022年4月28日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レートを用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

フォーカス・シキャブ（以下、フォーカス・シキャブを「本投資法人」、フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド、フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドルおよびフォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルを個別にまたは総称して「ファンド」または「サブ・ファンド」という。）の概況は以下のとおりである。

（注）ファンドにはクラス米ドルF - acc投資証券、クラスF - acc投資証券およびクラス円ヘッジF - acc投資証券以外の投資証券も存在するが、その他の投資証券は日本で販売されていないため、以下、ファンドについて「投資証券」というときは、上記のクラス米ドルF - acc投資証券、クラスF - acc投資証券およびクラス円ヘッジF - acc投資証券を指すものとする。

(1) 主要な経営指標等の推移

(フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2020年10月末日 に終了する 会計年度末	2021年4月末日に 終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	5,061,997.18	33,409,379.15	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	5,061,997.18	33,409,379.15	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	5,061,997.18	33,409,379.15	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23
(d) 出資総額 ⁽²⁾	480,474,551.61	552,660,833.03	633,524,759.66	639,116,719.43	561,673,497.74
(e) 発行済投資口総数 (クラス米ドルF-acc投資証券)	1,171,658.715口	1,299,726.601口	1,566,856.504口	1,612,030.485口	1,525,890.076口
(クラス円ヘッジF-acc投資証券)	309,281.571口	342,950.208口	434,674.208口	488,147.208口	543,409.208口
(f) 純資産額	480,474,551.61	552,660,833.03	633,524,759.66	639,116,719.43	561,673,497.74
(g) 資産総額	484,427,222.81	554,401,974.03	634,942,088.11	642,599,292.21	565,873,989.24
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス米ドルF-acc投資証券)	159.76	164.26	162.68	163.28	151.80
(クラス円ヘッジF-acc投資証券)	10,864円	11,149円	11,018円	11,044円	10,244円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス米ドルF-acc投資証券)	3.29	7.12	- 1.62	- 1.01	- 11.71
(クラス円ヘッジF-acc投資証券)	2.93円	7.01円	- 5.42円	- 8.78円	- 17.18円
(j) 分配総額	661,703.36	661,703.36	583,121.30	583,121.30	553,230.65
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.18%	99.69%	99.78%	99.46%	99.26%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス米ドルF-acc投資証券)	7.85%	5.40%	1.83%	- 0.60%	- 6.69%
(クラス円ヘッジF-acc投資証券)	4.97%	3.89%	1.42%	- 0.94%	- 7.02%

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

(2) ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

(3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。

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

(注) フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンドは2008年2月20日に運用を開始し、クラス米ドルF - acc投資証券は2008年2月20日に運用が開始され、クラス円ヘッジF-acc投資証券は2017年1月6日に運用が開始された。

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年10月末日 に終了する 会計年度末	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	8,879,440.88	88,270,974.04	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	8,879,440.88	88,270,974.04	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	8,879,440.88	88,270,974.04	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,329,019,591.33	1,451,498,055.36	1,175,651,219.97	1,349,798,222.03	1,757,025,004.99
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - acc投資証券)	7,941,398.199口	3,499,351.239口	2,969,192.534口	3,518,934.573口	4,228,885.081口
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	95,970.000口	96,770.000口	90,231.000口	100,247.000口	160,397.000口
(f) 純資産額	3,329,019,591.33	1,451,498,055.36	1,175,651,219.97	1,349,798,222.03	1,757,025,004.99
(g) 資産総額	3,346,978,916.90	1,480,190,652.67	1,186,420,663.99	1,362,943,018.11	1,814,445,503.63
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	157.43	158.35	158.14	157.33	150.23
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	10,358円	10,391円	10,359円	10,295円	9,810円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF - acc投資証券)	3.36	9.36	- 0.21	- 1.05	- 10.19
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	3.31円	5.80円	- 4.83円	- 9.07円	- 11.38円
(j) 分配総額	2,461,537.91	2,461,537.91	1,799,162.13	- 1,799,162.13	1,495,530.58
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.46%	98.06%	99.09%	99.04%	96.84%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - acc投資証券)	6.65%	4.28%	0.45%	- 0.64%	- 5.00%
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	3.58%	2.78%	0.01%	- 0.92%	- 5.30%

(注) フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドルは2005年8月31日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2005年8月31日に運用が開始され、クラス円ヘッジF - acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2020年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2020年10月末日 に終了する 会計年度末	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	184,718,275.81	323,980,274.76	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	184,718,275.81	323,980,274.76	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	184,718,275.81	323,980,274.76	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,899,584,154.32	3,338,824,962.37	1,883,195,339.07	2,294,398,605.83	3,718,475,442.60
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - acc投資証券)	6,980,484.392口	5,812,675.053口	3,170,000.782口	4,375,187.469口	7,631,786.057口
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	207,460.000口	209,460.000口	202,609.000口	235,162.000口	346,604.000口
(f) 純資産額	3,899,584,154.32	3,338,824,962.37	1,883,195,339.07	2,294,398,605.83	3,718,475,442.60
(g) 資産総額	3,919,230,217.42	3,377,704,680.12	1,914,220,515.82	2,324,504,005.61	3,826,394,458.84
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	206.52	208.51	202.75	203.60	184.96
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	10,933円	11,011円	10,681円	10,708円	9,700円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF - acc投資証券)	10.34	14.81	- 5.22	- 4.08	- 18.63
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	7.47円	10.46円	- 8.05円	- 11.08円	- 15.81円
(j) 分配総額	6,993,957.50	6,993,957.50	6,927,412.32	6,927,412.32	5,681,392.75
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.50%	98.85%	98.38%	98.38%	97.18%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - acc投資証券)	13.79%	7.96%	- 1.83%	- 2.35%	- 8.77%
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	9.33%	6.08%	- 2.30%	- 2.75%	- 9.18%

(注) フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2006年10月27日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2006年10月27日に運用が開始され、クラス円ヘッジF - acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。

(2) 外国投資法人の出資総額

2022年5月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数(口)	
	千米ドル	百万円		
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	561,621.11	72,005	クラス米ドル F-acc投資証券	1,517,278.568
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	551,922.208
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	3,203,162.70	410,677	クラス F-acc投資証券	7,811,669.716
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	165,053.000
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	3,946,192.53	505,941	クラス F-acc投資証券	7,910,648.961
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	357,259.000

(注) 米ドルの円貨換算は、別途記載のない限り、便宜上、2022年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=128.21円)による。以下同じ。

(3) 主要な投資主の状況

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

(4) 役員 の 状況

(2022年5月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ロバート・スティンガー (Robert Süttinger)	取締役会長	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッヒ) マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ グアニーニ (Francesca Guagnini)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント (UK)リミテッド、ロンドン マネージング・ディレクター	該当なし
ジョゼ・リンダ・デニス (Josée Lynda Denis)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	ルクセンブルグ インディペンデント・ディレクター	該当なし
イオアナ・ナウム (Ioana Naum)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ スイス・エイ・ジー(チューリッヒ) エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
ラファエル・ シュミット-リヒター (Raphael Schmidt - Richter)	取締役会役員 (メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ)	UBSアセット・マネジメント・ (ドイツ)ゲーエムベーハー、 フランクフルト エグゼクティブ・ディレクター	該当なし

(注)本投資法人に従業員はいない。本投資法人の独立監査法人はプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)である。

(5) その他

a. 定款の変更

本投資法人の定款は、投資主総会で補足またはその他に変更することができる。変更は、1915年8月10日法の規定における定足数および過半数に関する要件に従う。

b. 事業譲渡または事業譲受

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

定足数および過半数に関する法律の規定を満たす投資主総会は、いつでも、本投資法人を清算することができる。

本投資法人の純資産総額が所定の最低資本金の3分の2または4分の1以下になった場合、本投資法人の取締役会は、本投資法人を清算するか否かについて投資主総会の採決を求めなければならない。本投資法人が解散する場合、清算は投資主総会で指名された一名以上の清算人が実行する。投資主総会では清算人の職務の範囲および報酬を決定する。清算人は投資主の最善の利益にかなうように本投資法人の資産を売却して、サブ・ファンドの清算による正味収入を各投資主の保有量に比例して当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資主に分配する。清算の完了時(9か月かかる可能性がある)に投資主に分配できない清算収入は遅滞なくルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に預託される。

同一サブ・ファンド内で各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産総額が当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスを経済的に合理的に管理するため要求される価額を下回った場合またはかかる価額に達しなかった場合、または政治、経済もしくは金融の状況が著しく変化した場合または合理化の一環として、投資主総会または本投資法人の取締役会は、該当する投資証券クラスのすべての投

投資証券を評価日または決定が効力を生じる時間における純資産価額にて(投資対象の実際の換金率および経費を考慮して)買い戻すことを決定することができる。

本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、本投資法人の取締役会の提案に基づいて、サブ・ファンドの投資主総会で当該サブ・ファンドが発行した投資証券を消却して本投資法人の資本を減資し、投資主に対して保有する投資証券の純資産価額を返還することができる。かかる純資産価額は上記の決定を実施する日に計算し、サブ・ファンドの資産の処分によって実現した実際価格およびかかる処分に起因する費用を織り込むものとする。

下記「本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会」の項の規定が投資主総会の決定のために適宜適用される。取締役会はまた、上記に記載される規定に従いサブ・ファンドまたは投資証券クラスを解散または清算できる。

投資証券の買い戻しのための投資主総会または本投資法人の取締役会の決定は、「報告書を受領する権利」に記載されているとおり関係するサブ・ファンドの投資主に通知される。投資主に支払われていない解散された投資証券の買戻対価としての純資産価額相当額は、遅滞なくルクセンブルグの供託金庫(Caisse de Consignation)に預託される。

本投資法人またはサブ・ファンドと他の投資信託(「UCI」)またはそのサブ・ファンドとの合併、サブ・ファンドの合併

「合併」とは、以下の取引である。

- a) 一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、すべての資産および負債を別の既存のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価額の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- b) 二つ以上のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、清算なしのその解散に基づき、そのすべての資産および負債を設立した別のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転し、吸収対象UCITSの投資主が見返りに吸収UCITSの投資証券および適宜、当該投資証券の純資産価額の10%を超えない支払額を受け取る取引。
- c) 負債が完済されるまで存続し続ける一もしくは複数のUCITSまたは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収対象UCITS」が、すべての純資産を同じUCITSの別のサブ・ファンド、当該UCITSが設立した別のUCITSまたは別の既存のUCITSもしくは当該UCITSのサブ・ファンド、すなわち「吸収UCITS」に移転する取引。

合併は、2010年法に規定される状況において認められる。合併の法律上の効果は、2010年法に準拠する。

「本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散」の項に記載される状況の下で、本投資法人の取締役会は、サブ・ファンドまたは投資証券クラスの資産を本投資法人の別の既存のサブ・ファンドもしくは投資証券クラス、または2010年法パート もしくは海外UCITSに関する2010年法の規則に基づきルクセンブルグの別のUCIもしくは海外のUCITSに配分することおよび、(必要な場合、分裂または統合により、および投資主の比例的権限に相当する金額の支払を通じ)当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券を別のサブ・ファンドまたは別の投資証券クラスの投資証券として指定変更することを決定することができる。

前項の本投資法人の取締役会の権限にかかわらず、上記のサブ・ファンドを合併する決定もまた、当該サブ・ファンドの投資主総会において採択することができる。

合併の決定は「報告書を受領する権利」に記載されている方法で投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、前記「第2 手続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する所定の手続きに従って、買戻手数料またはその他の管理料金を支払わずに、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券

は、交換比率が計算される日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価額に基づいて交換される。集合的投資ファンド(契約型オープン投資信託)の受益証券を割り当てる場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

サブ・ファンドの清算および合併のいずれの場合についても、本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会の定足数は要求されず、決定は総会に出席したまたは委任状により代表される投資証券の単純多数によって承認されることができる。

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

本書提出日前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド)

(2022年5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(%)
-------	-------	-----------	---------

債券	アメリカ合衆国	120,324,586.96	20.69
	中国	51,912,562.32	8.93
	日本	47,342,199.02	8.14
	イギリス	25,026,046.64	4.30
	フランス	22,371,812.41	3.85
	カナダ	20,551,423.60	3.53
	ニュージーランド	17,549,016.93	3.02
	オーストラリア	16,888,422.35	2.90
	スペイン	13,677,056.34	2.35
	イタリア	13,457,026.02	2.31
	オランダ	13,182,034.87	2.27
	大韓民国	10,802,068.49	1.86
	アイルランド	10,589,832.88	1.82
	ドイツ	8,995,036.84	1.55
	ベルギー	8,318,527.21	1.43
	ルクセンブルグ	6,356,097.59	1.09
	インド	3,364,530.75	0.58
	スロベニア	2,561,255.59	0.44
	ケイマン諸島	2,517,588.75	0.43
	メキシコ	2,493,268.50	0.43
	ベネズエラ	2,179,710.32	0.37
	スウェーデン	2,138,666.46	0.37
	スイス	1,974,034.45	0.34
	サウジアラビア	1,682,922.00	0.29
	シンガポール	1,655,252.23	0.28
	ポーランド	1,591,386.06	0.27
	ルーマニア	1,371,702.90	0.24
	タイ	1,152,663.40	0.20
	チリ	1,152,562.50	0.20
	ノルウェー	1,146,438.84	0.20
	バミューダ	1,068,977.55	0.18
	フィリピン	1,065,149.10	0.18
	国際機関	995,589.37	0.17
	カタール	967,375.00	0.17
	フィンランド	838,085.52	0.14
	ブラジル	702,934.37	0.12
	デンマーク	634,720.55	0.11
	ブルガリア	518,578.73	0.09
	チェコ	421,755.99	0.07
	ペルー	388,657.50	0.07
インドネシア	368,948.75	0.06	
マレーシア	309,405.93	0.05	

	ジャージー	290,942.76	0.05
	多国籍	266,968.80	0.05
	エクアドル	252,820.79	0.04
	香港	25,000.00	0.00
	小計	443,441,643.93	76.26
不動産担保証券、アセット バック証券およびその他の ディスカウント債券	アメリカ合衆国	55,250,787.17	9.50
投資信託	ルクセンブルグ	4,299,318.17	0.74
ポートフォリオ合計		502,991,749.27	86.50
現金・その他資産		78,514,479.22	13.50
資産総額		581,506,228.49	100.00
負債総額		19,885,116.68	3.42
合計(純資産総額)		561,621,111.81 (約72,005百万円)	96.58

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

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル)

(2022年5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(%)
債券	アメリカ合衆国	2,233,320,579.55	46.15
	カナダ	125,150,479.61	2.59
	ドイツ	121,122,768.39	2.50
	国際機関	120,917,003.37	2.50
	フランス	72,387,605.76	1.50
	オーストラリア	55,042,209.18	1.14
	シンガポール	43,132,467.15	0.89
	スウェーデン	41,299,454.35	0.85
	ノルウェー	32,640,609.62	0.67
	大韓民国	32,165,270.63	0.66
	ルクセンブルグ	28,631,273.42	0.59
	イギリス	24,341,940.04	0.50
	中国	21,038,852.49	0.43
	フィリピン	17,954,742.87	0.37
	オランダ	17,803,592.08	0.37
	フィンランド	17,722,752.78	0.37
	スイス	16,915,042.95	0.35
	ベルギー	16,101,043.10	0.33
	アラブ首長国連邦	15,877,500.00	0.33
	カタール	15,818,125.00	0.33
	日本	10,196,487.94	0.21
	コートジボワール	9,805,181.74	0.20
	ケイマン諸島	8,726,961.54	0.18
	オーストリア	6,992,433.50	0.14
イギリス領ヴァージン諸島	6,412,210.00	0.13	
ジャージー	6,330,225.00	0.13	
香港	5,195,749.96	0.11	
サウジアラビア	740,664.00	0.02	
ポートフォリオ合計		3,123,783,226.02	64.55
現金・その他資産		1,715,803,329.36	35.45
資産総額		4,839,586,555.38	100.00
負債総額		1,636,423,853.56	33.81
合計(純資産総額)		3,203,162,701.82 (約410,677百万円)	66.19

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(2022年5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(%)
債券	アメリカ合衆国	2,741,203,464.96	47.11
	カナダ	176,662,980.63	3.04
	国際機関	172,388,009.45	2.96
	ドイツ	108,084,395.74	1.86
	ルクセンブルグ	104,896,711.17	1.80
	アラブ首長国連邦	80,963,168.75	1.39
	フィリピン	79,845,696.26	1.37
	ノルウェー	64,238,009.40	1.10
	カタール	56,834,875.00	0.98
	オーストラリア	54,666,761.40	0.94
	大韓民国	49,897,002.25	0.86
	フランス	48,282,668.91	0.83
	オランダ	37,246,795.61	0.64
	香港	36,548,854.55	0.63
	フィンランド	25,412,580.00	0.44
	シンガポール	24,698,296.89	0.42
	イギリス領ヴァージン諸島	18,146,543.00	0.31
		ベルギー	707,937.58
ポートフォリオ合計		3,880,724,751.55	66.69
現金・その他資産		1,938,536,468.43	33.31
資産総額		5,819,261,219.98	100.00
負債総額		1,873,068,687.00	32.19
合計(純資産総額)		3,946,192,532.98 (約505,941百万円)	67.81

(2) 運用実績

純資産等の推移

2022年5月末日までの1年間における各月末の総資産および純資産の推移は以下のとおりである。

(フォーカス・シキャブ・グローバル・ボンド)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2021年6月末日	658,411.08	84,415	654,139.14	83,867	163.95	21,020	11,101
7月末日	682,282.40	87,475	673,183.75	86,309	165.94	21,275	11,231
8月末日	671,511.54	86,094	669,879.21	85,885	165.67	21,241	11,210
9月末日	730,640.75	93,675	654,972.52	83,974	164.10	21,039	11,100
10月末日	642,599.29	82,388	639,116.72	81,941	163.28	20,934	11,044
11月末日	632,501.37	81,093	631,172.61	80,923	164.21	21,053	11,103
12月末日	632,936.22	81,149	632,530.40	81,097	163.90	21,014	11,077
2022年1月末日	688,367.65	88,256	618,212.20	79,261	161.36	20,688	10,903
2月末日	614,037.41	78,726	610,824.96	78,314	158.88	20,370	10,732
3月末日	654,008.00	83,850	598,247.85	76,701	156.04	20,006	10,531
4月末日	565,873.99	72,551	561,673.50	72,012	151.80	19,462	10,244
5月末日	581,506.23	74,555	561,621.11	72,005	151.07	19,369	10,182

(注1) フォーカス・シキャブ・グローバル・ボンドは2008年2月20日に運用を開始し、クラス米ドルF-acc投資証券は2008年2月20日に運用が開始され、クラス円ヘッジF-acc投資証券は2017年1月6日に運用が開始された。以下同じ。

(注2) 各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある(財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。

(フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2021年6月末日	1,910,203.14	244,907	1,229,093.89	157,582	158.13	20,274	10,355
7月末日	1,927,276.00	247,096	1,238,747.96	158,820	158.70	20,347	10,388
8月末日	2,017,630.44	258,680	1,275,923.42	163,586	158.59	20,333	10,379
9月末日	2,089,694.58	267,920	1,351,270.24	173,246	158.15	20,276	10,348
10月末日	1,362,943.02	174,743	1,349,798.22	173,058	157.33	20,171	10,295
11月末日	1,382,538.28	177,255	1,366,781.59	175,235	157.27	20,164	10,288
12月末日	1,656,759.96	212,413	1,655,715.40	212,279	157.00	20,129	10,262
2022年1月末日	2,049,717.37	262,794	1,345,159.80	172,463	155.46	19,932	10,159
2月末日	2,515,224.06	322,477	1,634,103.89	209,508	154.64	19,826	10,104
3月末日	5,407,764.40	693,329	3,498,845.55	448,587	151.63	19,440	9,903
4月末日	1,814,445.50	232,630	1,757,025.00	225,268	150.23	19,261	9,810
5月末日	4,839,586.56	620,483	3,203,162.70	410,677	151.22	19,388	9,864

(注) フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドルは2005年8月31日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2005年8月31日に運用が開始され、クラス円ヘッジF - acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。以下同じ。

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2021年6月末日	3,093,032.40	396,558	1,984,070.98	254,378	205.13	26,300	10,803
7月末日	3,135,188.58	401,963	2,005,991.40	257,188	208.11	26,682	10,954
8月末日	3,185,220.77	408,377	2,028,692.15	260,099	207.51	26,605	10,920
9月末日	3,604,034.94	462,073	2,302,283.86	295,176	204.93	26,274	10,781
10月末日	2,324,504.01	298,025	2,294,398.61	294,165	203.60	26,104	10,708
11月末日	2,412,633.98	309,324	2,390,108.30	306,436	204.81	26,259	10,767
12月末日	3,816,574.38	489,323	3,814,089.00	489,004	204.35	26,200	10,736
2022年1月末日	3,563,227.97	456,841	2,379,771.93	305,111	200.10	25,655	10,510
2月末日	5,676,382.20	727,769	3,748,468.56	480,591	198.86	25,496	10,443
3月末日	6,448,171.82	826,720	4,327,960.48	554,888	191.67	24,574	10,058
4月末日	3,826,394.46	490,582	3,718,475.44	476,746	184.96	23,714	9,700
5月末日	5,819,261.22	746,087	3,946,192.53	505,941	186.49	23,910	9,768

