

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2022年9月30日

【計算期間】 第21期中（自 2022年1月1日 至 2022年6月30日）

【ファンド名】 ジャナス・セレクション
(Janus Selection)

【発行者名】 ヘンダーソン・マネジメント・エスエー（注1）
(Henderson Management, S.A.)

【代表者の役職氏名】 取締役
シビル・ホフマン（Sybille Hofmann）
イグナチオ・デ・ラ・マーサ（Ignacio de la Maza）
マッテオ・カンドルフィーニ（Matteo Candolfini）
ポール・グリーンウッド（Paul Greenwood）

【本店の所在の場所】 ルクセンブルク大公国、ルクセンブルク市L-1273、ビトブル通り
2番地
(2 rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 森 下 国 彦

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
電話番号 03(6775)1000

【事務連絡者氏名】 弁護士 橋 本 雅 行
同 島 田 充 生
同 上 山 紗 穂
同 打 田 峻
同 小 峰 駿 介

【連絡場所】 東京都千代田区大手町一丁目1番1号大手町パークビルディング
アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業

【電話番号】 (03)6775-1000

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません

(注 1) 管理会社であるヘンダーソン・マネジメント・エスエーは、2022年10月 1 日付で、ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・ヨーロッパ・エスエーに名称を変更します。以下同じです。

(注 2) 本書中における各種通貨の円貨換算は、別段の記載のあるものを除き、2022年 7 月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行公表の対顧客電信売買相場の仲値(1 米ドル = 134. 61円、 1 ユーロ = 137. 25円、 1 豪ドル = 94. 20円、 1 NZドル = 84. 64円)によります。

1 【ファンドの運用状況】

ジャナス・セレクション(以下「当ファンド」又は「ファンド」といいます。)のサブファンドの運用状況は、以下のとおりです。

(1) 【投資状況】

(2022年7月29日現在)

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンドクラスI受益証券	(注) アイルランド	353,498,971 (47,584百万円)	104.32%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		-14,642,187 (-1,971百万円)	-4.32%
純資産総額		338,856,784 (45,614百万円)	100.00%

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンドクラスI受益証券	(注) アイルランド	96,850,278 (13,037百万円)	105.21%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		-4,798,262 (-646百万円)	-5.21%
純資産総額		92,052,016 (12,391百万円)	100.00%

ジャナス・ハイイールド・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンドクラスI受益証券	(注) アイルランド	256,327,991 (34,504百万円)	112.96%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		-29,403,162 (-3,958百万円)	-12.96%
純資産総額		226,924,829 (30,546百万円)	100.00%

ジャナス・バランス・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド クラスⅠ受益証券	(注) アイルランド	247,396,331 (33,302百万円)	99.94%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		159,088 (21百万円)	0.06%
純資産総額		247,555,419 (33,323百万円)	100.00%

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・USスモール・ミッド・ キャップ・バリュー・ファンド クラスⅠ受益証 券	(注) アイルランド	130,912,521 (17,622百万円)	99.90%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		130,636 (18百万円)	0.10%
純資産総額		131,043,157 (17,640百万円)	100.00%

ジャナス・フォーティ・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・フ ァンド クラスⅠ受益証券	(注) アイルランド	573,687,168 (77,224百万円)	99.74%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		1,505,849 (203百万円)	0.26%
純資産総額		575,193,017 (77,427百万円)	100.00%

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサ イエンス・ファンド クラスⅠ受益証券	(注) アイルランド	160,799,350 (21,645百万円)	99.61%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		632,454 (85百万円)	0.39%
純資産総額		161,431,804 (21,730百万円)	100.00%

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

資産の種類	発行国名	時価合計（米ドル）	投資比率
ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエ ステート・エクイティ・インカム・ファンド ク ラスⅠ 受益証券	(注) アイルランド	58,096,448 (7,820百万円)	99.89%
現金、受取債権及びその他の資産（負債控除後）		66,222 (9百万円)	0.11%
純資産総額		58,162,670 (7,829百万円)	100.00%

(注) ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンドの各受益証券はアイルランドにおいて発行され、ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド及びジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・エクイティ・インカム・ファンドを除き、主として米国内で発行される有価証券に投資するものです。

(2) 【運用実績】

【純資産の推移】

2022年7月末日から同日前1年以内における各月末並びに直近10計算期間の各会計年度末の純資産の推移は次の通りです。1口当たりの純資産価格のうち12月末日の数値は、12月31日の数値を記載しております。このため、販売会社が公表する毎月最終営業日における1口当たりの純資産価格と、各月末の1口当たりの純資産価格とが異なる場合があります。

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	472,879	63,654	183.99	24,767	18,698	2,517	14,413
第12会計年度 (2013年12月31日)	377,874	50,866	182.13	24,517	15,092	2,032	14,178
第13会計年度 (2014年12月31日)	337,643	45,450	189.29	25,480	12,884	1,734	14,663
第14会計年度 (2015年12月31日)	305,694	41,149	187.87	25,289	12,884	1,734	14,446
第15会計年度 (2016年12月31日)	371,397	49,994	190.78	25,681	18,314	2,465	14,428
第16会計年度 (2017年12月31日)	324,639	43,700	195.69	26,342	16,935	2,280	14,486
第17会計年度 (2018年12月31日)	303,644	40,874	192.17	25,868	12,258	1,650	13,840
第18会計年度 (2019年12月31日)	382,308	51,462	208.08	28,010	16,916	2,277	14,535
第19会計年度 (2020年12月31日)	502,131	67,592	227.86	30,672	24,085	3,242	15,672
第20会計年度 (2021年12月31日)	424,256	57,109	223.67	30,108	19,633	2,643	15,309
2021年8月末日	478,938	64,470	226.10	30,435	20,235	2,724	15,510
2021年9月末日	467,421	62,920	224.27	30,189	19,687	2,650	15,377
2021年10月末日	456,222	61,412	223.56	30,093	19,009	2,559	15,323
2021年11月末日	441,936	59,489	223.85	30,132	20,204	2,720	15,334
2021年12月末日	424,256	57,109	223.67	30,108	19,633	2,643	15,309
2022年1月末日	404,062	54,391	218.48	29,410	19,155	2,578	14,949
2022年2月末日	392,705	52,862	215.76	29,043	18,299	2,463	14,761
2022年3月末日	370,389	49,858	208.72	28,096	17,263	2,324	14,256
2022年4月末日	342,778	46,141	200.98	27,054	16,577	2,231	13,714
2022年5月末日	338,511	45,567	201.35	27,104	16,672	2,244	13,722
2022年6月末日	313,012	42,135	197.85	26,633	15,891	2,139	13,457
2022年7月末日	317,124	42,688	202.93	27,316	16,631	2,239	13,772

	クラス A（豪ドル）受益証券				クラス A（NZドル）受益証券			
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格		純資産総額		1口当たりの 純資産価格	
	千米ドル	百万円	豪ドル	円	千米ドル	百万円	NZドル	円
第20会計年度 (2021年12月31日)	4,096	551	98.73	9,300	628	84	98.91	8,372
2021年 8 月末日	4,067	547	99.88	9,409	484	65	99.90	8,456
2021年 9 月末日	4,330	583	99.04	9,330	560	75	99.08	8,386
2021年10月末日	4,065	547	98.72	9,299	584	79	98.78	8,361
2021年11月末日	3,947	531	98.85	9,312	600	81	98.95	8,375
2021年12月末日	4,096	551	98.73	9,300	628	84	98.91	8,372
2022年 1 月末日	4,056	546	96.40	9,081	589	79	96.63	8,179
2022年 2 月末日	4,127	556	95.20	8,968	619	83	95.48	8,081
2022年 3 月末日	3,994	538	92.05	8,671	634	85	92.38	7,819
2022年 4 月末日	3,863	520	88.59	8,345	563	76	89.01	7,534
2022年 5 月末日	3,839	517	88.68	8,354	569	77	89.16	7,547
2022年 6 月末日	3,690	497	87.06	8,201	541	73	87.61	7,415
2022年 7 月末日	4,102	552	89.30	8,412	828	111	89.89	7,608

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	1,113	150	12,304
第12会計年度 (2013年12月31日)	766	103	14,871
第13会計年度 (2014年12月31日)	376	51	17,660
第14会計年度 (2015年12月31日)	532	72	17,668
第15会計年度 (2016年12月31日)	184	25	17,525
第16会計年度 (2017年12月31日)	45	6	17,407
第17会計年度 (2018年12月31日)	43	6	16,703
第18会計年度 (2019年12月31日)	37	5	18,010
第19会計年度 (2020年12月31日)	411	55	18,830
第20会計年度 (2021年12月31日)	113	15	20,682
2021年 8 月末日	129	17	19,968
2021年 9 月末日	114	15	20,043
2021年10月末日	114	15	20,468
2021年11月末日	114	15	20,332
2021年12月末日	113	15	20,682
2022年 1 月末日	111	15	20,217
2022年 2 月末日	109	15	19,951
2022年 3 月末日	105	14	20,445
2022年 4 月末日	101	14	20,993
2022年 5 月末日	171	23	20,870
2022年 6 月末日	168	23	21,621
2022年 7 月末日	172	23	21,803

ジャンナス・マルチセクター・インカム・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第19会計年度 (2020年12月31日)	106,279	14,306	103.34	13,911	10,021	1,349	10,319
第20会計年度 (2021年12月31日)	122,350	16,470	104.75	14,100	21,556	2,902	10,416
2021年8月末日	125,893	16,947	105.67	14,224	22,834	3,074	10,526
2021年9月末日	129,713	17,461	105.30	14,174	23,242	3,129	10,485
2021年10月末日	128,965	17,360	104.73	14,098	23,017	3,098	10,425
2021年11月末日	126,530	17,032	104.16	14,021	22,465	3,024	10,364
2021年12月末日	122,350	16,470	104.75	14,100	21,556	2,902	10,416
2022年1月末日	117,891	15,869	102.83	13,842	18,275	2,460	10,221
2022年2月末日	112,812	15,186	101.30	13,636	17,600	2,369	10,070
2022年3月末日	105,057	14,142	99.57	13,403	16,000	2,154	9,886
2022年4月末日	94,903	12,775	96.86	13,038	15,144	2,039	9,608
2022年5月末日	87,256	11,745	95.81	12,897	11,852	1,595	9,494
2022年6月末日	77,687	10,457	92.43	12,442	10,760	1,448	9,142
2022年7月末日	76,432	10,289	95.65	12,875	10,336	1,391	9,440

	クラスA（豪ドル）受益証券				クラスA（NZドル）受益証券			
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格	
	千米ドル	百万円	豪ドル	円	千米ドル	百万円	NZドル	円
第20会計年度 (2021年12月31日)	6,237	840	99.51	9,374	932	126	99.71	8,439
2021年8月末日	4,372	589	100.50	9,467	589	79	100.51	8,507
2021年9月末日	5,162	695	100.11	9,430	613	83	100.15	8,477
2021年10月末日	5,580	751	99.57	9,379	655	88	99.63	8,433
2021年11月末日	5,741	773	99.00	9,326	896	121	99.11	8,389
2021年12月末日	6,237	840	99.51	9,374	932	126	99.71	8,439
2022年1月末日	5,982	805	97.64	9,198	900	121	97.89	8,285
2022年2月末日	6,053	815	96.19	9,061	933	126	96.49	8,167
2022年3月末日	5,699	767	94.45	8,897	923	124	94.86	8,029
2022年4月末日	4,854	653	91.80	8,648	837	113	92.31	7,813
2022年5月末日	4,855	653	90.72	8,546	835	112	91.28	7,726
2022年6月末日	4,278	576	87.42	8,235	772	104	88.06	7,453
2022年7月末日	4,481	603	90.45	8,520	803	108	91.14	7,714

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	232,906	31,351	206.13	27,747	14,644	1,971	16,357
第12会計年度 (2013年12月31日)	244,296	32,885	219.16	29,501	17,735	2,387	17,334
第13会計年度 (2014年12月31日)	217,858	29,326	218.04	29,350	11,783	1,586	17,192
第14会計年度 (2015年12月31日)	156,873	21,117	212.13	28,555	8,154	1,098	16,639
第15会計年度 (2016年12月31日)	169,491	22,815	236.92	31,892	12,139	1,634	18,341
第16会計年度 (2017年12月31日)	189,918	25,565	248.52	33,453	17,556	2,363	18,860
第17会計年度 (2018年12月31日)	151,604	20,407	238.60	32,118	11,624	1,565	17,632
第18会計年度 (2019年12月31日)	174,696	23,516	270.98	36,477	12,029	1,619	19,444
第19会計年度 (2020年12月31日)	171,111	23,033	285.42	38,420	14,349	1,932	20,190
第20会計年度 (2021年12月31日)	184,673	24,859	298.37	40,164	18,400	2,477	21,030
2021年8月末日	187,256	25,206	297.74	40,079	18,021	2,426	21,013
2021年9月末日	187,383	25,224	297.03	39,983	18,829	2,535	20,955
2021年10月末日	186,251	25,071	295.70	39,804	18,668	2,513	20,857
2021年11月末日	183,577	24,711	292.36	39,355	17,973	2,419	20,619
2021年12月末日	184,673	24,859	298.37	40,164	18,400	2,477	21,030
2022年1月末日	177,393	23,879	288.58	38,846	17,471	2,352	20,331
2022年2月末日	173,071	23,297	284.99	38,363	17,105	2,302	20,079
2022年3月末日	167,644	22,567	281.03	37,829	16,480	2,218	19,774
2022年4月末日	155,317	20,907	267.87	36,058	12,077	1,626	18,834
2022年5月末日	152,084	20,472	267.38	35,992	13,018	1,752	18,784
2022年6月末日	137,055	18,449	247.71	33,344	11,922	1,605	17,376
2022年7月末日	143,311	19,291	262.01	35,269	12,789	1,722	18,342

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	2,703	364	13,330
第12会計年度 (2013年12月31日)	1,686	227	17,348
第13会計年度 (2014年12月31日)	1,422	191	19,769
第14会計年度 (2015年12月31日)	804	108	19,437
第15会計年度 (2016年12月31日)	645	87	21,257
第16会計年度 (2017年12月31日)	289	39	21,647
第17会計年度 (2018年12月31日)	132	18	20,359
第18会計年度 (2019年12月31日)	149	20	23,083
第19会計年度 (2020年12月31日)	102	14	23,271
第20会計年度 (2021年12月31日)	86	12	27,288
2021年 8 月末日	103	14	25,984
2021年 9 月末日	86	12	26,239
2021年10月末日	86	12	26,766
2021年11月末日	85	11	26,259
2021年12月末日	86	12	27,288
2022年 1 月末日	83	11	26,418
2022年 2 月末日	82	11	26,075
2022年 3 月末日	80	11	27,243
2022年 4 月末日	77	10	27,697
2022年 5 月末日	77	10	27,439
2022年 6 月末日	71	10	26,807
2022年 7 月末日	75	10	27,883

	クラス A（米ドル）受益証券（毎月分配型）（注 2）							
	純資産総額				1口当たりの純資産価格			
	千米ドル （分配落）	百万円 （分配落）	千米ドル （分配付）	百万円 （分配付）	米ドル （分配落）	円 （分配落）	米ドル （分配付）	円 （分配付）
第11会計年度 (2012年12月31日)	64,085	8,626	64,360	8,663	99.83	13,438	100.25	13,495
第12会計年度 (2013年12月31日)	64,524	8,686	64,799	8,723	100.80	13,569	101.23	13,627
第13会計年度 (2014年12月31日)	54,054	7,276	54,300	7,309	95.27	12,824	95.70	12,882
第14会計年度 (2015年12月31日)	42,535	5,726	42,747	5,754	87.74	11,811	88.18	11,870
第15会計年度 (2016年12月31日)	42,331	5,698	42,529	5,725	92.51	12,453	92.94	12,511
第16会計年度 (2017年12月31日)	43,448	5,849	43,657	5,877	91.78	12,355	92.22	12,414
第17会計年度 (2018年12月31日)	35,886	4,831	36,071	4,856	83.13	11,190	83.56	11,248
第18会計年度 (2019年12月31日)	59,407	7,997	59,693	8,035	89.00	11,980	89.43	12,038
第19会計年度 (2020年12月31日)	64,521	8,685	64,733	8,714	88.82	11,956	89.12	11,996
第20会計年度 (2021年12月31日)	59,188	7,967	59,387	7,994	89.18	12,005	89.48	12,045
2021年 8 月末日	62,017	8,348	62,225	8,376	90.20	12,142	90.50	12,182
2021年 9 月末日	61,566	8,287	61,772	8,315	89.69	12,073	89.99	12,114
2021年10月末日	60,063	8,085	60,267	8,113	88.99	11,979	89.29	12,019
2021年11月末日	59,163	7,964	59,366	7,991	87.69	11,804	87.99	11,844
2021年12月末日	59,188	7,967	59,387	7,994	89.18	12,005	89.48	12,045
2022年 1 月末日	56,987	7,671	57,186	7,698	85.97	11,572	86.27	11,613
2022年 2 月末日	54,566	7,345	54,759	7,371	84.59	11,387	84.89	11,427
2022年 3 月末日	53,156	7,155	53,350	7,181	83.11	11,187	83.41	11,228
2022年 4 月末日	48,778	6,566	48,969	6,592	78.93	10,625	79.23	10,665
2022年 5 月末日	47,511	6,395	47,694	6,420	78.47	10,563	78.77	10,603
2022年 6 月末日	43,281	5,826	43,461	5,850	72.41	9,747	72.71	9,787
2022年 7 月末日	45,477	6,122	45,656	6,146	76.28	10,268	76.58	10,308

	クラスA（円）受益証券（毎月分配型）（注2）					
	純資産総額				1口当たりの純資産価格	
	千米ドル （分配落）	百万円 （分配落）	千米ドル （分配付）	百万円 （分配付）	円 （分配落）	円 （分配付）
第11会計年度 （2012年12月31日）	37,905	5,102	38,069	5,124	8,413	8,449
第12会計年度 （2013年12月31日）	34,873	4,694	35,022	4,714	10,325	10,370
第13会計年度 （2014年12月31日）	29,539	3,976	29,674	3,994	11,101	11,151
第14会計年度 （2015年12月31日）	22,135	2,980	22,244	2,994	10,259	9,666
第15会計年度 （2016年12月31日）	22,370	3,011	22,474	3,025	10,517	10,144
第16会計年度 （2017年12月31日）	25,561	3,441	25,682	3,457	10,059	9,531
第17会計年度 （2018年12月31日）	20,062	2,701	20,166	2,715	8,863	8,976
第18会計年度 （2019年12月31日）	21,115	2,842	21,217	2,856	9,407	9,367
第19会計年度 （2020年12月31日）	24,291	3,270	24,377	3,281	8,918	8,949
第20会計年度 （2021年12月31日）	25,676	3,456	25,763	3,468	9,964	9,998
2021年8月末日	26,002	3,500	26,094	3,512	9,642	9,675
2021年9月末日	25,657	3,454	25,746	3,466	9,698	9,731
2021年10月末日	25,483	3,430	25,571	3,442	9,853	9,887
2021年11月末日	24,850	3,345	24,939	3,357	9,628	9,662
2021年12月末日	25,676	3,456	25,763	3,468	9,964	9,998
2022年1月末日	24,673	3,321	24,761	3,333	9,608	9,642
2022年2月末日	24,249	3,264	24,338	3,276	9,444	9,479
2022年3月末日	26,690	3,593	26,779	3,605	9,824	9,859
2022年4月末日	25,383	3,417	25,481	3,430	9,944	9,982
2022年5月末日	26,848	3,614	26,948	3,627	9,807	9,846
2022年6月末日	23,650	3,184	23,756	3,198	9,536	9,577
2022年7月末日	25,273	3,402	25,375	3,416	9,871	9,913

ジャナス・バランス・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	41,479	5,583	163.87	22,059	4,220	568	13,278
第12会計年度 (2013年12月31日)	52,753	7,101	190.33	25,620	4,218	568	15,388
第13会計年度 (2014年12月31日)	58,232	7,839	198.20	26,680	4,429	596	15,986
第14会計年度 (2015年12月31日)	56,076	7,548	196.49	26,450	4,925	663	15,783
第15会計年度 (2016年12月31日)	51,971	6,996	201.84	27,170	5,073	683	16,025
第16会計年度 (2017年12月31日)	59,303	7,983	234.43	31,557	6,816	918	18,267
第17会計年度 (2018年12月31日)	71,541	9,630	231.62	31,178	6,880	926	17,585
第18会計年度 (2019年12月31日)	83,061	11,181	277.51	37,356	8,859	1,193	20,483
第19会計年度 (2020年12月31日)	135,094	18,185	311.32	41,907	10,459	1,408	22,725
第20会計年度 (2021年12月31日)	263,543	35,476	358.88	48,309	23,125	3,113	26,093
2021年8月末日	229,361	30,874	348.00	46,844	20,057	2,700	25,330
2021年9月末日	232,915	31,353	334.95	45,088	20,254	2,726	24,374
2021年10月末日	247,924	33,373	350.43	47,171	21,434	2,885	25,498
2021年11月末日	254,661	34,280	349.73	47,077	22,283	3,000	25,444
2021年12月末日	263,543	35,476	358.88	48,309	23,125	3,113	26,093
2022年1月末日	252,587	34,001	342.25	46,070	22,653	3,049	24,879
2022年2月末日	248,912	33,506	334.69	45,053	22,197	2,988	24,332
2022年3月末日	247,999	33,383	335.54	45,167	21,255	2,861	24,366
2022年4月末日	227,656	30,645	311.54	41,936	19,846	2,671	22,610
2022年5月末日	225,917	30,411	311.05	41,870	21,188	2,852	22,548
2022年6月末日	213,026	28,675	295.36	39,758	20,156	2,713	21,368
2022年7月末日	225,134	30,305	313.53	42,204	22,382	3,013	22,630

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	558	75	12,232
第12会計年度 (2013年12月31日)	415	56	17,417
第13会計年度 (2014年12月31日)	219	29	20,805
第14会計年度 (2015年12月31日)	102	14	20,874
第15会計年度 (2016年12月31日)	160	22	21,028
第16会計年度 (2017年12月31日)	107	14	23,746
第17会計年度 (2018年12月31日)	76	10	23,018
第18会計年度 (2019年12月31日)	36	5	27,572
第19会計年度 (2020年12月31日)	37	5	29,652
第20会計年度 (2021年12月31日)	37	5	38,399
2021年 8 月末日	38	5	35,513
2021年 9 月末日	35	5	34,603
2021年10月末日	36	5	37,099
2021年11月末日	36	5	36,744
2021年12月末日	37	5	38,399
2022年 1 月末日	35	5	36,658
2022年 2 月末日	34	5	35,836
2022年 3 月末日	170	23	38,069
2022年 4 月末日	154	21	37,705
2022年 5 月末日	154	21	37,369
2022年 6 月末日	58	8	37,422
2022年 7 月末日	39	5	39,069

ジャンナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	37,693	5,074	173.32	23,331	3,250	437	14,666
第12会計年度 (2013年12月31日)	69,669	9,378	215.84	29,054	5,290	712	18,228
第13会計年度 (2014年12月31日)	68,157	9,175	232.19	31,255	4,029	542	19,601
第14会計年度 (2015年12月31日)	61,612	8,294	221.52	29,819	3,699	498	18,672
第15会計年度 (2016年12月31日)	57,914	7,796	253.42	34,113	3,808	513	21,171
第16会計年度 (2017年12月31日)	62,931	8,471	283.99	38,228	4,836	651	23,315
第17会計年度 (2018年12月31日)	56,010	7,540	257.04	34,600	3,962	533	20,575
第18会計年度 (2019年12月31日)	56,392	7,591	323.53	43,550	3,718	500	25,200
第19会計年度 (2020年12月31日)	67,574	9,096	332.18	44,715	4,877	656	25,653
第20会計年度 (2021年12月31日)	135,351	18,220	398.12	53,591	10,144	1,365	30,679
2021年8月末日	130,722	17,596	391.56	52,708	10,102	1,360	30,182
2021年9月末日	122,244	16,455	374.44	50,403	10,095	1,359	28,860
2021年10月末日	126,396	17,014	389.55	52,437	10,226	1,377	30,019
2021年11月末日	127,649	17,183	374.63	50,429	10,011	1,348	28,876
2021年12月末日	135,351	18,220	398.12	53,591	10,144	1,365	30,679
2022年1月末日	129,931	17,490	377.17	50,771	9,311	1,253	29,051
2022年2月末日	133,659	17,992	382.04	51,426	9,887	1,331	29,427
2022年3月末日	132,702	17,863	380.03	51,156	9,585	1,290	29,250
2022年4月末日	123,332	16,602	357.57	48,132	8,906	1,199	27,515
2022年5月末日	125,429	16,884	368.79	49,643	9,911	1,334	28,342
2022年6月末日	111,612	15,024	331.56	44,631	9,026	1,215	25,441
2022年7月末日	120,858	16,269	363.49	48,929	10,121	1,362	27,814

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	1,194	161	11,105
第12会計年度 (2013年12月31日)	1,040	140	16,954
第13会計年度 (2014年12月31日)	1,138	153	20,922
第14会計年度 (2015年12月31日)	205	28	20,201
第15会計年度 (2016年12月31日)	432	58	22,664
第16会計年度 (2017年12月31日)	321	43	24,693
第17会計年度 (2018年12月31日)	100	13	21,928
第18会計年度 (2019年12月31日)	100	13	27,594
第19会計年度 (2020年12月31日)	91	12	27,160
第20会計年度 (2021年12月31日)	121	16	36,566
2021年 8 月末日	108	15	34,301
2021年 9 月末日	103	14	33,206
2021年10月末日	106	14	35,404
2021年11月末日	113	15	33,789
2021年12月末日	121	16	36,566
2022年 1 月末日	113	15	34,679
2022年 2 月末日	114	15	35,113
2022年 3 月末日	123	17	37,011
2022年 4 月末日	117	16	37,147
2022年 5 月末日	157	21	38,029
2022年 6 月末日	71	10	36,058
2022年 7 月末日	64	9	38,878