(注) フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2006年10月27日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2006年10月27日に運用が開始され、クラス円ヘッジF - acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。以下同じ。

ファンドの投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。同取引所での実質的な取引実績はない。

分配の推移

グローバル・ボンド - クラス米ドルF - acc投資証券	該当事項なし。
グローバル・ボンド - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。

自己資本利益率(収益率)の推移

2021年6月1日から2022年5月末日までの1年間の自己資本利益率(収益率)は以下のとおりである。

	収益率(%) (注)	
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	クラス米ドルF-acc投資証券	- 7.41
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	- 7.83
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 4.55
	クラス円ヘッジF - acc投資証券	- 4.93
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 8.51
	クラス円ヘッジF - acc投資証券	- 9.01

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2022年5月末日現在の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた額)

b = 2021年5月末日現在の1口当たり純資産価格(分配落の額)

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2022年4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」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

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

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ(「管理会社」)

資本金(株主資本)の額

2022年4月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約18億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2022年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=137.76円)による。

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)(「投資運用会社」)

資本金(株主資本)の額

2022年4月末日現在の株主資本総額は、500,000スイスフラン(約6,673万円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2022年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=133.45円)による。

(2) 大株主の状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2022年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・アセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2022年4月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
ユービーエス・アセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	5,000,000	100

(3) 役員状況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、スイス、ヘッド・オブ・プロダクト	該当なし
フランチェスカ・ギリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月5日	UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ、ルクセンブルグ、チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
アンドレ・ヴァレンテ (André Valente)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年2月17日	UBSファンド・マネジメント(スイス) エイ・ジー、バーゼル、チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
アン - シャルロット・ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、インディペンデント・ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年3月8日	ルクセンブルグ大公国、インディペンデント・ディレクター	該当なし

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

(2022年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
ミーダーホフ・マーカス・ ジョアンヌ (Miederhoff Markus Johannes)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年6月20日就任	該当なし
ケッテラー・レト・ユー (Ketterer Reto U.)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年9月24日就任	該当なし
サリバ・ガイレ・フアド (Saliba Gaylee Fouad)	ヴァイス・チェアマン	2021年12月1日就任	該当なし
イヴァノビッチ・アレクサン ダー (Ivanovic Aleksandar)	チェアマン	2020年9月24日就任	該当なし
スティラート・シャープ・ イボンヌ・シルビア (Stillhart Sharp Yvonne Silvia)	社外インディペンデント・ ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし
ビョーハイム・ジェイコブ (Bjorheim Jacob)	社外インディペンデント・ ディレクター	2019年6月20日就任	該当なし

(4) 事業の内容及び営業の概況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

管理会社は、本投資法人と管理会社契約を締結し、当該契約に詳述された業務を遂行する。

2022年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、418本のサブファンドの管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	364	513,708,267.68オーストラリア・ドル
			3,064,844,769.72カナダ・ドル
			14,155,737,917.72スイス・フラン
			15,363,659,489.56中国元
			512,358,099.17デンマーク・クローネ
			53,086,909,794.43ユーロ
			1,921,556,707.33英ポンド
			277,431,682.92香港ドル
			397,307,452,352.77日本円
			50,024,422.32シンガポール・ドル
			131,641,887,421.99米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	54	1,121,888,467.65オーストラリア・ドル
			185,573,569.00スイス・フラン
			2,360,467,443.02ユーロ
			2,567,401,937.16英ポンド
			17,722,654,987日本円
			33,590,883,777.72米ドル

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)

2022年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー(チューリッヒ)は117本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (米ドル)
1	UBS (Lux) Bond Sicav - Convert Global (EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月23日	5,017,000,703
2	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月26日	3,718,475,443
3	UBS (Lux) Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月29日	2,803,419,706
4	UBS (Lux) Institutional Fund - Equities Europe (ex UK ex Switzerland) Passive II	契約型投資信託	2020年5月13日	2,509,896,002
5	Focused Sicav - World Bank Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2018年2月14日	2,452,508,305
6	UBS (Lux) Fund Solutions - Sustainable Development Bank Bonds UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2018年11月8日	1,793,896,945
7	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2005年8月30日	1,757,025,005
8	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond EUR	変動資本を有する 投資法人	2006年11月2日	1,678,120,278
9	UBS (Lux) Strategy Sicav - Systematic Allocation Portfolio Medium (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年6月1日	1,643,246,668
10	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR Sustainable	契約型投資信託	1989年10月11日	1,577,986,042

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、フォーカス・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド(フォーカス・シキャブ-グローバル・ボンド、フォーカス・シキャブ-ハイ・グレード・ボンド・米ドルおよびハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル)に関連する部分のみを翻訳している。なお、グローバル・ボンド、ハイ・グレード・ボンド・米ドルおよびハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc投資証券
 - グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc投資証券
 - ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券
 - ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券
 - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券
 - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券
- c . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。
- d . ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2022年5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=128.21円)で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

(1) 資産及び負債の状況

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

純資産計算書

2022年4月30日現在

	2022年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	566,881,002.53	72,679,813
投資有価証券、未実現評価(損)益	(62,508,057.25)	(8,014,158)
投資有価証券合計(注1)	504,372,945.28	64,665,655
現金預金、要求払預金および預託金勘定	55,495,432.02	7,115,069
その他の流動資産(マージン)	1,692,531.72	216,999
有価証券売却未収金(注1)	174,370.59	22,356
発行未収金	561,884.18	72,039
有価証券に係る未収利息	3,556,809.80	456,019
流動資産に係る未収利息	755.41	97
その他の未収金	19,260.24	2,469
資産合計	565,873,989.24	72,550,704
負 債		
TBAモーゲージ担保証券に係る未実現損失(注1)	(243,547.79)	(31,225)
金融先物に係る未実現損失(注1)	(1,167,096.83)	(149,633)
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(1,438,898.76)	(184,481)
有価証券購入未払金(注1)	(12,128.85)	(1,555)
買戻未払金	(1,229,120.45)	(157,586)
報酬引当金(注2)	(93,175.47)	(11,946)
年次税引当金(注3)	(4,438.82)	(569)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(12,084.53)	(1,549)
引当金合計	(109,698.82)	(14,064)
負債合計	(4,200,491.50)	(538,545)
期末現在純資産	561,673,497.74	72,012,159

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産計算書

2022年4月30日現在

	2022年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,830,964,238.69	234,747,925
投資有価証券、未実現評価(損)益	(76,593,477.82)	(9,820,050)
投資有価証券合計(注1)	1,754,370,760.87	224,927,875
現金預金、要求払預金および預託金勘定	7,108,131.90	911,334
その他の流動資産(マージン)	263,422.55	33,773
有価証券売却未収金(注1)	45,719,543.98	5,861,703
発行未収金	701,703.05	89,965
有価証券に係る未収利息	5,038,105.85	645,936
前払費用	163.11	21
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,243,672.32	159,451
資産合計	1,814,445,503.63	232,630,058
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(50,004,869.73)	(6,411,124)
有価証券購入未払金(注1)	(1,443,963.73)	(185,131)
買戻未払金	(5,639,008.07)	(722,977)
報酬引当金(注2)	(180,081.01)	(23,088)
年次税引当金(注3)	(13,998.27)	(1,795)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(138,577.83)	(17,767)
引当金合計	(332,657.11)	(42,650)
負債合計	(57,420,498.64)	(7,361,882)
期末現在純資産	1,757,025,004.99	225,268,176

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

2022年4月30日現在

	2022年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,070,837,394.26	521,922,062
投資有価証券、未実現評価(損)益	(379,772,083.83)	(48,690,579)
投資有価証券合計(注1)	3,691,065,310.43	473,231,483
現金預金、要求払預金および預託金勘定	40,807,863.54	5,231,976
その他の流動資産(マージン)	1,144,000.00	146,672
有価証券売却未収金(注1)	73,691,465.79	9,447,983
発行未収金	2,403,008.61	308,090
有価証券に係る未収利息	17,275,858.13	2,214,938
前払費用	6,952.34	891
資産合計	3,826,394,458.84	490,582,034
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(91,594,842.16)	(11,743,375)
有価証券購入未払金(注1)	(3,198,568.42)	(410,088)
買戻未払金	(12,517,293.64)	(1,604,842)
報酬引当金(注2)	(390,776.56)	(50,101)
年次税引当金(注3)	(29,625.23)	(3,798)
その他の手数料および報酬引当金(注2)	(187,910.23)	(24,092)
引当金合計	(608,312.02)	(77,992)
負債合計	(107,919,016.24)	(13,836,297)
期末現在純資産	3,718,475,442.60	476,745,736

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

運用計算書

自2021年11月1日 至2022年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,034.46	133
有価証券に係る利息	6,070,045.25	778,241
貸付証券に係る純収益	69,010.04	8,848
その他の収益（注4）	19,472.12	2,497
収益合計	6,159,561.87	789,717
費 用		
報酬（注2）	(630,547.56)	(80,843)
年次税（注3）	(29,787.83)	(3,819)
その他の手数料および報酬（注2）	(14,086.05)	(1,806)
現金資産および当座借越に係る利息	(27,445.19)	(3,519)
費用合計	(701,866.63)	(89,986)
投資純（損）益	5,457,695.24	699,731
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	947,858.71	121,525
金融先物に係る実現（損）益	(1,925,887.30)	(246,918)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(4,449,963.72)	(570,530)
為替差（損）益	(1,541,297.11)	(197,610)
実現（損）益合計	(6,969,289.42)	(893,533)
当期実現純（損）益	(1,511,594.18)	(193,801)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	(72,676,167.13)	(9,317,811)
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	(7,120.76)	(913)
TBAモーゲージ担保証券に係る未実現評価（損）益	(164,958.53)	(21,149)
金融先物に係る未実現評価（損）益	158,592.83	20,333
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(829,767.46)	(106,384)
未実現評価（損）益の変動合計	(73,519,421.05)	(9,425,925)
運用の結果による純資産の純増（減）	(75,031,015.23)	(9,619,726)

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

運用計算書

自2021年11月1日 至2022年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	422.74	54
有価証券に係る利息	11,084,563.70	1,421,152
貸付証券に係る純収益	229,266.09	29,394
その他の収益（注4）	2,029,347.64	260,183
収益合計	13,343,600.17	1,710,783
費 用		
報酬（注2）	(1,089,951.67)	(139,743)
年次税（注3）	(130,998.79)	(16,795)
その他の手数料および報酬（注2）	(35,574.55)	(4,561)
現金資産および当座借越に係る利息	(1,521.26)	(195)
費用合計	(1,258,046.27)	(161,294)
投資純（損）益	12,085,553.90	1,549,489
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(65,103,970.34)	(8,346,980)
金融先物に係る実現（損）益	4,456,330.20	571,346
先渡為替契約に係る実現（損）益	(8,768,204.43)	(1,124,171)
為替差（損）益	(9,445,719.68)	(1,211,036)
実現（損）益合計	(78,861,564.25)	(10,110,841)
当期実現純（損）益	(66,776,010.35)	(8,561,352)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	(61,592,762.32)	(7,896,808)
金融先物に係る未実現評価（損）益	440,937.77	56,533
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(48,481,744.99)	(6,215,845)
未実現評価（損）益の変動合計	(109,633,569.54)	(14,056,120)
運用の結果による純資産の純増（減）	(176,409,579.89)	(22,617,472)

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2021年11月1日 至2022年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	228.58	29
有価証券に係る利息	28,870,139.40	3,701,441
貸付証券に係る純収益	441,442.94	56,597
その他の収益（注4）	5,002,144.32	641,325
収益合計	34,313,955.24	4,399,392
費 用		
報酬（注2）	(2,239,482.96)	(287,124)
年次税（注3）	(213,725.91)	(27,402)
その他の手数料および報酬（注2）	(65,077.40)	(8,344)
現金資産および当座借越に係る利息	(5,065.15)	(649)
費用合計	(2,523,351.42)	(323,519)
投資純（損）益	31,790,603.82	4,075,873
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(52,190,029.90)	(6,691,284)
金融先物に係る実現（損）益	(5,700,269.30)	(730,832)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(28,127,457.34)	(3,606,221)
為替差（損）益	(22,957,497.71)	(2,943,381)
実現（損）益合計	(108,975,254.25)	(13,971,717)
当期実現純（損）益	(77,184,650.43)	(9,895,844)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	(334,870,806.34)	(42,933,786)
金融先物に係る未実現評価（損）益	(782,656.49)	(100,344)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(86,565,682.20)	(11,098,586)
未実現評価（損）益の変動合計	(422,219,145.03)	(54,132,717)
運用の結果による純資産の純増（減）	(499,403,795.46)	(64,028,561)

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

純資産変動計算書

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	639,116,719.43	81,941,155
発行額	66,072,636.91	8,471,173
買戻額	(67,931,612.72)	(8,709,512)
純発行（買戻）合計	(1,858,975.81)	(238,339)
支払分配金	(553,230.65)	(70,930)
投資純（損）益	5,457,695.24	699,731
実現（損）益合計	(6,969,289.42)	(893,533)
未実現評価（損）益の変動合計	(73,519,421.05)	(9,425,925)
運用の結果による純資産の純増（減）	(75,031,015.23)	(9,619,726)
期末現在純資産	561,673,497.74	72,012,159

発行済投資証券数の変動表

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(口)	
クラス米ドルF-acc		
期首現在発行済投資証券数	1,612,030.4850	
期中発行投資証券数	119,330.3320	
期中買戻投資証券数	(205,470.7410)	
期末現在発行済投資証券数	<u>1,525,890.0760</u>	
クラス円ヘッジF-acc		
期首現在発行済投資証券数	488,147.2080	
期中発行投資証券数	126,931.0000	
期中買戻投資証券数	(71,669.0000)	
期末現在発行済投資証券数	<u>543,409.2080</u>	

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり 分配金額
該当なし				

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

最重要数値

日付	ISIN	2022年4月30日	2021年10月31日	2020年10月31日
純資産額(米ドル)		561,673,497.74	639,116,719.43	552,660,833.03
クラス米ドルF-acc	LU0326808440			
発行済受益証券口数(口)		1,525,890.0760	1,612,030.4850	1,299,726.6010
1口当たり純資産価格(米ドル)		151.80	163.28	164.26
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		151.80	163.28	164.26
クラス円ヘッジF-acc	LU1490620330			
発行済投資証券数(口)		543,409.2080	488,147.2080	342,950.2080
1口当たり純資産価格(円)		10,244	11,044	11,149
1口当たり発行・買戻価格(円) ¹		10,244	11,044	11,149

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	30.93
中国	9.31
日本	8.53
イギリス	4.64
フランス	3.79
カナダ	3.62
オーストラリア	3.05
ニュージーランド	3.02
スペイン	2.53
イタリア	2.45
オランダ	2.40
ルクセンブルグ	1.96
アイルランド	1.90
韓国	1.90
ドイツ	1.61
ベルギー	1.47
インド	0.61
スロベニア	0.47
ケイマン諸島	0.47
メキシコ	0.44
ベネズエラ	0.38
スウェーデン	0.38
スイス	0.35
サウジアラビア	0.30
ポーランド	0.29
シンガポール	0.29
ルーマニア	0.25
香港	0.24
タイ	0.21
チリ	0.20
ノルウェー	0.20
バミューダ	0.19
フィリピン	0.19
国際	0.18
カタール	0.17
デンマーク	0.15
フィンランド	0.15
ブラジル	0.13
ブルガリア	0.09
チェコ共和国	0.08
ペルー	0.07
インドネシア	0.07
マレーシア	0.05
ジャージー	0.05
エクアドル	0.04
合計	89.80

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	40.15
銀行および金融機関	17.04
モーゲージおよび貸付機関	9.43
金融および持株会社	7.06
エネルギー・水道	1.68
石油	1.46
交通・運輸	1.42
保険	1.24
通信	1.01
国際機関	0.99
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	0.97
不動産	0.91
投資信託	0.82
公共、非営利機関	0.81
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.68
医薬品・化粧品・医療品	0.56
たばこ・アルコール	0.54
機械工学・産業機器	0.41
化学	0.37
その他の非分類会社	0.34
電気装置・部品	0.25
都市・地方自治体	0.23
小売り・百貨店	0.18
鉱業・石炭・鋼鉄	0.17
その他のサービス業	0.17
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.16
ヘルスケア・社会福祉	0.15
自動車	0.15
航空宇宙産業	0.12
繊維・衣服・革製品	0.12
食品・清涼飲料	0.06
バイオテクノロジー	0.06
梱包業	0.05
その他の消費財	0.04
合計	89.80

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,349,798,222.03	173,057,630
発行額	2,712,798,498.76	347,807,896
買戻額	(2,127,666,605.33)	(272,788,135)
純発行（買戻）合計	585,131,893.43	75,019,760
支払分配金	(1,495,530.58)	(191,742)
投資純（損）益	12,085,553.90	1,549,489
実現（損）益合計	(78,861,564.25)	(10,110,841)
未実現評価（損）益の変動合計	(109,633,569.54)	(14,056,120)
運用の結果による純資産の純増（減）	(176,409,579.89)	(22,617,472)
期末現在純資産	1,757,025,004.99	225,268,176

発行済投資証券数の変動表

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(口)	
クラスF-acc		
期首現在発行済投資証券数	3,518,934.5730	
期中発行投資証券数	6,145,080.7420	
期中買戻投資証券数	(5,435,130.2340)	
期末現在発行済投資証券数	4,228,885.0810	
クラス円ヘッジF-acc		
期首現在発行済投資証券数	100,247.0000	
期中発行投資証券数	67,530.0000	
期中買戻投資証券数	(7,380.0000)	
期末現在発行済投資証券数	160,397.0000	

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	分配落ち日	支払日	通貨	1口当たり 分配金額
該当なし				

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2022年4月30日	2021年10月31日	2020年10月31日
純資産額(米ドル)		1,757,025,004.99	1,349,798,222.03	1,451,498,055.36
クラスF-acc	LU0224580786			
発行済受益証券口数(口)		4,228,885.0810	3,518,934.5730	3,499,351.2390
1口当たり純資産価格(米ドル)		150.23	157.33	158.35
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		150.20	157.33	158.35
クラス円ヘッジF-acc	LU1786948718			
発行済受益証券口数(口)		160,397.0000	100,247.0000	96,770.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		9,810	10,295	10,391
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		9,808	10,295	10,391

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	55.16
カナダ	7.09
国際	5.36
ドイツ	4.90
フランス	2.92
オーストラリア	2.92
シンガポール	2.45
スウェーデン	2.18
フィリピン	1.83
韓国	1.82
ノルウェー	1.46
ルクセンブルグ	1.36
イギリス	1.33
オランダ	1.01
フィンランド	1.00
中国	0.93
ベルギー	0.91
カタール	0.84
スイス	0.79
アラブ首長国連邦	0.71
日本	0.58
コートジボワール	0.56
ケイマン諸島	0.50
英領ヴァージン諸島	0.36
ジャージー	0.36
香港	0.29
オーストリア	0.19
サウジアラビア	0.04
合計	99.85

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	42.57
銀行および金融機関	22.46
国際機関	13.10
金融および持株会社	4.90
モーゲージおよび貸付機関	4.25
公共、非営利機関	2.24
石油	1.96
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.87
郡、連邦州	1.83
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.56
その他のサービス業	0.93
食品・清涼飲料	0.59
建築業・資材	0.36
交通・運輸	0.28
投資信託	0.27
バイオテクノロジー	0.26
その他の消費財	0.26
医薬品・化粧品・医療品	0.16
合計	99.85

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,294,398,605.83	294,164,845
発行額	4,045,898,186.62	518,724,607
買戻額	(2,116,736,161.64)	(271,386,743)
純発行（買戻）合計	1,929,162,024.98	247,337,863
支払分配金	(5,681,392.75)	(728,411)
投資純（損）益	31,790,603.82	4,075,873
実現（損）益合計	(108,975,254.25)	(13,971,717)
未実現評価（損）益の変動合計	(422,219,145.03)	(54,132,717)
運用の結果による純資産の純増（減）	(499,403,795.46)	(64,028,561)
期末現在純資産	3,718,475,442.60	476,745,736