ジャナス・フォーティ・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	46,261	6,227	147.97	19,918	4,959	668	12,624
第12会計年度 (2013年12月31日)	76,282	10,268	201.24	27,089	4,443	598	17,204
第13会計年度 (2014年12月31日)	85,300	11,482	219.93	29,605	5,434	731	18,826
第14会計年度 (2015年12月31日)	110,884	14,926	231.54	31,168	5,972	804	19,818
第15会計年度 (2016年12月31日)	91,822	12,360	225.15	30,307	4,502	606	19,112
第16会計年度 (2017年12月31日)	79,710	10,730	287.78	38,738	5,332	718	23,998
第17会計年度 (2018年12月31日)	141,561	19,056	286.46	38,560	7,907	1,064	23,308
第18会計年度 (2019年12月31日)	131,269	17,670	384.95	51,818	8,472	1,140	30,479
第19会計年度 (2020年12月31日)	338,325	45,542	530.20	71,370	22,144	2,981	41,650
第20会計年度 (2021年12月31日)	612,817	82,491	643.00	86,554	65,091	8,762	50,293
2021年8月末日	531,762	71,581	646.45	87,019	46,222	6,222	50,617
2021年9月末日	526,698	70,899	612.54	82,454	47,375	6,377	47,949
2021年10月末日	564,199	75,947	642.21	86,448	53,862	7,250	50,269
2021年11月末日	581,078	78,219	638.60	85,962	58,240	7,840	49,974
2021年12月末日	612,817	82,491	643.00	86,554	65,091	8,762	50,293
2022年1月末日	558,016	75,114	582.03	78,347	63,749	8,581	45,523
2022年2月末日	548,744	73,866	559.19	75,273	66,274	8,921	43,743
2022年3月末日	566,548	76,263	568.63	76,543	75,634	10,181	44,430
2022年4月末日	487,724	65,652	490.78	66,064	67,166	9,041	38,341
2022年5月末日	467,846	62,977	468.80	63,105	67,378	9,070	36,579
2022年6月末日	425,617	57,292	422.51	56,874	65,003	8,750	32,912
2022年7月末日	471,803	63,509	469.97	63,263	74,353	10,009	36,502

	クラス A（豪ドル）受益証券				クラス A（NZドル）受益証券			
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格		純資産総額		1口当たりの 純資産価格	
	千米ドル	百万円	豪ドル	円	千米ドル	百万円	NZドル	円
第20会計年度 (2021年12月31日)	28,444	3,829	106.31	10,014	2,172	292	106.50	9,014
2021年 8 月末日	16,693	2,247	107.22	10,100	1,556	209	107.22	9,075
2021年 9 月末日	23,245	3,129	101.53	9,564	1,646	222	101.54	8,594
2021年10月末日	27,993	3,768	106.40	10,023	1,980	267	106.42	9,007
2021年11月末日	26,012	3,501	105.79	9,965	1,893	255	105.85	8,959
2021年12月末日	28,444	3,829	106.31	10,014	2,172	292	106.50	9,014
2022年 1 月末日	29,435	3,962	96.09	9,052	2,028	273	96.33	8,153
2022年 2 月末日	30,742	4,138	92.26	8,691	2,145	289	92.59	7,837
2022年 3 月末日	32,922	4,432	93.50	8,808	2,385	321	94.00	7,956
2022年 4 月末日	26,626	3,584	80.46	7,579	1,923	259	81.02	6,858
2022年 5 月末日	26,431	3,558	76.51	7,207	1,874	252	77.13	6,528
2022年 6 月末日	23,830	3,208	68.74	6,475	1,695	228	69.42	5,876
2022年 7 月末日	26,237	3,532	76.32	7,189	2,092	282	77.13	6,528

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	2,817	379	11,816
第12会計年度 (2013年12月31日)	1,861	251	19,698
第13会計年度 (2014年12月31日)	1,323	178	24,695
第14会計年度 (2015年12月31日)	945	127	26,302
第15会計年度 (2016年12月31日)	860	116	25,083
第16会計年度 (2017年12月31日)	1,201	162	31,171
第17会計年度 (2018年12月31日)	1,075	145	30,442
第18会計年度 (2019年12月31日)	1,183	159	40,898
第19会計年度 (2020年12月31日)	779	105	53,999
第20会計年度 (2021年12月31日)	1,145	154	73,564
2021年 8 月末日	972	131	70,543
2021年 9 月末日	922	124	67,668
2021年10月末日	1,132	152	72,701
2021年11月末日	1,136	153	71,743
2021年12月末日	1,145	154	73,564
2022年 1 月末日	1,033	139	66,658
2022年 2 月末日	993	134	64,016
2022年 3 月末日	1,064	143	68,980
2022年 4 月末日	919	124	63,508
2022年 5 月末日	832	112	60,216
2022年 6 月末日	643	87	57,235
2022年 7 月末日	708	95	62,612

ジャンナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券				クラスA（円）受益証券		
	純資産総額		1口当たりの純資産価格		純資産総額		1口当たりの純資産価格
	千米ドル	百万円	米ドル	円	千米ドル	百万円	円
第20会計年度 (2021年12月31日)	154,330	20,774	100.66	13,550	42,968	5,784	10,053
2021年8月末日	89,468	12,043	101.83	13,707	23,711	3,192	10,182
2021年9月末日	125,718	16,923	97.74	13,157	32,659	4,396	9,770
2021年10月末日	141,311	19,022	102.04	13,736	39,275	5,287	10,197
2021年11月末日	141,821	19,091	94.49	12,719	38,557	5,190	9,442
2021年12月末日	154,330	20,774	100.66	13,550	42,968	5,784	10,053
2022年1月末日	140,882	18,964	91.65	12,337	39,809	5,359	9,150
2022年2月末日	142,891	19,235	92.07	12,394	39,934	5,375	9,194
2022年3月末日	145,881	19,637	95.31	12,830	40,025	5,388	9,506
2022年4月末日	129,590	17,444	88.65	11,933	35,191	4,737	8,835
2022年5月末日	128,085	17,242	87.73	11,809	34,035	4,581	8,732
2022年6月末日	125,256	16,861	86.95	11,704	32,683	4,399	8,638
2022年7月末日	127,100	17,109	90.08	12,126	34,332	4,621	8,928

ジャンナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラスA（米ドル）受益証券（四半期分配型）（注2）							
	純資産総額				1口当たりの純資産価格			
	千米ドル （分配落）	百万円 （分配落）	千米ドル （分配付）	百万円 （分配付）	米ドル （分配落）	円 （分配落）	米ドル （分配付）	円 （分配付）
第11会計年度 (2012年12月31日)	94,621	12,737	94,703	12,748	112.19	15,102	112.29	15,115
第12会計年度 (2013年12月31日)	102,391	13,783	102,485	13,796	118.57	15,961	118.67	15,974
第13会計年度 (2014年12月31日)	79,672	10,725	79,736	10,733	132.50	17,836	132.61	17,851
第14会計年度 (2015年12月31日)	66,234	8,916	66,288	8,923	125.66	16,915	125.77	16,930
第15会計年度 (2016年12月31日)	54,067	7,278	54,111	7,284	129.11	17,379	129.21	17,393
第16会計年度 (2017年12月31日)	52,749	7,101	52,785	7,105	148.80	20,030	148.91	20,045
第17会計年度 (2018年12月31日)	44,650	6,010	44,682	6,015	141.14	18,999	141.24	19,012
第18会計年度 (2019年12月31日)	56,303	7,579	56,335	7,583	181.78	24,469	181.88	24,483
第19会計年度 (2020年12月31日)	55,036	7,408	55,066	7,412	182.35	24,546	182.45	24,560
第20会計年度 (2021年12月31日)	65,768	8,853	65,799	8,857	219.79	29,586	219.89	29,599
2021年8月末日	69,820	9,399	69,853	9,403	215.00	28,941	215.10	28,955
2021年9月末日	64,288	8,654	64,320	8,658	200.99	27,055	201.09	27,069
2021年10月末日	67,770	9,122	67,802	9,127	213.16	28,693	213.26	28,707
2021年11月末日	62,343	8,392	62,375	8,396	204.88	27,579	204.98	27,592
2021年12月末日	65,768	8,853	65,799	8,857	219.79	29,586	219.89	29,599
2022年1月末日	60,628	8,161	60,659	8,165	204.80	27,568	204.90	27,582
2022年2月末日	58,851	7,922	58,880	7,926	199.87	26,905	199.97	26,918
2022年3月末日	60,883	8,195	60,913	8,199	209.19	28,159	209.29	28,173
2022年4月末日	57,677	7,764	57,706	7,768	201.17	27,079	201.27	27,093
2022年5月末日	54,992	7,403	55,022	7,406	193.76	26,082	193.86	26,095
2022年6月末日	49,770	6,700	49,800	6,704	178.33	24,005	178.43	24,018
2022年7月末日	53,600	7,215	53,629	7,219	193.54	26,052	193.64	26,066

	クラスA（円）受益証券（四半期分配型）（注2）					
	純資産総額				1口当たりの純資産価格	
	千米ドル （分配落）	百万円 （分配落）	千米ドル （分配付）	百万円 （分配付）	円 （分配落）	円 （分配付）
第11会計年度 （2012年12月31日）	13,376	1,801	13,388	1,802	9,939	9,949
第12会計年度 （2013年12月31日）	10,356	1,394	10,366	1,395	10,472	10,482
第13会計年度 （2014年12月31日）	8,165	1,099	8,173	1,100	11,675	11,685
第14会計年度 （2015年12月31日）	6,497	875	6,502	875	11,026	10,346
第15会計年度 （2016年12月31日）	6,062	816	6,067	817	11,186	10,747
第16会計年度 （2017年12月31日）	5,949	801	5,953	801	12,628	11,916
第17会計年度 （2018年12月31日）	5,067	682	5,070	682	11,661	11,810
第18会計年度 （2019年12月31日）	5,931	798	5,934	799	14,579	14,456
第19会計年度 （2020年12月31日）	5,981	805	5,984	806	14,443	14,451
第20会計年度 （2021年12月31日）	5,989	806	5,992	807	17,333	17,341
2021年8月末日	6,261	843	6,264	843	16,975	16,983
2021年9月末日	5,609	755	5,612	755	15,863	15,871
2021年10月末日	5,906	795	5,909	795	16,818	16,826
2021年11月末日	5,709	769	5,712	769	16,165	16,173
2021年12月末日	5,989	806	5,992	807	17,333	17,341
2022年1月末日	5,537	745	5,540	746	16,144	16,152
2022年2月末日	5,381	724	5,384	725	15,757	15,765
2022年3月末日	5,321	716	5,323	717	16,472	16,480
2022年4月末日	4,717	635	4,719	635	15,837	15,845
2022年5月末日	4,475	602	4,478	603	15,230	15,238
2022年6月末日	3,957	533	3,959	533	13,990	13,998
2022年7月末日	4,341	584	4,343	585	15,136	15,144

	クラスⅠ（円）受益証券（注１）		
	純資産総額		1口当たりの 純資産価格
	千米ドル	百万円	円
第11会計年度 (2012年12月31日)	3,751	505	9,051
第12会計年度 (2013年12月31日)	3,113	419	11,755
第13会計年度 (2014年12月31日)	2,250	303	15,101
第14会計年度 (2015年12月31日)	644	87	14,523
第15会計年度 (2016年12月31日)	574	77	14,665
第16会計年度 (2017年12月31日)	299	40	16,465
第17会計年度 (2018年12月31日)	41	6	15,347
第18会計年度 (2019年12月31日)	177	24	19,790
第19会計年度 (2020年12月31日)	72	10	19,057
第20会計年度 (2021年12月31日)	302	41	25,831
2021年 8 月末日	385	52	24,094
2021年 9 月末日	256	34	22,801
2021年10月末日	303	41	24,779
2021年11月末日	281	38	23,646
2021年12月末日	302	41	25,831
2022年 1 月末日	284	38	24,093
2022年 2 月末日	277	37	23,515
2022年 3 月末日	241	32	26,078
2022年 4 月末日	232	31	26,750
2022年 5 月末日	223	30	25,587
2022年 6 月末日	206	28	24,834
2022年 7 月末日	222	30	26,506

（注１） クラスⅠ（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

（注２） 分配型クラスの会計年度末における分配付の純資産総額及び1口当たりの純資産価格は、当該会計年度の分配総額ではなく、当該年度末の月の分配額のみを加算した価格となっています。

【分配の推移】

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA受益証券、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・フォーティ・ファンド及びジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドについては、投資収益その他の実現収益及び未実現収益を分配することは予定されておりません。

ジャナス・ハイイールド・ファンド クラスA受益証券（毎月分配型）

	クラスA(米ドル)受益証券(毎月分配型)		クラスA(円)受益証券 (毎月分配型)
	1口当たりの分配額(米ドル)	1口当たりの分配額(円)	1口当たりの分配額(円)
第11会計年度 (2012年12月31日)	5.16	694.59	401.01
第12会計年度 (2013年12月31日)	5.16	694.59	489.13
第13会計年度 (2014年12月31日)	5.16	694.59	528.95
第14会計年度 (2015年12月31日)	5.16	694.59	606.61
第15会計年度 (2016年12月31日)	5.16	694.59	546.81
第16会計年度 (2017年12月31日)	5.16	694.59	563.42
第17会計年度 (2018年12月31日)	5.16	694.59	554.52
第18会計年度 (2019年12月31日)	5.16	694.59	547.91
第19会計年度 (2020年12月31日)	4.51	607.09	474.89
第20会計年度 (2021年12月31日)	3.60	484.60	395.15
2021年8月1日～ 2022年7月31日	3.60	484.60	431.25

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラス A (米ドル)受益証券(四半期分配型)		クラス A (円)受益証券 (四半期分配型)
	1 口当たりの分配額(米ドル)	1 口当たりの分配額(円)	1 口当たりの分配額(円)
第11会計年度 (2012年12月31日)	0.40	53.84	35.4660
第12会計年度 (2013年12月31日)	0.40	53.84	35.47
第13会計年度 (2014年12月31日)	0.40	53.84	37.415
第14会計年度 (2015年12月31日)	0.40	53.84	35.189
第15会計年度 (2016年12月31日)	0.40	53.84	33.78
第16会計年度 (2017年12月31日)	0.40	53.84	34.27
第17会計年度 (2018年12月31日)	0.40	53.84	33.55
第18会計年度 (2019年12月31日)	0.40	53.84	33.00
第19会計年度 (2020年12月31日)	0.40	53.84	31.56
第20会計年度 (2021年12月31日)	0.40	53.84	32.24
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	0.40	53.84	31.57

【収益率の推移】

ジャンナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券	クラスＩ（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 (2012年12月31日)	6.78%	6.24%	20.76%
第12会計年度 (2013年12月31日)	-1.01%	-1.63%	20.86%
第13会計年度 (2014年12月31日)	3.93%	3.42%	18.75%
第14会計年度 (2015年12月31日)	-0.75%	-1.48%	0.05%
第15会計年度 (2016年12月31日)	1.55%	-0.12%	-0.81%
第16会計年度 (2017年12月31日)	2.57%	0.40%	-0.67%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-1.80%	-4.46%	-4.04%
第18会計年度 (2019年12月31日)	8.28%	5.02%	7.82%
第19会計年度 (2020年12月31日)	9.51%	7.82%	4.55%
第20会計年度 (2021年12月31日)	-1.84%	-2.32%	9.84%
2021年８月１日～ 2022年７月31日	-10.38%	-11.35%	9.38%

	収益率（注１）	
	クラスＡ（豪ドル）受益証券	クラスＡ（NZドル）受益証券
第20会計年度 (2021年12月31日)	-1.27%	-1.09%
2021年８月１日～ 2022年７月31日	-10.74%	-10.15%

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

	収益率（注１）	
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券
第19会計年度 (2020年12月31日)	3.34%	3.19%
第20会計年度 (2021年12月31日)	1.36%	0.94%
2021年８月１日～ 2022年７月31日	-9.32%	-10.16%

	収益率（注１）	
	クラスＡ（豪ドル）受益証券	クラスＡ（NZドル）受益証券
第20会計年度 (2021年12月31日)	-0.49%	-0.29%
2021年８月１日～ 2022年７月31日	-9.85%	-9.15%

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券	クラスＩ（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 (2012年12月31日)	13.05%	12.57%	28.16%
第12会計年度 (2013年12月31日)	6.32%	5.97%	30.14%
第13会計年度 (2014年12月31日)	-0.51%	-0.82%	13.96%
第14会計年度 (2015年12月31日)	-2.71%	-3.22%	-1.68%
第15会計年度 (2016年12月31日)	11.68%	10.23%	9.36%
第16会計年度 (2017年12月31日)	4.90%	2.83%	1.83%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-3.99%	-6.51%	-5.95%
第18会計年度 (2019年12月31日)	13.57%	10.28%	13.38%
第19会計年度 (2020年12月31日)	5.33%	3.84%	0.81%
第20会計年度 (2021年12月31日)	4.54%	4.16%	17.26%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-11.59%	-12.32%	8.18%

	収益率（注１）	
	クラスＡ（米ドル）受益証券 （毎月分配型）	クラスＡ（円）受益証券 （毎月分配型）
第11会計年度 (2012年12月31日)	12.73%	26.42%
第12会計年度 (2013年12月31日)	6.14%	28.70%
第13会計年度 (2014年12月31日)	-0.37%	12.64%
第14会計年度 (2015年12月31日)	-2.48%	-2.11%
第15会計年度 (2016年12月31日)	11.31%	7.84%
第16会計年度 (2017年12月31日)	4.79%	1.00%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-3.80%	-6.38%
第18会計年度 (2019年12月31日)	13.27%	12.32%
第19会計年度 (2020年12月31日)	4.87%	-0.15%
第20会計年度 (2021年12月31日)	4.46%	16.16%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-11.32%	7.28%

ジャンナス・バランス・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券	クラスＩ（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 (2012年12月31日)	11.27%	10.96%	26.34%
第12会計年度 (2013年12月31日)	16.15%	15.89%	42.39%
第13会計年度 (2014年12月31日)	4.13%	3.89%	19.45%
第14会計年度 (2015年12月31日)	-0.86%	-1.27%	0.33%
第15会計年度 (2016年12月31日)	2.72%	1.53%	0.74%
第16会計年度 (2017年12月31日)	16.15%	13.99%	12.93%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-1.20%	-3.73%	-3.07%
第18会計年度 (2019年12月31日)	19.81%	16.48%	19.78%
第19会計年度 (2020年12月31日)	12.18%	10.95%	7.54%
第20会計年度 (2021年12月31日)	15.28%	14.82%	29.50%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-8.61%	-9.39%	11.99%

ジャンナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券	クラスＩ（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 (2012年12月31日)	7.84%	7.66%	22.42%
第12会計年度 (2013年12月31日)	24.53%	24.29%	52.67%
第13会計年度 (2014年12月31日)	7.58%	7.53%	23.40%
第14会計年度 (2015年12月31日)	-4.60%	-4.74%	-3.45%
第15会計年度 (2016年12月31日)	14.40%	13.38%	12.19%
第16会計年度 (2017年12月31日)	12.06%	10.13%	8.95%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-9.49%	-11.75%	-11.20%
第18会計年度 (2019年12月31日)	25.87%	22.48%	25.84%
第19会計年度 (2020年12月31日)	2.67%	1.80%	-1.57%
第20会計年度 (2021年12月31日)	19.85%	19.59%	34.63%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-5.25%	-5.96%	16.1%

ジャナス・フォーティ・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券	クラスＩ（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 (2012年12月31日)	21.18%	21.12%	37.59%
第12会計年度 (2013年12月31日)	36.00%	36.28%	66.71%
第13会計年度 (2014年12月31日)	9.29%	9.43%	25.37%
第14会計年度 (2015年12月31日)	5.28%	5.27%	6.51%
第15会計年度 (2016年12月31日)	-2.76%	-3.56%	-4.63%
第16会計年度 (2017年12月31日)	27.82%	25.57%	24.27%
第17会計年度 (2018年12月31日)	-0.46%	-2.88%	-2.34%
第18会計年度 (2019年12月31日)	34.38%	30.77%	34.35%
第19会計年度 (2020年12月31日)	37.73%	36.65%	32.03%
第20会計年度 (2021年12月31日)	21.27%	20.75%	36.23%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-25.42%	-26.05%	-8.63%

	収益率（注１）	
	クラスＡ（豪ドル）受益証券	クラスＡ（NZドル）受益証券
第20会計年度 (2021年12月31日)	6.31%	6.50%
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	-27.02%	-26.23%

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

	収益率（注１）	
	クラスＡ（米ドル）受益証券	クラスＡ（円）受益証券
第20会計年度 (2021年12月31日)	0.66%	0.53%
2021年 8 月17日 ~ 2022年 7 月31日	-9.92%	-10.72%

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	収益率（注１）		
	クラスA（米ドル）受益証券 （四半期分配型）	クラスA（円）受益証券 （四半期分配型）	クラスI（円）受益証券 （注２）
第11会計年度 （2012年12月31日）	33.46%	33.22%	51.46%
第12会計年度 （2013年12月31日）	6.04%	5.72%	29.88%
第13会計年度 （2014年12月31日）	12.09%	11.85%	28.46%
第14会計年度 （2015年12月31日）	-4.86%	-5.26%	-3.83%
第15会計年度 （2016年12月31日）	3.06%	1.76%	0.98%
第16会計年度 （2017年12月31日）	15.56%	13.20%	12.27%
第17会計年度 （2018年12月31日）	-4.88%	-7.39%	-6.79%
第18会計年度 （2019年12月31日）	29.08%	25.31%	28.95%
第19会計年度 （2020年12月31日）	0.53%	-0.72%	-3.70%
第20会計年度 （2021年12月31日）	20.75%	20.23%	35.55%
2021年8月1日～ 2022年7月31日	-9.39%	-10.29%	10.94%

（注１） 収益率とは、以下の計算式により算出される値であり、騰落率とは異なる点にご留意ください。

$$\text{収益率（％）} = 100 \times (a - b) / b$$

a = 上記会計年度末（2022年7月31日の収益率については2022年7月31日現在）の1口当たり純資産価格（分配型クラスについては、当該会計年度中（2022年7月31日の収益率については2021年8月1日から2022年7月31日までの期間中）の分配金の合計額を加えた額）

b = 当該会計年度の直前の会計年度末（2022年7月31日の収益率については2021年7月31日現在）の1口当たり純資産価格（分配型クラスについては、分配落の額）

第19会計年度のジャナス・マルチセクター・インカム・ファンドのクラスA（米ドル）受益証券及びクラスA（円）受益証券については、それぞれ受益証券1口当たり当初発行価格である100米ドル及び10,000円

第20会計年度のジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド及びジャナス・フォーティ・ファンドのクラスA（豪ドル）受益証券及びクラスA（NZドル）受益証券については、それぞれ受益証券1口当たり当初発行価格である100豪ドル及び100NZドル

第20会計年度及び2022年7月31日のジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドのクラスA（米ドル）受益証券及びクラスA（円）受益証券については、それぞれ受益証券1口当たり当初発行価格である100米ドル及び10,000円

（注２） クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

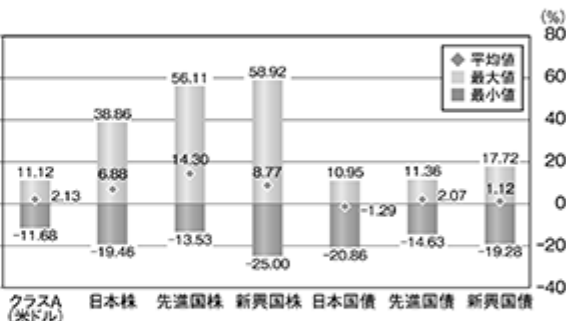
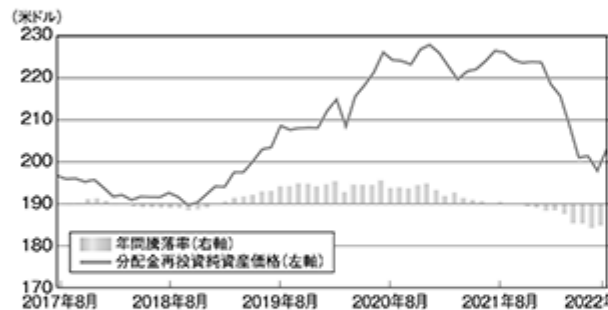
(3) 【投資リスク】

グラフは、ファンドの投資リスクをご理解いただくための情報の一つとしてご利用ください。

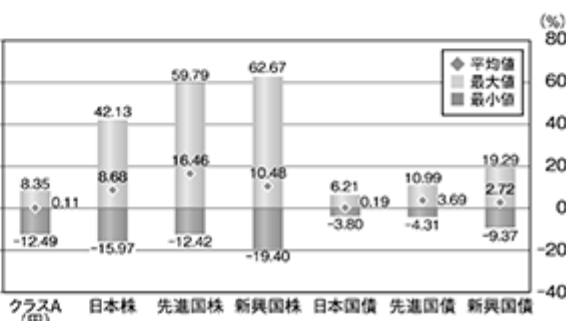
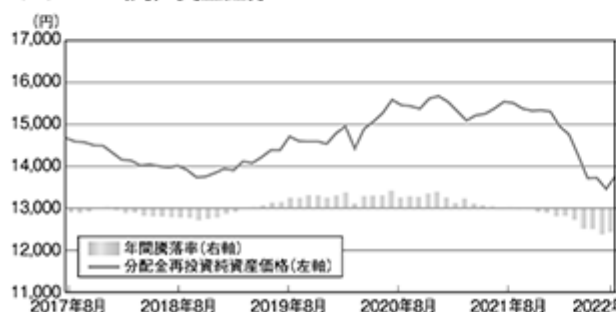
サブファンドの年間騰落率
および分配金再投資純資産価格の推移
(2017年8月～2022年7月)*1