発行済投資証券数の変動表

	自2021年11月1日 至2022年4月30日	
	(口)	
クラスF-acc		
期首現在発行済投資証券数	4,375,187.4690	
期中発行投資証券数	7,482,078.8720	
期中買戻投資証券数	(4,225,480.2840)	
期末現在発行済投資証券数	7,631,786.0570	
クラス円ヘッジF-acc		
期首現在発行済投資証券数	235,162.0000	
期中発行投資証券数	121,546.0000	
期中買戻投資証券数	(10,104.0000)	
期末現在発行済投資証券数	346,604.0000	

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル	分配落日	支払日	通貨	1口当たり 分配金額
該当なし				

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2022年4月30日	2021年10月31日	2020年10月31日
純資産額(米ドル)		3,718,475,442.60	2,294,398,605.83	3,338,824,962.37
クラスF-acc	LU0270450066			
発行済受益証券口数(口)		7,631,786.0570	4,375,187.4690	5,812,675.0530
1口当たり純資産価格(米ドル)		184.96	203.60	208.51
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		184.96	203.60	208.51
クラス円ヘッジF-acc	LU1786951779			
発行済受益証券口数(口)		346,604.0000	235,162.0000	209,460.0000
1口当たり純資産価格(米ドル)		9,700	10,708	11,011
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		9,700	10,708	11,011

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	69.89
カナダ	4.84
国際	4.75
ルクセンブルグ	2.81
ドイツ	2.77
フィリピン	2.19
アラブ首長国連邦	1.56
カタール	1.43
ノルウェー	1.43
オーストラリア	1.35
韓国	1.34
フランス	1.29
香港	0.98
オランダ	0.80
フィンランド	0.68
シンガポール	0.65
英領ヴァージン諸島	0.48
ベルギー	0.02
合計	99.26

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	50.57
国際機関	14.66
銀行および金融機関	6.83
金融および持株会社	5.69
郡、連邦州	3.77
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	3.59
モーゲージおよび貸付機関	3.27
石油	1.98
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.47
公共、非営利機関	1.29
小売り・百貨店	1.03
バイオテクノロジー	0.99
その他の消費財	0.93
その他のサービス業	0.89
医薬品・化粧品・医療品	0.81
食品・清涼飲料	0.71
都市・地方自治体	0.30
エネルギー・水道	0.24
交通・運輸	0.17
投資信託	0.07
合計	99.26

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ

財務書類に対する注記

2022年4月30日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

財務書類は、ルクセンブルグにおける投資信託に関する一般に公正妥当と認められる会計原則に従って作成されている。重要な会計方針は、以下のように要約される。

a) 純資産額の計算

各サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券1口当たりの純資産価格、発行価格および買戻価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの計算通貨で表示され、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産総額を当該サブ・ファンドの投資証券クラスの投資証券数で除することにより営業日毎に計算される。

この場合の「営業日」は、ルクセンブルグの通常の銀行営業日(すなわち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日)を指し、12月24日および31日、ルクセンブルグの個々の法定外休日ならびにサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価することができない日等を含まない。

サブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額の百分率は、投資証券の発行または買戻しの度に変動する。この百分率は、投資証券クラスに請求される報酬を考慮し、サブ・ファンドの発行済投資証券総数に対する各投資証券クラスの発行済投資証券の比率によって決定される。

b) 評価原則

- 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形および売掛金、前払費用、現金配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、評価額が決定される。
- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。これらの証券、派生商品もしくはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の価格が適用される。

証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の資産で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、定期的に運営され、認知され、公開されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。
- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていない派生商品(OTC派生商品)は、独立の値付機関に基づき評価される。派生商品に利用可能である独立の値付機関が1社のみの場合、得られた評価の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の市場価格に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算方法によって検証される。

- その他の譲渡性証券集合投資事業(UCITS)および/または集合投資事業(UCIs)の受益証券は、その最終純資産価額で評価される。特定のその他のUCITSおよび/またはUCIsの受益証券は、ポートフォリオ・マネージャーまたは投資顧問会社から独立した、信頼できるサービス・プロバイダーによって提供される見積評価額(価値評価)に基づいて評価される。
- 証券取引所または公開されている他の規制市場で取引されていない短期金融商品は、関連するカーブに基づいて評価される。カーブに基づく評価は、金利および信用スプレッドの2要素を参照する。このプロセスには次の原則が適用される。各短期金融商品には、残余期間が最も近い金利が補間される。このように計算された金利は、裏付けとなる借り手を反映する信用スプレッドを加えることによって市場価格に転換される。この信用スプレッドは、借り手の信用格付に重大な変更がある場合には調整される。
- 注文日から決済日までの間にサブ・ファンドが得た利息収入は、関連するサブ・ファンドの資産の評価に含まれる。そのため、評価日における投資証券1口当たりの資産価格は、予定される利息収入を含む。
- 関連するサブ・ファンドの参照通貨以外の通貨で表示され、為替取引によるヘッジを行わない証券、短期金融商品、派生商品およびその他の投資対象は、ルクセンブルグにおける為替相場の仲値(売買相場の仲値)または、入手不能な場合は、当該通貨の最も代表的な市場におけるレートで評価される。
- 定期預金および信託投資資産は、額面価額に累積利息を付して評価される。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社によって計算され、また別の外部サービス提供会社による第二の独立した評価も利用される。かかる計算は、流入および流出の両方のすべてのキャッシュ・フローの正味現在価値に基づいている。特定の場合に、(ブルームバーグより入手可能なモデルと市場データに基づいた)内部での算出額、および/またはブローカー・ステイトメントの評価を利用することもできる。評価方法は、各有価証券によって異なり、適用されるUBS評価方針に従って決定される。

特別な状況に起因して、上記の規則による評価が実行不可能または不正確になった場合、本投資法人は、誠実に純資産額の適切な評価を遂行するために他の一般に認められておりかつ精査が可能な評価基準を用いる権限を付与されている。

これらの評価基準は、取引または価格設定モデルによる市場の相場、ならびにポートフォリオの評価時点でこれらの証券の公正価値を判断する際に信頼性があり、かつ適切であると取締役会が考えるブローカーの声明を含むその他のあらゆるソースに基づき、取締役会によって慎重に決定される。

特別な状況のもとで、さらなる評価は、当該日に限り行うことができる。これらの新評価は、爾後に発行もしくは買戻される投資証券について正式なものとなる。

報酬および手数料ならびに投資資産の売買スプレッドにより、サブ・ファンドの資産および投資対象の売買に係る実際の費用は、入手可能な最新の価格または該当する場合は投資証券1口当たり純資産価格を計算するために用いられる純資産価額とは異なることがある。当該費用は、サブ・ファンドの価値にマイナスの影響を及ぼすものであり「希薄化」と称される。希薄化の影響を軽減するために、取締役会はその裁量により、投資証券1口当たり純資産価格に対して希薄化調整を行うことができる(スイング・プライシング)。

投資証券は、通常、単一の価格である純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。しかしながら、希薄化の影響を軽減するために、投資証券1口当たり純資産価格は、以下に記載するとおり評価日に調整される。これは、サブ・ファンドが関連する評価日において正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに関係なく行われる。特定の評価日において、いずれかのサブ・ファンドまたはサブ・ファンドのクラスにおいて取引が行われない場合、未調整の投資証券1口当たり純資産価格が適用される。かかる希薄化調整が行われる状況は、取締役会の裁量により決定される。希薄化調整を実行するための要件は、通常、関連するサブ・ファンドにおける投資証券の申込みまたは買戻しの規模に左右される。取締役会は、その見解において、既存の投資主(申込みの場合)または残存する投資主(買戻しの場合)が損害を被る可能性がある場合、希薄化調整を行うことができる。希薄化調整は、以下の場合に行われることがある。

- (a) サブ・ファンドが一定の下落(すなわち買戻しによる純流出)を記録した場合。
- (b) サブ・ファンドがその規模に比べて大量の正味申込みを記録した場合。
- (c) サブ・ファンドが特定の評価日において正味申込ポジションまたは正味買戻ポジションを示した場合。または、
- (d) 投資主の利益のために希薄化調整が必要であると取締役会が確信するその他のあらゆる場合。

評価額調整が行われる場合、サブ・ファンドが正味申込ポジションにあるかまたは正味買戻ポジションにあるかに応じて、投資証券1口当たり純資産価格に価値が加算されるかまたは投資証券1口当たり純資産価格から価値が控除される。評価額調整の範囲は、取締役会の意見において、報酬および手数料ならびに売買価格のスプレッドを十分にカバーするものとする。特に、各サブ・ファンドの純資産価額は、()見積もり税金費用、()サブ・ファンドが負担する可能性がある取引費用および()サブ・ファンドが投資する資産の想定売買スプレッドを反映する金額分が(上方または下方に)調整される。一部の株式市場および国々では買主および売手の側に異なる手数料体系を示すことがあるため、純流入および純流出の調整は異なることがある。調整は通常、その時点の投資証券1口当たり実勢純資産価格の最大2%に制限されるものとする。取締役会は、例外的な状況(例えば、高い市場ボラティリティおよび/または流動性、例外的な市況、市場の混乱等)において、サブ・ファンドおよび/または評価日に関して、その時点の投資証券1口当たり実勢純資産価格の2%を超える希薄化調整を一時的に適用することを決定することができる。ただし、当該調整が実勢の市況を代表するものであることおよび投資主の最善の利益に資するものであることを取締役会が正当化できることを条件とする。当該希薄化調整は、取締役会が決定した方法に従って計算される。投資主は、一時的措置が導入された時点および終了した時点で、通常の連絡経路を通じて通知される。

サブ・ファンドの各クラスの純資産価額は個別に計算される。ただし、希薄化調整は、各クラスの純資産価額に対してパーセンテージの点において同程度の影響を及ぼす。希薄化調整はサブ・ファンドのレベルで行われ資本活動に関連するが、各個人投資家の取引の特定の状況には関連しない。

シングル・スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

c) 先渡為替契約の評価

未決済の先渡為替契約の未実現(損)益は、評価日の実勢先渡為替レートに基づいて評価される。

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て保有される銀行勘定、その他の純資産および投資有価証券評価額は、評価日の最終現物相場の仲値で換算される。個々のサブ・ファンドの通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払日の最終現物相場の仲値で換算される。為替差損益は運用計算書に計上される。

個々のサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て証券の取得原価は、取得日の最終現物相場の仲値で換算される。

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2022年4月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書および連結純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目をユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2022年4月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1ユーロ	=	1.023987	スイスフラン
1ユーロ	=	0.840263	英ポンド
1ユーロ	=	1.054950	米ドル

i) 「モーゲージ担保証券」

本投資法人はその投資方針に従い、「モーゲージ担保証券」に投資することができる。「モーゲージ担保証券」は、証券の形態に統合されたモーゲージ・プールへの参加を意味するものである。対象モーゲージに係る元本および利息の支払いは、モーゲージ担保証券の保有者にパススルーされ、そのうちの元本部分により証券のコスト・ベースが減少する。元本および利息の支払いは、米国の準政府機関により保証されることがある。利益または損失は、各元本に対する支払いがある都度計算される。この利益または損失は、運用計算書の「有価証券の売却に係る実現純利益または損失」に計上されている。さらに、対象モーゲージの期限前返済により証券の残存期間が短縮することがあり、それにより本投資法人の予想利回りが影響を受けることがある。

「モーゲージ担保証券」について、証券の額面価格に適用されるべき要因が、評価日現在1つ以上である場合、財務書類に表示される額面価格はこの要因を反映するよう調整される。その他の場合、表示される額面価格は、1要因についての影響を反映する。

j) モーゲージ関連証券 - TBA証券

TBAポジションは、モーゲージ・プール(ジニー・メイ、ファニー・メイまたはフレディ・マック)からの証券が、将来日において定められた価格で取得される場合のモーゲージ・バック証券市場に係る一般的な取引慣行に関連する。かかる証券の正確な構成については購入時点では知ることは出来ないが、その主な特性についてはすでに定義されている。現時点で価格も設定されているものの、額面価格についてはまだ明確に設定されていない。

TBAポジションは、純資産計算書の「投資有価証券、未実現評価(損)益」の項目に含まれる。投資有価証券その他の純資産明細表において、TBAポジションは、「モーゲージ関連証券、固定利付債」の投資有価証券として個別に開示されている。

これらのTBAポジションは、「TBAモーゲージ担保証券に係る未実現(損)益」に含まれる。2022年4月30日現在、TBAポジションの価格は、サブ・ファンドのフォーカス・シキャブ - グローバル・ボンドにおける12,253,051.78米ドルである。

k) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」という項目には、外貨取引による未収金が含まれる。また「有価証券購入未払金」という項目には、外貨取引による未払金が含まれる。

外貨取引による未収金および未払金は、相殺される。

l) 収益の認識

源泉税控除後の配当金は、当該証券が「配当落ち」として最初に記載される日に収益として認識される。受取利息は、日々ベースで発生する。

m) スワップ

本投資法人は、その分野の取引において専門性を持つ一流金融機関を相手方として、金利スワップ契約、金利スワップシジョンに係る先渡レート契約、およびクレジット・デフォルト・スワップを締結することができる。

未実現損益の変動は、運用計算書の「スワップに係る未実現評価(損)益」の変動の項目に含まれる。

手じまいまたは満期到来により生じたスワップに係る損益は、運用計算書の「スワップに係る実現(損)益」に計上される。

注2 - 報酬

本投資法人は、サブ・ファンドの平均純資産額で計算される月次定率報酬を、名称に「F」が付く投資証券クラスのために支払う。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

名称に「F」が付く投資証券クラス	上限定率報酬	名称に「ヘッジ」が付く投資証券クラス の上限定率報酬
名称に「F」が付く投資証券クラス	2.000%	2.030%

フォーカス・シキャブ	実効定率報酬	
	2021年10月31日	2022年4月30日
- グローバル・ボンド クラス米ドルF - acc	0.20%	0.20%
- グローバル・ボンド クラス円ヘッジF - acc	0.21%	0.21%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF - acc	0.12%	0.12%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF - acc	0.13%	0.13%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF - acc	0.14%	0.14%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF - acc	0.15%	0.15%

定率報酬は、当会計年度中に変更された。詳細については、上記の表を参照のこと。

上限定率報酬は、下記のように使用される。

- 本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等）に関して、管理会社は、本投資法人の資産から、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬を受領する。当該報酬は、純資産の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限定率料率）。
当該報酬は、運用計算書において「報酬」として開示される。
- 上限定率報酬は、以下の報酬および本投資法人にも請求される追加費用を含まない。
 - 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値スプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくシングル・スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
 - 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
 - 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。

- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト(翻訳コストを含む)。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト(目論見書、KIID、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書)。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト(該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む)。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用(外部顧問報酬を含む)。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用(例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト)を本投資法人の資産に対して請求できる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、当該コストは、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用比率(TER)の開示において考慮される。
- l) 本投資法人の取締役を支払われる手数料、コストおよび費用(合理的な立替費用、保険料および取締役会に関連する合理的な交通費ならびに取締役の報酬)。

当該手数料および報酬は、運用計算書において「その他の手数料および報酬」として開示される。

3. 管理会社は、本投資法人の販売業務をカバーするために手数料を支払うことができる。

販売報酬は、運用手数料から本投資法人の販売会社および資産運用会社に支払われる。

保管受託銀行、管理事務代行会社および本投資法人は、投資者の利益のためこれらが行う特別手配に係る費用の払戻しを受ける権利を有するが、かかる費用は本投資法人に対し直接請求されることもある。

定率管理報酬を有していない他のファンドのプロバイダーの報酬規定との一般的な比較可能性の目的のために、管理報酬の上限は、定率管理報酬の80%で設定している。

本投資法人はまた、本投資法人資産の管理事務に関連して生じる一切の取引費用(市場に沿ったブローカー手数料、報酬、税金等)も負担する。

本投資法人の収益および資産に対し課せられる一切の税金、特に年次税("taxe d'abonnement")(申込み税)は、これもまた本投資法人が負担する。

個々のサブ・ファンドに割当てられる費用はすべて、当該サブ・ファンドに請求される。投資証券クラスに割当てられる費用は、当該投資証券クラスに請求される。費用が複数またはすべてのサブ・ファンド/投資証券クラスに関連する場合には、これらの費用について当該サブ・ファンド/投資証券がその純資産額に比例して負担する。

その投資方針の条項に従ってその他の投資信託（UCIsまたはUCITS）に投資するサブ・ファンドの場合、当該対象ファンドおよびサブ・ファンドの両段階で支払いが生じる。

共同経営もしくは支配を通じて、または実質的な直接保有もしくは間接保有することにより、管理会社または他の関連会社によって直接的もしくは間接的に運営されるファンドの受益証券に投資を行う場合、投資を行うサブ・ファンドは、対象ファンドの発行または買戻手数料を請求されることはない。

本投資法人の現行の手数料の詳細は、KIIDに記載されている。

注3 - 年次税

ルクセンブルグの現行法規に準拠して、本投資法人は、四半期毎に支払われ各四半期末日の本投資法人の純資産額に基づいて計算される年率0.05%の年次税、または幾つかの投資証券クラスに関して年率0.01%になる減額された年次税を課されている。

ルクセンブルグ法の法定条項に準拠して、既に年次税を支払っている他の投資信託の受益証券もしくは投資証券に投資されている本投資法人の資産の部分に関して、年次税は課されない。

注4 - その他の収益

その他の収益は、主にスイング・プライシングから生じた収益で構成される。

注5 - 収益の分配

当該サブ・ファンドの投資主総会は、取締役会の提案によりサブ・ファンドの年次決算の終了後に、各サブ・ファンドおよび/または投資証券クラスから分配金を支払うか否か、またどの程度の分配金を支払うかを決定する。本投資法人の純資産が法律に規定されている最低資産額を下回る場合には、分配金の支払いは行われず。分配が行われる場合、支払いは会計年度が終了してから4ヶ月以内に行われる。

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

収入調整金は、分配金と実際に収入を受け取る権利が一致するように計算される。

注6 - ソフト・コミッション協定

2021年11月1日から2022年4月30日までの期間において、フォーカス・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション協定」はなく、「ソフト・コミッション協定」の金額はゼロである。

注7 - 金融先物契約、オプションおよびスワップ

2022年4月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物契約、オプションおよびスワップならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

フォーカス・シキャブ	債券に係る金融先物 (購入)	債券に係る金融先物 (売却)
- グローバル・ボンド	48,921,351.45米ドル	13,656,176.81米ドル
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	67,460,000.00米ドル	126,755,859.38米ドル
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

フォーカス・シキャブ	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (売却)
- グローバル・ボンド	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

債券または指数に係る金融先物契約(もしあれば)は、当該金融先物の時価(契約数×想定取引規模×当該先物の市場価格)に基づき計算される。

b) オプション

フォーカス・シキャブ	指数オプション従来型(売却)
- グローバル・ボンド	該当なし
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル	該当なし
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル	該当なし

c) スワップ

フォーカス・シキャブ	クレジット・デフォルト・ スワップ(購入)	クレジット・デフォルト・ スワップ(売却)
- グローバル・ボンド	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

注8 - 総費用比率 (TER)

この比率は、スイス資産運用協会 (AMAS) / スイス・ファンド資産運用協会 (SFAMA) の「TERの計算ならびに開示に関するガイドライン」現行版に従って計算された。比率はまた、純資産の百分率として遡及的に計算され、純資産 (運用費用) に対し継続ベースで請求されるすべての費用および手数料の合計を表す。

過去12ヶ月のTERは、以下のとおりである。

フォーカス・シキャブ	総費用比率 (TER)
- グローバル・ボンド クラス米ドルF - acc	0.21%
- グローバル・ボンド クラス円ヘッジF - acc	0.22%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF - acc	0.14%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF - acc	0.15%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF - acc	0.16%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF - acc	0.17%

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

通貨ヘッジに関連して発生した取引費用、利息費用、貸付証券費用およびその他の費用は、TERに含まれていない。

定率報酬は、当会計年度中に変更される場合がある (注2を参照のこと。)。

注9 - 名称変更

以下の名称変更が生じた。

旧名称	新名称	日付
該当なし		

注10 - 事象

ウクライナにおける戦争は、第一にロシアやウクライナの証券、さらに世界的に広範な市場に依然として重大な影響を及ぼしている。このような状況は依然として非常に不安定であり、投資者の利益を守るために迅速に適切な措置をとるため、本投資法人の経営陣によって慎重に監視されている。

EU、スイス、英国、米国および国際連合 (UN) において、特に最近制定された制裁制度に限定されるものではないが、適用される法律および規則を常に遵守するために必要な措置を講じている。制裁を受けたロシア証券を超えて深刻な取引制限を経験しているため、相場価格 (もし入手可能であれば) が、その時々市場価値を反映していないと考えられるすべての該当証券に公正価値の価格設定が適用される。

また、本投資法人の経営陣の評価によると、本報告書の日付時点において、本投資法人およびそのサブ・ファンドの業績、継続企業の前提または業務には、上記の事象が重大な影響を及ぼしていない。

注11 - 適用法、業務地および公認言語

ルクセンブルグ地方裁判所は、投資主、本投資法人およびカストディアンとの間ですべての法的紛争処理を行う場所である。ルクセンブルグ法が適用される。しかし、他の国の投資者の賠償請求に関する件については、本投資法人および/またはカストディアンは、本投資法人投資証券が売買された国の裁判管轄権に自らを服することを選択することができる。

当財務書類についてはドイツ語版が公認されたものである。しかし、本投資法人投資証券の購入および売却が可能なその他の国の投資主に対して投資証券が販売される場合、管理会社および保管受託銀行は、当該国の言語への承認された翻訳（すなわち、管理会社および保管受託銀行によって承認されたもの）に自らが拘束されるものと認めることができる。

注12 - 貸付証券

本投資法人は、第三者にファンドの組入証券の一部を貸付けることができる。一般的に、貸付は、クリアストリーム・インターナショナルもしくはユーロクリアのような公認の決済機関、または同種の業務を専門とする第一級の金融機関の仲介を通して、それらの機関が設定した方法に従ってのみ行われる。貸付証券の収益および費用は、運用計算書に別個に計上される。担保は、貸付証券に関連して受領される。担保は、一般的に借入れられた証券の少なくとも時価に相当する金額の高格付証券から構成される。

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、証券の貸付機関として行為する。

	2022年4月30日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー*		2022年4月30日現在の 担保の内訳(%)		
	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・スイス・ エイ・ジー)	株式	債券	現金
フォーカス・シキャブ					
- グローバル・ボンド	105,892,008.07 米ドル	112,615,907.01 米ドル	48.93	51.07	0.00
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	257,237,415.59 米ドル	273,571,399.80 米ドル	48.93	51.07	0.00
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	1,281,393,698.35 米ドル	1,362,759,250.81 米ドル	48.93	51.07	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2022年4月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2022年4月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

	フォーカス・シキャブ		
	- グローバル・ボンド	- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル
貸付証券収益	115,016.73 米ドル	382,110.15 米ドル	735,738.23 米ドル
貸付証券コスト	46,006.69 米ドル	152,844.06 米ドル	294,295.29 米ドル
純貸付証券収益	69,010.04 米ドル	229,266.09 米ドル	441,442.94 米ドル

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

2022年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	280 000.00	299 165.76	0.05
EUR BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23	150 000.00	161 242.78	0.03
EUR BP CAPITAL MARKETS BV-REG-S 0.93300% 20-04.12.40	380 000.00	285 615.68	0.05
EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28	585 000.00	492 087.34	0.09
EUR CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	1 160 000.00	1 024 883.92	0.18
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 340 000.00	1 339 275.91	0.24
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-11.02.25	700 000.00	706 157.16	0.13
EUR FISERV INC 1.62500% 19-01.07.30	625 000.00	613 024.85	0.11
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 3.37500% 20-27.03.25	435 000.00	477 888.08	0.08
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	565 000.00	529 771.12	0.09
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28	420 000.00	369 701.57	0.07
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.12500% 20-11.02.28	300 000.00	291 028.84	0.05
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31	300 000.00	279 417.65	0.05
EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	300 000.00	283 369.32	0.05
EUR NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANS-REG-S 0.19000% 20-20.01.25	100 000.00	101 982.44	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	100 000.00	103 437.85	0.02
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	340 000.00	332 948.21	0.06
EUR VONOVIA SE-REG-S 2.37500% 22-25.03.32	300 000.00	300 217.05	0.05
ユーロ合計		7 991 215.53	1.42
英ポンド			
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.50000% 21-28.08.27	250 000.00	298 213.23	0.05
英ポンド合計		298 213.23	0.05
米ドル			
USD 3M CO 2.65000% 20-15.04.25	220 000.00	216 074.46	0.04
USD ABBOTT LABORATORIES 4.90000% 16-30.11.46	160 000.00	174 839.36	0.03
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	200 000.00	199 350.70	0.04
USD ABBVIE INC 4.40000% 13-06.11.42	310 000.00	294 171.37	0.05
USD ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48	170 000.00	170 281.80	0.03
USD ADOBE INC 2.15000% 20-01.02.27	215 000.00	202 654.95	0.04
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.50000% 20-15.09.23	150 000.00	150 301.31	0.03
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	160 000.00	165 843.24	0.03
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	1 625 000.00	1 445 116.61	0.26
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30	210 000.00	184 162.82	0.03
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.52	1 560 000.00	1 301 501.91	0.23
USD ALBEMARLE CORPORATION 5.45000% 14-01.12.44	200 000.00	204 465.97	0.04
USD ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26	102 000.00	103 113.00	0.02
USD ALTRIA GROUP INC 4.80000% 19-14.02.29	14 000.00	13 866.16	0.00
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	650 000.00	654 693.38	0.12
USD ANHEUSER-BUSCH COS 3.65000% 19-01.02.26	150 000.00	149 040.46	0.03
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	380 000.00	391 066.82	0.07
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.50000% 20-01.06.50	310 000.00	290 050.10	0.05
USD ANTHEM INC 3.65000% 17-01.12.27	130 000.00	127 150.32	0.02
USD APPLE INC 1.80000% 19-11.09.24	160 000.00	156 332.74	0.03
USD APPLE INC 3.85000% 16-04.08.46	420 000.00	398 050.85	0.07
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	1 220 000.00	1 226 306.55	0.22
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	510 000.00	514 866.50	0.09
USD AT&T INC 4.75000% 15-15.05.46	550 000.00	544 966.89	0.10
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 0.50000% 20-28.04.23	1 445 000.00	1 419 264.55	0.25

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BOEING CO/THE 2.19600% 21-04.02.26	570 000.00	519 890.52	0.09
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO 4.25000% 20-26.10.49	750 000.00	720 187.14	0.13
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.60000% 20-16.05.22	335 000.00	335 221.32	0.06
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.30000% 22-07.04.25	870 000.00	857 277.42	0.15
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 2.45000% 21-02.12.31	750 000.00	652 358.84	0.12
USD CHEVRON USA INC 3.85000% 21-15.01.28	150 000.00	151 130.10	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.86000% 17-21.06.47	630 000.00	546 249.38	0.10
USD CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	375 000.00	328 108.51	0.06
USD CIGNA CORP 4.90000% 19-15.12.48	80 000.00	79 553.27	0.01
USD CITIGROUP INC 4.65000% 18-23.07.48	425 000.00	418 820.88	0.07
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	140 000.00	140 985.25	0.02
USD CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 6.40000% 07-15.05.37	1 050 000.00	1 151 720.43	0.20
USD COCA-COLA FEMSA SA 2.75000% 20-22.01.30	390 000.00	349 830.00	0.06
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	235 000.00	237 716.55	0.04
USD COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	155 000.00	155 834.63	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.62500% 17-01.08.27	620 000.00	596 285.00	0.11
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	120 000.00	101 860.26	0.02
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	90 000.00	90 399.15	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	115 000.00	115 692.75	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.12500% 15-20.07.45	635 000.00	635 548.83	0.11
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 5.30000% 19-15.05.49	290 000.00	272 394.86	0.05
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	198 120.00	123 800.23	0.02
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	75 600.00	61 179.30	0.01
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	90 800.00	49 134.15	0.01
USD ENERGY TRANSFER LP 6.05000% 11-01.06.41	890 000.00	905 009.28	0.16
USD ENERGY TRANSFER LP 6.00000% 18-15.06.48	210 000.00	205 553.87	0.04
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.85000% 13-15.03.44	140 000.00	134 357.88	0.02
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	590 000.00	564 907.30	0.10
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	910 000.00	865 590.42	0.15
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	415 000.00	401 917.54	0.07
USD FLOWSERVE CORP 3.50000% 20-01.10.30	450 000.00	402 975.73	0.07
USD FOMENTO ECONOMICO MEXIC SAB DE CV 3.50000% 20-16.01.50	540 000.00	433 350.00	0.08
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35	319 000.00	311 780.80	0.06
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	425 000.00	448 632.57	0.08
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	420 000.00	421 568.91	0.08
USD GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23	340 000.00	336 589.04	0.06
USD GILEAD SCIENCES INC 4.80000% 14-01.04.44	350 000.00	343 801.22	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	955 000.00	940 575.21	0.17
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.40000% 18-15.03.48	220 000.00	209 566.32	0.04
USD ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26	410 000.00	396 700.00	0.07
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 2.85000% 19-13.05.22	1 720 000.00	1 720 982.41	0.31
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	985 000.00	971 208.37	0.17
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 13-25.01.23	1 280 000.00	1 289 668.98	0.23
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	235 000.00	237 385.80	0.04
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	350 000.00	305 372.29	0.05
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	1 600 000.00	1 223 300.00	0.22
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.00000% 17-04.10.27	210 000.00	200 104.80	0.04
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	215 000.00	191 860.63	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	890 000.00	748 045.00	0.13
USD MICROSOFT CORP 2.92100% 21-17.03.52	650 000.00	526 924.50	0.09
USD MORGAN STANLEY 6.37500% 12-24.07.42	360 000.00	432 368.33	0.08
USD MPLX LP 5.20000% 17-01.03.47	200 000.00	189 684.39	0.03
USD NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	500 000.00	501 452.44	0.09
USD NATWEST GROUP PLC 4.80000% 16-05.04.26	300 000.00	302 605.70	0.05
USD NIKE INC 2.40000% 20-27.03.25	105 000.00	102 672.32	0.02
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	235 000.00	224 102.54	0.04
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.65000% 19-01.10.26	260 000.00	249 038.10	0.04
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.85000% 19-01.10.29	390 000.00	357 085.97	0.06
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.50000% 20-01.05.25	245 000.00	230 127.61	0.04
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.45700% 20-05.05.30	1 185 000.00	1 051 817.85	0.19
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 4.68000% 15-15.02.45	400 000.00	380 643.42	0.07
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	255 000.00	236 030.82	0.04
USD PUBLIC STORAGE 1.95000% 21-09.11.28	320 000.00	284 295.22	0.05

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31	1 090 000.00	953 750.00	0.17
USD QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47	160 000.00	158 610.23	0.03
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 750 000.00	1 380 802.50	0.25
USD REYNOLDS AMERICAN INC 5.70000% 15-15.08.35	680 000.00	670 882.13	0.12
USD ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48	1 400 000.00	1 269 887.50	0.23
USD ROPER TECHNOLOGIES INC 2.00000% 20-30.06.30	375 000.00	314 662.98	0.06
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31	720 000.00	637 044.55	0.11
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 1.62500% 20-24.11.25	200 000.00	185 600.00	0.03
USD SGSP AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S 3.25000% 16-29.07.26	530 000.00	514 576.66	0.09
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 4.60000% 20-13.07.30	200 000.00	43 000.00	0.01
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 3.45000% 21-11.01.31	340 000.00	68 000.00	0.01
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.20000% 21-16.01.27	505 000.00	111 100.00	0.02
USD SOUTHERN CO 4.40000% 16-01.07.46	120 000.00	109 323.90	0.02
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 4.75000% 20-04.05.23	125 000.00	127 179.79	0.02
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.12500% 20-15.06.27	195 000.00	202 144.44	0.04
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-09.07.25	450 000.00	99 000.00	0.02
USD SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 2.80000% 17-04.05.22	205 000.00	205 000.00	0.04
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 0.75000% 20-15.05.25	1 210 000.00	1 132 575.82	0.20
USD TSMC ARIZONA CORP 3.12500% 21-25.10.41	400 000.00	334 848.00	0.06
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	165 000.00	166 808.90	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	413 000.00	412 603.52	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	1 440 000.00	1 289 576.61	0.23
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	417 000.00	427 257.26	0.08
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.00000% 16-15.11.46	195 000.00	181 106.94	0.03
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	100 000.00	99 021.46	0.02
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	330 000.00	306 664.04	0.05
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.37500% 21-01.05.29	195 000.00	176 958.60	0.03
USD VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24	480 000.00	451 426.27	0.08
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	490 000.00	474 297.66	0.08
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.42100% 19-24.07.39	395 000.00	377 615.54	0.07
USD XLIT LTD 5.25000% 13-15.12.43	605 000.00	672 506.51	0.12
米ドル合計		52 222 196.98	9.30
ノート、固定利付債合計		60 511 625.74	10.77
ノート、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	25 948.00	14 130.31	0.00
米ドル合計		14 130.31	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計		14 130.31	0.00
ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 0.577%/VAR 21-09.08.29	935 000.00	853 532.82	0.15
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	800 000.00	760 509.23	0.14
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	520 000.00	455 316.42	0.08
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 22-PRP	600 000.00	593 409.38	0.11
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	655 000.00	671 690.07	0.12
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32	405 000.00	399 662.63	0.07
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	185 000.00	175 987.98	0.03
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	1 010 000.00	908 293.15	0.16
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN-REG-S-SUB 4.375%/VAR 22-PRP	900 000.00	872 311.78	0.15
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	500 000.00	432 118.07	0.08
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	339 166.43	0.06
ユーロ合計		6 461 997.96	1.15
米ドル			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	400 000.00	362 000.00	0.07
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	750 000.00	748 241.57	0.13
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24	180 000.00	175 077.73	0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	620 000.00	605 938.40	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	610 000.00	536 179.12	0.10
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.574%/3M LIBOR+120.5BP 17-07.11.28	340 000.00	323 009.16	0.06
USD MORGAN STANLEY 0.731%/VAR 21-05.04.24	405 000.00	394 341.43	0.07
USD NATWEST GROUP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23	295 000.00	295 014.38	0.05
USD PRUDENTIAL PLC-SUB-REG-S 2.950%/VAR 21-03.11.33	945 000.00	843 423.84	0.15
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 3.885%/VAR 18-15.03.24	640 000.00	640 028.52	0.11
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	550 000.00	518 504.80	0.09
米ドル合計		5 441 758.95	0.97
ノート、変動利付債合計		11 903 756.91	2.12
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	210 000.00	149 402.15	0.03
AUD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25	1 150 000.00	818 121.95	0.14
AUD QANTAS AIRWAYS LTD 3.15000% 21-27.09.28	440 000.00	270 426.48	0.05
オーストラリア・ドル合計		1 237 950.58	0.22
ユーロ			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	900 000.00	896 944.44	0.16
EUR AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 1.75000% 21-30.07.31	130 000.00	116 859.87	0.02
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY AB-REG-S 1.75000% 17-07.02.25	260 000.00	272 339.57	0.05
EUR AROUNDTOWN SA-REG-S 2.00000% 18-02.11.26	300 000.00	306 209.99	0.05
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	455 000.00	431 976.10	0.08
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	500 000.00	483 852.81	0.09
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 3.25000% 16-04.04.26	200 000.00	215 666.81	0.04
EUR BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUEL-REG-S-SUB 3.00000% 15-11.09.25	200 000.00	215 535.99	0.04
EUR CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMME-REG-S 0.37500% 22-10.03.26	1 230 000.00	1 248 734.29	0.22
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	600 000.00	631 305.05	0.11
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.50000% 21-08.06.28	600 000.00	549 964.85	0.10
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32	600 000.00	504 634.06	0.09
EUR CEZ AS-REG-S 2.37500% 22-06.04.27	405 000.00	420 521.21	0.07
EUR CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26	550 000.00	578 604.84	0.10
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	310 000.00	320 225.65	0.06
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.25000% 16-14.04.26	200 000.00	206 681.58	0.04
EUR CREDIT SUISSE AG/LONDON-REG-S 0.25000% 21-05.01.26	910 000.00	897 321.97	0.16
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	1 280 000.00	1 223 029.02	0.22
EUR DANSKE BANK AS-REG-S 1.37500% 19-24.05.22	515 000.00	543 782.79	0.10
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	200 000.00	198 556.36	0.03
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24	400 000.00	406 155.75	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	1 200 000.00	1 120 356.90	0.20
EUR DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23	615 000.00	641 649.73	0.11
EUR E.ON SE-REG-S 0.87500% 22-08.01.25	400 000.00	416 338.98	0.07
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 1.50000% 17-22.11.27	535 000.00	550 124.62	0.10
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49	200 000.00	162 493.95	0.03
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	170 000.00	164 362.14	0.03
EUR ELIA TRANSMISSION BELGIUM SA-REG-S 0.87500% 20-28.04.30	100 000.00	94 659.62	0.02
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25	1 300 000.00	1 352 372.05	0.24
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	980 000.00	1 044 230.86	0.19
EUR GAS NETWORKS IRELAND-REG-S 0.12500% 19-04.12.24	580 000.00	592 701.08	0.11
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	104 657.63	0.02
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 2.00000% 18-01.11.28	610 000.00	621 029.78	0.11
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	400 000.00	423 387.73	0.08
EUR LINDE PLC-REG-S 1.37500% 22-31.03.31	1 200 000.00	1 198 989.49	0.21
EUR LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.25000% 21-06.04.28	700 000.00	666 987.96	0.12
EUR LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.75000% 21-06.04.33	485 000.00	433 296.55	0.08
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	790 000.00	772 611.89	0.14
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	465 000.00	453 492.40	0.08
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	1 495 000.00	1 414 802.36	0.25
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	550 000.00	552 606.23	0.10
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	1 470 000.00	1 495 413.78	0.27

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25	700 000.00	757 325.41	0.13
EUR ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.62500% 22-23.03.26	1 200 000.00	1 229 544.22	0.22
EUR RTE EDF TRANSPORT SA-REG-S 1.00000% 16-19.10.26	100 000.00	102 611.92	0.02
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 1.00000% 20-15.04.25	280 000.00	292 208.24	0.05
EUR TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON-REG-S 1.12500% 22-08.02.27	425 000.00	394 861.57	0.07
EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32	100 000.00	104 013.64	0.02
EUR TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S 1.25000% 21-24.03.33	600 000.00	504 878.39	0.09
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.50000% 19-24.05.39	320 000.00	306 614.04	0.05
EUR VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG-REG-S 1.50000% 19-01.10.24	390 000.00	408 613.84	0.07
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51	400 000.00	275 211.98	0.05
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	2 395 000.00	2 273 009.88	0.40
ユーロ合計		31 594 361.86	5.63
英ポンド			
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.25000% 17-16.10.24	165 000.00	201 858.41	0.03
GBP PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC-REG-S-SUB 4.12500% 17-20.07.22	400 000.00	503 696.56	0.09
GBP VICINITY CENTRES TRUST-REG-S 3.37500% 16-07.04.26	480 000.00	606 019.61	0.11
英ポンド合計		1 311 574.58	0.23
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25	1 180 000.00	1 183 762.43	0.21
USD DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE-REG-S 0.75000% 20-07.05.23	1 940 000.00	1 904 967.08	0.34
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	910 000.00	862 953.00	0.15
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.20000% 22-30.03.52	315 000.00	295 013.25	0.05
USD GENERAL ELECTRIC CO 6.75000% 02-15.03.32	49 000.00	57 240.67	0.01
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 2.80000% 21-10.02.31	1 255 000.00	1 046 921.00	0.19
USD JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 1.00000% 20-21.05.25	1 940 000.00	1 826 264.01	0.33
USD KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 0.25000% 21-21.07.23	510 000.00	495 123.30	0.09
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	1 400 000.00	1 402 096.39	0.25
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	410 000.00	363 951.88	0.07
USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 21-08.04.31	575 000.00	517 500.00	0.09
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 120 000.00	1 013 110.00	0.18
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	1 530 000.00	1 478 362.50	0.26
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 1.62500% 19-05.09.22	1 660 000.00	1 653 516.54	0.29
米ドル合計		14 100 782.05	2.51
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		48 244 669.07	8.59
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28	2 800 000.00	2 744 859.63	0.49
EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 0.00000% 20-20.02.23	600 000.00	633 053.55	0.11
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	240 000.00	234 483.79	0.04
ユーロ合計		3 612 396.97	0.64
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		3 612 396.97	0.64
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	350 000.00	363 361.71	0.07
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 2.625%/VAR 22-24.03.26	200 000.00	207 086.69	0.04
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 1.875%/VAR 22-05.06.26	505 000.00	522 827.82	0.09
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 3.375%/VAR 20-02.04.25	330 000.00	358 272.54	0.06
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	290 000.00	303 166.78	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.000%/VAR 20-22.04.26	700 000.00	715 934.43	0.13
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	400 000.00	407 636.06	0.07
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30	300 000.00	280 065.81	0.05
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 22-24.06.32	300 000.00	302 243.17	0.05
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	200 000.00	210 462.53	0.04
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.500%/VAR 22-29.03.26	400 000.00	417 069.84	0.08
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.000%/VAR 18-04.03.25	800 000.00	848 547.77	0.15