サブファンドと他の代表的な資産クラスとの
年間騰落率の比較
(2017年8月～2022年7月)*2

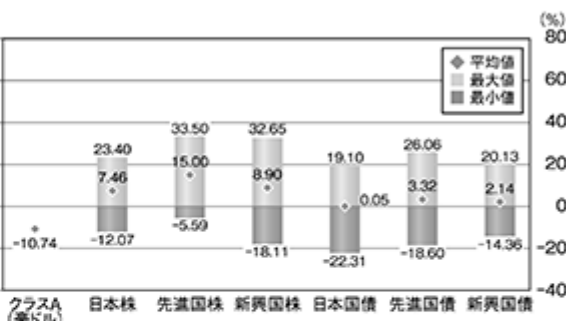
ジャンナス・フレキシブル・インカム・ファンド
クラスA (米ドル) 受益証券



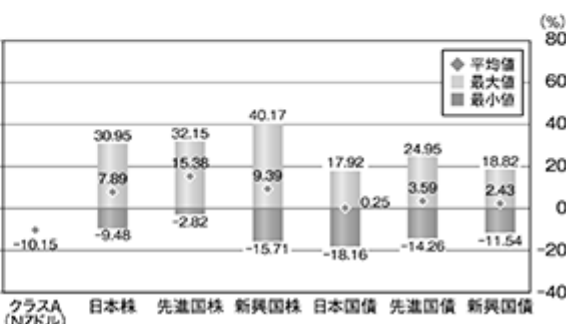
クラスA (円) 受益証券



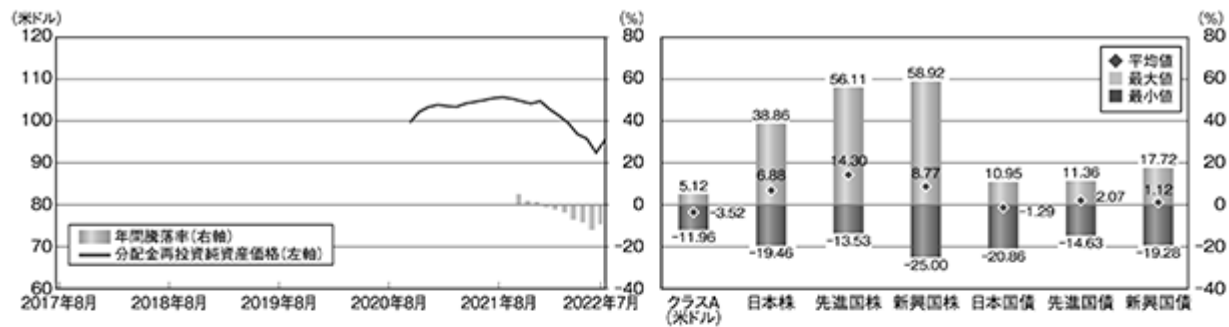
クラスA (豪ドル) 受益証券



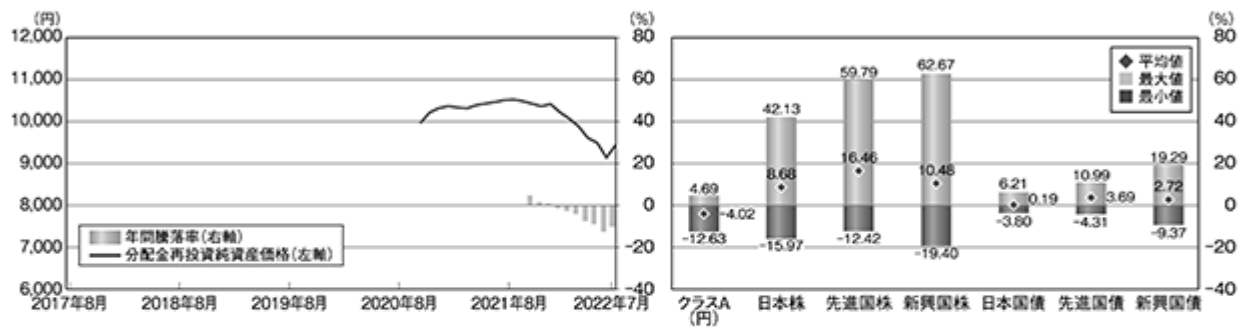
クラスA (NZドル) 受益証券



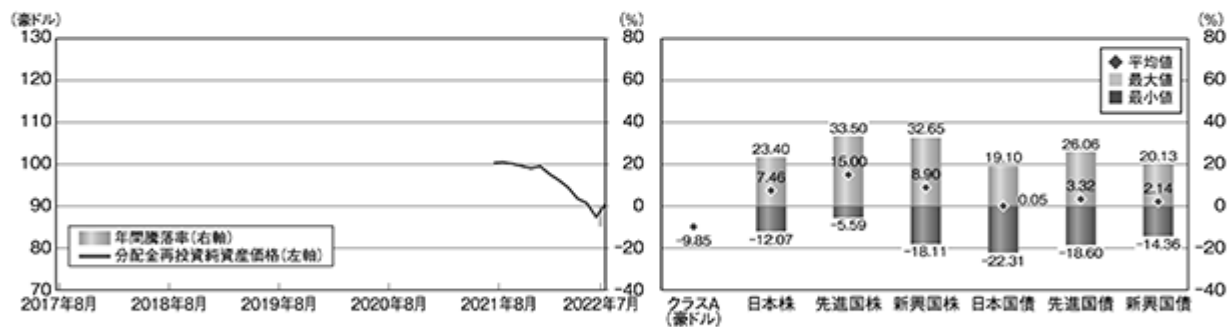
ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド クラスA(米ドル) 受益証券



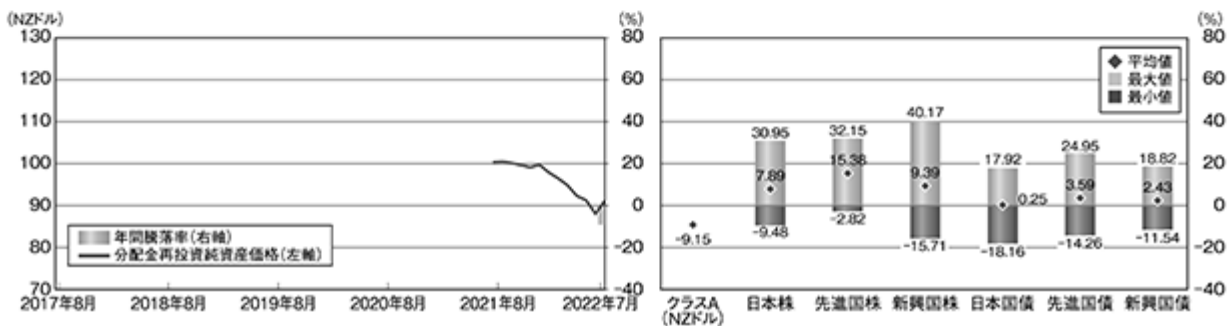
クラスA(円) 受益証券



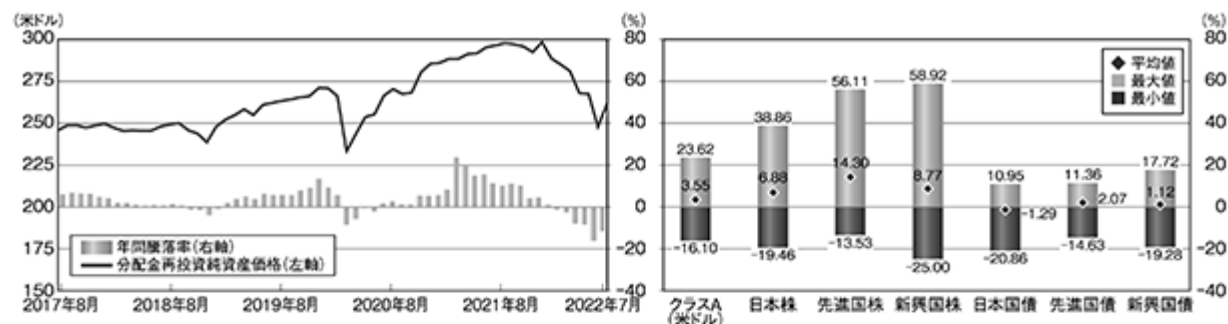
クラスA(豪ドル) 受益証券



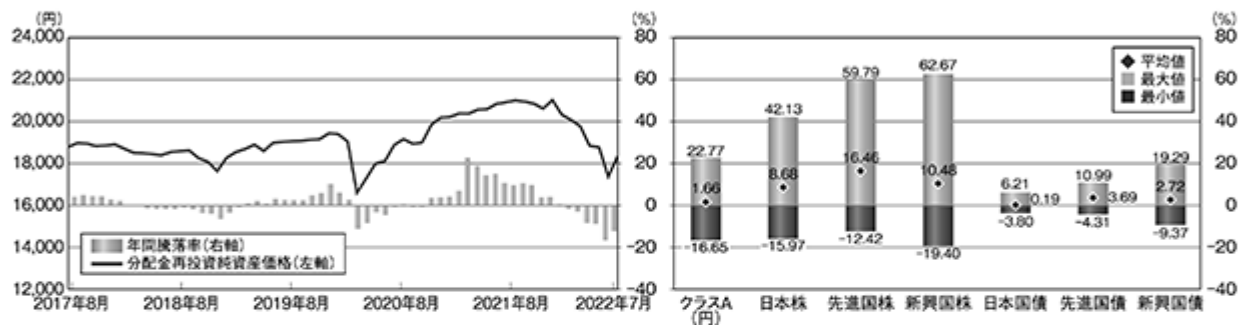
クラスA(NZドル) 受益証券



ジャナス・ハイイルド・ファンド クラスA(米ドル) 受益証券

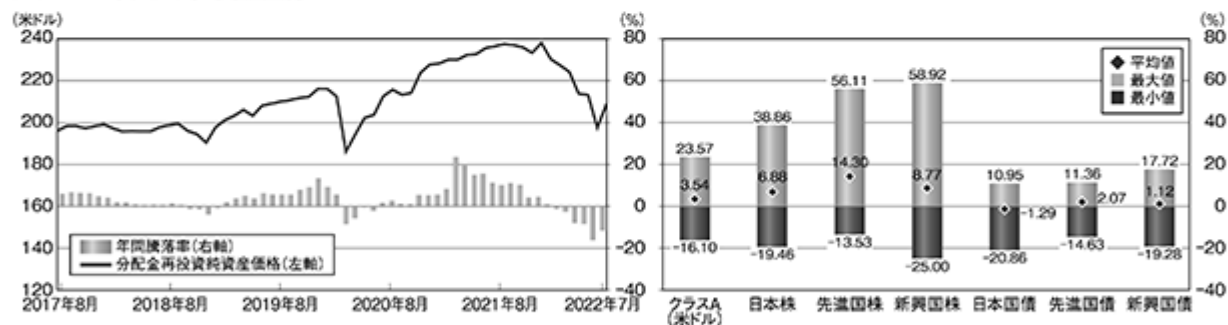


クラスA (円) 受益証券

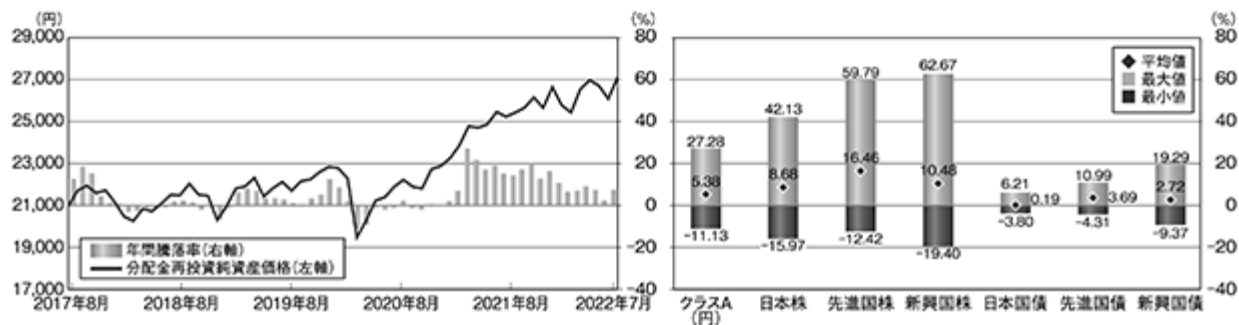


ジャナス・ハイイルド・ファンド (毎月分配型)