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S-SUB 1.043%/VAR 21-14.09.32	490 000.00	454 294.80	0.08
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 100 000.00	2 144 502.36	0.38
ユーロ合計		7 535 472.31	1.34
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26	675 000.00	660 334.59	0.12
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	920 000.00	860 849.08	0.16
USD WELLS FARGO & CO 3.526%/VAR 22-24.03.28	600 000.00	575 921.87	0.10
米ドル合計		2 097 105.54	0.38
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		9 632 577.85	1.72
債券、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.50000% 19-21.06.31	8 090 000.00	5 015 968.32	0.89
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	3 610 000.00	2 461 340.68	0.44
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	270 000.00	177 007.07	0.03
オーストラリア・ドル合計		7 654 316.07	1.36
カナダ・ドル			
CAD CANADA HOUSING TRUST-144A 2.35000% 13-15.09.23	3 990 000.00	3 110 111.42	0.55
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 15-01.06.26	4 000 000.00	2 983 107.08	0.53
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.00000% 16-01.06.27	2 930 000.00	2 105 895.23	0.37
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 11-01.12.45	3 410 000.00	2 952 015.96	0.53
CAD CANADA, GOVERNMENT 4.00000% 08-01.06.41	970 000.00	878 035.76	0.16
カナダ・ドル合計		12 029 165.45	2.14
中国元			
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.80000% 16-25.01.36	77 000 000.00	12 308 083.18	2.19
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04000% 17-10.04.27	39 800 000.00	6 351 282.43	1.13
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.45000% 19-20.09.29	121 500 000.00	18 861 665.36	3.36
中国元合計		37 521 030.97	6.68
ユーロ			
EUR ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23	375 000.00	397 451.88	0.07
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	400 000.00	365 223.69	0.06
EUR ADO PROPERTIES SA-REG-S 1.50000% 17-26.07.24	400 000.00	312 265.20	0.06
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	300 000.00	288 049.46	0.05
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	1 315 000.00	1 247 201.56	0.22
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.80000% 15-22.06.25	6 690 000.00	7 100 045.89	1.26
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24	1 230 000.00	1 281 472.45	0.23
EUR BPCE SA-REG-S 0.25000% 20-15.01.26	500 000.00	500 117.97	0.09
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	305 000.00	303 947.13	0.05
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	1 310 000.00	1 021 703.91	0.18
EUR FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25	720 000.00	672 077.41	0.12
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 17-25.05.28	3 680 000.00	3 823 066.55	0.68
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	1 800 000.00	1 748 060.58	0.31
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40	3 480 000.00	2 949 962.25	0.52
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 2.50000% 21-15.01.26	415 000.00	402 307.08	0.07
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	800 000.00	822 228.03	0.15
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 15-18.02.45	3 850 000.00	4 175 890.35	0.74
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26	1 990 000.00	2 117 782.80	0.38
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.00000% 05-01.02.37	2 210 000.00	2 639 226.82	0.47
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	3 690 000.00	4 006 963.67	0.71
EUR ITALY, REPUBLIC OF-REG-S-144A 0.60000% 21-01.08.31	6 390 000.00	5 592 104.81	1.00
EUR MAPFRE SA-REG-S-SUB 2.87500% 22-13.04.30	500 000.00	504 002.36	0.09
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	620 000.00	656 521.76	0.12
EUR RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26	200 000.00	206 354.13	0.04
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	2 130 000.00	2 649 673.23	0.47
EUR SPAIN, KINGDOM OF 4.20000% 05-31.01.37	1 300 000.00	1 725 259.75	0.31
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	810 000.00	932 269.87	0.17
EUR SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25	7 500 000.00	8 079 862.05	1.44
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	250 000.00	238 896.73	0.04

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	200 000.00	197 514.92	0.04
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.25000% 21-15.02.27	370 000.00	350 616.05	0.06
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	400 000.00	422 755.60	0.08
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 4.12500% 18-16.11.38	300 000.00	346 775.78	0.06
ユーロ合計		58 077 651.72	10.34
英ポンド			
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 3.25000% 21-16.02.26	345 000.00	379 420.75	0.07
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	185 000.00	193 722.24	0.03
GBP BUPA FINANCE PLC-REG-S-SUB 5.00000% 13-25.04.23	49 000.00	62 687.01	0.01
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	655 000.00	800 736.14	0.14
GBP SCOTTISH WIDOWS PLC-REG-S-SUB 5.50000% 13-16.06.23	380 000.00	488 722.41	0.09
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.25000% 12-22.01.44	990 000.00	1 488 215.33	0.27
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47	3 890 000.00	4 330 745.05	0.77
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.62500% 18-22.10.28	3 140 000.00	3 927 533.79	0.70
英ポンド合計		11 671 782.72	2.08
日本円			
JPY JAPAN 0.10000% 19-20.12.28	927 000 000.00	7 157 704.99	1.27
JPY JAPAN 0.10000% 21-20.12.30	99 000 000.00	757 797.78	0.14
JPY JAPAN 0.30000% 16-20.06.46	467 300 000.00	3 173 246.88	0.57
JPY JAPAN 0.50000% 19-20.03.59	462 950 000.00	3 023 253.59	0.54
JPY JAPAN 1.10000% 03-20.03.33	750 000 000.00	6 287 704.53	1.12
JPY JAPAN 1.60000% 10-20.06.30	125 000 000.00	1 075 659.93	0.19
JPY JAPAN 1.70000% 14-20.09.44	530 100 000.00	4 834 318.87	0.86
JPY JAPAN 2.00000% 11-20.09.41	209 000 000.00	1 984 822.48	0.35
JPY JAPAN 2.30000% 05-20.06.35	803 600 000.00	7 698 210.11	1.37
日本円合計		35 992 719.16	6.41
韓国ウォン			
KRW KOREA, REPUBLIC OF 1.87500% 16-10.06.26	14 078 000 000.00	10 649 938.26	1.90
韓国ウォン合計		10 649 938.26	1.90
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	1 810 000.00	982 551.17	0.18
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	1 340 000.00	630 178.09	0.11
NZD NEW ZEALAND 3.00000% 18-20.04.29	7 020 000.00	4 386 972.18	0.78
ニュージーランド・ドル合計		5 999 701.44	1.07
米ドル			
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	170 000.00	144 025.32	0.03
USD BNG BANK NV-REG-S 0.75000% 20-17.04.23	2 110 000.00	2 074 513.66	0.37
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37	650 000.00	701 715.62	0.13
USD CITIGROUP INC 3.87500% 13-25.10.23	840 000.00	851 940.04	0.15
USD CONSUMERS ENERGY COMPANY 3.25000% 16-15.08.46	100 000.00	84 592.37	0.02
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	340 000.00	220 150.00	0.04
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.00000% 12-30.09.42	250 000.00	228 227.67	0.04
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.15000% 15-22.05.45	420 000.00	420 308.90	0.07
USD JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 0.62500% 20-22.05.23	1 520 000.00	1 491 963.75	0.27
USD LLOYDS BANK PLC-REG-S 2.12500% 19-24.07.22	1 710 000.00	1 712 411.10	0.30
USD MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD-REG-S 3.07500% 21-28.04.51	365 000.00	307 124.68	0.05
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	713 000.00	568 617.50	0.10
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 2.10000% 20-01.08.27	225 000.00	193 823.93	0.03
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 2.50000% 20-01.02.31	240 000.00	189 954.85	0.03
USD PACIFICORP 6.00000% 09-15.01.39	340 000.00	390 247.76	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	440 000.00	380 407.50	0.07
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	290 000.00	292 095.00	0.05
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.00000% 17-01.04.47	170 000.00	145 391.64	0.03
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	235 000.00	234 421.49	0.04
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 2.85000% 19-01.08.29	155 000.00	139 667.17	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 20-10.01.25	200 000.00	45 000.00	0.01
米ドル合計		10 816 599.95	1.92
債券、固定利付債合計		190 412 905.74	33.90

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.05.35	3 690 000.00	3 394 289.09	0.61
ユーロ合計		3 394 289.09	0.61
債券、ゼロ・クーポン合計			
		3 394 289.09	0.61
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	361 105.16	0.06
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	250 000.00	253 301.40	0.05
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	200 000.00	196 213.10	0.03
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	400 000.00	409 848.08	0.07
EUR ORSTED A/S-REG-S-SUB 2.250%/VAR 17-24.11.3017	100 000.00	103 898.86	0.02
EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	830 000.00	790 481.84	0.14
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	200 000.00	204 694.06	0.04
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	99 343.80	0.02
ユーロ合計		2 418 886.30	0.43
英ポンド			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	430 000.00	556 261.78	0.10
英ポンド合計		556 261.78	0.10
日本円			
JPY JAPAN 0.100%/CPI LINKED 19-10.03.29	927 000 000.00	7 693 577.68	1.37
日本円合計		7 693 577.68	1.37
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35	3 280 000.00	2 745 132.05	0.49
ニュージーランド・ドル合計		2 745 132.05	0.49
米ドル			
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	245 000.00	234 881.50	0.04
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	1 210 000.00	1 252 641.85	0.22
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	400 000.00	361 700.00	0.07
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 5.000%/VAR 17-PRP	305 000.00	288 641.24	0.05
米ドル合計		2 137 864.59	0.38
債券、変動利付債合計			
		15 551 722.40	2.77
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 13-15.05.43	2 970 000.00	2 815 583.19	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46	14 820 000.00	12 509 006.25	2.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.08.47	1 680 000.00	1 569 750.00	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 19-15.05.49	2 470 000.00	2 395 417.58	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 15-31.10.22	16 550 000.00	16 587 496.01	2.96
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 16-28.02.23	5 150 000.00	5 129 279.28	0.91
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 16-30.09.23	7 250 000.00	7 139 834.00	1.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 13-15.11.23	3 210 000.00	3 219 529.69	0.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26	8 530 000.00	8 045 522.61	1.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	14 050 000.00	11 694 978.48	2.08
米ドル合計		71 106 397.09	12.66
財務省証券(T-note)、固定利付債合計			
		71 106 397.09	12.66
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		414 384 471.17	73.78

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD COLT MERGER SUB INC-144A 3.6000% 18-25.02.48	1 500 000.00	603 330.00	0.11
USD CPS AUTO RECEIVABLES-144A 3.6600% 18-15.12.23	325 000.00	53 123.50	0.01
USD CPS AUTO RECEIVABLES TRUST-144A 4.3400% 18-16.09.24	600 000.00	314 402.49	0.05
USD CPS AUTO TRUST-144A 4.4000% 18-17.06.24	840 000.00	386 558.92	0.07
USD DRIVE AUTO RECEIVABLES TRUST 4.3000% 18-16.09.24	575 000.00	150 226.14	0.03
USD DRIVE AUTO RECEIVABLES TRUST 4.0900% 18-15.01.26	600 000.00	297 650.97	0.05
USD FLAGSHIP CREDIT AUTO TRUST-144A 3.8600% 18-15.04.24	1 630 000.00	1 559 710.63	0.28
USD GLS AUTO RECEIVABLES TRUST-144A 4.1700% 18-15.04.24	780 000.00	285 848.32	0.05
USD PSNH FUNDING LLC 3.8140% 18-01.02.35	600 000.00	605 709.60	0.11
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 2.4900% 16-25.01.36	625 000.00	4 299.97	0.00
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.3400% 18-25.08.47	1 890 000.00	665 989.74	0.12
米ドル合計		4 926 850.28	0.88
アセット・バック証券、固定利付債合計		4 926 850.28	0.88
アセット・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A VAR 17-25.07.40	150 000.00	147 771.44	0.03
米ドル合計		147 771.44	0.03
アセット・バック証券、変動利付債合計		147 771.44	0.03
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK BNK-SUB 4.4070% 18-01.11.61	300 000.00	306 186.18	0.05
USD BBCMS TRUST-144A-SUB 4.4980% 15-06.08.35	407 000.00	402 553.37	0.07
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST 3.9436% 18-01.07.51	200 000.00	198 371.28	0.04
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB 3.9790% 19-01.03.62	200 000.00	195 295.54	0.03
USD BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.4543% 13-10.03.33	200 000.00	196 431.76	0.03
USD CD MORTGAGE TRUST 3.4560% 17-01.11.50	400 000.00	388 993.64	0.07
USD CITIGROUP COMMERCIAL MORT TRST 2015-SUB 3.7780% 15-01.09.58	280 000.00	279 730.08	0.05
USD CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 4.2280% 18-01.06.51	375 000.00	378 762.52	0.07
USD COMM 2015-PC1 MORTGAGE TRUST 3.6200% 15-01.07.50	250 000.00	140 217.44	0.02
USD FANNIE MAE 1.0000% 22-01.04.51	950 000.00	810 129.80	0.14
USD FANNIE MAE 1.5000% 21-01.02.51	550 000.00	425 540.01	0.08
USD FANNIE MAE 2.0000% 20-01.09.50	1 750 000.00	1 180 329.12	0.21
USD FANNIE MAE 2.0000% 20-01.01.51	500 000.00	379 119.98	0.07
USD FANNIE MAE 2.0000% 21-01.02.51	1 775 000.00	1 362 629.35	0.24
USD FANNIE MAE 2.0000% 21-01.02.51	2 200 000.00	1 720 237.05	0.31
USD FANNIE MAE 2.5000% 21-01.08.51	1 100 000.00	970 404.67	0.17
USD FANNIE MAE 3.0000% 13-01.08.43	136 385.00	34 716.30	0.01
USD FANNIE MAE 3.0000% 16-01.07.46	1 500 000.00	531 545.19	0.09
USD FANNIE MAE 3.0000% 20-01.06.50	2 250 000.00	893 072.71	0.16
USD FANNIE MAE 3.5000% 16-01.08.46	450 000.00	140 474.78	0.02
USD FANNIE MAE 3.5000% 15-01.04.45	200 000.00	76 899.68	0.01
USD FANNIE MAE 3.5000% 16-01.01.46	175 000.00	62 254.87	0.01
USD FANNIE MAE 3.5000% 16-01.12.46	600 000.00	314 306.13	0.06
USD FANNIE MAE 3.5000% 18-01.03.48	250 000.00	56 071.33	0.01
USD FANNIE MAE 3.5000% 18-01.07.48	350 000.00	88 604.21	0.02
USD FANNIE MAE 3.5000% 17-01.08.47	650 000.00	112 095.39	0.02
USD FANNIE MAE 4.0000% 10-01.01.41	1 357 002.00	101 918.35	0.02
USD FANNIE MAE 4.0000% 11-01.01.41	1 584 763.00	124 515.54	0.02
USD FANNIE MAE 4.0000% 15-01.11.45	1 250 000.00	419 652.38	0.07
USD FANNIE MAE 4.0000% 16-01.02.46	1 025 000.00	134 780.02	0.02
USD FANNIE MAE 4.0000% 15-01.08.45	1 575 000.00	538 478.12	0.10
USD FANNIE MAE 4.0000% 14-01.11.44	400 000.00	116 307.06	0.02

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FANNIE MAE 4.00000% 11-01.02.41	938 348.00	70 870.45	0.01
USD FANNIE MAE 4.00000% 11-01.02.41	2 969 225.00	237 493.32	0.04
USD FANNIE MAE 4.50000% 15-01.06.44	465 000.00	105 464.21	0.02
USD FANNIE MAE 4.50000% 16-01.07.44	350 000.00	70 659.88	0.01
USD FANNIE MAE 4.50000% 11-01.04.41	1 629 000.00	84 969.98	0.02
USD FANNIE MAE 5.00000% 11-01.01.41	589 000.00	43 761.70	0.01
USD FANNIE MAE 5.00000% 10-01.08.40	50 000.00	2 703.83	0.00
USD FANNIE MAE 5.50000% 15-01.01.39	425 000.00	95 919.19	0.02
USD FANNIE MAE 5.50000% 07-01.04.37	1 242 395.00	56 131.31	0.01
USD FANNIE MAE POOL 2.00000% 21-01.10.51	3 075 000.00	2 648 839.80	0.47
USD FANNIE MAE POOL 2.50000% 21-01.10.51	3 000 000.00	2 642 715.48	0.47
USD FREDDIE MAC 1.50000% 21-01.09.51	2 496 884.00	2 054 176.03	0.37
USD FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.10.51	3 075 000.00	2 641 402.09	0.47
USD FREDDIE MAC 2.00000% 22-01.01.52	1 400 000.00	1 228 216.66	0.22
USD FREDDIE MAC 2.50000% 20-01.10.50	625 000.00	458 058.39	0.08
USD FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.09.46	975 000.00	228 010.43	0.04
USD FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.10.46	1 200 000.00	466 188.09	0.08
USD FREDDIE MAC 3.00000% 18-01.04.47	2 125 000.00	630 883.80	0.11
USD FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.08.46	600 000.00	110 761.98	0.02
USD FREDDIE MAC 3.50000% 15-01.06.45	350 000.00	132 483.22	0.02
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.11.47	325 000.00	60 485.79	0.01
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.08.47	450 000.00	90 317.21	0.02
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.11.47	475 000.00	100 820.04	0.02
USD FREDDIE MAC 4.50000% 11-01.03.41	2 647 244.00	127 647.58	0.02
USD FREDDIE MAC 4.50000% 11-01.09.41	1 120 431.00	49 662.91	0.01
USD FREDDIE MAC 5.00000% 05-01.05.35	11 775 000.00	145 392.29	0.03
USD FREDDIE MAC 5.50000% 14-01.06.41	575 000.00	77 659.69	0.01
USD FREDDIE MAC POOL 2.50000% 21-01.10.51	3 000 000.00	2 648 322.22	0.47
USD GINNIE MAE 3.00000% 16-01.08.46	1 925 000.00	377 104.49	0.07
USD GINNIE MAE 3.50000% 12-01.08.42	1 300 000.00	289 075.10	0.05
USD GINNIE MAE 3.50000% 18-01.01.48	525 000.00	102 007.41	0.02
USD GINNIE MAE 4.50000% 11-01.05.41	1 141 511.00	58 091.66	0.01
USD GINNIE MAE 5.50000% 11-01.06.41	1 219 909.00	10 822.51	0.00
USD GINNIE MAE 5.50000% 08-01.12.38	1 706 205.00	32 891.18	0.01
USD GINNIE MAE 5.50000% 10-01.03.40	1 357 167.00	36 468.61	0.01
USD GINNIE MAE 5.50000% 08-01.01.38	1 053 419.00	117 280.30	0.02
USD GINNIE MAE 6.50000% 07-01.06.37	8 288 862.00	405 105.62	0.07
USD GINNIE MAE 6.50000% 08-01.10.38	8 474 348.00	28 348.60	0.01
USD GINNIE MAE II 2.50000% 21-01.12.51	3 550 000.00	3 237 304.93	0.58
USD HILTON USA TRUST-144-SUB 3.32284% 16-01.11.35	400 000.00	393 154.28	0.07
USD JPMBB COMMERCIAL MTG SEC TRUST-SUB 3.79960% 14-01.01.48	660 000.00	651 927.74	0.12
USD MORGAN STANLEY BOA MERR LYH TRT 15-C24 3.73200% 15-01.05.48	170 000.00	169 534.66	0.03
USD MSBAM LYNCH TRUST-SUB 3.99400% 16-01.12.49	700 000.00	679 809.83	0.12
USD WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 4.21200% 18-01.05.51	200 000.00	201 716.58	0.04
USD WF-RBS COMMERCIAL MORTGAGE TRUST-SUB 4.10100% 14-01.03.47	260 320.00	261 970.90	0.05
米ドル合計		37 443 255.82	6.67
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		37 443 255.82	6.67
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD ANGEL OAK MORTGAGE TRUST I LLC-144A VAR 18-01.09.48	200 000.00	8 904.00	0.00
USD BAML COMMERCIAL MORTGAGE-144A VAR 15-01.04.33	800 000.00	766 648.72	0.14
USD BX TRUST-144A 1M LIBOR+80BP 18-15.05.35	350 000.00	343 402.15	0.06
USD CD MORTGAGE TRUST FLR 17-01.11.50	230 000.00	223 756.65	0.04
USD CHT COSMO MORTGAGE TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+225BP 17-15.11.36	550 000.00	544 482.57	0.10
USD COMM 2014-CCRE15 MORTGAGE TRUST-SUB VAR 14-01.02.47	500 000.00	501 709.70	0.09
USD DBGS MORTGAGE TRUST-144A 1M LIBOR+80.3BP 18-15.05.35	325 000.00	294 171.71	0.05
USD FREMF MORTGAGE TRUST-144A-SUB VAR 17-01.05.50	200 000.00	195 529.58	0.03
USD GS MORTGAGE SECUR CORP II 4.560%/VAR 18-01.07.51	968 000.00	926 850.13	0.16
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST 4.047%/VAR 17-01.03.50	325 000.00	314 344.32	0.06
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST-144A VAR 17-01.01.43	650 000.00	624 280.15	0.11