クラスA (米ドル) 受益証券

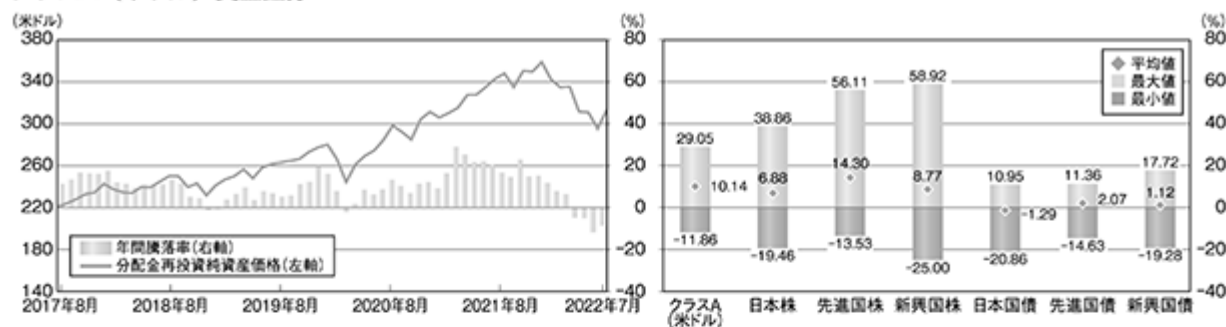


クラスA (円) 受益証券

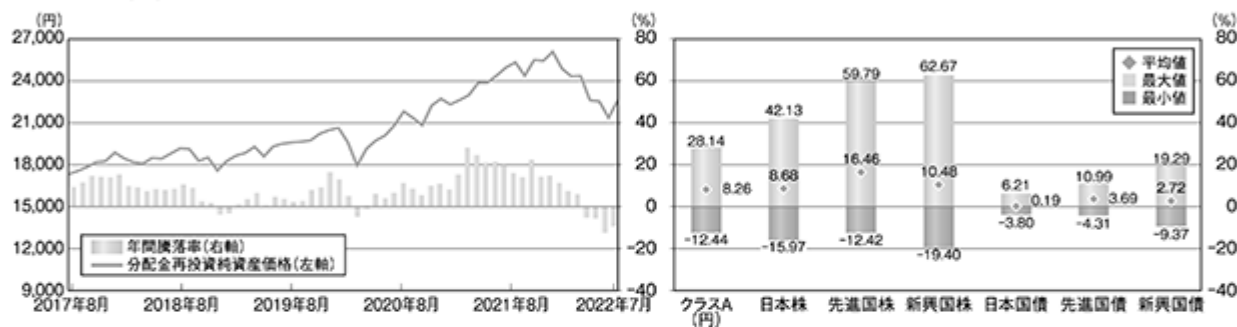


ジャナス・バランス・ファンド

クラスA (米ドル) 受益証券

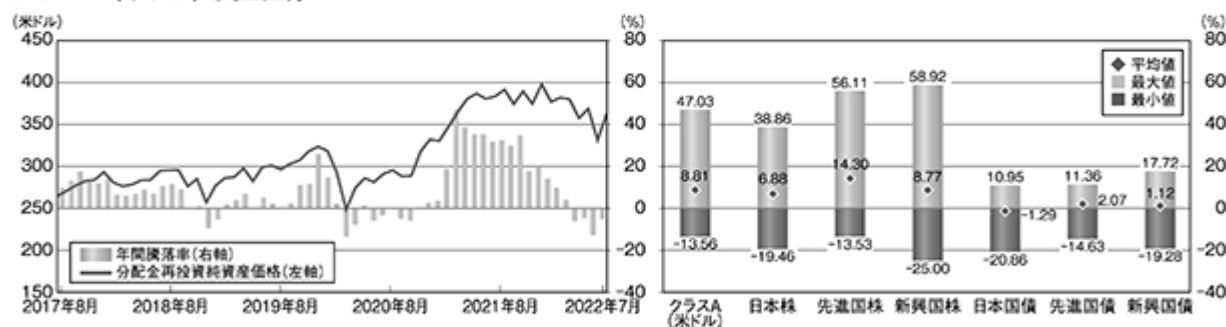


クラスA (円) 受益証券

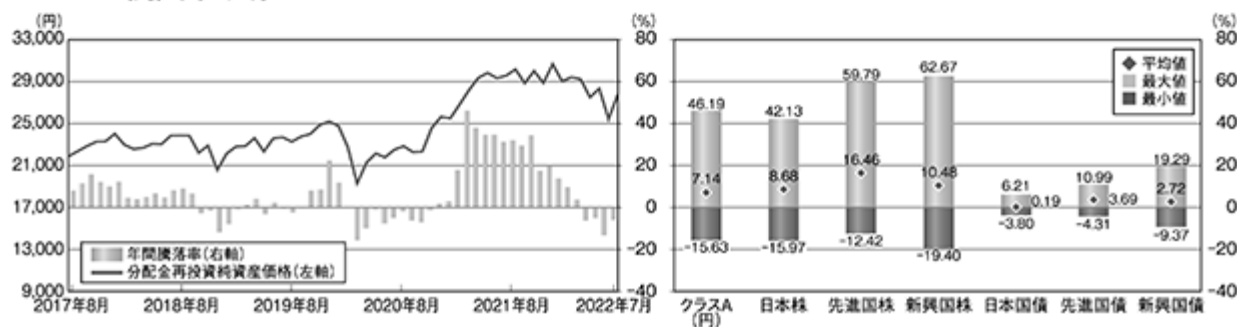


ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

クラスA (米ドル) 受益証券

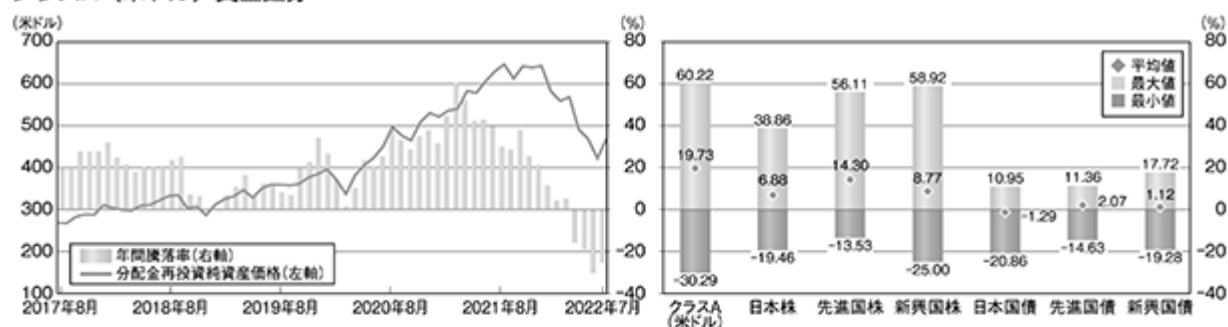


クラスA (円) 受益証券

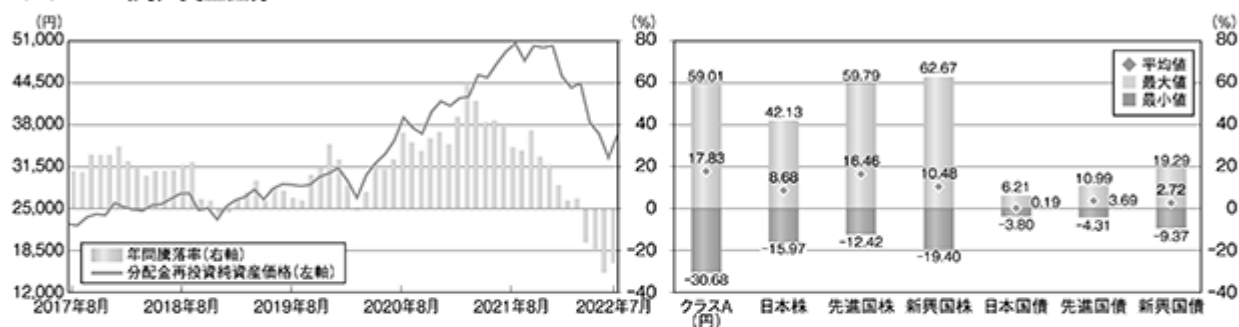


ジャナス・フォーティ・ファンド

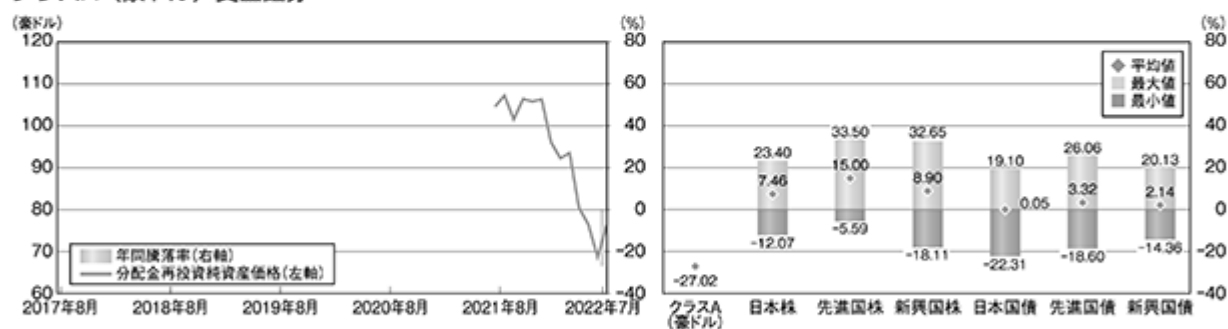
クラスA(米ドル) 受益証券



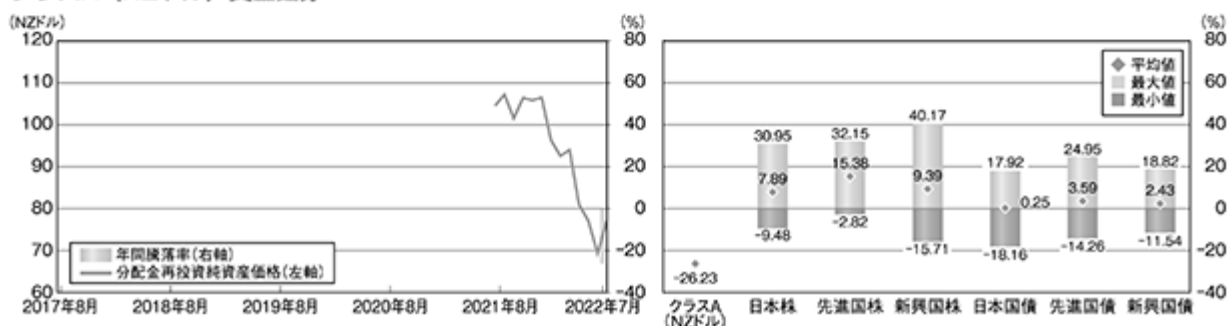
クラスA(円) 受益証券



クラスA(豪ドル) 受益証券

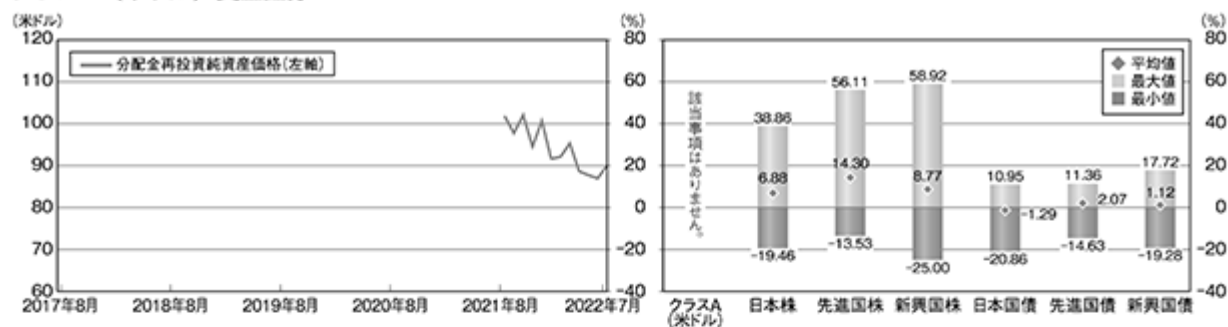


クラスA(NZドル) 受益証券

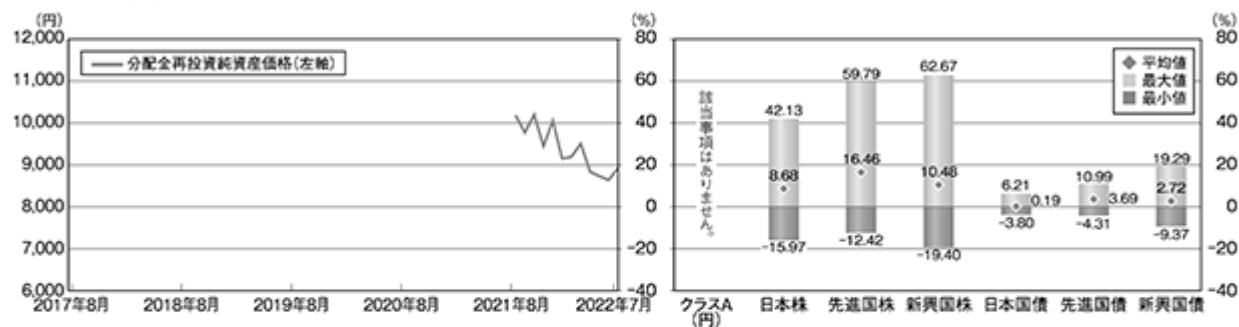


ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

クラスA (米ドル) 受益証券

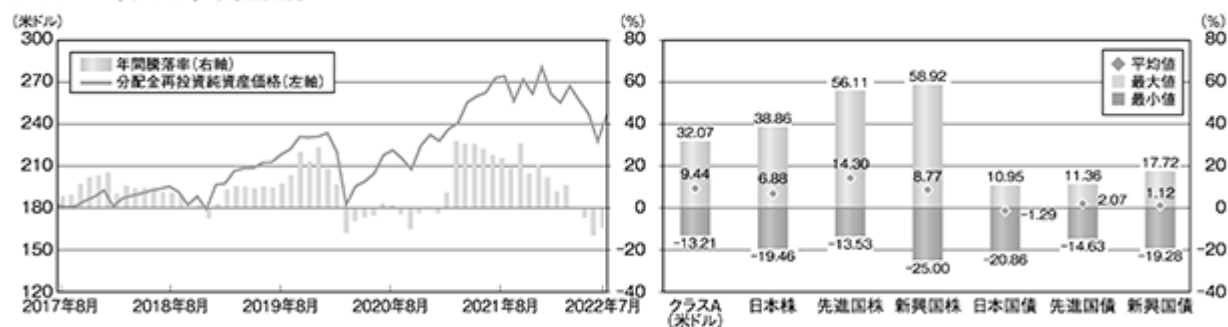


クラスA (円) 受益証券

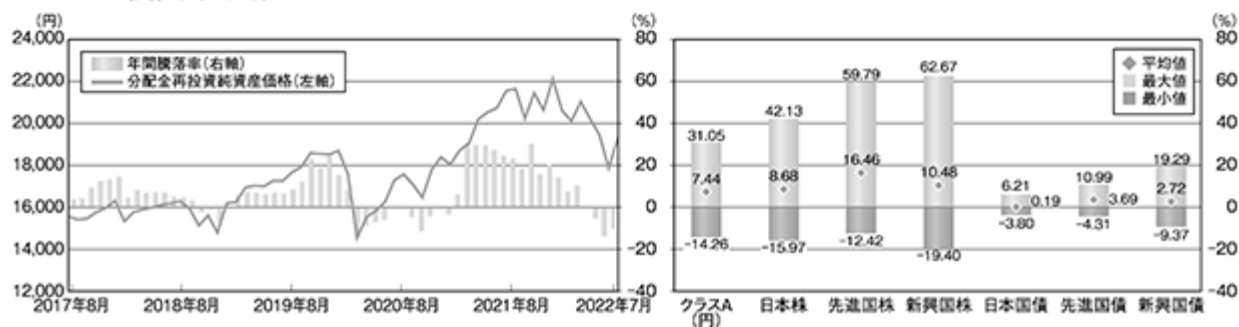


ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

クラスA (米ドル) 受益証券



クラスA (円) 受益証券



- *1 2017年8月から2022年7月の5年間の各月末における分配金再投資純資産価格および年間騰落率を表示したものです。ただし、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド（クラスA（米ドル）受益証券およびクラスA（円）受益証券）については、2020年10月1日に運用を開始したため、2020年9月30日以前の分配金再投資純資産価格は算出されません。また、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）およびジャナス・フォーティ・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）は2021年7月20日に運用を開始したため、2021年7月19日以前の分配金再投資純資産価格は算出されません。
- さらに、ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドについては、2021年8月17日に運用を開始したため、年間騰落率および2021年8月16日以前の分配金再投資純資産価格は算出されません。
- *2 2017年8月から2022年7月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。ただし、2020年10月1日に運用を開始したジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド（クラスA（米ドル）受益証券およびクラスA（円）受益証券）については、運用開始日以降算出できる値を使用しています。また、2021年7月20日に運用を開始したジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）およびジャナス・フォーティ・ファンド（クラスA（豪ドル）受益証券およびクラスA（NZドル）受益証券）については、2021年7月末日から2022年7月末日までの騰落率を使用しています。なお、2021年8月17日に運用を開始したジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドについては、直近1年間の騰落率がないため表示しておりません。

※分配金再投資純資産価格は1口当たりの値です。

※分配金再投資純資産価格および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものととして計算した理論上のものであり、実際の純資産価格および実際の純資産価格に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

なお、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンド（毎月分配型を除きます。）、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・フォーティ・ファンドおよびジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドの各ファンドは2022年7月末日まで分配の実績はありません。このため分配金再投資純資産価格は、受益証券1口当たり純資産価格と等しくなります。

※上記はファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して受益証券の各クラスの通貨に換算しています。

<各資産クラスの指数>

日本株 … 東証株価指数（TOPIX）（配当込）
 先進国株 … MSCI-KOKUSA指数（配当込）（円ベース/米ドルベース/豪ドルベース/NZドルベース）
 新興国株 … MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込）（円ベース/米ドルベース/豪ドルベース/NZドルベース）
 日本国債 … JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（日本）（円ベース/米ドルベース/豪ドルベース/NZドルベース）
 先進国債 … JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（除く日本）（円ベース/米ドルベース/豪ドルベース/NZドルベース）
 新興国債 … JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースIFIED（米ドルベース）

※当ファンドの円建てのクラスとの比較においては、円ベースの指数（新興国債の指数については、米ドルベースの指数を各月末時点の為替レートにより円換算したもの）を、米ドル建てのクラスとの比較においては、米ドルベースの指数（日本株の指数については、円ベースの指数を各月末時点の為替レートにより米ドル換算したもの）を、豪ドル建てのクラスとの比較においては、豪ドルベースの指数（日本株の指数については、円ベースの指数を各月末時点の為替レートにより豪ドル換算したもの）、新興国債の指数については、米ドルベースの指数を各月末時点の為替レートによりNZドル換算したもの）を、NZドル建てのクラスとの比較においては、NZドルベースの指数（日本株の指数については、円ベースの指数を各月末時点の為替レートによりNZドル換算したもの）、新興国債の指数については、米ドルベースの指数を各月末時点の為替レートによりNZドル換算したもの）を、それぞれ使用しています。

2 【販売及び買戻しの実績】

当ファンドの各会計年度中及び2021年8月1日から2022年7月31日までの期間中の販売及び買戻しの実績、並びに各会計年度末現在及び2022年7月31日現在の発行済口数は次のとおりです。

ジャンナス・フレキシブル・インカム・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	490,366	314,754	2,570,153
	クラスA（円） 受益証券	24,989	11,549	112,374
	クラスI（円） 受益証券	3,819	6,164	7,839
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	534,130	1,029,497	2,074,786
	クラスA（円） 受益証券	46,953	47,247	112,079
	クラスI（円） 受益証券	2,242	4,659	5,421
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	309,003	600,101	1,783,688
	クラスA（円） 受益証券	23,652	30,501	105,230
	クラスI（円） 受益証券	1,526	4,399	2,549
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	264,535	421,054	1,627,169
	クラスA（円） 受益証券	21,940	19,986	107,184
	クラスI（円） 受益証券	4,439	3,367	3,620
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	607,564	288,017	1,946,716
	クラスA（円） 受益証券	62,146	20,990	148,340
	クラスI（円） 受益証券	142	2,535	1,226
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	180,256	467,987	1,658,985
	クラスA（円） 受益証券	33,892	50,524	131,708
	クラスI（円） 受益証券	53	986	294
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	249,272	328,151	1,580,107
	クラスA（円） 受益証券	13,207	47,850	97,065
	クラスI（円） 受益証券	2,294	2,306	281

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	595,421	338,176	1,837,352
	クラスA（円） 受益証券	51,620	22,244	126,441
	クラスI（円） 受益証券	198	259	221
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	847,374	481,037	2,203,690
	クラスA（円） 受益証券	79,118	46,878	158,682
	クラスI（円） 受益証券	3,403	1,368	2,256
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	427,867	734,746	1,897,852
	クラスA（円） 受益証券	54,880	66,044	147,552
	クラスI（円） 受益証券	831	2,457	630
	クラスA（豪ドル） 受益証券	64,982	7,963	57,019
	クラスA（NZドル） 受益証券	9,267	0	9,267
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	122,145	712,632	1,562,690
	クラスA（円） 受益証券	58,886	39,433	161,029
	クラスI（円） 受益証券	427	116	1053
	クラスA（豪ドル） 受益証券	62,584	13,675	65,744
	クラスA（NZドル） 受益証券	8,938	141	14,643

（注 1） 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

（注 2） クラス I（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

（注 3） ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンドのクラス A（豪ドル）受益証券及びクラス A（NZドル）受益証券は、2021年 7 月20日に運用を開始しました。

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	1,069,304	40,860	1,028,444
	クラスA（円） 受益証券	104,918	4,650	100,268
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	681,420	541,858	1,168,051
	クラスA（円） 受益証券	215,543	77,749	238,043
	クラスA（豪ドル） 受益証券	95,104	8,948	86,156
	クラスA（NZドル） 受益証券	13,655	0	13,655
2021年 8 月 1 日 ~ 2022年 7 月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	199,415	602,227	799,088
	クラスA（円） 受益証券	149,762	175,286	145,998
	クラスA（豪ドル） 受益証券	44,468	25,080	70,903
	クラスA（NZドル） 受益証券	8,216	277	14,013

（注 1） 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

（注 2） ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンドのクラスA（米ドル）受益証券及びクラスA（円）は、2020年10月 1 日に運用を開始しました。

（注 3） ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンドのクラスA（豪ドル）受益証券及びクラスA（NZドル）受益証券は、2021年 7 月20日に運用を開始しました。

ジャナス・ハイイールド・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	220,746	178,573	1,129,885
	クラスA（円） 受益証券	17,930	15,063	77,548
	クラスI（円） 受益証券	4,305	5,380	17,564
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	40,585	65,178	641,960
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	2,685	18,922	390,279
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	570,041	585,211	1,114,715
	クラスA（円） 受益証券	66,423	36,246	107,725
	クラスI（円） 受益証券	3,117	10,445	10,235
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	124,693	126,518	640,134
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	35,750	70,422	355,607
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	330,954	446,486	999,182
	クラスA（円） 受益証券	23,641	49,283	82,083
	クラスI（円） 受益証券	1,723	3,345	8,612
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	87,683	160,446	567,371
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	57,623	94,543	318,688
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	46,352	306,031	739,504
	クラスA（円） 受益証券	2,296	25,488	58,891
	クラスI（円） 受益証券	895	4,539	4,969
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	36,977	119,578	484,770
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	16,352	75,737	259,302

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	146,066	170,184	715,386
	クラスA（円） 受益証券	34,895	16,443	77,344
	クラスI（円） 受益証券	774	2,199	3,544
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	54,155	81,325	457,600
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	41,962	52,712	248,553
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	259,357	210,551	764,192
	クラスA（円） 受益証券	67,652	40,128	104,868
	クラスI（円） 受益証券	305	2,348	1,502
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	99,736	83,924	473,412
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	82,515	44,798	286,270
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	42,119	170,919	635,392
	クラスA（円） 受益証券	3,551	36,170	72,249
	クラスI（円） 受益証券	259	1,051	709
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	28,601	70,313	431,700
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	21,874	60,082	248,062
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	136,657	127,369	644,679
	クラスA（円） 受益証券	15,632	20,671	67,209
	クラスI（円） 受益証券	93	103	700
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	279,342	43,556	667,486
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	29,161	33,371	243,851

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	92,632	137,801	599,511
	クラスA（円） 受益証券	22,153	15,981	73,381
	クラスI（円） 受益証券	0	249	451
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	140,385	81,442	726,429
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	66,527	29,128	281,250
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	132,051	112,625	618,921
	クラスA（円） 受益証券	55,721	28,456	100,646
	クラスI（円） 受益証券	377	466	361
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	83,590	146,363	663,651
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	82,258	67,097	296,412
2021年8月1日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	60,245	138,732	546,961
	クラスA（円） 受益証券	50,569	41,977	92,981
	クラスI（円） 受益証券	0	179	341,398
	クラスA（米ドル） 受益証券 （毎月分配型）	20,792	123,298	357
	クラスA（円） 受益証券 （毎月分配型）	86,691	51,002	596,205

（注1） 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

（注2） クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

ジャナス・バランス・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	40,932	18,426	253,122
	クラスA（円） 受益証券	4,211	5,784	27,526
	クラスI（円） 受益証券	1,286	802	3,952
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	88,805	64,770	277,157
	クラスA（円） 受益証券	6,961	5,629	28,858
	クラスI（円） 受益証券	441	1,883	2,509
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	97,154	80,509	293,802
	クラスA（円） 受益証券	10,078	5,757	33,179
	クラスI（円） 受益証券	874	2,125	1,259
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	44,495	52,912	285,385
	クラスA（円） 受益証券	8,095	3,775	37,499
	クラスI（円） 受益証券	515	1,188	585
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	24,295	52,193	257,487
	クラスA（円） 受益証券	4,223	4,728	36,993
	クラスI（円） 受益証券	736	431	889
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	50,115	54,632	252,970
	クラスA（円） 受益証券	11,240	6,194	42,039
	クラスI（円） 受益証券	255	634	510
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	97,196	41,289	308,877
	クラスA（円） 受益証券	7,588	6,748	42,880
	クラスI（円） 受益証券	533	680	363
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	79,290	88,854	299,314
	クラスA（円） 受益証券	14,449	10,342	46,987
	クラスI（円） 受益証券	204	424	143
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	219,753	85,134	433,933
	クラスA（円） 受益証券	24,862	24,328	47,521
	クラスI（円） 受益証券	190	204	129

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	466,850	166,440	734,075
	クラスA（円） 受益証券	70,117	15,691	102,321
	クラスI（円） 受益証券	39	59	110
2021年8月1日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	285,103	196,316	718,055
	クラスA（円） 受益証券	72,796	19,380	131,890
	クラスI（円） 受益証券	814	841	132

（注1） 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

（注2） クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	30,368	34,715	217,479
	クラスA（円） 受益証券	2,806	3,087	19,196
	クラスI（円） 受益証券	3,202	5,455	9,313
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	297,608	192,310	322,776
	クラスA（円） 受益証券	18,167	6,805	30,556
	クラスI（円） 受益証券	4,060	6,917	6,456
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	140,903	170,142	293,537
	クラスA（円） 受益証券	7,717	13,653	24,620
	クラスI（円） 受益証券	2,037	1,977	6,516
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	61,911	77,318	278,131
	クラスA（円） 受益証券	5,957	6,770	23,808
	クラスI（円） 受益証券	857	6,154	1,219
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	67,537	117,138	228,529
	クラスA（円） 受益証券	7,521	10,308	21,021
	クラスI（円） 受益証券	2,060	1,051	2,228

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	79,272	86,200	221,600
	クラスA（円） 受益証券	8,351	6,006	23,366
	クラスI（円） 受益証券	2,496	3,260	1,464
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	51,997	55,692	217,905
	クラスA（円） 受益証券	4,623	6,885	21,104
	クラスI（円） 受益証券	977	1,939	502
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	32,145	75,750	174,299
	クラスA（円） 受益証券	344	5,420	16,027
	クラスI（円） 受益証券	785	895	392
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	72,890	43,765	203,424
	クラスA（円） 受益証券	9,475	5,872	19,631
	クラスI（円） 受益証券	76	122	347
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	237,424	100,870	339,939
	クラスA（円） 受益証券	30,898	12,494	37,903
	クラスI（円） 受益証券	436	403	379
2021年8月1日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	96,945	110,298	332,489
	クラスA（円） 受益証券	20,459	8,062	48,525
	クラスI（円） 受益証券	388	514	220

（注1） 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

（注2） クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

ジャナス・フォーティ・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	61,861	171,694	312,634
	クラスA（円） 受益証券	2,584	7,528	34,023
	クラスI（円） 受益証券	3,607	5,271	20,649
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	370,069	303,637	379,067
	クラスA（円） 受益証券	16,163	22,996	27,189
	クラスI（円） 受益証券	4,354	15,054	9,949
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	318,755	309,968	387,854
	クラスA（円） 受益証券	19,891	12,511	34,569
	クラスI（円） 受益証券	3,071	6,602	6,418
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	281,099	190,045	478,908
	クラスA（円） 受益証券	12,715	11,067	36,217
	クラスI（円） 受益証券	2,455	4,555	4,318
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	70,547	141,636	407,819
	クラスA（円） 受益証券	8,553	17,244	27,526
	クラスI（円） 受益証券	4,300	4,613	4,005
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	94,897	225,737	276,978
	クラスA（円） 受益証券	5,885	8,380	25,031
	クラスI（円） 受益証券	2,607	2,270	4,342
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	310,629	93,438	494,168
	クラスA（円） 受益証券	21,807	9,662	37,176
	クラスI（円） 受益証券	4,107	4,578	3,872
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	146,356	299,518	341,006
	クラスA（円） 受益証券	6,147	13,127	30,197
	クラスI（円） 受益証券	1,814	2,544	3,141
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	567,137	270,030	638,113
	クラスA（円） 受益証券	54,949	30,249	54,897
	クラスI（円） 受益証券	3,549	5,200	1,490

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	610,053	295,114	953,180
	クラスA（円） 受益証券	127,940	33,963	148,793
	クラスI（円） 受益証券	2,381	2,081	1,790
	クラスA（豪ドル） 受益証券	423,936	56,183	366,605
	クラスA（NZドル） 受益証券	33,289	3,515	29,484
2021年8月1日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	422,001	229,441	1,003,896
	クラスA（円） 受益証券	207,156	35,741	271,629
	クラスI（円） 受益証券	653	720	1,508
	クラスA（豪ドル） 受益証券	429,612	100,023	491,993
	クラスA（NZドル） 受益証券	31,827	5,343	43,134

(注1) 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

(注2) クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

(注3) ジャナス・フォーティ・ファンドのクラスA（豪ドル）受益証券及びクラスA（NZドル）受益証券は、2021年7月20日に運用を開始しました。

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券	1,584,694	51,543	1,534,289
	クラスA（円） 受益証券	503,730	12,067	491,663
2021年8月17日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券	1,682,442	271,463	1,411,004
	クラスA（円） 受益証券	563,588	50,456	512,784

(注1) 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

(注2) ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドは、2021年8月17日に運用を開始しました。

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第11会計年度 (2012年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	81,807	80,719	843,413
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	10,261	6,474	116,569
	クラスI（円） 受益証券	14,808	23,228	35,902
第12会計年度 (2013年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	378,268	358,100	863,581
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	10,531	22,976	104,124
	クラスI（円） 受益証券	9,327	17,345	27,883
第13会計年度 (2014年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	111,499	373,797	601,283
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	6,309	26,674	83,759
	クラスI（円） 受益証券	4,355	14,394	17,844
第14会計年度 (2015年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	60,138	134,352	527,069
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	2,028	14,970	70,818
	クラスI（円） 受益証券	1,477	13,993	5,329
第15会計年度 (2016年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	30,573	138,859	418,783
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	11,521	19,006	63,333
	クラスI（円） 受益証券	2,069	2,822	4,576
第16会計年度 (2017年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	17,025	81,325	354,483
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	150	10,412	53,071
	クラスI（円） 受益証券	1,663	4,195	2,044

会計年度	クラス	販売口数	買戻口数	発行済口数
第17会計年度 (2018年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	9,417	47,543	316,357
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	623	6,078	47,616
	クラスI（円） 受益証券	482	2,234	293
第18会計年度 (2019年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	34,804	41,420	309,741
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	2,145	5,566	44,195
	クラスI（円） 受益証券	1,003	323	972
第19会計年度 (2020年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	31,762	39,692	301,812
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	7,630	9,065	42,760
	クラスI（円） 受益証券	1,705	2,285	392
第20会計年度 (2021年12月31日)	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	69,037	71,615	299,887
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	2,451	5,466	39,746
	クラスI（円） 受益証券	2,479	1,526	1,346
2021年8月1日～ 2022年7月31日	クラスA（米ドル） 受益証券 （四半期分配型）	18,946	65,779	276,952
	クラスA（円） 受益証券 （四半期分配型）	2,051	5,185	38,243
	クラスI（円） 受益証券	1,438	1,764	1,118

(注1) 上記の数字は、本邦内における販売口数及び買戻口数並びに発行済口数を表します。本邦外においては、各受益証券は販売されておりません。

(注2) クラスI（円）受益証券は適格機関投資家専用です。

3 【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの2022年6月30日に終了した6ヶ月間の日本文の中間財務書類は、アイルランドにおいて一般に公正妥当と認められる会計基準及び1990年ユニット・トラスト法を含むアイルランドの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す(但し、円換算部分を除きます。)。これは、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)第76条第4項但し書きの規定の適用によるものです。
- (2) 当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項に規定される外国監査法人等をいいます。)の監査を受けておりません。
- (3) 当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ます。日本文の未監査中間財務書類には、2022年7月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行公表の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=134.61円)を使用して換算された円換算額が、併記されています。金額は千円単位(単位金額未満は四捨五入)で表示されています。なお、日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総和と一致しない場合があります。

(1) 【資産及び負債の状況】

財政状態計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ ファンド	2022年6月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産	333,188,863	44,850,553	454,428,180	61,170,577
現金及び外国通貨	686,399	92,396	1,045,608	140,749
未収金：				
売却投資証券	8,370,717	1,126,782	2,889,440	388,948
未決済スポット外国為替契約	—	—	2	0
発行ファンド受益証券	320,137	43,094	327,916	44,141
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	342,566,116	46,112,825	458,691,146	61,744,415
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 負債	82,854	11,153	13,177	1,774
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
購入投資証券	—	—	—	—
未決済スポット外国為替契約	820	110	3,785	509
買戻しファンド受益証券	8,754,013	1,178,378	9,348,145	1,258,354
管理会社報酬	147,510	19,856	194,725	26,212
受益者サービス手数料	236,250	31,802	311,831	41,976
会計・管理・名義書換手数料	30,700	4,133	17,146	2,308
未払費用	76,094	10,243	59,401	7,996
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益 者に帰属する純資産を除く)	9,328,241	1,255,675	9,948,210	1,339,129
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純 資産	333,237,875	44,857,150	448,742,936	60,405,287

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	93,728,444	12,616,786	151,318,837	20,369,029
現金及び外国通貨	28,772	3,873	8,845	1,191
未収金：				
売却投資証券	111,985	15,074	1,081,156	145,534
未決済スポット外国為替契約	122	16	—	—
発行ファンド受益証券	151,587	20,405	313,089	42,145
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	94,020,910	12,656,155	152,721,927	20,557,899
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	72,105	9,706	10,314	1,388
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	158	21
購入投資証券	57,884	7,792	—	—
未決済スポット外国為替契約	—	—	2,340	315
買戻しファンド受益証券	217,310	29,252	1,377,409	185,413
管理会社報酬	22,726	3,059	33,613	4,525
受益者サービス手数料	122,415	16,478	181,041	24,370
会計・管理・名義書換手数料	15,652	2,107	2,772	373
未払費用	26,553	3,574	30,762	4,141
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	534,645	71,969	1,638,409	220,546
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	93,486,265	12,584,186	151,083,518	20,337,352

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	216,043,993	29,081,682	288,026,665	38,771,269
現金及び外国通貨	400,315	53,886	620,456	83,520
未収金：				
売却投資証券	153	21	72,854	9,807
未決済スポット外国為替契約	—	—	39	5
発行ファンド受益証券	341,913	46,025	476,477	64,139
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	216,786,374	29,181,614	289,196,491	38,928,740
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	43,551	5,862	7,095	955
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
購入投資証券	190,898	25,697	38,336	5,160
未決済スポット外国為替契約	1,034	139	298	40
買戻しファンド受益証券	114,553	15,420	631,427	84,996
管理会社報酬	96,707	13,018	120,294	16,193
受益者サービス手数料	251,707	33,882	313,021	42,136
会計・管理・名義書換手数料	22,841	3,075	9,576	1,289
未払費用	50,799	6,838	39,495	5,316
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	772,090	103,931	1,159,542	156,086
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	216,014,284	29,077,683	288,036,949	38,772,654

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	233,638,158	31,450,032	286,869,228	38,615,467
現金及び外国通貨	158,937	21,395	200,688	27,015
未収金：				
売却投資証券	214,347	28,853	226,293	30,461
未決済スポット外国為替契約	167	22	177	24
発行ファンド受益証券	1,506,926	202,847	3,373,451	454,100
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	235,518,535	31,703,150	290,669,837	39,127,067
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	73,598	9,907	18,784	2,529
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	33	4	1,994	268
購入投資証券	543,645	73,180	63,294	8,520
未決済スポット外国為替契約	700	94	410	55
買戻しファンド受益証券	563,229	75,816	3,339,875	449,581
管理会社報酬	100,084	13,472	116,473	15,678
受益者サービス手数料	320,152	43,096	372,736	50,174
会計・管理・名義書換手数料	20,778	2,797	5,396	726
未払費用	42,907	5,776	28,336	3,814
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	1,665,126	224,143	3,947,298	531,346
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	233,853,409	31,479,007	286,722,539	38,595,721

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産	120,883,244	16,272,093	145,214,863	19,547,373
現金及び外国通貨	124,525	16,762	140,405	18,900
未収金：				
売却投資証券	—	—	5,952	801
未決済スポット外国為替契約	102	14	220	30
発行ファンド受益証券	306,035	41,195	771,608	103,866
管理会社からの未収金	722	97	722	97
流動資産合計	121,314,628	16,330,162	146,133,770	19,671,067
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融 負債	33,376	4,493	12,936	1,741
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
購入投資証券	96,141	12,942	34,027	4,580
未決済スポット外国為替契約	253	34	178	24
買戻しファンド受益証券	105,854	14,249	195,823	26,360
管理会社報酬	38,654	5,203	42,152	5,674
受益者サービス手数料	183,904	24,755	200,459	26,984
会計・管理・名義書換手数料	16,065	2,163	3,052	411
未払費用	27,890	3,754	21,511	2,896
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益 者に帰属する純資産を除く)	502,137	67,593	510,138	68,670
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純 資産	120,812,491	16,262,569	145,623,632	19,602,397

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	517,700,487	69,687,663	706,153,842	95,055,369
現金及び外国通貨	567,203	76,351	514,449	69,250
未収金：				
売却投資証券	—	—	312,002	41,999
未決済スポット外国為替契約	1,166	157	7,946	1,070
発行ファンド受益証券	3,893,227	524,067	9,925,880	1,336,123
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	522,162,083	70,288,238	716,914,119	96,503,810
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	418,951	56,395	288,763	38,870
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	1	0	181	24
購入投資証券	2,239,695	301,485	1,914,185	257,668
未決済スポット外国為替契約	1,859	250	2,260	304
買戻しファンド受益証券	542,525	73,029	3,677,447	495,021
管理会社報酬	163,663	22,031	204,143	27,480
受益者サービス手数料	772,982	104,051	963,425	129,687
会計・管理・名義書換手数料	35,060	4,719	13,151	1,770
未払費用	88,026	11,849	48,859	6,577
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	4,262,762	573,810	7,112,414	957,402
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	517,899,321	69,714,428	709,801,705	95,546,408

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド	2022年6月30日現在		2021年12月31日現在*	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	158,222,700	21,298,358	196,859,062	26,499,198
現金及び外国通貨	7,003	943	64	9
未収金：				
売却投資証券	20,865	2,809	—	—
未決済スポット外国為替契約	1	0	1,778	239
発行ファンド受益証券	449,395	60,493	1,727,693	232,565
管理会社からの未収金	162,807	21,915	192,230	25,876
流動資産合計	158,862,771	21,384,518	198,780,827	26,757,887
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	119,357	16,067	70,623	9,507
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
購入投資証券	212,959	28,666	724,789	97,564
未決済スポット外国為替契約	499	67	—	—
買戻しファンド受益証券	22,434	3,020	295,661	39,799
管理会社報酬	66,128	8,901	78,137	10,518
受益者サービス手数料	224,835	30,265	265,664	35,761
会計・管理・名義書換手数料	15,618	2,102	(2,211)	(298)
未払費用	26,927	3,625	11,554	1,555
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	688,757	92,714	1,444,217	194,406
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	158,174,014	21,291,804	197,336,610	26,563,481

* 2021年8月16日（設定日）から2021年12月31日までの会計期間。

注記は財務諸表の一部を構成します。

財政状態計算書

ジャナス・グローバル・ リアルエステート・ファンド	2022年 6 月30日現在		2021年12月31日現在	
	米ドル	千円	米ドル	千円
流動資産：				
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	53,931,468	7,259,715	72,802,075	9,799,887
現金及び外国通貨	143,264	19,285	194,512	26,183
未収金：				
売却投資証券	—	—	7,482	1,007
未決済スポット外国為替契約	—	—	—	—
発行ファンド受益証券	89,216	12,009	22,122	2,978
管理会社からの未収金	—	—	—	—
流動資産合計	54,163,948	7,291,009	73,026,191	9,830,056
流動負債：				
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	14,146	1,904	5,056	681
未払金：				
銀行当座借越及び外国通貨	—	—	—	—
購入投資証券	88,464	11,908	287	39
未決済スポット外国為替契約	574	77	20	3
買戻しファンド受益証券	—	—	786,112	105,819
管理会社報酬	21,976	2,958	27,434	3,693
受益者サービス手数料	72,108	9,706	89,804	12,089
会計・管理・名義書換手数料	13,495	1,817	2,102	283
未払費用	20,232	2,723	19,416	2,614
流動負債合計(買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産を除く)	230,995	31,094	930,231	125,218
買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産	53,932,953	7,259,915	72,095,960	9,704,837

注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	3,493,337	470,238	4,760,389	640,796
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純利益/(損失)	(54,650,000)	(7,356,437)	(13,530,694)	(1,821,367)
収益/(費用)合計	(51,156,663)	(6,886,198)	(8,770,305)	(1,180,571)
費用：				
管理会社報酬	483,774	65,121	645,395	86,877
受益者サービス報酬	773,786	104,159	1,161,234	156,314
監査報酬	6,335	853	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	36,123	4,863	44,076	5,933
その他費用	47,714	6,423	40,233	5,416
費用合計	1,347,732	181,418	1,893,459	254,879
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	1,347,732	181,418	1,893,459	254,879
運用(損失)/利益	(52,504,395)	(7,067,617)	(10,663,764)	(1,435,449)
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラス A (米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラス A (円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(52,504,395)	(7,067,617)	(10,663,764)	(1,435,449)

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・マルチセクター・インカム・ ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純利益/(損失)	(17,722,024)	(2,385,562)	1,853,442	249,492
収益/(費用)合計	(17,722,024)	(2,385,562)	1,853,442	249,492
費用：				
管理会社報酬	80,600	10,850	165,947	22,338
受益者サービス報酬	433,998	58,420	464,651	62,547
監査報酬	7,029	946	(2,911)	(392)
会計・管理・名義書換手数料	26,938	3,626	17,435	2,347
その他費用	17,036	2,293	14,510	1,953
費用合計	565,601	76,136	659,632	88,793
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	565,601	76,136	659,632	88,793
運用(損失)/利益	(18,287,625)	(2,461,697)	1,193,810	160,699
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラス A (米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラス A (円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(18,287,625)	(2,461,697)	1,193,810	160,699

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	5,836,073	785,594	6,271,010	844,141
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純利益/(損失)	(53,624,567)	(7,218,403)	3,555,885	478,658
収益/(費用)合計	(47,788,494)	(6,432,809)	9,826,895	1,322,798
費用：				
管理会社報酬	316,926	42,661	343,479	46,236
受益者サービス報酬	823,752	110,885	961,309	129,402
監査報酬	5,656	761	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	30,669	4,128	27,618	3,718
その他費用	33,209	4,470	22,332	3,006
費用合計	1,210,212	162,907	1,357,259	182,701
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	1,210,212	162,907	1,357,259	182,701
運用(損失)/利益	(48,998,706)	(6,595,716)	8,469,636	1,140,098
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	(1,139,948)	(153,448)	(1,265,194)	(170,308)
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	(569,884)	(76,712)	(546,447)	(73,557)
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	(1,709,832)	(230,160)	(1,811,641)	(243,865)
運用による純資産の純増加/(減少)額	(50,708,538)	(6,825,876)	6,657,995	896,233

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純利益/(損失)	(53,087,176)	(7,146,065)	13,839,608	1,862,950
収益/(費用)合計	(53,087,176)	(7,146,065)	13,839,608	1,862,950
費用：				
管理会社報酬	322,342	43,390	216,653	29,164
受益者サービス報酬	1,031,052	138,790	736,461	99,135
監査報酬	5,568	750	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	32,527	4,378	24,369	3,280
その他費用	31,102	4,187	18,055	2,430
費用合計	1,422,591	191,495	998,059	134,349
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	1,422,591	191,495	998,059	134,349
運用(損失)/利益	(54,509,767)	(7,337,560)	12,841,549	1,728,601
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(54,509,767)	(7,337,560)	12,841,549	1,728,601

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純利益/(損失)	(25,314,370)	(3,407,567)	12,348,492	1,662,231
収益/(費用)合計	(25,314,370)	(3,407,567)	12,348,492	1,662,231
費用：				
管理会社報酬	122,961	16,552	128,837	17,343
受益者サービス報酬	579,915	78,062	437,597	58,905
監査報酬	5,108	688	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	26,030	3,504	19,243	2,590
その他費用	20,485	2,757	12,844	1,729
費用合計	754,499	101,563	601,042	80,906
費用補填の控除	—	—	(128,837)	(17,343)
費用補填考慮後純費用	754,499	101,563	472,205	63,564
運用(損失)/利益	(26,068,869)	(3,509,130)	11,876,287	1,598,667
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラス A (米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラス A (円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(26,068,869)	(3,509,130)	11,876,287	1,598,667

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	—	—	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純利益/(損失)	(267,781,825)	(36,046,111)	61,826,027	8,322,401
収益/(費用)合計	(267,781,825)	(36,046,111)	61,826,027	8,322,401
費用：				
管理会社報酬	549,546	73,974	540,885	72,809
受益者サービス報酬	2,589,574	348,583	1,834,686	246,967
監査報酬	6,975	939	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	51,074	6,875	41,707	5,614
その他費用	71,231	9,588	39,637	5,336
費用合計	3,268,400	439,959	2,459,436	331,065
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	3,268,400	439,959	2,459,436	331,065
運用(損失)/利益	(271,050,225)	(36,486,071)	59,366,591	7,991,337
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(271,050,225)	(36,486,071)	59,366,591	7,991,337

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

2022年6月30日に終了した期間*

	米ドル	千円
投資収益：		
配当金	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融資産及び負債に係る純利益/(損失)	(32,189,727)	(4,333,059)
収益/(費用)合計	(32,189,727)	(4,333,059)
費用：		
管理会社報酬	216,559	29,151
受益者サービス報酬	736,300	99,113
監査報酬	6,987	941
会計・管理・名義書換手数料	32,124	4,324
その他費用	24,780	3,336
費用合計	1,016,750	136,865
費用補填の控除	(539,281)	(72,593)
費用補填考慮後純費用	477,469	64,272
運用(損失)/利益	(32,667,196)	(4,397,331)
財務費用：		
買戻可能受益証券の受益者への配当：		
投資純利益—クラスA(米ドル) (毎月分配型)	—	—
投資純利益—クラスA(円) (毎月分配型)	—	—
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	—	—
運用による純資産の純増加/(減少)額	(32,667,196)	(4,397,331)

*当ファンドは2021年8月16日に設定されたため、比較期間のデータはありません。
損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

包括利益計算書

ジャナス・グローバル・ リアルエステート・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
投資収益：				
配当金	556,205	74,871	255,587	34,405
損益を通じて公正価値で測定する金融 資産及び負債に係る純利益/(損失)	(14,061,989)	(1,892,884)	7,760,760	1,044,676
収益/(費用)合計	(13,505,784)	(1,818,014)	8,016,347	1,079,080
費用：				
管理会社報酬	72,124	9,709	81,559	10,979
受益者サービス報酬	234,184	31,524	244,193	32,871
監査報酬	4,837	651	2,521	339
会計・管理・名義書換手数料	22,153	2,982	16,812	2,263
その他費用	12,991	1,749	10,504	1,414
費用合計	346,289	46,614	355,589	47,866
費用補填の控除	—	—	—	—
費用補填考慮後純費用	346,289	46,614	355,589	47,866
運用(損失)/利益	(13,852,073)	(1,864,628)	7,660,758	1,031,215
財務費用：				
買戻可能受益証券の受益者への配当：				
投資純利益—クラス A (米ドル) (四半期分配型)	(58,117)	(7,823)	(62,064)	(8,354)
投資純利益—クラス A (円) (四半期分配型)	(5,096)	(686)	(6,456)	(869)
買戻可能受益証券の受益者への配当合計	(63,213)	(8,509)	(68,520)	(9,223)
運用による純資産の純増加/(減少)額	(13,915,286)	(1,873,137)	7,592,238	1,021,991

損益は、継続事業からの損益のみです。包括利益計算書に計上されている損益以外に、損益はありませんでした。
注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(52,504,395)	(7,067,617)	(10,663,764)	(1,435,449)
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	13,021,398	1,752,810	77,159,512	10,386,442
受益証券買戻し	(76,022,064)	(10,233,330)	(86,680,893)	(11,668,115)
資本取引による純増加/(減少)額	(63,000,666)	(8,480,520)	(9,521,381)	(1,281,673)
純資産の純増加/(減少)額	(115,505,061)	(15,548,136)	(20,185,145)	(2,717,122)
純資産：				
期首	448,742,936	60,405,287	526,266,654	70,840,754
期末	333,237,875	44,857,150	506,081,509	68,123,632

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(18,287,625)	(2,461,697)	1,193,810	160,699
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	3,473,007	467,501	50,618,268	6,813,725
受益証券買戻し	(42,782,635)	(5,758,970)	(31,467,792)	(4,235,879)
資本取引による純増加/(減少)額	(39,309,628)	(5,291,469)	19,150,476	2,577,846
純資産の純増加/(減少)額	(57,597,253)	(7,753,166)	20,344,286	2,738,544
純資産：				
期首	151,083,518	20,337,352	116,308,831	15,656,332
期末	93,486,265	12,584,186	136,653,117	18,394,876

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・ハイイールド・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(50,708,538)	(6,825,876)	6,657,995	896,233
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	13,550,450	1,824,026	39,265,013	5,285,463
受益証券買戻し	(34,864,577)	(4,693,121)	(29,079,532)	(3,914,396)
資本取引による純増加/(減少)額	(21,314,127)	(2,869,095)	10,185,481	1,371,068
純資産の純増加/(減少)額	(72,022,665)	(9,694,971)	16,843,476	2,267,300
純資産：				
期首	288,036,949	38,772,654	274,395,554	36,936,386
期末	216,014,284	29,077,683	291,239,030	39,203,686

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・バランス・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(54,509,767)	(7,337,560)	12,841,549	1,728,601
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	36,415,084	4,901,834	78,490,951	10,565,667
受益証券買戻し	(34,774,447)	(4,680,988)	(22,653,124)	(3,049,337)
資本取引による純増加/(減少)額	1,640,637	220,846	55,837,827	7,516,330
純資産の純増加/(減少)額	(52,869,130)	(7,116,714)	68,679,376	9,244,931
純資産：				
期首	286,722,539	38,595,721	145,602,860	19,599,601
期末	233,853,409	31,479,007	214,282,236	28,844,532

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(26,068,869)	(3,509,130)	11,876,287	1,598,667
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	22,217,561	2,990,706	71,798,305	9,664,770
受益証券買戻し	(20,959,833)	(2,821,403)	(18,099,833)	(2,436,419)
資本取引による純増加/(減少)額	1,257,728	169,303	53,698,472	7,228,351
純資産の純増加/(減少)額	(24,811,141)	(3,339,828)	65,574,759	8,827,018
純資産：				
期首	145,623,632	19,602,397	72,547,650	9,765,639
期末	120,812,491	16,262,569	138,122,409	18,592,657

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・フォーティ・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(271,050,225)	(36,486,071)	59,366,591	7,991,337
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	150,101,085	20,205,107	204,582,536	27,538,855
受益証券買戻し	(70,953,244)	(9,551,016)	(101,236,401)	(13,627,432)
資本取引による純増加/(減少)額	79,147,841	10,654,091	103,346,135	13,911,423
純資産の純増加/(減少)額	(191,902,384)	(25,831,980)	162,712,726	21,902,760
純資産：				
期首	709,801,705	95,546,408	361,339,020	48,639,845
期末	517,899,321	69,714,428	524,051,746	70,542,606

注記は財務諸表の一部を構成します。

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間*	
	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(32,667,196)	(4,397,331)
受益証券の資本取引：		
受益証券の発行	13,187,057	1,775,110
受益証券買戻し	(19,682,457)	(2,649,456)
資本取引による純増加/(減少)額	(6,495,400)	(874,346)
純資産の純増加/(減少)額	(39,162,596)	(5,271,677)
純資産：		
期首	197,336,610	26,563,481
期末	158,174,014	21,291,804

買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド	2022年 6 月30日に終了した期間		2021年 6 月30日に終了した期間	
	米ドル	千円	米ドル	千円
運用による純資産の純増加/(減少)額	(13,915,286)	(1,873,137)	7,592,238	1,021,991
受益証券の資本取引：				
受益証券の発行	1,239,568	166,858	9,881,123	1,330,098
受益証券買戻し	(5,487,289)	(738,644)	(5,455,199)	(734,324)
資本取引による純増加/(減少)額	(4,247,721)	(571,786)	4,425,924	595,774
純資産の純増加/(減少)額	(18,163,007)	(2,444,922)	12,018,162	1,617,765
純資産：				
期首	72,095,960	9,704,837	61,094,985	8,223,996
期末	53,932,953	7,259,915	73,113,147	9,841,761

* 当ファンドは2022年 8 月16日に設定されたため、比較期間のデータはありません。

注記は財務諸表の一部を構成します。

[次へ](#)

財務諸表に対する注記

1 一般事項

ジャナス・セレクション(以下「当トラスト」という。また、当トラストの有する8つのファンドを以下「ファンド」という。)は、AIFルールブックの第1章に従い、アイルランド中央銀行からRIAIFとして認可を受けています。管理会社は、オルタナティブ投資ファンド運営者(以下「AIFM」という。)としてルクセンブルクAIFM法に従い、ルクセンブルク金融監督委員会(Commission de Surveillance du Secteur Financier、以下「CSSF」という。)から認可を受けており、当トラストのAIFMです。AIFMは、オルタナティブ投資ファンド運用指令(以下「AIFMD」という。)を順守する義務を負い、この義務には、様々な組織的な要件を満たし、事業行為規範に従うこと、活動プログラム、様々な方針や手続(リスク管理、流動性管理及び報酬等の分野に関するもの)を採用及び実施すること、並びに現在の資本の維持、報告及び透明性の義務を順守することが含まれますが、これらに限定されません。

2 会計方針

財務諸表作成の基礎

2022年6月30日に終了した会計期間の本財務諸表は、財務報告基準第102号「英国及びアイルランドにおいて適用される財務報告基準」に付随する中間報告に対する報告基準である財務報告基準第104号「中間財務報告」（以下「FRS第104号」という。）及び1990年ユニット・トラスト法に準拠して作成されております。

主要な会計方針及び見積りの手法は、前年度の監査済年次財務諸表に適用されたものと一致しています。

3 関連当事者間取引

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー(以下「HMSA」という。)は、当トラストの全般的な管理について責任を負っており、ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・インターナショナル・リミテッド(以下「JHIIL」という。)をファンドの投資顧問及び総販売会社に選任しました。JHIILは、英国金融行動監視機構(以下「FCA」という。)により規制を受ける、イングランド及びウェールズの法律に基づいて設立された企業です。間接的にJHIILを所有しているジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・US・エルエルシー(以下「JHIUS」という。)は、最終的にはジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーにより所有されています。これらの関連当事者の報酬の取り決めに変更はありません。関連当事者、取締役あるいは重大な利害関係のある当事者との取引は全て、通常業務の一環として、通常の商業取引の条件で行われています。

ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・UK・リミテッド(以下「JHIUKL」という。)は、販売契約に従って受益証券の販売を促進し、販売し、その他の方法で販売を支援する総販売会社に選任されました。

ファンドは、その資産の大部分を、ジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーのグループ内の投資顧問会社が運用するジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーのファンドに投資を行います。2022年6月30日現在、各ファンドが保有するアンダーライニング・ファンドの投資の価値は、投資有価証券明細表に開示されています。

管理会社の取締役報酬

当ファンドの取締役は、HMSAによって報酬を支払われており、よって2022年6月30日に終了した会計期間において、当トラストからは取締役報酬の支払いは発生していません。

管理会社報酬

AIFMでもある管理会社は、各ファンドの資産から管理会社報酬を受け取る権利を有しています。かかる管理会社報酬は、各ファンドの純資産価額に対する一定の割合として日々計算及び計上され、1ヶ月毎に後払いされます。

ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド及びジャナス・マルチセクター・インカム・ファンドを除く各ファンドについて、管理会社報酬はファンドの純資産価額の年率0.25%を超過しないものとします。ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド及びジャナス・マルチセクター・インカム・ファンドの管理会社報酬は、各ファンドのそれぞれ0.18%、0.23%及び0.13%を超過しないものとします。管理会社は、ファンドから受領した管理会社報酬の中から、投資顧問会社であるJHILの報酬を支払います。管理会社報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。

受益者サービス報酬

クラスA受益証券、クラスB受益証券及びクラスV受益証券に関する受益者サービス報酬(年率)は、各ファンドの資産から、該当するクラスに帰属するファンドの平均日次純資産価額の年率0.85%を上限として、総販売会社であるJHILに支払われます。ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド及びジャナス・ハイイールド・ファンドの受益者サービス報酬は、各ファンドにつきそれぞれ最大0.80%、0.40%及び0.65%の利率で支払われます。受益者サービス報酬は、日々計算され、1ヶ月毎に後払いされます。受益者サービス報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。

販売会社報酬

クラスB受益証券に関する販売会社報酬は、ファンドの資産から、該当するクラスに帰属するファンドの平均日次純資産価額の年率0.50%を上限として、総販売会社であるJHILに支払われます。販売会社報酬は、日々計算され、1ヶ月毎に後払いされます。販売会社報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。2022年6月30日に終了した会計期間に計上された販売会社報酬の該当はありませんでした。

ファンドの費用の上限

管理会社は、会計期間中に各受益証券クラスに配分されたファンドに関する管理事務代行報酬、受託報酬及び立替費用の合計(管理会社報酬、管理会社及びJHILの立替費用、受益者サービス報酬及び販売会社報酬、並びにアンダーライニング・ファンドにより発生したあらゆる手数料を除く)が、いずれのファンドについても各クラスに帰属する日次総純資産価額の0.25%を超えないようにするために必要な範囲において、管理会社報酬の全部又は一部を権利放棄することに同意しています。目論見書の規定では、かかる超過額は、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド及びジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンドを除いて、翌会計期間に(過年度に関連するかかる未払超過額と併せて)繰り越すことができるとされています。ただし、かかる繰越額は、関連する会計期間に適用される費用の上限の対象となります。その結果生じる偶発負債は、ファンドが将来の繰越費用について請求される可能性が現時点では高くないと投資顧問会社が判断したため、開示されていません。ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンドに関しては、管理会社が規定するファンドの上限を超える手数料及び費用は、翌会計期間に繰り越すことはできません。また、JHILは当該ファンドの費用合計の上限を超えないようにするために必要な範囲において、当該ファンドに関する運用報酬の一部を権利放棄する予定です。ファンドの費用の上限に関する詳細は、包括利益計算書の「費用補填の控除」として表示されています。管理会社は運用報酬の放棄を撤回し、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンドについて、クラスAで0.18%、クラスIで0.25%の新しい運用報酬率に合意しました。

アンダーライニング・ファンドには、一定の手数料及び費用が課されますが、これは費用の上限によって制限されています。2022年6月30日に終了した会計期間及び2021年12月31日終了会計年度にアンダーライニング・ファンドに適用される費用の上限は、以下のとおりです。

ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシー アンダーライニング・ファンド	費用の上限(%)
ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド	0.80 (11 m USD)
ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド	0.95 (12 USD)
ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド	0.90 (11 m USD)
ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド	1.05 (12 USD)
ジャナス・ヘンダーソン・USモール・ミッド・キャップ・バリュー・ファンド	1.20 (12 USD)
ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド	1.20 (12 USD)
ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド	1.75 (12 USD)
ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・エクイティ・インカム・ファンド	1.25 (11 q USD)

管理会社の取締役は、()管理会社が当トラストに関して、JHIL、受託会社及び／又は代理人あるいはこれらのグループ会社(以下「関連当事者」という。)と行う取引が、独立当事者間の取引条件で行われ、当該取引が受益者にとって最も有利な取引であることを確保するために、(文書化された手順によって明示された)取決めがあり、また()当期において締結された、管理会社が当トラストに関して関連当事者で行った全ての取引が、独立当事者間の取引条件で行われ、受益者にとって最も有利な取引であったと確信しています。

管理事務代行会社が計上した報酬は、包括利益計算書に個別の表示科目として開示されています。受託会社が計上した報酬は、包括利益計算書のその他費用に含まれています。

4 税金

当トラストは、1997年税連結法（改正）の第739B条に規定される投資会社としての資格を有しています。そのため、当トラストの収益又は利益には、通常アイルランドの税金が課税されません。

当トラストに課税事由が発生した場合には、アイルランドの税金が発生する可能性があります。課税事由には、受益者への分配金の支払、あるいは受益証券の現金化、中止、買戻しによる換金又は譲渡及び受益証券のそれぞれの取得から8年目の期末時点における受益証券保有数などが含まれます。アイルランドの税金は、課税事由の発生時に差し引かれます。以下の事項に該当する課税事由に関しては、税金は発生しません。

- a) 課税事由の発生時にアイルランドの居住者でない受益者及び税務上アイルランドに通常居住していない受益者。ただし、当トラストが1997年税連結法（改正）の条項に準拠した適切で有効な宣言書を保有している、又は適切な宣言書がない場合には当トラストが総額を支払うことをアイルランド国税局に承認されていること。
- b) 当トラストに必要な署名済みの法定宣言書を提出した、特定の免税となるアイルランドに居住する投資家。

課税事由について当トラストに納税義務が生じた場合、当該課税額を支払うために、当トラストは当該課税事由から発生する支払いから適切な税額に等しい金額を控除することができ、及び／もしくは該当する場合には、受益者もしくは実質受益者が保有する受益証券の必要数を割り当てるもしくは消却することができます。当該受益者は、当トラストが課税事由の発生により課税されることにより、当トラストに損失が生じないよう、当トラストを補償します。

当トラストが保有する投資有価証券により受領した配当金、利息及びキャピタル・ゲイン(ある場合)は、当該国で課税される源泉税などの課税対象となる可能性があり、かかる課税は当トラスト又は受益者に還付されない場合があります。

5 現金預金

全ての現金残高は、2022年6月30日に終了した会計期間及び2021年12月31日終了会計年度においては、保管受託会社に保管されていました。銀行当座借越は、アンダーライニング・ファンドの取引のタイミングにより計上され、決済時に清算されます。

6 ソフト・コミッション契約

投資顧問会社は、内部及び外部のリサーチを利用して、その意思決定について情報提供することができます。2022年6月30日に終了した会計期間及び2021年12月31日終了会計年度において、ソフト・コミッション契約はありませんでした。投資顧問会社は当該リサーチ使用料を自己の費用として決済しています。