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD JPMCC COMMERCIAL MORTGAGE SEC TRUST VAR 17-01.09.50	220 000.00	202 163.78	0.04
USD JPMDB COMRCIAL MOTGE SECURTIES TRST 3.985%/VAR 17-01.10.50	650 000.00	628 666.22	0.11
USD MAD MORTGAGE TRUST-144A 3.478%/VAR 17-01.08.34	370 000.00	355 676.56	0.06
USD MAD MORTGAGE TRUST-144A 3.599%/VAR 17-01.08.34	450 000.00	431 860.86	0.08
USD MORGAN STANLEY BOA ML TRT 2015-C24-SUB VAR 15-01.05.48	500 000.00	493 982.50	0.09
USD MSCG TRUST 2018-SELF-144A-SUB 1M LIBOR+90BP 18-15.10.37	495 000.00	490 636.57	0.09
USD WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE TRUST-SUB FLR 18-01.05.51	300 000.00	288 791.97	0.05
米ドル合計		7 635 858.14	1.36
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		7 635 858.14	1.36
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.12500% 21-21.02.26	340 000.00	303 014.80	0.05
USD BNP PARIBAS-144A 4.40000% 18-14.08.28	295 000.00	288 621.45	0.05
USD BROADCOM INC 3.15000% 20-15.11.25	94 000.00	91 602.57	0.02
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	400 000.00	346 241.06	0.06
USD BROADCOM INC-144A 2.60000% 21-15.02.33	1 630 000.00	1 309 488.05	0.23
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	506 000.00	434 117.88	0.08
USD CCO LLC/CAPITAL 5.37500% 17-01.05.47	110 000.00	98 404.25	0.02
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25	285 000.00	296 263.46	0.05
USD COLONIAL ENTERPRISES INC-144A 3.25000% 20-15.05.30	290 000.00	269 875.16	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.85000% 21-15.07.25	200 000.00	209 966.04	0.04
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	600 000.00	618 320.57	0.11
USD GLENCORE FUNDING LLC-144A 4.87500% 19-12.03.29	260 000.00	259 716.39	0.05
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	180 000.00	167 647.19	0.03
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 2.00000% 21-15.07.26	200 000.00	180 402.41	0.03
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	105 000.00	104 018.19	0.02
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.15000% 20-01.05.27	200 000.00	189 296.00	0.03
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 2.70000% 20-01.05.25	80 000.00	76 658.40	0.01
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	80 000.00	79 446.03	0.01
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 6.20000% 10-15.03.40	320 000.00	363 090.64	0.06
USD STATE STREET CORP 2.90100% 20-30.03.26	375 000.00	367 328.35	0.07
USD TEACHERS INSURANCE&ANNUITY ASS-144A-SUB 4.90000% 14-15.09.44	1 090 000.00	1 099 915.60	0.20
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	115 000.00	108 836.25	0.02
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 2.05000% 21-15.04.26	285 000.00	258 751.50	0.05
USD XCEL ENERGY INC 4.80000% 11-15.09.41	290 000.00	287 210.37	0.05
米ドル合計		7 808 232.61	1.39
ノート、固定利付債合計		7 808 232.61	1.39
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AURIZON FINANCE PTY LTD 3.00000% 21-09.03.28	1 020 000.00	629 717.48	0.11
オーストラリア・ドル合計		629 717.48	0.11
英ポンド			
GBP NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION 4.00000% 12-08.06.27	330 000.00	432 676.61	0.08
英ポンド合計		432 676.61	0.08
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		1 062 394.09	0.19
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB 2.950%VAR 20-22.07.30	240 000.00	228 703.70	0.04
米ドル合計		228 703.70	0.04
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		228 703.70	0.04

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	340 000.00	344 411.16	0.06
米ドル合計		344 411.16	0.06
債券、固定利付債合計			0.06
債券、変動利付債			
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40	1 890 000.00	1 591 109.34	0.28
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	5 910 000.00	5 069 544.63	0.90
ニュージーランド・ドル合計		6 660 653.97	1.18
米ドル			
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	315 000.00	303 677.64	0.05
米ドル合計		303 677.64	0.05
債券、変動利付債合計			1.23
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			11.85
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA MTGE SECS-SUB 6.00000% 07-01.01.37	4 053 000.00	5.50	0.00
USD DBGS 2018-B10D MORTGAGE TRUST-SUB 4.76400% 18-01.10.51	200 000.00	203 556.78	0.04
米ドル合計		203 562.28	0.04
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計			0.04
ノート、固定利付債			
カナダ・ドル			
CAD PSP CAPITAL INC 0.90000% 20-15.06.26	4 300 000.00	3 071 149.80	0.55
カナダ・ドル合計		3 071 149.80	0.55
米ドル			
USD VICI PROPERTIES LP 5.12500% 22-15.05.32	535 000.00	530 923.30	0.09
米ドル合計		530 923.30	0.09
ノート、固定利付債合計			0.64
債券、固定利付債			
中国元			
CNY AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.45000% 20-23.09.25	88 000 000.00	13 656 748.73	2.43
中国元合計		13 656 748.73	2.43
債券、固定利付債合計			2.43
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			3.11

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
----	-----------	---	------------------

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル			
USD COMCAST CORP-144A 2.93700% 21-01.11.56	332 000.00	237 487.55	0.04
USD LUNDIN ENERGY FINANCE BV-144A 3.10000% 21-15.07.31	200 000.00	174 385.28	0.03
USD MAGALLANES INC-144A 4.27900% 22-15.03.32	960 000.00	891 738.69	0.16
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	145 000.00	136 445.00	0.02
米ドル合計		1 440 056.52	0.25
ノート、固定利付債合計		1 440 056.52	0.25

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計

ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs

投資信託、オープン・エンド型

ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	250.00	36 015.99	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	2.00	41 418.64	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	67 000.00	4 446 790.00	0.79
ルクセンブルグ合計		4 524 224.63	0.81
投資信託、オープン・エンド型合計		4 524 224.63	0.81
ルクセンブルグ2010年12月17日法(改訂済)の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		4 524 224.63	0.81
投資有価証券合計		504 372 945.28	89.80

To Be Announced ("TBA") モーゲージ担保証券(注1)

TBAモーゲージ担保証券

USD FANNIE MAE 2.50000% APR 22 12.05.22	5 050 000.00	-103 948.19	-0.02
USD FANNIE MAE 3.50000% MAY 22 12.05.22	2 625 000.00	-35 260.65	0.00
USD FANNIE MAE 2.00000% MAY 22 12.05.22	3 375 000.00	-64 177.73	-0.01
USD GINNIE MAE 2.00000% MAY 22 19.05.22	2 350 000.00	-40 161.22	-0.01
TBAモーゲージ担保証券合計		-243 547.79	-0.04
To Be Announced ("TBA") モーゲージ担保証券(注1)合計		-243 547.79	-0.04

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.22	99.00	-1 339 965.84	-0.24
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.06.22	34.00	-202 297.21	-0.04
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.06.22	-38.00	1 227 497.62	0.22
GBP LONG GILT FUTURE 28.06.22	37.00	-174 200.63	-0.03
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.22	64.00	-498 312.50	-0.09
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.22	25.00	-21 032.04	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	80.00	-400 625.04	-0.07
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.22	-28.00	451 484.38	0.08
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.22	42.00	-225 699.91	-0.04
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.22	-2.00	16 054.34	0.00
債券関連金融先物合計		-1 167 096.83	-0.21
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-1 167 096.83	-0.21
金融派生商品合計		-1 167 096.83	-0.21

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)		
先渡為替契約					
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日					
USD	53 188 111.07	CNY 340 005 000.00	5.5.2022	1 698 726.76	0.30
USD	10 926 271.62	KRW 13 228 000 000.00	6.5.2022	420 657.12	0.07
USD	10 658 326.10	AUD 14 180 000.00	5.5.2022	580 791.55	0.10
EUR	135 821 000.00	USD 149 643 231.53	5.5.2022	-6 339 583.59	-1.13
USD	132 674 902.56	EUR 120 420 000.00	5.5.2022	5 620 726.22	1.00
GBP	25 399 600.00	USD 33 307 547.02	5.5.2022	-1 418 603.21	-0.25
USD	17 749 005.85	GBP 13 535 000.00	5.5.2022	755 948.70	0.13
CHF	104 714 300.00	USD 113 007 856.16	5.5.2022	-5 111 198.20	-0.91
USD	20 008 327.08	NZD 28 890 000.00	5.5.2022	1 257 229.24	0.22
USD	17 103 607.79	CAD 21 385 000.00	5.5.2022	371 412.88	0.07
JPY	5 313 551 700.00	USD 43 311 707.17	6.5.2022	-2 293 425.83	-0.41
USD	58 696 634.75	JPY 7 201 000 000.00	6.5.2022	3 108 082.95	0.55
NZD	520 000.00	USD 361 188.31	5.5.2022	-23 681.53	0.00
JPY	115 249 900.00	USD 934 569.69	5.5.2022	-44 891.17	-0.01
CHF	573 900.00	USD 616 034.68	5.5.2022	-24 693.36	0.00
AUD	395 000.00	USD 295 677.53	5.5.2022	-14 956.36	0.00
JPY	45 111 100.00	USD 364 249.86	6.5.2022	-16 012.02	0.00
USD	234 716.82	JPY 29 463 300.00	6.5.2022	7 273.11	0.00
EUR	1 980 000.00	USD 2 156 241.58	5.5.2022	-67 159.46	-0.01
JPY	101 458 100.00	USD 810 558.03	6.5.2022	-27 346.14	-0.01
USD	334 438.43	GBP 256 600.00	5.5.2022	12 279.70	0.00
USD	1 249 033.62	CHF 1 165 500.00	5.5.2022	48 113.07	0.01
USD	475 618.02	JPY 59 713 800.00	6.5.2022	14 653.76	0.00
USD	1 611 317.23	EUR 1 480 100.00	5.5.2022	49 675.59	0.01
JPY	40 419 400.00	USD 321 056.00	6.5.2022	-9 036.02	0.00
GBP	300 000.00	USD 389 475.60	5.5.2022	-12 828.60	0.00
JPY	59 426 000.00	USD 465 216.99	5.5.2022	-6 474.42	0.00
CAD	850 000.00	USD 680 593.80	5.5.2022	-15 531.11	0.00
CNY	340 005 000.00	USD 51 925 015.27	5.5.2022	-435 630.96	-0.08
USD	51 720 439.92	CNY 340 005 000.00	6.6.2022	514 892.83	0.09
EUR	1 280 000.00	USD 1 366 428.16	5.5.2022	-15 910.42	0.00
USD	432 351.42	JPY 55 055 500.00	6.5.2022	7 347.18	0.00
USD	10 391 405.96	KRW 13 228 000 000.00	7.6.2022	-102 476.21	-0.02
KRW	13 228 000 000.00	USD 10 391 201.89	6.5.2022	114 412.61	0.02
USD	55 282 419.00	JPY 7 201 000 000.00	6.6.2022	-364 436.99	-0.06
USD	51 807 917.35	CNY 340 005 000.00	5.5.2022	318 533.04	0.06
JPY	5 530 983 600.00	USD 42 437 808.02	7.6.2022	305 944.33	0.05
USD	42 395 036.14	JPY 5 530 983 600.00	6.5.2022	-301 723.80	-0.05
先渡為替契約合計				-1 438 898.76	-0.26
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				57 187 963.74	10.18
その他の資産および負債				2 962 132.10	0.53
純資産総額				561 673 497.74	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

2022年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 18-20.09.23	7 000 000.00	7 038 299.10	0.40
USD ALPHABET INC 1.99800% 16-15.08.26	5 350 000.00	5 082 279.90	0.29
USD APPLE INC 0.70000% 21-08.02.26	12 000 000.00	10 959 615.84	0.62
USD APPLE INC 1.80000% 19-11.09.24	3 000 000.00	2 931 238.86	0.17
USD APPLE INC 3.20000% 15-13.05.25	7 500 000.00	7 518 607.87	0.43
USD APPLE INC 3.35000% 17-09.02.27	6 000 000.00	5 970 103.92	0.34
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVEST BANK/THE 0.50000% 21-30.10.24	9 165 000.00	8 608 830.13	0.49
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK/THE 0.50000% 20-28.05.25	5 000 000.00	4 615 800.00	0.26
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 2.00000% 22-21.03.25	11 000 000.00	10 712 020.00	0.61
USD BANQUE FEDERATIVE DU CRT MUT SA-REG-S 1.60400% 21-04.10.26	7 000 000.00	6 289 259.84	0.36
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIA-144A 0.62500% 21-18.02.26	3 000 000.00	2 733 751.53	0.16
USD CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 1.37500% 22-05.02.25	5 000 000.00	4 785 410.25	0.27
USD CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 21-19.05.26	7 000 000.00	6 399 277.36	0.37
USD CHEVRON USA INC 0.68700% 20-12.08.25	5 000 000.00	4 595 457.75	0.26
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.12500% 21-15.06.26	6 000 000.00	5 431 805.40	0.31
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BK 1.37500% 20-27.02.25	10 000 000.00	9 571 336.30	0.55
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 0.37500% 21-10.06.24	2 000 000.00	1 900 794.54	0.11
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 20-04.03.25	7 500 000.00	7 145 071.57	0.41
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25	1 077 000.00	1 042 045.90	0.06
USD EQUINOR ASA 1.75000% 20-22.01.26	8 000 000.00	7 493 830.00	0.43
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-19.05.25	5 000 000.00	4 635 906.90	0.26
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.62500% 20-25.07.25	10 800 000.00	10 032 641.43	0.57
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.37500% 21-26.03.26	5 000 000.00	4 517 050.00	0.26
USD EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 0.25000% 21-08.09.23	6 000 000.00	5 814 202.74	0.33
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	5 500 000.00	5 480 406.25	0.31
USD EXXON MOBIL CORP 2.01900% 19-16.08.24	3 204 000.00	3 136 400.47	0.18
USD EXXON MOBIL CORP 2.99200% 20-19.03.25	8 200 000.00	8 118 721.28	0.46
USD EXXON MOBIL CORP 3.04300% 16-01.03.26	3 000 000.00	2 952 598.41	0.17
USD HONG KONG GOVT GREEN BND PRGM-REG-S 2.50000% 19-28.05.24	600 000.00	595 189.12	0.03
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	5 450 000.00	5 223 719.54	0.30
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-23.09.24	5 000 000.00	4 727 924.70	0.27
USD INTER-AMERICAN INVESTMENT CORP 2.62500% 22-22.04.25	2 000 000.00	1 973 980.00	0.11
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.87500% 21-15.07.26	5 000 000.00	4 592 653.40	0.26
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.50000% 19-28.08.24	5 000 000.00	4 850 105.05	0.28
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-28.10.25	5 000 000.00	4 586 827.20	0.26
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.87500% 20-12.03.25	7 000 000.00	6 601 901.11	0.38
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 1.12500% 21-17.05.26	7 000 000.00	6 365 450.00	0.36
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22	2 150 000.00	2 153 090.62	0.12
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	10 975 000.00	10 673 715.95	0.61
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.50000% 21-20.09.24	5 000 000.00	4 730 287.10	0.27
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.00000% 21-01.10.26	5 000 000.00	4 591 948.30	0.26
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 2.00000% 15-13.01.25	3 975 000.00	3 877 482.08	0.22
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.50000% 20-27.05.25	5 000 000.00	4 638 300.00	0.26
USD MICROSOFT CORP 2.70000% 15-12.02.25	5 000 000.00	4 940 117.40	0.28
USD MICROSOFT CORP 2.87500% 17-06.02.24	5 124 000.00	5 130 300.22	0.29
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	3 565 000.00	3 576 070.14	0.20
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	5 000 000.00	4 789 543.00	0.27
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.75000% 20-15.01.25	10 000 000.00	9 685 432.10	0.55
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.15000% 21-14.01.27	8 500 000.00	7 671 409.71	0.44
USD NORDEA BANK AB-REG-S 0.62500% 21-24.05.24	9 000 000.00	8 498 330.91	0.48
USD NORDIC INVESTMENT BANK 0.37500% 21-20.09.24	3 000 000.00	2 827 890.00	0.16
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.62500% 22-04.04.25	16 000 000.00	15 848 320.00	0.90
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.00000% 20-14.02.27	4 000 000.00	3 757 567.04	0.21
USD OMERS FINANCE TRUST CP-REG-S 1.10000% 21-26.03.26	1 000 000.00	922 420.00	0.05

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ONTARIO, PROVINCE OF 0.62500% 21-21.01.26	7 000 000.00	6 384 350.00	0.36
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.00000% 21-23.04.26	5 000 000.00	4 570 268.10	0.26
USD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA CANADA 0.90000% 21-20.07.26	3 000 000.00	2 733 720.00	0.16
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 1.00000% 21-29.06.26	2 000 000.00	1 828 700.00	0.10
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 0.50000% 21-15.09.24	2 500 000.00	2 361 046.15	0.14
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 1.37500% 21-12.09.26	2 500 000.00	2 265 625.00	0.13
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	5 000 000.00	5 012 500.00	0.29
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.40000% 20-16.04.25	7 500 000.00	7 481 250.00	0.43
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	8 505 000.00	8 298 070.96	0.47
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 0.55000% 21-11.06.24	2 100 000.00	1 980 518.15	0.11
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 2.37500% 12-23.01.23	8 050 000.00	8 024 244.83	0.46
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.25000% 21-23.04.26	7 000 000.00	6 346 620.00	0.36
USD UBS AG LONDON BRANCH-REG-S 1.25000% 21-01.06.26	1 000 000.00	899 381.04	0.05
USD UBS AG/LONDON-144A 1.25000% 21-01.06.26	3 000 000.00	2 698 143.12	0.15
USD UBS AG/LONDON-REG-S 0.70000% 21-09.08.24	11 000 000.00	10 369 007.34	0.59
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 3.40000% 18-24.07.23	3 000 000.00	3 024 540.21	0.17
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	7 179 000.00	7 128 496.74	0.41
USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26	6 000 000.00	5 462 683.80	0.31
米ドル合計		390 211 903.67	22.21
ノート、固定利付債合計		390 211 903.67	22.21
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD DNB BANK ASA-REG-S 0.856%/VAR 21-30.09.25	7 000 000.00	6 564 202.26	0.37
米ドル合計		6 564 202.26	0.37
ノート、変動利付債合計		6 564 202.26	0.37
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25	6 000 000.00	5 572 015.26	0.32
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 2.50000% 20-16.04.25	5 000 000.00	4 882 187.50	0.28
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26	3 000 000.00	2 743 320.00	0.16
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.62500% 21-22.01.26	2 000 000.00	1 826 548.86	0.10
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.37500% 22-21.01.25	5 000 000.00	4 787 826.05	0.27
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.46000% 20-30.06.25	500 000.00	471 704.00	0.03
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.26000% 21-10.02.26	800 000.00	736 288.00	0.04
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26	11 000 000.00	10 023 399.10	0.57
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.37500% 21-11.06.24	15 000 000.00	14 263 278.30	0.81
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 21-08.10.24	8 250 000.00	7 815 336.38	0.44
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 22-20.01.27	10 000 000.00	9 324 929.00	0.53
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 3.70000% 15-16.11.25	6 000 000.00	6 079 485.00	0.35
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 2.87500% 14-18.09.24	7 000 000.00	6 983 508.00	0.40
USD BNG BANK NV-REG-S 0.87500% 21-18.05.26	5 000 000.00	4 575 288.00	0.26
USD CAISSE D'AMORT DE LA DS-REG-S 0.37500% 20-23.09.25	13 000 000.00	11 869 402.35	0.67
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETT-REG-S 1.12500% 21-29.11.24	7 500 000.00	7 151 475.00	0.41
USD CDP FINANCIAL INC-REG-S 1.75000% 22-01.02.27	8 000 000.00	7 487 326.40	0.43
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	3 350 000.00	3 248 967.75	0.18
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 18-20.07.23	14 000 000.00	14 036 643.60	0.80
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.01500% 22-11.01.27	7 000 000.00	6 371 536.99	0.36
USD DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 0.50000% 21-19.01.24	5 000 000.00	4 784 194.85	0.27
USD DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 1.87500% 22-14.02.25	4 600 000.00	4 422 012.48	0.25
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	1 000 000.00	1 001 250.00	0.06
USD ERSTE ABWICKLUNGSANSTALT-REG-S 0.25000% 21-01.03.24	6 000 000.00	5 726 460.00	0.33
USD ERSTE ABWICKLUNGSANSTALT-REG-S 0.87500% 21-30.10.24	7 400 000.00	7 049 246.88	0.40
USD EUROCLEAR BANK-REG-S 1.26100% 21-03.08.26	10 000 000.00	9 026 477.80	0.51
USD HONG KONG GOVERNMENT INT BD-REG-S 0.62500% 21-02.02.26	5 000 000.00	4 577 126.00	0.26
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-20.04.26	12 000 000.00	11 027 380.07	0.63
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.87500% 18-31.07.23	2 000 000.00	2 007 694.86	0.11
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.37500% 20-16.07.25	7 000 000.00	6 443 539.97	0.37