7 効率的なポートフォリオの運用

ファンドは、ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのそれぞれのクラスI(円)受益証券並びにジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)の場合を除き、効率的なポートフォリオの運用及び通貨リスクのヘッジ目的で、格付の高い専門金融機関と、「店頭」契約ベースで通貨の先渡売買及び為替取引を行う場合があります。当期において、ファンドは、ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)、ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのそれぞれのクラスI(円)受益証券、並びにジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)の場合を除き、特定の受益証券の円クラスの価額をヘッジするために先渡為替取引を締結しました。2022年6月30日現在の未決済デリバティブ・ポジションは、関連するファンドの投資有価証券明細表に開示されています。2022年6月30日現在の保有総額も投資有価証券明細表に含まれています。

8 為替レート

下記の為替レートは、2022年6月30日現在及び2021年12月31日現在の米ドル以外の通貨建ての資産及び負債の米ドルへの換算に使用されています。

	2022年6月30日現在	2021年12月31日現在
豪ドル	1.4488	1.3745
ユーロ	0.9542	0.8783
日本円	135.6800	115.0300
ニュージーランド・ドル	1.6012	1.4601

9 リスク要因及びその他の特別な検討事項

目論見書に記載されている投資目標を達成するため、各ファンドはジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの対応するアンダーライニング・ファンドにのみ投資を行います。リスクの監視及び管理活動は全て、アンダーライニング・ファンドに対して行われています。

FRS第102号により要求されるリスクの評価及び監視に関する詳細は、添付のジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンド・ピーエルシーの財務諸表の注記14（訳者注：原文）に記載されています。

投資リスク

各ファンドは、対応するアンダーライニング・ファンドへの投資を行います。そのため、各ファンドの投資家は、関連する各アンダーライニング・ファンドが保有する投資ポジションに係るリスクの対象となります。

ファンド又はアンダーライニング・ファンドが投資目標を達成するという保証はありません。異なる国々の企業及び政府によって発行された異なる通貨建ての投資有価証券は一定のリスクを伴っており、受益証券の価額の下落を招く可能性もあります。受益証券の価額は、アンダーライニング・ファンドが投資する有価証券の資本価値の変動の結果として、アンダーライニング・ファンドの価額とともに上昇又は下落する可能性があります。

為替リスク

ジャナス・フォーティ・ファンド、ジャナス・バランス・ファンド、ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド、ジャナス・グローバル・リアルエーステート・ファンド、ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド、ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド、ジャナス・グローバル・ライフ・サイエンス・ファンド、ジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスI(円)受益証券(適格機関投資家専用)及びジャナス・ハイイールド・ファンドのクラスA(円)受益証券(毎月分配型)はクラスレベルでのヘッジを行わないため、このクラスに対する投資は為替リスクにさらされる可能性があります。

ファンドは、豪ドル、ニュージーランド・ドル及び円クラスの為替リスクのヘッジに努めるものの(上記で開示したものを除きます)、豪ドル、ニュージーランド・ドル及び円クラスの価額が米ドルに対する豪ドル、ニュージーランド・ドル及び円の水準によって影響を受けないという保証は一切できません。

信用リスク

各ファンドは、アンダーライニング・ファンドが取引を行う取引相手の信用リスクにさらされており、結果として、決済不履行のリスクも負うこととなります。アンダーライニング・ファンドは、認可を受けた、信用できる取引所で、複数のカウンターパーティと取引を行うことにより、信用リスクの集中を最小限に抑えています。

ファンドの資産は全て、アンダーライニング・ファンドが保有する金融デリバティブ商品を除いて、現在のところ、J.P.モルガン・バンクの預託ネットワーク内に保護預けされています。受託会社の破産又は倒産により、ファンドの受託会社に係る権利行使が遅延又は制限される場合があります。管理会社は、受託会社の信用の質及び財政状態を監視することにより、当該リスクを監視しています。

2022年6月30日の保管受託会社の信用格付けはA+（2021年12月31日：A+）です。先渡為替予約のカウンターパーティはJ.P.モルガンです。2022年6月30日のJ.P.モルガンの信用格付けはA+（2021年12月31日：A+）です。

流動性リスク

管理会社は、当トラストに関して適切な流動性管理システムを採用し、ファンドの流動性リスクを監視し、ファンドの投資の流動性プロファイルによって当トラストが通常の状況において償還請求を満たすことを可能にする文書化された手順を採用しています。さらに、管理会社が例外的な状況において当トラストの流動性を管理することを可能にする手順があります。

全てのファンドについて、管理会社は、営業日に買い戻されたファンドの受益証券（あるファンドから他のファンドの受益証券への転換の一環として買い戻された受益証券を含む）の数を当該ファンドの発行されている総受益証券数の10%以内に制限する権利を有しています。この場合、この制限は当該営業日に当該ファンドの受益証券の換金（買戻し）を希望している全ての受益者に対し比例して適用されるため、当該受益証券のうち買戻しが許容される割合で実現することとなります。買い戻されてはいないが、買い戻される予定であった受益証券は、翌営業日に換金（買戻し）を請求されたものとみなされ、当初請求していた受益証券全ての換金（買戻し）が終了するまで、その翌営業日に買戻換金（買戻）されていき、当該営業日に残存する受益証券はその日の1口当たりの純資産価格で評価されます（換金（買戻し）を行う受益者には、当該営業日の受益証券1口当たりの純資産価格が変動するリスクがあります）。翌営業日には、繰り延べられた換金（買戻し）請求がその後の換金（買戻し）請求に優先し、換金（買戻し）請求が受領された順番に処理されます。換金（買戻し）請求がそのように繰り延べられる場合は、管理会社は影響を受ける受益者に通知します。

換金（買戻し）請求中には、受益者の保有する当該受益証券を換金（買戻し）又は交換する権利も同様に停止されますが、停止期間中に受益者は保留中の換金（買戻し）請求を取り下げることができます。

当トラストにおいては、2022年6月30日に終了した会計期間及び2021年12月31日終了会計年度に換金（買戻し）請求の取り下げはありませんでした。

公正価値の見積り

FRS第102号では、各ファンドは、測定を行う際に使用されたインプットの重要性を反映する公正価値ヒエラルキーを用いて投資を分類することが要求されています。財政状態計算書において公正価値で保有されている金融商品については、ファンドは、金融商品の各クラスについて、公正価値測定が区分される以下の公正価値ヒエラルキーのレベルに係る分析を開示するよう要求されています。公正価値測定は、公正価値測定全体に重要な最低レベルのインプットに基づいて、その全体が区分されています。公正価値ヒエラルキーは以下のレベルに分けられます。

レベル1 - 同一の資産又は負債の活発な市場における相場価格(無調整)。

レベル2 - レベル1に含まれる相場価格以外の重要な観察可能なインプットを用いて決定される価格。観察可能なインプットとは、市場参加者が有価証券の価格を決定する際に利用する仮定を反映したインプットで、報告企業から独立した情報源から得た市場データに基づいています。

レベル3 - 重要な観察不能なインプットを用いて決定される価格。観察不能なインプットとは、相場価格又は観察可能なインプットが入手可能でない、あるいは関連性が低いと考えられる場合（例えば、期末時点で投資に関する市場取引がほとんどない、又は市場取引がない場合）、市場参加者が有価証券の価格を決定する際に使用するファクターに関する報告企業独自の仮定を反映したインプットであり、そのような状況において入手可能な最善の情報に基づくものです。

公正価値測定に対する特定のインプットの重要性の全体としての評価には、資産又は負債に特有の要素の判断及び検討が要求されます。アンダーライニング・ファンド及び先渡為替予約はレベル2とされます。2022年6月30日に終了した会計期間において異なるレベル間の振替はありませんでした（2021年：なし）。

10 純資産の比較

	2022年6月30日		2021年12月31日		2020年12月31日	
	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)
ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド						
クラスA(豪ドル・ヘッジ)受益証券	3,699,897	87.06	4,096,009	98.74	—	—
クラスA(円)受益証券	15,927,775	13,457.00	19,633,775	15,310.00	24,068,493	15,661.00
クラスA(ニュージーランド・ドル・ヘッジ)受益証券	540,842	87.61	627,758	98.91	—	—
クラスA(米ドル)受益証券	312,901,487	197.85	424,272,053	223.68	501,786,990	227.70
クラスI(円)受益証券	167,874	21,621.00	113,341	20,682.00	411,171	18,817.00
ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド						
クラスA(豪ドル・ヘッジ)受益証券	4,278,426	87.42	6,237,550	99.51	—	—
クラスA(円)受益証券	10,760,265	9,142.00	21,557,413	10,416.00	10,021,363	10,320.00
クラスA(ニュージーランド・ドル・ヘッジ)受益証券	772,332	88.06	932,524	99.71	—	—
クラスA(米ドル)受益証券	77,675,242	92.43	122,356,031	104.76	106,287,468	103.35
ジャナス・ハイイールド・ファンド						
クラスA(円)(毎月分配型)受益証券	23,701,982	9,536.00	25,676,992	9,965.00	24,292,973	8,919.00
クラスA(円)受益証券	11,922,361	17,376.00	18,400,752	21,031.00	14,349,702	20,192.00
クラスA(米ドル)(毎月分配型)受益証券	43,279,807	72.41	59,190,832	89.19	64,526,248	88.83
クラスA(米ドル)受益証券	137,039,514	247.71	184,682,624	298.39	171,125,037	285.44
クラスI(円)受益証券	70,620	26,807.00	85,749	27,288.00	101,594	23,272.00
ジャナス・バランス・ファンド						
クラスA(円)受益証券	20,343,141	21,368.00	23,126,866	26,095.00	10,459,522	22,727.00
クラスA(米ドル)受益証券	213,461,542	295.36	263,559,091	358.90	135,106,353	311.35
クラスI(円)受益証券	48,726	37,422.00	36,582	38,400.00	36,985	29,653.00

	2022年6月30日		2021年12月31日		2020年12月31日	
	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)	純資産 (米ドル)	1口当たり 純資産価格 (現地通貨)
ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド						
クラスA(円)受益証券	9,036,831	25,441.00	10,144,240	30,680.00	4,877,410	25,655.00
クラスA(米ドル)受益証券	111,711,663	331.56	135,358,857	398.14	67,579,096	332.21
クラスI(円)受益証券	63,997	36,058.00	120,535	36,567.00	91,144	27,160.00
ジャナス・フォーティ・ファンド						
クラスA(豪ドル・ヘッジ)受益証券	23,942,570	68.74	28,449,823	106.33	—	—
クラスA(円)受益証券	65,328,647	32,912.00	65,102,846	50,303.00	22,149,283	41,660.00
クラスA(ニュージーランド・ドル・ヘッジ)受益証券	1,694,815	69.42	2,172,265	106.52	—	—
クラスA(米ドル)受益証券	426,294,196	422.51	612,931,633	643.12	338,410,330	530.33
クラスI(円)受益証券	639,093	57,235.00	1,145,138	73,574.00	779,407	54,009.00
ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド						
クラスA(円)受益証券	32,760,611	8,638.00	42,976,615	10,055.00	—	—
クラスA(米ドル)受益証券	125,413,403	86.95	154,359,995	100.68	—	—
ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド						
クラスA(円)(四半期分配型)受益証券	3,956,715	13,990.00	5,992,157	17,342.00	5,981,789	14,444.00
クラスA(米ドル)(四半期分配型)受益証券	49,770,604	178.33	65,801,517	219.90	55,040,766	182.37
クラスI(円)受益証券	205,634	24,834.00	302,286	25,843.00	72,430	19,058.00

11 受益証券の資本取引

議決権：各受益者は、投票により受益者の表決に付された当トラストに関する事項について、各受益証券(議決権を有しない単位未満の受益証券は除外する)につき1議決権を与えられています。各受益者は、かかる集會に本人又は代理人により出席し、議決権を行使することができます。当トラスト又はファンドについて行使された議決権の50%以上が書面によって承認した決議は、いかなる目的においても、当トラスト又はファンドの正式に承認された通常決議として取り扱われるものとします。特定のファンドのみに影響を与える事項については、当該ファンドの受益者のみが議決権を行使する権利を有しています。上記の規則は、ファンドにおけるあらゆる種類の集會に対して同様に適用されるものとします。

買戻可能受益証券：受益者は、営業日に受益証券の全部又は一部の換金（買戻し）を請求する場合があります。ファンド又は受益証券クラスにおける受益者の保有額が、換金（買戻し）によって当該受益証券の最低当初投資額を下回る場合、管理会社又は管理事務代行会社はかかるファンド又は受益証券クラスにおける受益者の保有額を全て買い戻すことができます。全てのファンドについて、管理会社は、営業日に買い戻されたファンドの受益証券（あるファンドから他のファンドの受益証券への転換の一環として買い戻された受益証券を含む）の数を当該ファンドの発行されている総受益証券数の10%以内に制限する権利を有しています。この場合、この制限は当該営業日に当該ファンドの受益証券の換金（買戻し）を希望している全ての受益者に対し比例して適用されるため、当該受益証券のうち買戻しが許容される割合で実現することとなります。買い戻されてはいないが、買い戻される予定であった受益証券は、翌営業日に換金（買戻し）を請求されたものとみなされ、当初請求していた受益証券全ての換金（買戻し）が終了するまで、その翌営業日に買戻換金（買戻）されていき、当該営業日に残存する受益証券はその日の1口当たりの純資産価格で評価されます（換金（買戻し）を行う受益者には、当該営業日の受益証券1口当たりの純資産価格が変動するリスクがあります）。翌営業日には、繰り延べられた換金（買戻し）請求がその後の換金（買戻し）請求に優先し、換金（買戻し）請求が受領された順番に処理されます。

2022年6月30日に終了した会計期間における各ファンドの受益証券の発行及び換金（買戻し）に関する詳細は、以下の通りです。

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	クラスA(豪ドル・ヘッジ)受益証券	クラスA(円)受益証券	クラスA(ニュージーランド・ドル・ヘッジ)受益証券	クラスA(米ドル)受益証券	クラスI(円)受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	57,019	147,518	9,267	1,896,811	630
受益証券の発行	10,263	33,603	758	41,457	427
受益証券買戻し	(5,712)	(20,534)	(141)	(356,756)	(4)
期末	61,570	160,587	9,884	1,581,512	1,053

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

	クラスA(豪ドル・ヘッジ)受益証券	クラスA(円)受益証券	クラスA(ニュージーランド・ドル・ヘッジ)受益証券	クラスA(米ドル)受益証券
	口数	口数	口数	口数
期首	86,156	238,062	13,655	1,168,006
受益証券の発行	879	22,557	635	15,806
受益証券買戻し	(16,132)	(100,930)	(247)	(343,415)
期末	70,903	159,689	14,043	840,397

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	クラスA(円) (毎月分配型)受益証券	クラスA(円)受益証券	クラスA(米ドル) (毎月分配型)受益証券	クラスA(米ドル)受益証券	クラスI(円)受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	296,412	100,646	663,655	618,937	361
受益証券の発行	70,838	20,133	8,586	15,324	—
受益証券買戻し	(30,004)	(27,684)	(74,525)	(81,037)	(4)
期末	337,246	93,095	597,716	553,224	357

ジャンナス・バランス・ファンド

	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	101,947	734,344	110
受益証券の発行	37,220	88,399	814
受益証券買戻し	(9,993)	(100,021)	(747)
期末	129,174	722,722	177

ジャンナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	38,034	339,978	379
受益証券の発行	13,144	50,854	346
受益証券買戻し	(2,983)	(53,906)	(484)
期末	48,195	336,926	241

ジャンナス・フォーティ・ファンド

	クラスA (豪ドル・ ヘッジ) 受益証券	クラスA (円) 受益証券	クラスA (ニュージーラ ンド・ドル・ヘッジ) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	367,753	148,874	29,774	953,053	1,790
受益証券の発行	161,700	137,811	11,143	177,036	376
受益証券買戻し	(24,828)	(17,370)	(1,828)	(121,141)	(651)
期末	504,625	269,315	39,089	1,008,949	1,515

ジャンナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券
	口数	口数
期首	491,663	1,533,151
受益証券の発行	58,513	96,257
受益証券買戻し	(35,595)	(187,120)
期末	514,581	1,442,288

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラスA(円) (四半期分配型) 受益証券	クラスA(米ドル) (四半期分配型) 受益証券	クラスI(円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	39,746	299,233	1,346
受益証券の発行	1,064	5,532	10
受益証券買戻し	(2,435)	(25,665)	(233)
期末	38,375	279,100	1,123

2021年12月31日終了会計年度における各ファンドの受益証券の発行及び換金（買戻し）に関する詳細は、以下の通りです。

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

	クラスA(豪ドル・ ヘッジ)受益証券	クラスA(円) 受益証券	クラスA(ニュージーラ ンド・ドル・ヘッジ) 受益証券	クラスA(米ドル) 受益証券	クラスI(円) 受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	—	158,682	—	2,203,690	2,256
受益証券の発行	64,982	54,880	9,267	427,867	831
受益証券買戻し	(7,963)	(66,044)	—	(734,746)	(2,457)
期末	57,019	147,518	9,267	1,896,811	630

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

	クラスA(豪ドル・ ヘッジ)受益証券	クラスA(円) 受益証券	クラスA(ニュージーラ ンド・ドル・ヘッジ) 受益証券	クラスA(米ドル) 受益証券
	口数	口数	口数	口数
期首	—	100,268	—	1,028,444
受益証券の発行	95,104	215,543	13,655	681,420
受益証券買戻し	(8,948)	(77,749)	—	(541,858)
期末	86,156	238,062	13,655	1,168,006

ジャナス・ハイイールド・ファンド

	クラスA (円) (毎月分配型)受益証券	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) (毎月分配型)受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	281,250	73,381	726,429	599,511	451
受益証券の発行	82,259	55,721	83,589	132,051	376
受益証券買戻し	(67,097)	(28,456)	(146,363)	(112,625)	(466)
期末	296,412	100,646	663,655	618,937	361

ジャナス・バランス・ファンド

	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	47,521	433,933	129
受益証券の発行	70,117	466,851	40
受益証券買戻し	(15,691)	(166,440)	(59)
期末	101,947	734,344	110

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

	クラスA (円) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	19,631	203,424	347
受益証券の発行	30,897	237,424	435
受益証券買戻し	(12,494)	(100,870)	(403)
期末	38,034	339,978	379

ジャナス・フォーティ・ファンド

	クラスA (豪ドル・ ヘッジ)受益証券	クラスA (円) 受益証券	クラスA (ニュージーラ ンド・ドル・ヘッジ) 受益証券	クラスA (米ドル) 受益証券	クラスI (円) 受益証券
	口数	口数	口数	口数	口数
期首	—	54,897	—	638,113	1,490
受益証券の発行	423,936	127,940	33,289	610,054	2,381
受益証券買戻し	(56,183)	(33,963)	(3,515)	(295,114)	(2,081)
期末	367,753	148,874	29,774	953,053	1,790

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

	クラス A (円) 受益証券	クラス A (米ドル) 受益証券
	口数	口数
期首	—	—
受益証券の発行	503,730	1,584,694
受益証券買戻し	(12,067)	(51,543)
期末	491,663	1,533,151

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

	クラス A (円) (四半期分配型) 受益証券	クラス A (米ドル) (四半期分配型) 受益証券	クラス I (円) 受益証券
	口数	口数	口数
期首	42,760	301,812	392
受益証券の発行	2,452	69,036	2,480
受益証券買戻し	(5,466)	(71,615)	(1,526)
期末	39,746	299,233	1,346

12 （訳文では省略）

13 当期中に生じた重要な事象

2022年1月3日に、ジャナス・キャピタル・マネジメント・エルエルシーは、その名称をジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・US・エルエルシーに変更しました。

2022年1月22日(以下「合併日」という。)に、J.P.モルガン・バンク(アイルランド)ピーエルシーはJ.P.モルガン・エージと合併し、同時にその法的形態をドイツ株式会社(Aktiengesellschaft)から欧州会社(Societas Europaea)に変更し、J.P.モルガン・エスイーとなりました。

合併により、J.P.モルガン・バンク(アイルランド)ピーエルシーがファンドに提供するサービスの範囲は変更されません。合併日以降、J.P.モルガン・エスイーはJ.P.モルガン・エスイー - ダブリン支店を通じて預託機能を継続して実施しています。

J.P.モルガン・バンク(アイルランド)ピーエルシーの法的後継者として、J.P.モルガン・エスイー - ダブリン支店は、J.P.モルガン・バンク(アイルランド)ピーエルシーがファンドとの既存の契約に基づいて有する全ての権利及び義務を引き継ぎます。J.P.モルガン・バンク(アイルランド)ピーエルシーとの契約は、法令に基づきJ.P.モルガン・エスイー - ダブリン支店に移転されます。

2022年3月11日に、ジャナス・キャピタル・インターナショナル・リミテッドは、その名称をジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・インターナショナル・リミテッド(以下「JHIIL」という。)に変更しました。

2022年3月15日に、ヘンダーソン・グローバル・インベスターズ・リミテッドは、その名称をジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・UK・リミテッドに変更しました。

2022年4月7日に改訂目論見書が発表されました。

ジャナス・ヘンダーソンは引き続きロシアとウクライナの紛争を非常に綿密に監視し、変化に適時に対応できるように通常の業務活動に組み込まれたプロセスを確立しています。ファンドは、事業継続と危機管理のプロセスを十分に確立し、テストしています。このプロセスは、サイバー脅威や市場イベントを含む多くの破壊的なシナリオをカバーしています。ジャナス・ヘンダーソンは、進行中の状況を継続的に監視しながら、潜在的なシナリオのモデル化を投資判断に反映させています。2022年6月30日現在、ファンドは、ロシア又はウクライナに対する直接的なエクスポージャーを有していませんでした。

2022年6月30日に終了した会計期間において、他の重要な事象はありませんでした。

14 後発事象

当会計期間末以降、他の後発事象はありませんでした。

15 財務諸表の承認

本財務諸表は、2022年8月25日に取締役会により承認されました。

(2) 【投資有価証券明細表等】

【投資株式明細表】

該当事項はありません。

【株式以外の投資有価証券明細表】

ジャナス・フレキシブル・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 101.24% USD 454,323,071) アイルランド 資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド、 クラスI1m USD.....	29,073,998	99.99	333,188,016
合同運用型スキーム合計.....		99.99	333,188,016
投資有価証券合計(取得原価: USD 356,654,291).....		99.99	333,188,016

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.02% USD 105,109)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD 10,000 USD	6,877	6,904	2022年7月29日	0.00	27
JPY 19,186,086 USD	140,802	141,614	2022年7月29日	0.00	812
USD 8,936 AUD	12,933	8,928	2022年7月29日	0.00	8
合計				0.00	847
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				99.99	333,188,863

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.00% USD (13,177))

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD 5,312,780 USD	3,689,257	3,667,786	2022年7月29日	(0.01)	(21,470)
JPY 2,123,308,591 USD	15,727,906	15,672,325	2022年7月29日	(0.02)	(55,581)
NZD 859,822 USD	542,705	536,902	2022年7月29日	0.00	(5,803)
合計				(0.03)	(82,854)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.03)	(82,854)

当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・マルチセクター・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 100.06% USD 151,174,230)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド、 クラスI2 USD.....	9,793,986	100.26	93,728,444
合同運用型スキーム合計.....		100.26	93,728,444
投資有価証券合計(取得原価: USD 102,077,402).....		100.26	93,728,444

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.10% USD 144,607)

損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計	100.26	93,728,444
-----------------------	--------	------------

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: (0.01)% USD (10,314))

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD CA	6,254,948 USD	4,343,452	4,318,231	2022年7月29日	(0.03) (25,221)
JPY CA	1,474,600,922 USD	10,922,625	10,884,158	2022年7月29日	(0.04) (38,467)
NZD CA	1,247,190 USD	787,206	778,789	2022年7月29日	(0.01) (8,417)
合計				(0.08)	(72,105)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.08)	(72,105)

CA 当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・ハイイールド・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 99.98% USD 287,973,566)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド、 クラスI1m USD.....	28,464,177	100.01	216,043,102
合同運用型スキーム合計.....		100.01	216,043,102
投資有価証券合計(取得原価: USD 256,975,877).....		100.01	216,043,102

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.02% USD 53,099)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価益(米ドル)	
J.P. Morgan						
JPY 25 CA	21,070,000 USD	154,629	155,520	2022年 7 月29日	0.00	891
合計				0.00	891	
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				100.01	216,043,993	

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.00% USD (7,095))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価損(米ドル)
J.P. Morgan							
JPY 	1,628,112,729	USD	12,059,860	12,017,242	2022年7月29日	(0.02)	(42,618)
USD 	183,136	JPY	24,937,867	184,069	2022年7月29日	0.00	(933)
合計						(0.02)	(43,551)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(0.02)	(43,551)

CA 当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・バランス・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 100.03% USD 286,798,895)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド、 クラスI2 USD.....	5,458,819	99.91	233,637,435
合同運用型スキーム合計.....		99.91	233,637,435
投資有価証券合計(取得原価: USD 217,704,376).....		99.91	233,637,435

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.02% USD 70,333)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
JPY 15,500,000	USD 113,684	114,407	2022年7月29日	0.00	723
合計				0.00	723
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				99.91	233,638,158

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: (0.01)% USD (18,784))

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
JPY 2,767,682,752	USD 20,501,147	20,428,507	2022年7月29日	(0.03)	(72,640)
USD 358,585	JPY 48,711,294	359,543	2022年7月29日	0.00	(958)
合計				(0.03)	(73,598)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.03)	(73,598)

当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・ストラテジック・バリュー・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 99.68% USD 145,162,651)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・USスモール・ミッド・キャップ・ バリュー・ファンド、クラスI2 USD.....	3,346,705	100.06	120,882,982
合同運用型スキーム合計.....		100.06	120,882,982
投資有価証券合計(取得原価: USD 112,854,256).....		100.06	120,882,982

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.04% USD 52,212)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価益(米ドル)	
J.P. Morgan						
JPY 	8,000,000 USD	58,787	59,049	2022年 7 月29日	0.00	262
合計				0.00	262	
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				100.06	120,883,244	

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: (0.01)% USD (12,936))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価損(米ドル)
J.P. Morgan							
JPY 	1,244,854,699	USD	9,221,074	9,188,380	2022年 7 月29日	(0.03)	(32,694)
USD 	133,959	JPY	18,241,392	134,641	2022年 7 月29日	0.00	(682)
合計						(0.03)	(33,376)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(0.03)	(33,376)

CA 当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・フォーティ・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 99.39% USD 705,478,678)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・USフォーティ・ファンド、 クラスI2 USD.....	10,208,952	99.96	517,695,947
合同運用型スキーム合計.....		99.96	517,695,947
投資有価証券合計(取得原価: USD 568,460,616).....		99.96	517,695,947

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: 0.10% USD 675,164)

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD 25 CA 21,582	USD 14,842	14,900	2022年7月29日	0.00	58
JPY 25 CA 36,038,251	USD 264,146	266,002	2022年7月29日	0.00	1,856
NZD 25 CA 1,423	USD 885	888	2022年7月29日	0.00	3
USD 25 CA 262,482	AUD 377,314	260,486	2022年7月29日	0.00	1,996
USD 25 CA 726,311	JPY 98,340,875	725,863	2022年7月29日	0.00	448
USD 25 CA 18,848	NZD 29,898	18,669	2022年7月29日	0.00	179
合計				0.00	4,540
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				99.96	517,700,487

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年: (0.04)% USD (288,763))

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD 25 CA 36,469,296	USD 25,322,955	25,177,322	2022年7月29日	(0.03)	(145,633)
JPY 25 CA 9,315,863,524	USD 69,006,532	68,761,199	2022年7月29日	(0.05)	(245,333)
NZD 25 CA 2,867,286	USD 1,809,842	1,790,433	2022年7月29日	0.00	(19,409)
USD 25 CA 742,738	AUD 1,079,049	744,944	2022年7月29日	0.00	(2,206)
USD 25 CA 2,244,870	JPY 304,986,692	2,251,134	2022年7月29日	0.00	(6,264)
USD 25 CA 53,375	NZD 85,648	53,481	2022年7月29日	0.00	(106)
合計				(0.08)	(418,951)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.08)	(418,951)

25
CA 当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。
注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 99.69% USD 196,719,437)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ ファンド、クラスI2 USD.....	3,035,146	100.03	158,222,185
合同運用型スキーム合計.....		100.03	158,222,185
投資有価証券合計(取得原価: USD 180,679,796).....		100.03	158,222,185

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉（2021年：0.07% USD 139,625）

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価益(米ドル)
J.P. Morgan					
JPY 10,000,000	USD 73,296	73,811	2022年 7 月29日	0.00	515
合計				0.00	515
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				100.03	158,222,700

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年：(0.04)% USD (70,623))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	純資産に占める割合(%)	未実現評価損(米ドル)
J.P. Morgan							
JPY 	4,489,134,989	USD	33,252,657	33,134,696	2022年7月29日	(0.07)	(117,961)
USD 	522,709	JPY	71,006,436	524,105	2022年7月29日	0.00	(1,396)
合計						(0.07)	(119,357)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(0.07)	(119,357)

当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

ジャナス・グローバル・リアルエステート・ファンド

投資有価証券明細表

損益を通じて公正価値で測定する金融資産

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
合同運用型スキーム(2021年: 100.95% USD 72,781,375)			
アイルランド			
資本市場			
ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・エクイ ティ・インカム・ファンド、クラス I1q USD.....	2,997,819	100.00	53,930,767
合同運用型スキーム合計.....		100.00	53,930,767
投資有価証券合計(取得原価: USD 41,739,563).....		100.00	53,930,767

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉（2021年：0.03% USD 20,700）

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
JPY 11,708,353	USD 85,828	86,420	2022年7月29日	0.00	592
USD 30,770	JPY 4,154,028	30,661	2022年7月29日	0.00	109
合計				0.00	701
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				100.00	53,931,468

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉(2021年：(0.01)% USD (5,056))

購入通貨	売却通貨	時価(米ドル)	決済日	純資産に占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
JPY 538,299,695	USD 3,987,383	3,973,236	2022年7月29日	(0.03)	(14,146)
合計				(0.03)	(14,146)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.03)	(14,146)

当該先渡為替予約は、受益証券クラスレベルでのヘッジに使用されます。

注記は財務諸表の一部を構成します。

【投資不動産明細表】

該当事項はありません。

【その他投資資産明細表】

該当事項はありません。

【借入金明細表】

該当事項はありません。

[次へ](#)

（参考情報）

当ファンドは、アンダーライニング・ファンドであるジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンドを投資対象としています。ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンドの投資有価証券及びその他の資産の2022年6月30日現在の内訳は、以下の通りです。

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

(2022年6月30日現在)			
銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保ノ商業不動産担保証券 (2021年: 10.19% USD 77,329,932)			
280 Park Avenue Mortgage Trust, 2.0710%, due 15/9/34.....	2,068,116	0.36	2,025,043
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, 2.1740%, due 15/9/34	634,000	0.11	618,658
BANK, 4.2550%, 期日 15/5/61	2,830,170	0.50	2,832,241
BANK, 4.2170%, 期日 15/8/61	1,090,000	0.19	1,088,581
BBCMS Mortgage Trust, 2.1740%, 期日 15/8/36	548,000	0.10	537,233
BBCMS Mortgage Trust, 4.3140%, 期日 15/12/51.....	2,020,000	0.36	2,016,404
BBCMS Trust, 4.1970%, due 10/8/35	1,712,000	0.30	1,689,941
BXP Trust, 3.3790%, due 13/6/39	1,820,000	0.30	1,702,954
COMM Mortgage Trust, 4.2280%, due10/5/51.....	2,383,000	0.42	2,362,820
Connecticut Avenue Securities Trust, 4.0757%, 期日 25/12/41.....	2,388,000	0.34	1,916,395
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.9257%, 期日 25/3/42...	741,024	0.13	726,731
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.0257%, 期日 25/3/42...	1,710,212	0.30	1,679,342
Connecticut Avenue Securities Trust, 4.0236%, 期日 25/4/31...	85,822	0.02	85,567
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9236%, 期日 25/8/31...	85,427	0.02	85,129
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.7736%, 期日 25/9/31...	156,948	0.03	156,235
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.7236%, 期日 25/10/39.....	46,599	0.01	46,435
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.4757%, 期日 25/10/41.....	1,330,000	0.22	1,238,079
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.5757%, 期日 25/12/41.....	794,000	0.13	706,249
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.8257%, 期日 25/4/42...	739,689	0.13	727,432
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9257%, 期日 25/1/42...	865,000	0.14	796,649
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9257%, 期日 25/4/42...	528,000	0.09	500,592
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, 5.2100%, 期日 15/10/25.....	401,880	0.07	401,987
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, 5.5400%, 期日 15/1/26	676,032	0.12	676,277
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.6680%, 期日 25/10/49.....	2,269,755	0.37	2,061,843
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1160%, 期日 25/7/48	1,430,130	0.25	1,392,745
DT Auto Owner Trust, 5.5400%, 期日 16/6/25.....	885,000	0.16	887,141
GS Mortgage Securities Corp. II, 4.1550%, 期日 10/7/51.....	2,849,799	0.50	2,825,513
GS Mortgage Securities Trust, 3.9920%, 期日 10/3/51	2,842,876	0.50	2,798,882
Jack in the Box Funding LLC, 4.9700%, 期日 25/8/49.....	710,013	0.12	657,893
Jack in the Box Funding LLC, 4.4760%, 期日 25/8/49.....	1,619,500	0.28	1,551,340
Morgan Stanley Capital I Trust, 3.8090%, 期日 15/12/48.....	3,775,000	0.66	3,711,769
Morgan Stanley Capital I Trust, 2.7820%, 期日 15/8/49	3,041,000	0.51	2,867,943
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.4070%, 期日 15/10/51.....	825,000	0.15	828,015
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.3100%, due 15/12/51	2,784,627	0.49	2,764,038
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.1770%, due 15/7/51.....	2,813,605	0.46	2,791,782
New Residential Mortgage Loan Trust, 4.5000%, due 25/2/58 ...	436,768	0.08	437,414
NRZ Excess Spread-CollateralizedNotes, 3.1040%, 期日 25/7/26	1,003,704	0.16	913,913
Oak Street Investment Grade Net Lease Fund, 1.8500%, 期日 20/11/50.....	1,078,378	0.18	988,974

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Sequoia Mortgage Trust, 2.5000%, 期日 25/5/43	159,225	0.03	145,082
WFRBS Commercial Mortgage Trust, 3.6310%, due 15/11/47.....	1,252,000	0.22	1,234,005
資産担保ノ商業不動産担保証券合計.....		9.51	53,475,266
社債 (2021年: 30.32% USD 229,568,778)			
オーストラリア			
銀行			
Commonwealth Bank of Australia, 3.7840%, due 14/3/32.....	1,528,000	0.24	1,347,841
Westpac Banking Corp., 2.6680%, due 15/11/35.....	1,638,000	0.23	1,305,412
		0.47	2,653,253
カナダ			
銀行			
Bank of Montreal, 3.0880%, due 10/1/37.....	3,699,000	0.54	3,031,003
結合公益事業			
Algonquin Power & Utilities Corp., 4.7500%, due 18/1/82	1,661,000	0.25	1,385,808
フランス			
銀行			
BNP Paribas SA, 2.5910%, due 20/1/28.....	875,000	0.14	787,720
BNP Paribas SA, 3.1320%, due 20/1/33.....	735,000	0.11	616,074
Credit Agricole SA, 4.3750%, due 17/3/25.....	922,000	0.16	907,740
		0.41	2,311,534
ガーンジー			
各種金融サービス			
Pershing Square Holdings Ltd., 3.2500%, due 1/10/31	2,100,000	0.30	1,669,154
アイルランド			
消費者金融			
AerCap Ireland Capital DAC, 4.6250%, due 15/10/27	1,295,000	0.22	1,220,314
AerCap Ireland Capital DAC, 3.0000%, due 29/10/28	1,042,000	0.16	878,681
		0.38	2,098,995
ルクセンブルク			
食品			
JBS Finance Luxembourg SARL, 3.6250%, due 15/1/32	871,000	0.13	705,706
韓国			
半導体・半導体装置			
SK Hynix, Inc., 1.5000%, due 19/1/26.....	1,533,000	0.25	1,379,648
SK Hynix, Inc., 2.3750%, due 19/1/31.....	927,000	0.13	731,241
		0.38	2,110,889
スペイン			
銀行			
Banco Santander SA, 4.1750%, 期日 24/3/28	2,200,000	0.37	2,100,890
国際			
食品			
JBS USA LUX SA, 6.5000%, 期日 15/4/29	391,000	0.07	393,997
JBS USA LUX SA, 5.5000%, 期日 15/1/30	2,013,000	0.34	1,908,182
JBS USA LUX SA, 4.3750%, due 2/2/52	1,279,000	0.16	907,105
		0.57	3,209,284
英国			
バイオテクノロジー			
CSL Finance plc, 3.8500%, 期日 27/4/27.....	347,000	0.06	344,012
CSL Finance plc, 4.0500%, 期日 27/4/29.....	861,000	0.15	846,043
CSL Finance plc, 4.2500%, 期日 27/4/32.....	619,000	0.11	605,939
		0.32	1,795,994
医薬品			
Royalty Pharma plc, 3.3500%, 期日 2/9/51.....	715,000	0.09	485,961
米国			
航空貨物・物流			
GXO Logistics, Inc., 1.6500%, 期日 15/7/26.....	1,389,000	0.22	1,214,145
銀行			
Bank of America Corp., 5.2000%, 期日 1/6/23	736,000	0.12	683,100
Bank of America Corp., 6.2500%, 期日 5/9/24	1,573,000	0.27	1,532,889
Bank of America Corp., 3.5590%, 期日 23/4/27.....	1,591,000	0.27	1,525,926

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Bank of America Corp., 3.7050%, 期日 24/4/28.....	911,000	0.15	869,292
Bank of America Corp., 4.3760%, 期日 27/4/28.....	1,836,000	0.32	1,809,160
Bank of America Corp., 4.5710%, due 27/4/33	1,902,000	0.33	1,853,286
Citigroup, Inc., 5.3500%, due 15/5/23	897,000	0.15	837,035
Citigroup, Inc., 6.3000%, due 15/5/24	204,000	0.03	191,152
Citigroup, Inc., 5.9500%, due 15/5/25	456,000	0.08	423,898
JPMorgan Chase & Co., 5.0000%, due 1/8/24	736,000	0.12	649,980
JPMorgan Chase & Co., 4.6000%, due 1/2/25	777,000	0.12	658,135
JPMorgan Chase & Co., 2.0830%, due 22/4/26.....	151,000	0.03	141,386
JPMorgan Chase & Co., 4.0800%, 期日 26/4/26	517,000	0.09	511,266
JPMorgan Chase & Co., 3.9600%, 期日 29/1/27	2,342,000	0.41	2,289,108
JPMorgan Chase & Co., 4.5650%, 期日 14/6/30	983,000	0.17	965,925
JPMorgan Chase & Co., 2.9560%, 期日 13/5/31	1,686,000	0.26	1,457,115
JPMorgan Chase & Co., 2.9630%, 期日 25/1/33	2,555,000	0.39	2,195,089
JPMorgan Chase & Co., 4.5860%, 期日 26/4/33	304,000	0.05	298,917
SVB Financial Group, 4.2500%, 期日 15/11/26	3,301,000	0.44	2,496,895
SVB Financial Group, 4.1000%, 期日 15/2/31.....	1,737,000	0.21	1,203,245
US Bancorp, 2.4910%, 期日 3/11/36	1,705,000	0.25	1,391,268
		4.26	23,984,067
建設資材			
Standard Industries, Inc., 4.3750%, 期日 15/7/30.....	436,000	0.06	344,695
資本市場			
Ares Capital Corp., 2.8750%, due 15/6/27.....	1,211,000	0.18	1,011,828
Ares Capital Corp., 3.2000%, due 15/11/31	1,255,000	0.16	913,154
Charles Schwab Corp. (The), 5.3750%, 期日 1/6/25.....	3,167,000	0.56	3,143,248
Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.1020%, 期日 24/2/33.....	1,113,000	0.17	951,666
Morgan Stanley, 2.1880%, 期日 28/4/26	1,795,000	0.30	1,682,695
Morgan Stanley, 1.5930%, 期日 4/5/27.....	1,083,000	0.17	963,214
Morgan Stanley, 2.9430%, 期日 21/1/33	2,767,000	0.42	2,374,334
Morgan Stanley, 2.4840%, 期日 16/9/36	2,896,000	0.40	2,229,855
Morgan Stanley, 5.2970%, 期日 20/4/37	2,368,000	0.41	2,295,687
		2.77	15,565,681
商業サービス・用品			
Aramark Services, Inc., 6.3750%, 期日 1/5/25.....	1,645,000	0.29	1,612,799
消費者金融			
American Express Co., 4.9890%, 期日 26/5/33	1,600,000	0.28	1,602,548
電力事業			
Duquesne Light Holdings, Inc., 2.7750%, 期日 7/1/32	1,572,000	0.23	1,290,753
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 1.8750%, 期日 15/1/27	1,845,000	0.30	1,665,465
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2.4400%, 期日 15/1/32	611,000	0.09	509,426
NRG Energy, Inc., 6.6250%, 期日 15/1/27	366,000	0.06	359,079
		0.68	3,824,723
電子装置・機器・部品			
Allegion US Holding Co., Inc., 5.4110%, 期日 1/7/32	1,176,000	0.21	1,169,693
Trimble, Inc., 4.7500%, 期日 1/12/24.....	2,283,000	0.41	2,296,000
Trimble, Inc., 4.9000%, 期日 15/6/28.....	1,125,000	0.20	1,097,795
		0.82	4,563,488
エンターテインメント			
Netflix, Inc., 3.6250%, 期日 15/6/25.....	3,354,000	0.57	3,203,070
不動産投資信託 (REITs)			
Agree LP, 2.9000%, 期日 1/10/30	1,628,000	0.25	1,383,161
American Homes 4 Rent LP, 2.3750%, 期日 15/7/31	832,000	0.12	664,335
GLP Capital LP, 5.2500%, 期日 1/6/25.....	664,000	0.12	652,483
GLP Capital LP, 5.3000%, 期日 15/1/29	135,000	0.02	129,253
Invitation Homes Operating Partnership LP, 2.0000%, 期日 15/8/31	1,716,000	0.23	1,321,877
MPT Operating Partnership LP, 3.5000%, 期日 15/3/31	1,587,000	0.22	1,255,515
Rexford Industrial Realty LP, 2.1250%, 期日 1/12/30	1,973,000	0.28	1,583,963
Sun Communities Operating LP, 2.7000%, 期日 15/7/31	2,014,000	0.29	1,625,293
		1.53	8,615,880

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
食品			
Pilgrim's Pride Corp., 3.5000%, 期日 1/3/32	1,412,000	0.20	1,106,041
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス			
Centene Corp., 4.2500%, 期日 15/12/27	3,131,000	0.52	2,932,401
Centene Corp., 2.4500%, 期日 15/7/28.....	1,559,000	0.23	1,304,470
Centene Corp., 3.0000%, 期日 15/10/30	1,071,000	0.16	890,413
		0.91	5,127,284
保険			
Athene Global Funding, 1.7160%, 期日 7/1/25	748,000	0.12	698,631
Athene Global Funding, 1.7300%, 期日 2/10/26.....	2,519,000	0.39	2,188,001
Athene Global Funding, 2.7170%, 期日 7/1/29	1,427,000	0.22	1,214,937
Athene Global Funding, 2.6460%, 期日 4/10/31.....	2,349,000	0.33	1,877,833
Brown & Brown, Inc., 4.2000%, 期日 17/3/32.....	423,000	0.07	385,548
		1.13	6,364,950
インターネット販売・カタログ販売			
Amazon.com, Inc., 3.0000%, 期日 13/4/25	1,121,000	0.20	1,111,099
ITサービス			
Global Payments, Inc., 4.8000%, 期日 1/4/26	2,938,000	0.52	2,941,832
レジャー用品			
Hasbro, Inc., 3.9000%, 期日 19/11/29.....	1,978,000	0.32	1,818,244
Hasbro, Inc., 6.3500%, 期日 15/3/40	303,000	0.06	311,498
Hasbro, Inc., 5.1000%, 期日 15/5/44	244,000	0.04	218,896
		0.42	2,348,638
総合公益事業			
CMS Energy Corp., 4.7500%, 期日 1/6/50.....	1,472,000	0.23	1,293,476
Dominion Energy, Inc., 4.3500%, 期日 15/1/27.....	956,000	0.14	791,090
		0.37	2,084,566
石油・ガス・消耗燃料			
Energy Transfer LP, 4.9500%, 期日 15/6/28	150,000	0.03	147,960
EQT Corp., 3.1250%, 期日 15/5/26.....	3,009,000	0.50	2,821,705
Hess Midstream Operations LP, 5.1250%, 期日 15/6/28	2,196,000	0.35	1,975,082
Southwestern Energy Co., 4.7500%, 期日 1/2/32	931,000	0.14	797,811
		1.02	5,742,558
パーソナル用品			
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3.3750%, 期日 24/3/27	792,000	0.13	758,703
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3.3750%, 期日 24/3/29	505,000	0.08	472,906
		0.21	1,231,609
半導体・半導体装置			
Advanced Micro Devices, Inc., 3.9240%, 期日 1/6/32.....	426,000	0.07	419,702
Broadcom, Inc., 4.3000%, 期日 15/11/32.....	708,000	0.12	643,968
Marvell Technology, Inc., 1.6500%, 期日 15/4/26	1,283,000	0.20	1,151,046
Marvell Technology, Inc., 4.8750%, 期日 22/6/28	1,499,000	0.26	1,479,770
Microchip Technology, Inc., 2.6700%, due 1/9/23	2,127,000	0.37	2,092,519
TSMC Arizona Corp., 3.8750%, due 22/4/27.....	893,000	0.16	890,783
		1.18	6,677,788
ソフトウェア			
Cadence Design Systems, Inc., 4.3750%, due 15/10/24	4,036,000	0.72	4,075,306
Workday, Inc., 3.5000%, due 1/4/27.....	508,000	0.09	486,212
Workday, Inc., 3.7000%, due 1/4/29.....	381,000	0.06	356,754
		0.87	4,918,272
専門小売り			
Lithia Motors, Inc., 3.8750%, due 1/6/29.....	2,889,000	0.44	2,460,171
貯蓄・抵当金融			
Rocket Mortgage LLC, 2.8750%, 期日 15/10/26	1,253,000	0.18	1,039,025
Rocket Mortgage LLC, 3.6250%, 期日 1/3/29	1,145,000	0.16	902,443
Rocket Mortgage LLC, 3.8750%, 期日 1/3/31	819,000	0.11	616,007
Rocket Mortgage LLC, 4.0000%, due 15/10/33.....	927,000	0.12	660,256
		0.57	3,217,731

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
商社・代理店			
Air Lease Corp., 1.8750%, 期日 15/8/26.....	1,311,000	0.20	1,135,055
社債合計.....		23.93	134,557,161
政府発行証券 (2021年: 41.57% USD 315,006,572)			
米国財務省中期証券 / 長期証券			
1.2500%, 期日 30/11/26.....	3,072,800	0.51	2,845,641
1.2500%, 期日 31/12/26.....	32,794,000	5.39	30,314,594
2.7500%, 期日 30/4/27	24,580,500	4.31	24,251,160
3.2500%, due 30/6/27.....	16,085,000	2.89	16,243,337
1.1250%, due 31/8/28.....	1,042,400	0.16	927,858
2.8750%, due 30/4/29.....	7,341,000	1.29	7,256,120
2.7500%, due 31/5/29.....	4,997,000	0.87	4,899,402
2.8750%, 期日 15/5/32	54,008,700	9.50	53,409,541
1.3750%, 期日 15/11/40.....	3,883,000	0.50	2,798,035
1.7500%, 期日 15/8/41	14,444,000	1.96	10,992,674
2.0000%, 期日 15/11/41.....	11,155,000	1.58	8,863,868
2.3750%, 期日 15/2/42	7,499,000	1.13	6,361,261
2.7500%, 期日 15/8/42	6,649,500	1.06	5,971,822
1.3750%, 期日 15/8/50	14,164,000	1.66	9,329,705
1.8750%, 期日 15/2/51	2,716,500	0.36	2,038,967
2.2500%, 期日 15/2/52	14,677,000	2.15	12,083,299
0.0000%, 期日 5/7/22.....	36,100,000	6.42	36,096,534
政府発行証券合計.....		41.74	234,683,818

不動産担保証券 (2021年: 21.67% USD 163,921,535)

Fannie Mae

3.0000%, 期日 1/10/34	179,442	0.03	176,498
3.0000%, 期日 1/11/34	26,172	0.00	25,742
2.5000%, 期日 1/11/34	48,866	0.01	47,071
3.0000%, 期日 1/12/34	28,125	0.00	27,663
6.0000%, 期日 1/2/37.....	63,957	0.01	69,681
4.5000%, 期日 1/11/42	124,283	0.02	128,103
3.0000%, 期日 1/1/43.....	24,900	0.00	23,829
3.0000%, 期日 1/2/43.....	19,760	0.00	18,911
3.0000%, 期日 1/5/43.....	165,594	0.03	158,282
5.0000%, 期日 1/7/44.....	315,295	0.06	330,424
4.5000%, 期日 1/10/44	294,754	0.05	302,696
4.5000%, 期日 1/3/45.....	429,099	0.08	440,661
4.5000%, 期日 1/6/45.....	219,048	0.04	225,681
3.5000%, 期日 1/12/45	206,919	0.04	202,626
4.5000%, 期日 1/2/46.....	424,060	0.08	437,093
3.5000%, 期日 1/7/46.....	512,308	0.09	501,109
3.0000%, 期日 1/9/46.....	424,601	0.07	405,851
3.0000%, 期日 1/2/47.....	5,831,487	0.99	5,573,981
3.5000%, 期日 1/3/47.....	179,625	0.03	175,898
3.5000%, 期日 1/7/47.....	159,203	0.03	155,900
3.5000%, 期日 1/8/47.....	140,960	0.02	137,706
4.0000%, 期日 1/1/48.....	1,070,585	0.19	1,069,882
3.5000%, 期日 1/1/48.....	142,641	0.02	138,582
3.0000%, 期日 1/2/48.....	433,552	0.07	411,757
4.0000%, 期日 1/3/48.....	318,065	0.06	317,856
3.5000%, 期日 1/3/48.....	1,168,312	0.20	1,141,270
5.0000%, 期日 1/5/48.....	51,020	0.01	52,324
3.5000%, 期日 1/7/48.....	4,103,715	0.71	4,014,005
4.0000%, 期日 1/2/49.....	226,545	0.04	226,526
3.0000%, 期日 1/8/49.....	276,883	0.05	260,494
3.0000%, 期日 1/9/49.....	63,985	0.01	60,157
2.5000%, 期日 1/1/50.....	172,829	0.03	157,187
2.5000%, 期日 1/8/50.....	179,593	0.03	164,304
2.5000%, 期日 1/10/50	465,440	0.07	421,663
2.5000%, 期日 1/1/52.....	1,053,328	0.17	954,468