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 21-08.10.26	4 000 000.00	3 630 260.56	0.21
USD INTL FINANCE FACILITY FOR IMMUN-REG-S 1.00000% 21-21.04.26	7 500 000.00	6 911 939.62	0.39
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.62500% 21-15.09.25	8 000 000.00	7 376 209.60	0.42
USD LANDESKREDITBANK BADEN-REG-S 1.37500% 22-27.01.25	10 000 000.00	9 583 993.90	0.55
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 20-21.05.26	7 000 000.00	6 673 187.51	0.38
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	5 050 000.00	4 849 652.01	0.28
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 21-02.09.26	10 000 000.00	9 119 782.60	0.52
USD NEW DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 1.12500% 21-27.04.26	4 000 000.00	3 569 732.96	0.20
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	1 800 000.00	1 762 608.62	0.10
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 0.50000% 21-16.09.24	3 500 000.00	3 308 258.06	0.19
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.50000% 16-12.04.26	3 850 000.00	3 726 622.90	0.21
USD SFIL SA-REG-S 0.62500% 21-09.02.26	5 000 000.00	4 547 702.85	0.26
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 2.70000% 12-14.09.22	3 000 000.00	3 001 063.50	0.17
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	4 100 000.00	4 087 956.25	0.23
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	10 305 000.00	10 179 912.45	0.58
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 2.25000% 22-22.03.27	10 000 000.00	9 588 511.30	0.55
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 1.25000% 21-14.04.26	900 000.00	826 490.15	0.05
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 3.05900% 22-07.04.25	5 700 000.00	5 691 434.61	0.32
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 1.62500% 19-05.09.22	5 000 000.00	4 980 471.50	0.28
米ドル合計		289 731 639.40	16.49

メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		289 731 639.40	16.49
-----------------------	--	----------------	-------

債券、固定利付債

米ドル

USD ALBERTA, PROVINCE OF 2.95000% 19-23.01.24	4 100 000.00	4 108 355.60	0.23
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK/THE 2.25000% 19-16.05.24	8 200 000.00	8 102 916.35	0.46
USD BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 2.17000% 22-09.03.27	15 000 000.00	14 167 884.30	0.81
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 1.18800% 21-13.10.26	2 500 000.00	2 279 147.08	0.13
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	3 540 000.00	3 450 664.56	0.20
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	3 800 000.00	3 669 366.94	0.21
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26	10 000 000.00	9 140 013.80	0.52
USD DBS BANK LTD-REG-S 2.37500% 22-17.03.27	2 850 000.00	2 728 190.99	0.15
USD DNB BOLIGKREDIT AS-REG-S 3.25000% 18-28.06.23	5 000 000.00	5 028 689.50	0.29
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.25000% 20-15.09.23	5 000 000.00	4 845 661.50	0.28
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.375% 21-24.07.24	10 000 000.00	9 476 221.10	0.54
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 21-26.10.26	10 000 000.00	9 052 547.60	0.51
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 3.62500% 18-05.03.23	2 000 000.00	2 010 310.00	0.11
USD FAB SUKUK CO LTD-REG-S 1.41100% 21-14.01.26	2 000 000.00	1 852 500.00	0.11
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 2.84300% 19-25.04.24	2 500 000.00	2 494 075.00	0.14
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 0.90800% 20-25.06.25	4 100 000.00	3 803 264.51	0.22
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 13-04.10.23	5 000 000.00	5 027 459.90	0.29
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-15.07.25	5 000 000.00	4 641 080.95	0.26
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	2 100 000.00	2 080 009.87	0.12
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 15-29.07.25	5 700 000.00	5 615 187.08	0.32
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.37500% 20-28.07.25	5 000 000.00	4 600 835.11	0.26
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 0.80000% 21-19.07.26	10 000 000.00	8 985 700.00	0.51
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.87500% 20-05.10.25	6 500 000.00	5 907 265.00	0.34
USD KOREA, REPUBLIC OF 3.87500% 13-11.09.23	3 100 000.00	3 136 425.00	0.18
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.37500% 20-18.07.25	15 000 000.00	13 805 850.00	0.79
USD LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 2.00000% 22-24.02.25	5 000 000.00	4 834 230.70	0.27
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	8 000 000.00	7 726 003.36	0.44
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.37500% 16-14.01.26	5 000 000.00	4 975 297.00	0.28
USD NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 2.90000% 22-06.04.27	12 500 000.00	12 199 488.25	0.69
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	2 890 000.00	2 911 123.07	0.17
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	350 000.00	341 278.00	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA REG-S 1.05000% 21-14.09.26	17 250 000.00	15 658 349.74	0.89
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 3.15000% 19-16.01.24	5 000 000.00	5 014 472.00	0.29
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 2.00000% 20-16.01.25	10 000 000.00	9 734 262.00	0.55
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.55200% 21-30.09.26	4 000 000.00	3 722 503.20	0.21
米ドル合計		207 126 629.06	11.79

債券、固定利付債合計		207 126 629.06	11.79
------------	--	----------------	-------

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
財務省証券(T-note)、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.00000% 15-15.08.25	15 000 000.00	14 562 890.69	0.83
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-31.12.24	15 100 000.00	14 664 695.39	0.83
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.03.25	20 000 000.00	18 675 000.00	1.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 30.04.20-30.04.25	15 000 000.00	13 921 875.00	0.79
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25	30 000 000.00	27 658 593.60	1.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.06.25	25 000 000.00	22 996 093.75	1.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.07.23	10 000 000.00	9 736 328.10	0.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.07.25	20 000 000.00	18 346 093.80	1.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.08.25	20 000 000.00	18 304 687.60	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.09.23	15 000 000.00	14 533 007.85	0.83
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.25000% 20-31.10.25	28 000 000.00	25 507 343.68	1.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.12.23	15 000 000.00	14 415 234.31	0.82
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.12.25	20 000 000.00	18 221 875.01	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.01.26	30 000 000.00	27 264 843.60	1.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 21-15.02.24	30 000 000.00	28 679 296.80	1.63
USD AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26	25 000 000.00	22 786 132.75	1.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-15.04.24	20 000 000.00	19 114 062.40	1.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-30.04.26	20 000 000.00	18 345 312.40	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 21-15.05.24	30 000 000.00	28 529 296.80	1.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.05.26	20 000 000.00	18 306 250.00	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 21-15.06.24	30 000 000.00	28 451 953.20	1.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF TREASURY NOTE 0.37500% 21-15.07.24	30 000 000.00	28 466 015.70	1.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 21-31.07.26	10 000 000.00	9 070 312.50	0.52
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 21-31.08.23	25 000 000.00	24 237 304.75	1.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 21-15.09.24	50 000 000.00	47 189 453.00	2.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.25000% 21-30.09.23	30 000 000.00	29 074 218.60	1.66
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.10.23	25 000 000.00	24 208 984.50	1.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-31.10.26	20 000 000.00	18 460 937.60	1.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-15.11.24	25 000 000.00	23 710 937.50	1.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.11.26	20 000 000.00	18 553 906.20	1.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 21-30.11.23	20 000 000.00	19 355 468.80	1.10
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 21-15.12.24	25 000 000.00	23 833 984.50	1.36
USD UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.12500% 21-15.01.24	20 000 000.00	19 170 312.40	1.09
米ドル合計		708 352 702.78	40.32
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		708 352 702.78	40.32
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 601 987 077.17	91.18
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-REG-S 2.37500% 19-21.11.24	1 000 000.00	965 400.00	0.06
USD CDP FINANCIAL INC-144A 3.15000% 14-24.07.24	5 000 000.00	5 029 493.25	0.29
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-144A 2.85000% 16-18.05.26	4 000 000.00	3 887 530.92	0.22
USD FANNIE MAE 0.50000% 20-17.06.25	15 000 000.00	13 908 553.05	0.79
USD FANNIE MAE 0.50000% 20-07.11.25	5 000 000.00	4 591 783.25	0.26
USD FANNIE MAE 2.12500% 16-24.04.26	6 700 000.00	6 490 502.52	0.37
USD FREDDIE MAC 0.25000% 20-08.09.23	20 000 000.00	19 407 978.40	1.10
USD FREDDIE MAC 1.50000% 20-12.02.25	10 000 000.00	9 630 384.10	0.55
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A 3.50000% 17-10.01.27	4 000 000.00	3 973 587.60	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 0.62500% 20-15.01.26	3 000 000.00	2 714 247.60	0.15
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-144A 0.80000% 20-01.09.25	5 000 000.00	4 572 600.00	0.26
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.37500% 16-28.01.27	3 000 000.00	2 845 694.22	0.16
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 0.99100% 21-05.03.26	5 000 000.00	4 575 320.76	0.26
米ドル合計		82 593 075.67	4.70
ノート、固定利付債合計		82 593 075.67	4.70

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD DBS GROUP HOLDINGS-REG-S 1.16900% 21-22.11.24	7 000 000.00	6 655 687.50	0.38
米ドル合計		6 655 687.50	0.38
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		6 655 687.50	0.38
債券、固定利付債			
米ドル			
USD FANNIE MAE 1.87500% 16-24.09.26	7 300 000.00	6 971 972.31	0.39
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 0.50000% 20-14.04.25	8 800 000.00	8 212 627.28	0.47
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 1.20000% 21-14.10.26	5 000 000.00	4 562 791.60	0.26
USD HSBC BANK CANADA-REG-S 0.95000% 20-14.05.23	10 000 000.00	9 824 200.00	0.56
米ドル合計		29 571 591.19	1.68
債券、固定利付債合計		29 571 591.19	1.68
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		118 820 354.36	6.76
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD FREDDIE MAC 0.37500% 20-23.09.25	10 000 000.00	9 170 207.90	0.52
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	3 000 000.00	2 967 478.11	0.17
USD SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 0.65000% 21-09.09.24	4 000 000.00	3 749 052.88	0.21
USD SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 1.20000% 21-09.09.26	6 000 000.00	5 395 280.88	0.31
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 0.85000% 20-02.09.25	5 000 000.00	4 569 700.00	0.26
USD SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25	5 777 000.00	5 732 655.75	0.33
米ドル合計		31 584 375.52	1.80
ノート、固定利付債合計		31 584 375.52	1.80
債券、固定利付債			
米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	2 000 000.00	1 978 953.82	0.11
米ドル合計		1 978 953.82	0.11
債券、固定利付債合計		1 978 953.82	0.11
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		33 563 329.34	1.91
投資有価証券合計		1 754 370 760.87	99.85
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	320.00	-70 000.00	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.22	-1 125.00	1 313 672.32	0.07
債券関連金融先物合計		1 243 672.32	0.07
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		1 243 672.32	0.07
金融派生商品合計		1 243 672.32	0.07

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約			
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日			
JPY	1 613 199 300.00	USD 13 270 427.11	6.5.2022 -817 238.27 -0.04
GBP	247 714 100.00	USD 325 211 654.36	3.5.2022 -14 206 601.79 -0.81
SGD	4 112 500.00	USD 3 037 205.38	6.5.2022 -59 135.56 0.00
CHF	619 058 100.00	USD 669 637 856.19	2.5.2022 -31 861 005.63 -1.81
EUR	750 649 100.00	USD 837 855 759.19	2.5.2022 -45 958 491.04 -2.61
USD	1 536 873.28	CHF 1 414 700.00	2.5.2022 79 396.33 0.00
SGD	20 000.00	USD 14 737.01	6.5.2022 -254.00 0.00
USD	1 178 488.80	CHF 1 089 400.00	2.5.2022 56 148.10 0.00
USD	1 124 202.75	CHF 1 038 400.00	2.5.2022 54 404.16 0.00
USD	339 026 155.56	EUR 309 713 336.80	2.5.2022 12 294 070.86 0.70
USD	237 103 606.04	GBP 180 604 957.26	3.5.2022 10 354 082.19 0.59
USD	411 433 346.62	CHF 381 599 491.79	2.5.2022 18 295 251.75 1.04
CHF	1 446 500.00	USD 1 549 766.52	2.5.2022 -59 528.02 0.00
GBP	393 000.00	USD 513 044.05	3.5.2022 -19 632.55 0.00
USD	45 235.27	SGD 61 600.00	6.5.2022 627.59 0.00
USD	2 050 663.86	EUR 1 884 100.00	2.5.2022 63 032.56 0.00
USD	847 752.02	CHF 792 400.00	2.5.2022 31 391.85 0.00
GBP	884 100.00	USD 1 149 615.30	3.5.2022 -39 627.75 0.00
USD	559 814.39	CHF 520 000.00	2.5.2022 24 090.91 0.00
USD	436 135.47	GBP 334 300.00	3.5.2022 16 421.82 0.00
USD	108 251.72	JPY 13 550 000.00	6.5.2022 3 651.68 0.00
USD	980 011.48	EUR 900 300.00	2.5.2022 30 239.99 0.00
USD	129 564.35	JPY 16 262 800.00	6.5.2022 4 022.69 0.00
USD	603 184.33	CHF 562 900.00	2.5.2022 23 263.66 0.00
USD	250 891.28	JPY 31 564 800.00	6.5.2022 7 224.91 0.00
USD	529 708.51	CHF 499 200.00	2.5.2022 15 413.97 0.00
USD	1 240 740.83	EUR 1 147 700.00	2.5.2022 29 974.71 0.00
USD	391 150.40	CHF 370 900.00	2.5.2022 9 035.32 0.00
USD	1 570 123.98	EUR 1 444 500.00	2.5.2022 46 248.70 0.00
USD	578 914.93	CHF 554 500.00	2.5.2022 7 648.25 0.00
USD	130 891.13	GBP 103 000.00	3.5.2022 1 574.63 0.00
JPY	7 620 000.00	USD 59 742.66	6.5.2022 -919.61 0.00
USD	1 415 073.89	EUR 1 325 600.00	2.5.2022 16 632.17 0.00
GBP	67 949 000.00	USD 85 012 128.65	1.6.2022 296 855.87 0.02
USD	85 015 678.69	GBP 67 948 942.74	3.5.2022 -294 218.93 -0.02
USD	2 937 964.91	SGD 4 070 900.00	6.5.2022 -9 980.24 0.00
SGD	4 070 900.00	USD 2 937 839.82	2.6.2022 9 979.28 0.00
EUR	434 233 600.00	USD 457 701 320.68	2.6.2022 1 044 826.88 0.06
USD	11 960 009.36	JPY 1 559 441 700.00	6.5.2022 -78 194.46 0.00
JPY	1 559 441 700.00	USD 11 970 199.65	2.6.2022 79 384.57 0.00
CHF	232 062 800.00	USD 238 943 906.62	2.6.2022 512 761.87 0.03
USD	233 445.62	GBP 187 500.00	1.6.2022 -1 957.91 0.00
USD	1 304 679.51	EUR 1 240 400.00	2.6.2022 -5 741.24 0.00
先渡為替契約合計			-50 004 869.73 -2.85
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			7 371 554.45 0.42
その他の資産および負債			44 043 887.08 2.51
純資産総額			1 757 025 004.99 100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2022年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	2 000 000.00	1 966 625.00	0.05
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 1.62500% 21-04.02.31	10 000 000.00	8 353 603.99	0.23
USD ALBERTA, PROVINCE OF 3.30000% 18-15.03.28	12 425 000.00	12 416 815.65	0.33
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	18 580 000.00	15 188 938.56	0.41
USD AMAZON.COM INC 1.50000% 20-03.06.30	5 000 000.00	4 201 682.55	0.11
USD AMAZON.COM INC 1.65000% 21-12.05.28	5 000 000.00	4 445 819.10	0.12
USD AMAZON.COM INC 2.10000% 21-12.05.31	5 000 000.00	4 352 486.00	0.12
USD AMAZON.COM INC 3.60000% 22-13.04.32	5 000 000.00	4 902 300.00	0.13
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	20 000 000.00	17 505 336.00	0.47
USD APPLE INC 1.25000% 20-20.08.30	15 000 000.00	12 320 312.40	0.33
USD APPLE INC 1.40000% 21-05.08.28	10 000 000.00	8 777 170.40	0.24
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	21 240 000.00	18 268 844.72	0.49
USD APPLE INC 1.65000% 21-08.02.31	15 000 000.00	12 659 492.10	0.34
USD APPLE INC 1.70000% 21-05.08.31	20 000 000.00	16 866 958.40	0.45
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	12 800 000.00	11 619 154.81	0.31
USD APPLE INC 2.90000% 17-12.09.27	10 000 000.00	9 667 327.10	0.26
USD APPLE INC 3.00000% 17-13.11.27	5 000 000.00	4 872 881.95	0.13
USD APPLE INC 3.20000% 17-11.05.27	16 073 000.00	15 837 933.66	0.43
USD APPLE INC 3.35000% 17-09.02.27	5 000 000.00	4 975 086.60	0.13
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.25000% 20-01.09.30	4 000 000.00	3 285 487.96	0.09
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.70000% 21-15.05.28	9 000 000.00	8 093 515.77	0.22
USD BLACKROCK INC 1.90000% 20-28.01.31	5 000 000.00	4 207 059.65	0.11
USD BLACKROCK INC 2.40000% 20-30.04.30	10 000 000.00	8 950 430.40	0.24
USD BLACKROCK INC 3.25000% 19-30.04.29	2 000 000.00	1 928 502.46	0.05
USD BLACKROCK INC/NEW YORK 2.10000% 21-25.02.32	3 000 000.00	2 534 924.97	0.07
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	25 500 000.00	21 717 840.00	0.58
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A 1.00000% 20-21.10.30	10 000 000.00	8 423 563.20	0.23
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A-1.37500% 21-20.01.31	9 000 000.00	7 715 435.49	0.21
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	5 539 000.00	4 935 198.32	0.13
USD CME GROUP INC 2.65000% 22-15.03.32	3 000 000.00	2 671 860.00	0.07
USD CME GROUP INC 3.75000% 18-15.06.28	3 500 000.00	3 474 971.92	0.09
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	3 100 000.00	3 098 892.06	0.08
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	11 730 000.00	9 810 692.83	0.26
USD CPPIB CAPITAL INC-144A 2.00000% 19-01.11.29	10 000 000.00	9 157 706.60	0.25
USD CPPIB CAPITAL INC-144A 1.25000% 21-28.01.31	3 500 000.00	2 973 404.98	0.08
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.00000% 19-01.11.29	2 500 000.00	2 289 426.66	0.06
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	11 200 000.00	9 514 895.93	0.26
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 1.19400% 21-15.03.27	10 000 000.00	8 932 900.00	0.24
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	12 635 000.00	11 262 478.02	0.30
USD EQUINOR ASA 3.12500% 20-06.04.30	9 000 000.00	8 538 423.30	0.23
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	12 310 000.00	12 160 125.01	0.33
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	30 400 000.00	25 801 231.18	0.69
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25000% 21-14.02.31	33 390 000.00	28 871 713.94	0.78
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 21-13.05.31	3 000 000.00	2 680 349.49	0.07
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.12500% 22-18.01.32	10 000 000.00	8 651 600.00	0.23
USD EXXON MOBIL CORP 2.61000% 20-15.10.30	12 000 000.00	10 939 708.92	0.29
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	13 180 000.00	12 832 311.86	0.35
USD FANNIE MAE 7.12500% 00-15.01.30	3 000 000.00	3 823 107.66	0.10
USD FINLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.87500% 20-20.05.30	30 000 000.00	25 293 300.00	0.68
USD FREDDIE MAC 6.75000% 99-15.09.29	1 200 000.00	1 498 886.98	0.04
USD FREDDIE MAC 6.75000% 00-15.03.31	22 000 000.00	27 964 628.34	0.75
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32	3 000 000.00	2 669 140.20	0.07

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 18-18.09.28	7 500 000.00	7 511 545.35	0.20
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	16 875 000.00	15 969 656.25	0.43
USD INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000% 22-29.03.32	35 000 000.00	33 101 733.00	0.89
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	30 000 000.00	26 325 067.80	0.71
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	3 385 000.00	2 866 074.25	0.08
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	21 700 000.00	19 795 340.87	0.53
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-24.11.27	25 000 000.00	22 072 953.00	0.59
USD JOHNSON & JOHNSON 0.95000% 20-01.09.27	10 000 000.00	8 856 683.30	0.24
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	11 050 000.00	9 286 291.05	0.25
USD JOHNSON & JOHNSON 2.95000% 17-03.03.27	5 000 000.00	4 958 658.00	0.13
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	7 275 000.00	7 073 742.08	0.19
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 1.12500% 20-14.06.30	25 000 000.00	21 367 900.00	0.58
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.00000% 21-25.10.31	5 000 000.00	4 302 500.00	0.12
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.12500% 17-25.07.27	6 325 000.00	6 154 225.00	0.17
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 3.37500% 17-27.03.27	5 800 000.00	5 670 587.50	0.15
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.75000% 21-15.10.31	10 000 000.00	8 776 300.00	0.24
USD KOREA, REPUBLIC OF 2.75000% 17-19.01.27	2 500 000.00	2 439 531.25	0.07
USD KOREA, REPUBLIC OF 2.50000% 19-19.06.29	2 900 000.00	2 759 168.76	0.07
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.87500% 18-03.04.28	17 500 000.00	17 325 613.55	0.47
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	10 000 000.00	9 164 924.80	0.25
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	30 663 000.00	25 793 438.71	0.69
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	10 000 000.00	10 031 052.29	0.27
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 3.50000% 17-10.01.27	5 800 000.00	5 761 702.02	0.16
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	1 200 000.00	1 018 780.89	0.03
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-24.09.28	7 500 000.00	7 452 919.58	0.20
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	7 150 000.00	5 849 836.13	0.16
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.50000% 21-14.09.28	8 000 000.00	7 033 726.08	0.19
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 21-14.09.31	12 500 000.00	10 632 098.00	0.29
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	4 079 000.00	3 906 078.91	0.11
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	10 760 000.00	10 522 135.14	0.28
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	22 500 000.00	20 014 505.33	0.54
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 1.25000% 20-27.09.30	4 000 000.00	3 381 540.08	0.09
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-REG-S 2.00000% 21-16.04.31	15 000 000.00	13 321 500.00	0.36
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 19-02.10.29	6 900 000.00	6 317 962.92	0.17
USD ONTARIO, PROVINCE OF TB 1.60000% 21-25.02.31	5 000 000.00	4 353 463.25	0.12
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.80000% 21-14.10.31	15 000 000.00	13 122 409.80	0.35
USD PROCTER & GAMBLE CO 3.00000% 20-25.03.30	15 000 000.00	14 239 455.90	0.38
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.20000% 20-29.10.30	8 900 000.00	7 335 711.79	0.20
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.95000% 21-23.04.31	12 500 000.00	10 954 669.13	0.30
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.30000% 22-01.02.32	2 500 000.00	2 233 689.82	0.06
USD PROVINCE OF ONTARIO CANADA 2.12500% 22-21.01.32	10 000 000.00	8 975 877.40	0.24
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 1.62500% 21-26.10.28	10 000 000.00	9 049 200.00	0.24
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31	3 965 000.00	3 469 375.00	0.09
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	10 000 000.00	10 525 000.00	0.28
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	20 825 000.00	21 319 593.75	0.57
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	13 000 000.00	13 113 750.00	0.35
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.35000% 20-28.05.30	12 550 000.00	10 830 901.00	0.29
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.90000% 21-21.04.31	1 000 000.00	892 130.95	0.02
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	13 300 000.00	13 220 497.92	0.36
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.37500% 19-07.11.29	12 500 000.00	11 152 678.12	0.30
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.75000% 20-06.04.30	855 000.00	784 730.21	0.02
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	5 000 000.00	4 343 350.00	0.12
USD TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32	7 000 000.00	6 972 070.00	0.19
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.00000% 20-28.09.27	4 000 000.00	3 425 760.00	0.09
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.37500% 20-28.09.30	3 650 000.00	2 940 878.00	0.08
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.75000% 21-23.04.28	3 500 000.00	3 075 730.00	0.08
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	10 000 000.00	8 525 300.00	0.23
USD VISA INC 1.10000% 20-15.02.31	10 000 000.00	7 978 898.70	0.21
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	5 800 000.00	5 389 852.76	0.15
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	9 825 000.00	8 711 802.65	0.23
USD VISA INC 2.75000% 17-15.09.27	5 000 000.00	4 850 380.15	0.13
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	18 100 000.00	15 424 099.26	0.42
USD WALMART INC 3.25000% 19-08.07.29	5 000 000.00	4 889 671.55	0.13

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WESTPAC BANKING CORP 3.35000% 17-08.03.27	5 000 000.00	4 912 133.00	0.13
USD WESTPAC BANKING CORP 3.40000% 18-25.01.28	2 900 000.00	2 822 491.41	0.08
USD WESTPAC BANKING CORP 2.15000% 21-03.06.31	10 000 000.00	8 577 059.99	0.23
米ドル合計		1 111 130 866.49	29.88

ノート、固定利付債合計		1 111 130 866.49	29.88
-------------	--	------------------	-------

メディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル

USD ABU DHABI GOVERNMENT INTL-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	5 000 000.00	4 343 125.00	0.12
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	6 600 000.00	6 394 987.50	0.17
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 1.70000% 20-02.03.31	15 000 000.00	12 874 687.50	0.35
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 1.62500% 21-02.06.28	1 800 000.00	1 627 650.00	0.04
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-10.08.27	2 000 000.00	1 933 765.12	0.05
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.50000% 17-02.11.27	11 400 000.00	11 075 670.00	0.30
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	15 000 000.00	14 760 158.56	0.40
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	22 040 000.00	20 126 728.98	0.54
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 20-24.01.30	14 600 000.00	13 391 466.75	0.36
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.75000% 20-08.10.30	10 000 000.00	8 307 830.30	0.22
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 21-04.03.31	25 000 000.00	22 019 436.49	0.59
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.25000% 21-09.06.28	5 000 000.00	4 487 351.80	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 22-15.03.29	20 000 000.00	18 513 000.00	0.50
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	830 000.00	704 952.22	0.02
USD BNG BANK NV-REG-S 1.00000% 20-03.06.30	20 000 000.00	16 856 938.41	0.45
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCI-REG-S 1.00000% 20-21.10.30	24 900 000.00	20 974 672.37	0.56
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCI-REG-S 1.37500% 21-20.01.31	5 000 000.00	4 286 353.05	0.12
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.12500% 22-26.01.32	7 500 000.00	6 791 135.99	0.18
USD CDP FINANCIAL INC-REG-S 1.75000% 22-01.02.27	4 500 000.00	4 211 621.10	0.11
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.15000% 17-19.09.27	5 523 000.00	5 353 533.37	0.14
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.75000% 17-02.11.27	7 150 000.00	6 971 971.15	0.19
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONA-REG-S 1.75000% 21-24.11.31	13 000 000.00	11 413 899.90	0.31
USD HONG KONG GOVERNMENT INTER BOND-REG-S 1.37500% 21-02.02.31	5 000 000.00	4 311 708.40	0.12
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	28 300 000.00	24 150 798.04	0.65
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 1.37500% 21-20.04.28	10 000 000.00	9 071 094.30	0.24
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 20-27.08.30	500 000.00	419 333.92	0.01
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 17-22.11.27	6 500 000.00	6 313 939.97	0.17
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDER-REG-S 1.37500% 21-12.10.28	15 000 000.00	13 479 360.75	0.36
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 1.00000% 21-25.02.28	20 000 000.00	17 796 481.20	0.48
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.75000% 17-19.04.29	2 900 000.00	2 882 418.75	0.08
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 4.50000% 18-07.11.28	2 500 000.00	2 608 281.25	0.07
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	8 800 000.00	8 155 400.00	0.22
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	7 500 000.00	6 401 335.72	0.17
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.25000% 20-30.04.30	3 000 000.00	2 715 726.60	0.07
USD QUEBEC, PROVINCE OF 7.50000% 99-15.09.29	3 000 000.00	3 786 175.68	0.10
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-144A 1.00000% 20-06.10.30	2 000 000.00	1 639 900.00	0.05
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 3.62500% 18-01.08.28	2 900 000.00	2 935 551.39	0.08
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 1.00000% 20-06.10.30	8 450 000.00	6 878 891.50	0.19
USD TEMASEK FINANCIAL LTD-REG-S 1.62500% 21-02.08.31	1 500 000.00	1 266 209.99	0.03
USD UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 2.00000% 21-19.10.31	5 000 000.00	4 425 937.50	0.12
米ドル合計		336 659 480.52	9.05

メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		336 659 480.52	9.05
-----------------------	--	----------------	------

債券、固定利付債

米ドル

USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 19-30.09.29	13 400 000.00	12 598 512.50	0.34
USD ALBERTA, PROVINCE OF 1.30000% 20-22.07.30	20 000 000.00	17 133 254.20	0.46
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 19-09.10.29	15 000 000.00	13 579 162.34	0.36
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 20-23.09.30	15 800 000.00	13 181 932.10	0.35
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.75000% 22-15.03.29	25 000 000.00	23 006 581.25	0.62
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 1.25000% 20-21.09.30	1 200 000.00	993 720.00	0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FANNIE MAE 6.25000% 99-15.05.29	26 300 000.00	31 552 502.14	0.85
USD FANNIE MAE 6.62500% 00-15.11.30	10 000 000.00	12 546 894.60	0.34
USD FANNIE MAE 7.25000% 00-15.05.30	8 000 000.00	10 313 001.84	0.28
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.45000% 22-03.02.22	10 000 000.00	8 821 965.00	0.24
USD HONG KONG SUKUK 2017 LTD-REG-S 3.13200% 17-28.02.27	3 319 000.00	3 290 581.07	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-16.09.27	25 000 000.00	21 986 250.00	0.59
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-20.07.28	30 000 000.00	26 693 086.80	0.72
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	36 076 000.00	30 458 244.56	0.82
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	15 800 000.00	13 087 695.69	0.35
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	40 000 000.00	34 390 297.60	0.92
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	20 000 000.00	17 764 228.80	0.48
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.62500% 21-19.01.31	6 000 000.00	5 050 380.00	0.14
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 1.62500% 20-05.10.30	2 393 000.00	1 971 018.38	0.05
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-16.09.30	3 500 000.00	2 923 865.00	0.08
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	23 250 000.00	19 349 812.50	0.52
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	21 070 000.00	17 747 998.45	0.48
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	5 000 000.00	4 962 500.00	0.13
米ドル合計		343 403 484.82	9.24

債券、固定利付債合計		343 403 484.82	9.24
------------	--	----------------	------

財務省証券(T-note)、固定利付債

米ドル

USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.08.27	50 000 000.00	48 259 765.50	1.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.11.27	14 500 000.00	13 972 109.38	0.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 18-15.02.28	17 900 000.00	17 693 730.43	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.05.28	14 000 000.00	13 923 437.50	0.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.08.28	17 900 000.00	17 798 613.33	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	17 400 000.00	17 560 406.25	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	12 500 000.00	12 245 117.24	0.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.05.29	21 200 000.00	20 428 187.50	0.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 17-15.02.27	29 000 000.00	28 080 156.25	0.76
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 17-15.05.27	40 000 000.00	38 929 687.60	1.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-15.08.29	58 500 000.00	53 541 211.23	1.44
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	46 900 000.00	43 235 937.50	1.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-31.12.26	13 000 000.00	12 322 070.28	0.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-31.01.27	50 000 000.00	46 798 828.00	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30	43 000 000.00	38 787 343.75	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 20-28.02.27	50 000 000.00	45 916 015.50	1.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-31.03.27	50 000 000.00	44 730 469.00	1.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.04.27	50 000 000.00	44 339 844.00	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	60 000 000.00	50 207 812.80	1.35
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.05.27	50 000 000.00	44 232 422.00	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.06.27	60 000 000.00	52 975 781.41	1.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.07.27	40 000 000.00	35 026 562.40	0.94
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	40 000 000.00	33 295 312.39	0.90
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.08.27	40 000 000.00	35 167 187.60	0.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27	40 000 000.00	34 859 375.20	0.94
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.10.27	50 000 000.00	43 783 203.00	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	60 000 000.00	50 840 625.00	1.37
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-30.11.27	30 000 000.00	26 407 031.40	0.71
USD AMERICA, UNITED STATE OF TB 0.62500% 20-31.12.27	50 000 000.00	43 921 875.00	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.01.28	50 000 000.00	44 154 297.00	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	70 000 000.00	60 413 281.59	1.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-29.02.28	30 000 000.00	27 075 000.00	0.73
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.03.28	50 000 000.00	45 343 750.00	1.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.04.28	30 000 000.00	27 176 953.20	0.73
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31	29 000 000.00	26 064 882.74	0.70
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.05.28	40 000 000.00	36 181 250.00	0.97
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.06.28	50 000 000.00	45 162 109.50	1.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 21-31.07.28	60 000 000.00	53 268 750.00	1.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.08.31	65 000 000.00	56 296 093.75	1.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-31.08.28	50 000 000.00	44 691 406.00	1.20
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.09.28	30 000 000.00	26 989 453.21	0.73

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.10.28	50 000 000.00	45 296 875.00	1.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-15.11.31	30 000 000.00	26 198 437.51	0.70
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.500000% 21-30.11.28	50 000 000.00	45 615 234.50	1.23
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.12.28	45 000 000.00	40 710 937.50	1.10
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 31.01.22-31.01.29	45 000 000.00	41 684 765.40	1.12
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-15.02.32	45 000 000.00	41 090 625.00	1.11
米ドル合計		1 742 694 220.34	46.87

財務省証券(T-note)、固定利付債合計 1 742 694 220.34 46.87

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計 3 533 888 052.17 95.04

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.85000% 16-18.05.26	10 000 000.00	9 718 827.30	0.26
USD FANNIE MAE 0.75000% 20-08.10.27	10 000 000.00	8 890 239.20	0.24
USD FANNIE MAE 0.87500% 20-05.08.30	30 000 000.00	24 991 477.50	0.67
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.40000% 20-06.07.27	3 000 000.00	2 683 287.87	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 1.55000% 20-09.10.30	2 900 000.00	2 399 678.14	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	3 250 000.00	2 851 913.84	0.08
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 2.00000% 21-16.04.31	2 000 000.00	1 776 200.00	0.05
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.45000% 21-20.01.28	6 020 000.00	5 181 141.90	0.14
米ドル合計		58 492 765.75	1.57

ノート、固定利付債合計 58 492 765.75 1.57

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850% 19-13.09.29	20 000 000.00	19 658 710.80	0.53
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.4000% 22-11.01.32	10 000 000.00	8 619 230.30	0.23
米ドル合計		28 277 941.10	0.76

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計 28 277 941.10 0.76

債券、固定利付債

米ドル	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 3.25000% 18-16.11.28	34 900 000.00	35 289 885.35	0.95
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 300 000.00	2 985 652.63	0.08
米ドル合計		38 275 537.98	1.03

債券、固定利付債合計 38 275 537.98 1.03

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計 125 046 244.83 3.36

公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない
譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.55000% 20-09.10.30	5 800 000.00	4 799 356.28	0.13
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 1.93000% 21-13.12.28	4 550 000.00	4 085 469.43	0.11
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.07600% 21-13.12.31	22 500 000.00	19 386 229.28	0.52
米ドル合計		28 271 054.99	0.76

ノート、固定利付債合計 28 271 054.99 0.76

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.05000% 19-17.06.29	4 100 000.00	3 859 958.44	0.10
米ドル合計		3 859 958.44	0.10
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計			
		3 859 958.44	0.10
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない 譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		32 131 013.43	0.86
投資有価証券合計			
		3 691 065 310.43	99.26

先渡為替契約

購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日

GBP	138 952 600.00	USD	182 424 032.07	3.5.2022	-7 969 042.76	-0.21
JPY	3 464 600 000.00	USD	28 500 335.79	6.5.2022	-1 755 148.10	-0.05
SGD	12 228 200.00	USD	9 030 894.79	6.5.2022	-175 835.00	0.00
CHF	630 201 400.00	USD	681 691 612.57	2.5.2022	-32 434 516.81	-0.87
EUR	1 049 494 300.00	USD	1 171 419 300.30	2.5.2022	-64 255 288.37	-1.73
USD	8 144 455.49	EUR	7 296 100.00	2.5.2022	447 434.79	0.01
USD	1 175 150.26	CHF	1 084 700.00	2.5.2022	57 651.68	0.00
GBP	253 500.00	USD	331 969.89	3.5.2022	-13 700.64	0.00
USD	1 103 810.84	CHF	1 021 600.00	2.5.2022	51 320.24	0.00
SGD	33 500.00	USD	24 689.03	6.5.2022	-429.98	0.00
EUR	1 759 300.00	USD	1 931 344.06	2.5.2022	-75 370.52	0.00
USD	72 938 605.54	EUR	66 632 200.89	2.5.2022	2 644 965.20	0.07
USD	86 893 829.60	CHF	80 592 984.23	2.5.2022	3 863 917.45	0.10
USD	56 689 024.25	GBP	43 180 780.64	3.5.2022	2 475 554.15	0.07
GBP	581 900.00	USD	761 616.15	3.5.2022	-31 040.70	0.00
USD	17 526 486.89	EUR	16 033 600.00	2.5.2022	611 840.57	0.02
USD	2 434 585.80	GBP	1 863 100.00	3.5.2022	95 463.75	0.00
USD	9 871 793.50	CHF	9 201 400.00	2.5.2022	392 166.45	0.01
USD	269 766.87	SGD	367 100.00	6.5.2022	3 931.14	0.00
USD	482 048.03	JPY	59 700 000.00	6.5.2022	21 190.30	0.00
USD	2 506 328.90	EUR	2 304 900.00	2.5.2022	74 774.64	0.00
USD	1 473 704.76	CHF	1 372 500.00	2.5.2022	59 703.83	0.00
USD	369 991.08	GBP	283 600.00	3.5.2022	13 931.28	0.00
JPY	9 500 000.00	USD	75 896.04	6.5.2022	-2 560.22	0.00
USD	1 710 275.35	CHF	1 595 900.00	2.5.2022	66 119.37	0.00
USD	1 568 834.17	EUR	1 448 700.00	2.5.2022	40 528.10	0.00
USD	101 832.25	JPY	12 800 000.00	6.5.2022	3 021.88	0.00
USD	273 409.37	JPY	34 400 000.00	6.5.2022	7 856.50	0.00
USD	1 214 764.22	CHF	1 144 800.00	2.5.2022	35 348.36	0.00
USD	1 624 195.36	EUR	1 502 400.00	2.5.2022	39 238.48	0.00
USD	1 135 802.06	CHF	1 077 000.00	2.5.2022	26 236.31	0.00
USD	1 654 899.00	GBP	1 267 100.00	3.5.2022	64 054.95	0.00
USD	7 918 868.71	CHF	7 521 800.00	2.5.2022	169 628.51	0.01
USD	14 439 848.43	EUR	13 288 200.00	2.5.2022	421 461.84	0.01
USD	361 452.13	JPY	46 400 000.00	6.5.2022	3 264.54	0.00
USD	118 386.55	SGD	161 200.00	6.5.2022	1 653.45	0.00
USD	1 140 266.80	CHF	1 092 800.00	2.5.2022	14 423.29	0.00
JPY	18 800 000.00	USD	147 303.33	6.5.2022	-2 175.60	0.00
EUR	2 014 100.00	USD	2 150 326.67	2.5.2022	-25 551.87	0.00
GBP	93 193 500.00	USD	116 595 944.18	1.6.2022	407 144.15	0.01
USD	116 600 810.50	GBP	93 193 419.36	3.5.2022	-403 527.51	-0.01
SGD	11 733 400.00	USD	8 467 623.79	2.6.2022	28 762.91	0.00
USD	8 467 984.34	SGD	11 733 400.00	6.5.2022	-28 765.67	0.00
EUR	944 761 600.00	USD	995 820 295.91	2.6.2022	2 273 228.78	0.06

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量/ 額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)		
先渡為替契約(つづき)					
購入通貨/購入額/売却通貨/売却額/満期日					
USD	25 612 786.45	JPY 3 339 600 000.00	6.5.2022	-167 456.24	0.00
JPY	3 339 600 000.00	USD 25 634 609.33	2.6.2022	170 004.89	0.01
CHF	524 496 000.00	USD 540 048 311.27	2.6.2022	1 158 917.10	0.03
USD	212 654.54	GBP 170 900.00	1.6.2022	-1 907.93	0.00
CHF	1 605 500.00	USD 1 653 916.76	2.6.2022	2 736.88	0.00
先渡為替契約合計				-91 594 842.16	-2.46
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産				41 951 863.54	1.13
その他の資産および負債				77 053 110.79	2.07
純資産総額				3 718 475 442.60	100.00

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2021年6月1日から2022年5月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年5月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	クラス米ドル F-acc投資証券	260,179.398 (175,595.000)	325,527.525 (146,499.000)	1,517,278.568 (642,038.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	217,811.000 (213,461.000)	103,612.000 (103,492.000)	551,922.208 (487,011.708)
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	10,839,274.703 (78,309.000)	6,031,098.985 (42,647.000)	7,811,669.716 (183,583.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	96,916.000 (96,916.000)	20,415.000 (25,785.000)	165,053.000 (165,382.000)
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	9,682,371.814 (102,837.000)	5,032,573.637 (73,304.000)	7,910,648.961 (313,656.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	196,706.000 (196,706.000)	35,948.000 (44,713.000)	357,259.000 (359,154.000)

(注1) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡し日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。

(注2) フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンドは2008年2月20日に運用を開始し、クラス米ドルF-acc投資証券は2008年2月20日に運用が開始され、クラス円ヘッジF-acc投資証券は2017年1月6日に運用が開始された。

(注3) フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドルは2005年8月31日に運用を開始し、クラスF-acc投資証券は2005年8月31日に運用が開始され、クラス円ヘッジF-acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。

(注4) フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2006年10月27日に運用を開始し、クラスF-acc投資証券は2006年10月27日に運用が開始され、クラス円ヘッジF-acc投資証券は2019年5月24日に運用が開始された。