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
2.5000%, 期日 1/2/52.....	5,108,414	0.82	4,623,028
3.0000%, 期日 1/2/52.....	1,003,517	0.17	936,722
3.0000%, 期日 1/3/52.....	3,640,837	0.60	3,394,190
2.5000%, 期日 1/3/52.....	171,300	0.03	154,682
2.5000%, 期日 1/3/52.....	176,996	0.03	159,791
3.0000%, 期日 1/3/52.....	1,129,884	0.19	1,054,739
2.5000%, 期日 1/3/52.....	59,556	0.01	53,850
3.0000%, 期日 1/3/52.....	837,218	0.14	782,214
2.5000%, 期日 1/3/52.....	2,168,344	0.35	1,957,989
2.5000%, 期日 1/3/52.....	774,439	0.12	700,959
2.5000%, 期日 1/3/52.....	2,084,013	0.34	1,885,996
2.5000%, 期日 1/3/52.....	151,370	0.02	136,987
3.0000%, 期日 1/4/52.....	619,255	0.10	578,530
3.0000%, 期日 1/4/52.....	2,251,972	0.37	2,098,976
3.0000%, 期日 1/4/52.....	702,093	0.12	656,462
3.5000%, 期日 1/4/52.....	210,902	0.04	204,156
3.5000%, 期日 1/4/52.....	98,069	0.02	94,916
3.5000%, 期日 1/4/52.....	339,960	0.06	329,029
3.5000%, 期日 1/4/52.....	613,849	0.11	594,214
3.5000%, 期日 1/4/52.....	127,657	0.02	123,560
3.5000%, 期日 1/5/52.....	319,807	0.06	309,552
3.5000%, 期日 1/6/52.....	716,945	0.12	690,089
3.5000%, 期日 1/6/52.....	2,317,133	0.40	2,230,574
3.5000%, 期日 1/6/52.....	1,696,191	0.29	1,651,083
3.5000%, 期日 1/7/52.....	241,947	0.04	235,513
3.5000%, 期日 1/8/56.....	1,454,513	0.25	1,428,863
3.0000%, 期日 1/2/57.....	1,048,246	0.18	985,946
3.0000%, 期日 1/6/57.....	6,961	0.00	6,521
4.2236%, 期日 25/5/24.....	763,899	0.14	764,145
6.5236%, 期日 25/11/24.....	930,489	0.17	960,688
5.6236%, 期日 25/5/25.....	1,201,371	0.21	1,202,755
6.6236%, 期日 25/7/25.....	529,451	0.09	533,239
7.3236%, 期日 25/4/28.....	293,640	0.06	310,384
5.8736%, 期日 25/4/29.....	374,903	0.07	391,222
5.1736%, 期日 25/7/29.....	575,836	0.11	591,215
3.8236%, 期日 25/1/30.....	1,011,960	0.18	1,016,881
4.0236%, 期日 25/5/30.....	1,047,368	0.19	1,056,717
2.9257%, 期日 25/11/41.....	2,205,000	0.35	1,973,559
3.0000%, 期日 25/5/48.....	970,759	0.17	929,281
3.0000%, 期日 25/11/49.....	1,193,173	0.21	1,154,738
		10.29	57,899,836
Freddie Mac			
3.5000%, 期日 1/1/47.....	122,387	0.02	120,503
4.5736%, 期日 25/11/49.....	2,021,000	0.34	1,935,267
3.0257%, 期日 25/3/42.....	802,277	0.14	795,543
3.1757%, 期日 25/8/33.....	723,000	0.12	670,763
3.5736%, 期日 25/10/49.....	45,081	0.01	44,720
4.7736%, 期日 25/9/50.....	69,206	0.01	69,232
2.9257%, 期日 25/12/50.....	1,313,000	0.23	1,294,454
3.7292%, 期日 25/6/42.....	996,000	0.18	997,247
3.2257%, 期日 25/8/33.....	663,000	0.11	627,219
3.5257%, 期日 25/11/50.....	1,498,133	0.26	1,486,983
		1.42	8,041,931
Freddie Mac Pool			
3.0000%, 期日 1/5/31.....	997,442	0.18	990,615
3.0000%, 期日 1/9/32.....	262,098	0.05	259,626
3.0000%, 期日 1/10/32.....	56,835	0.01	56,299
3.0000%, 期日 1/1/33.....	172,359	0.03	170,734
2.5000%, 期日 1/12/33.....	1,242,324	0.22	1,216,787
3.0000%, 期日 1/10/34.....	384,683	0.07	378,374
3.0000%, 期日 1/10/34.....	176,952	0.03	174,050
2.5000%, 期日 1/11/34.....	46,912	0.01	45,190

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
2.5000%, 期日 1/11/34	73,173	0.01	70,488
6.0000%, 期日 1/4/40	100,529	0.02	109,822
3.5000%, 期日 1/7/42	10,588	0.00	10,415
3.5000%, 期日 1/8/42	12,147	0.00	11,949
3.5000%, 期日 1/8/42	11,336	0.00	11,151
3.5000%, 期日 1/2/43	193,184	0.03	190,147
3.0000%, 期日 1/3/43	898,369	0.15	858,703
3.0000%, 期日 1/6/43	9,208	0.00	8,697
3.5000%, 期日 1/2/44	298,952	0.05	294,252
4.5000%, 期日 1/5/44	201,090	0.04	207,170
3.0000%, 期日 1/1/45	352,126	0.06	335,838
4.0000%, 期日 1/2/46	248,890	0.04	252,732
3.5000%, 期日 1/7/46	229,569	0.04	223,180
4.0000%, 期日 1/3/47	46,841	0.01	47,046
3.5000%, 期日 1/4/47	1,264,247	0.22	1,236,569
3.0000%, 期日 1/4/47	364,633	0.06	345,849
3.5000%, 期日 1/2/48	120,040	0.02	116,416
4.0000%, 期日 1/4/48	283,104	0.05	282,426
4.0000%, 期日 1/4/48	237,108	0.04	237,088
4.0000%, 期日 1/5/48	485,656	0.09	485,615
4.5000%, 期日 1/7/48	110,836	0.02	112,757
5.0000%, 期日 1/9/48	13,974	0.00	14,333
3.5000%, 期日 1/8/49	830,501	0.14	808,375
3.0000%, 期日 1/8/49	91,736	0.02	86,307
3.0000%, 期日 1/12/49	113,015	0.02	106,327
3.0000%, 期日 1/12/49	104,384	0.02	98,206
2.5000%, 期日 1/1/50	76,260	0.01	69,364
3.0000%, 期日 1/3/50	66,979	0.01	62,891
3.5000%, 期日 1/3/50	2,860	0.00	2,765
2.5000%, 期日 1/8/50	92,032	0.01	84,246
2.5000%, 期日 1/8/50	33,094	0.01	30,278
2.5000%, 期日 1/9/50	169,537	0.03	155,023
2.5000%, 期日 1/1/52	202,241	0.03	182,713
2.5000%, 期日 1/1/52	334,198	0.05	303,037
2.5000%, 期日 1/2/52	467,894	0.08	423,435
3.5000%, 期日 1/2/52	678,644	0.12	654,352
3.0000%, 期日 1/2/52	227,679	0.04	212,770
3.0000%, 期日 1/2/52	171,278	0.03	160,172
2.5000%, 期日 1/3/52	74,693	0.01	67,447
3.0000%, 期日 1/3/52	290,750	0.05	271,877
3.5000%, due 1/4/52	215,973	0.04	209,070
3.5000%, due 1/4/52	238,353	0.04	230,734
3.5000%, due 1/4/52	71,157	0.01	68,871
3.5000%, due 1/4/52	84,970	0.01	82,245
3.5000%, due 1/5/52	1,842,242	0.32	1,775,317
3.5000%, due 1/6/52	981,335	0.17	952,734
		2.82	15,852,874
Ginnie Mae			
4.0000%, 期日 15/1/45	1,230,498	0.22	1,250,363
4.5000%, 期日 15/8/46	1,443,350	0.27	1,490,057
4.0000%, 期日 15/8/47	34,224	0.01	34,569
4.0000%, 期日 20/8/47	140,207	0.03	141,317
4.0000%, 期日 20/8/47	13,006	0.00	13,109
4.0000%, 期日 20/8/47	28,312	0.01	28,536
4.0000%, 期日 15/11/47	39,653	0.01	40,053
4.0000%, 期日 15/12/47	105,175	0.02	106,236
4.5000%, 期日 20/2/48	157,635	0.03	162,176
4.5000%, 期日 20/5/48	213,419	0.04	218,000
4.5000%, 期日 20/5/48	44,347	0.01	45,299
4.0000%, 期日 20/6/48	316,024	0.06	316,941
5.0000%, 期日 20/8/48	377,677	0.07	395,010
3.0000%, 期日 20/7/51	1,527,384	0.26	1,443,034

ジャナス・ヘンダーソン・フレキシブル・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.0000%, 期日 20/8/51	4,802,396	0.81	4,539,497
2.5000%, 期日 15/7/52	5,807,554	0.94	5,310,686
3.0000%, 期日 15/7/52	421,264	0.07	397,007
3.5000%, 期日 15/7/52	4,218,563	0.73	4,099,270
		3.59	20,031,160
UMBS			
2.0000%, 期日 25/7/37	3,376,252	0.56	3,150,802
2.5000%, 期日 25/7/37	1,912,784	0.32	1,827,418
2.5000%, 期日 25/7/52	4,900,630	0.78	4,405,737
3.0000%, 期日 25/7/52	12,892,597	2.13	12,004,077
3.5000%, 期日 25/7/52	19,962,908	3.41	19,199,216
4.0000%, 期日 25/7/52	13,444,500	2.36	13,257,071
4.5000%, 期日 25/7/52	14,107,438	2.52	14,162,550
		12.08	68,006,871
不動産担保証券合計.....		30.20	169,832,672
トランシュ・ローン (2021年: 3.36% USD 25,526,982)			
米国			
ヘルスケア機器・用品			
Medline Borrower LP, 4.9200%, 期日 23/10/28	2,872,585	0.48	2,672,854
トランシュ・ローン合計.....		0.48	2,672,854
投資有価証券合計 (取得原価: USD 640,064,333)		105.86	595,221,771

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年: 0.05% USD 474,459)

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan							
EUR	213	USD	223	224	2022年 7 月29日	0.00	1
USD	135,560	EUR	128,474	134,852	2022年 7 月29日	0.00	708
合計						0.00	709

先物契約[○] (2021年: 0.00% USD 9,010)

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	(56) US 10 Year Note	0.02	81,313
Goldman Sachs	(207) US 10 Year Ultra Bond	0.02	120,844
Goldman Sachs	20 US 2 Year Note	0.01	44,137
合計		0.05	246,294
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計		105.91	595,468,774

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年: 0.00% USD (15,127))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD ^(注)	2,684,951	USD 1,864,437	1,853,611	2022年 7 月29日	0.00 (10,826)
EUR ^(注)	18,401,857	USD 19,440,258	19,315,475	2022年 7 月29日	(0.02) (124,783)
USD ^(注)	13,250	EUR 12,672	13,301	2022年 7 月29日	0.00 (51)
合計				(0.02)	(135,660)

先物契約[○] (2021年: 0.00% USD -)

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Goldman Sachs	224 US 5 Year Note	(0.03)	(150,122)
Goldman Sachs	16 US Ultra Bond	0.00	(3,350)
合計		(0.03)	(153,472)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計		(0.05)	(289,132)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	33.48
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	54.37
規制市場において取引されている金融デリバティブ商品	0.04
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	12.11
資産合計	100.00

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。[○] 保有担保の詳細については、注記5 (訳者注: Appendixの注記5. Cash at Bank)を参照してください。

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保ノ商業不動産担保証券(2021年: 32.18% USD 90,729,633)			
Agora Securities UK DAC, 2.8134%, 期日 17/8/31.....	999,644	0.52	1,177,405
Alaska Airlines Pass-Through Trust, 4.8000%, 期日 15/8/27 ...	428,855	0.19	424,006
American Credit Acceptance Receivables Trust, 5.1700%, 期日 15/10/24.....	1,059,696	0.47	1,060,126
Apidos CLO XII, 6.4443%, 期日 15/4/31	1,000,000	0.38	847,347
Apidos CLO XV, 2.0727%, 期日 20/4/31.....	2,041,000	0.89	2,005,062
Atrium XII, 1.9663%, 期日 22/4/27	1,750,253	0.77	1,727,200
BAMLL Re-REMIC Trust, 期日 27/5/23.....	1,330,000	0.55	1,234,016
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., 4.5384%, 期日 14/1/32	861,000	0.34	761,337
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd., 4.1943%, 期日 15/7/31	1,500,000	0.58	1,304,802
Coinstar Funding LLC, 5.2160%, 期日 25/4/47	1,439,250	0.62	1,395,822
Connecticut Avenue Securities Trust, 5.9736%, 期日 25/4/31...	3,500,000	1.55	3,483,072
Connecticut Avenue Securities Trust, 5.7736%, 期日 25/8/31...	3,151,000	1.38	3,118,643
Connecticut Avenue Securities Trust, 5.7236%, 期日 25/9/31...	881,331	0.39	872,170
Connecticut Avenue Securities Trust, 5.7236%, 期日 25/7/39...	727,169	0.32	710,863
Connecticut Avenue Securities Trust, 4.0757%, 期日 25/12/41.....	1,076,000	0.38	863,501
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.9257%, 期日 25/3/42...	1,036,146	0.45	1,016,162
Connecticut Avenue Securities Trust, 4.0236%, 期日 25/4/31...	17,554	0.01	17,502
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9236%, 期日 25/8/31...	19,202	0.01	19,136
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.7736%, 期日 25/9/31...	86,748	0.04	86,354
Connecticut Avenue Securities Trust, 5.4257%, 期日 25/1/42...	1,373,000	0.55	1,245,956
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, 5.2100%, 期日 15/10/25.....	216,998	0.10	217,056
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, 5.5400%, 期日 15/1/26	281,635	0.13	281,737
DBCCRE Mortgage Trust, 5.0990%, 期日 10/1/34.....	1,300,000	0.55	1,245,330
DBCCRE Mortgage Trust, 5.0990%, 期日 10/1/34.....	1,588,000	0.67	1,509,853
DBGS Mortgage Trust, 2.8900%, 期日 15/5/35.....	1,370,644	0.59	1,331,918
Driven Brands Funding LLC, 4.6410%, 期日 20/4/49.....	1,935,000	0.83	1,880,048
Dryden 50 Senior Loan Fund, 7.3043%, 期日 15/7/30	1,000,000	0.40	896,696
Dryden 57 CLO Ltd., 2.4213%, 期日 15/5/31	4,000,000	1.74	3,918,136
Exeter Automobile Receivables Trust, 6.5500%, 期日 25/8/25...	1,750,000	0.80	1,792,510
First Investors Auto Owner Trust, 7.1600%, 期日 15/8/25	1,503,000	0.67	1,506,397
FREMF Mortgage Trust, 3.0699%, 期日 25/3/25	316,196	0.14	313,551
FREMF Mortgage Trust, 3.5699%, 期日 25/10/28.....	1,538,505	0.65	1,467,075
FREMF Mortgage Trust, 3.6199%, 期日 25/1/28	1,356,703	0.59	1,337,101
FREMF Mortgage Trust, 6.1199%, 期日 25/10/28.....	882,378	0.37	828,072
GS Mortgage Securities Corp. Trust, 4.7443%, 期日 10/10/32...	1,500,000	0.66	1,475,116
GS Mortgage Securities Corp. Trust, 4.7443%, 期日 10/10/32...	169,000	0.07	164,462
LCM XIV LP, 2.1027%, 期日 20/7/31	1,360,000	0.59	1,327,331
LCM XIV LP, 6.5627%, 期日 20/7/31	975,000	0.34	767,518
LCM XXI LP, 3.8627%, 期日 20/4/28	3,000,000		
Madison Park Funding XXX Ltd., 3.5443%, 期日 15/4/29.....	2,000,000	1.27	2,864,172
		0.83	1,871,824
Magnetite XII Ltd., 6.7243%, 期日 15/10/31.....	980,000	0.39	888,027
Multifamily Connecticut Avenue Securities Trust, 5.3736%, 期日 25/3/50.....	2,000,000	0.79	1,787,500
Newday Funding Master Issuer plc, 3.2844%, 期日 15/7/29	1,000,000	0.52	1,166,276
Oak Street Investment Grade Net Lease Fund, 5.1100%, 期日 20/11/50.....	501,000	0.20	451,153
Regatta XV Funding Ltd., 7.6840%, 期日 25/10/31	680,000	0.26	589,204
RR 4 Ltd., 3.9943%, 期日 15/4/30.....	2,945,000	1.19	2,670,968
Santander Prime Auto Issuance Notes Trust, 6.8000%, 期日 15/9/25	233,334	0.10	232,978

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
SC Germany SA Compartment Consumer, 3.3610%, 期日 14/11/34...	429,969	0.20	451,235
SEB Funding LLC, 4.9690%, 期日 30/1/52.....	1,249,868	0.51	1,152,068
Sofi Professional Loan Program Trust, 期日 25/2/48.....	10,000	0.04	94,737
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd., 5.7500%, 期日 17/5/32.....	864,687	0.29	658,414
Voya CLO Ltd., 4.3884%, 期日 14/7/31.....	1,460,000	0.54	1,215,437
Voya CLO Ltd., 6.2943%, 期日 15/7/31.....	1,500,000	0.55	1,237,007
Willis Engine Structured Trust III, 6.3600%, 期日 15/8/42 ...	1,451,069	0.50	1,128,626
Z Capital Credit Partners CLO Ltd., 2.6043%, 期日 16/1/31 ...	1,910,000	0.84	1,894,579
Z Capital Credit Partners CLO Ltd., 3.4943%, 期日 16/1/31 ...	2,500,000	1.10	2,466,628
資産担保ノ商業不動産担保証券合計.....		30.40	68,451,222
普通株式 (2021年: 0.16% USD 467,104)			
ジャージー			
専門サービス			
Clarivate plc	356	0.00	4,934
米国			
半導体・半導体装置			
NVIDIA Corp.....	1,184	0.08	179,483
普通株式合計.....		0.08	184,417
社債 (2021年: 41.59% USD 116,922,731)			
オーストラリア			
銀行			
Commonwealth Bank of オーストラリア, 3.7840%, 期日 14/3/32...	1,112,000	0.44	980,889
バミューダ			
保険			
Athene Holding Ltd., 3.5000%, 期日 15/1/31.....	658,000	0.25	557,759
ブラジル			
エンターテインメント			
Globo Comunicacao e Participacoes SA, 4.8750%, 期日 22/1/30	375,000	0.13	293,835
カナダ			
銀行			
Bank of Montreal, 3.0880%, 期日 10/1/37	1,086,000	0.40	889,881
金属・鉱業			
First Quantum Minerals Ltd., 7.5000%, 期日 1/4/25	724,000	0.30	685,952
Hudbay Minerals, Inc., 4.5000%, 期日 1/4/26	837,000	0.31	701,632
Hudbay Minerals, Inc., 6.1250%, 期日 1/4/29	820,000	0.30	666,160
IAMGOLD Corp., 5.7500%, 期日 15/10/28	842,000	0.25	561,039
		1.16	2,614,783
総合公益事業			
Algonquin Power & Utilities Corp., 4.7500%, 期日 18/1/82.....	1,812,000	0.67	1,511,790
ケイマン諸島			
各種電気通信サービス			
Sable International Finance Ltd., 5.7500%, 期日 7/9/27.....	321,000	0.13	295,034
ホテル・レストラン・レジャー			
Sands China Ltd., 4.8750%, 期日 18/6/30	215,000	0.07	157,515
フランス			
各種電気通信サービス			
Altice France SA, 5.5000%, 期日 15/10/29.....	397,000	0.14	304,493
ドイツ			
自動車部品			
IHO Verwaltungs GmbH, 3.8750%, 期日 15/5/27	819,000	0.29	671,393
建設資材			
HT Troplast GmbH, 9.2500%, 期日 15/7/25	180,000	0.07	167,882
HT Troplast GmbH, 9.2500%, 期日 15/7/25	100,000	0.04	93,268
		0.11	261,150
アイルランド			
銀行			
Permanent TSB Group Holdings plc, 2.1250%, 期日 26/9/24	766,000	0.35	783,959

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
メディア			
LCPR Senior Secured Financing DAC, 5.1250%, 期日 15/7/29.....	788,000	0.29	659,481
イタリア			
ホテル・レストラン・レジャー			
ASR Media and Sponsorship SpA, 5.1250%, 期日 1/8/24	741,767	0.31	696,680
機械			
IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3.7500%, 期日 15/1/28	100,000	0.04	84,379
IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3.7500%, 期日 15/1/28	340,000	0.13 0.17	286,888 371,267
ルクセンブルク			
容器・包装			
ARD Finance SA, 5.0000%, 期日 30/6/27	940,511	0.32	714,320
ARD Finance SA, 6.5000%, 期日 30/6/27	234,978	0.08 0.40	174,678 888,998
メディア			
Altice Financing SA, 5.0000%, 期日 15/1/28.....	317,000	0.11	256,331
不動産管理・開発			
CPI Property Group SA, 4.8750%, 期日 16/7/25.....	360,000	0.10	219,675
メキシコ			
建設資材			
GCC SAB de CV, 3.6140%, 期日 20/4/32.....	954,000	0.35	780,501
オランダ			
銀行			
Stichting AK Rabobank Certificaten, 6.5000%, 期日 29/3/71 ...	804,675	0.36	821,149
化学			
Diamond BC BV, 4.6250%, 期日 1/10/29.....	892,000	0.32	714,568
容器・包装			
Trivium Packaging Finance BV, 5.5000%, 期日 15/8/26	374,000	0.16	354,305
医薬品			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3.1500%, 期日 1/10/26.....	638,000	0.23	525,237
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4.7500%, 期日 9/5/27	748,000	0.28 0.51	639,815 1,165,052
不動産管理・開発			
AT Securities BV, 5.2500%, 期日 21/7/23	500,000	0.20	451,760
パナマ			
銀行			
Banco La Hipotecaria SA, 5.5000%, 期日 15/9/23.....	300,000	0.14	310,477
Banco La Hipotecaria SA, 4.1250%, 期日 15/12/24	1,000,000	0.43 0.57	970,935 1,281,412
ホテル・レストラン・レジャー			
Carnival Corp., 7.6250%, 期日 1/3/26.....	391,000	0.13	303,758
国際			
航空会社			
American Airlines, Inc., 5.5000%, 期日 20/4/26.....	691,000	0.28	637,309
容器・包装			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 6.0000%, 期日 15/6/27	441,000	0.19	437,254
Ardagh Packaging Finance plc, 4.1250%, 期日 15/8/26	520,000	0.20	441,600
Ardagh Packaging Finance plc, 5.2500%, 期日 15/8/27	650,000	0.21 0.60	465,247 1,344,101
食品			
JBS USA LUX SA, 6.5000%, 期日 15/4/29	58,000	0.03	58,445
スイス			
資本市場			
Credit Suisse Group AG, 7.5000%, 期日 11/12/23.....	560,000	0.24	534,881
UBS Group AG, 7.0000%, 期日 31/1/24	577,000	0.25	563,511
UBS Group AG, 4.7510%, 期日 12/5/28	600,000	0.26 0.75	594,379 1,692,771

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
英国			
銀行			
HSBC Holdings plc, 2.3570%, 期日 18/8/31.....	341,000	0.12	276,709
NatWest Group plc, 5.5160%, 期日 30/9/28.....	1,100,000	0.49	1,108,925
		0.61	1,385,634
家庭用耐久財			
Victoria plc, 3.7500%, 期日 15/3/28	630,000	0.20	454,686
米国			
自動車部品			
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6.6250%, 期日 15/10/29	777,000	0.26	574,786
銀行			
Bank of America Corp., 4.5710%, 期日 27/4/33.....	916,000	0.40	892,539
Citigroup, Inc., 3.8750%, 期日 18/2/26.....	436,000	0.16	362,970
Citigroup, Inc., 4.9100%, 期日 24/5/33.....	750,000	0.33	740,904
JPMorgan Chase & Co., 5.0000%, 期日 1/8/24.....	601,000	0.24	530,758
JPMorgan Chase & Co., 2.9560%, 期日 13/5/31	803,000	0.31	693,988
JPMorgan Chase & Co., 2.9630%, 期日 25/1/33	566,000	0.22	486,270
JPMorgan Chase & Co., 4.5860%, 期日 26/4/33	151,000	0.07	148,475
SVB Financial Group, 4.2500%, 期日 15/11/26	1,653,000	0.56	1,250,339
SVB Financial Group, 4.1000%, 期日 15/2/31.....	895,000	0.28	619,979
Wells Fargo & Co., 4.6110%, 期日 25/4/53.....	610,000	0.25	565,518
		2.82	6,291,740
建設資材			
Builders FirstSource, Inc., 6.3750%, 期日 15/6/32	1,130,000	0.45	1,010,983
CP Atlas Buyer, Inc., 7.0000%, 期日 1/12/28	239,000	0.08	172,938
JELD-WEN, Inc., 4.8750%, 期日 15/12/27.....	552,000	0.19	431,294
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5.2500%, 期日 15/7/28	1,204,000	0.44	991,476
Oscar AcquisitionCo LLC, 9.5000%, 期日 15/4/30.....	150,000	0.05	119,144
Standard Industries, Inc., 4.3750%, 期日 15/7/30.....	1,800,000	0.63	1,423,053
		1.84	4,148,888
資本市場			
Bank of New York Mellon Corp. (The), 4.7000%, 期日 20/9/25...	291,000	0.13	285,035
Charles Schwab Corp. (The), 4.0000%, 期日 1/6/26.....	896,000	0.34	760,623
Coinbase Global, Inc., 3.3750%, 期日 1/10/28.....	678,000	0.19	428,699
Coinbase Global, Inc., 3.6250%, 期日 1/10/31.....	1,085,000	0.27	612,494
Morgan Stanley, 3.6220%, 期日 1/4/31.....	506,000	0.21	465,266
Morgan Stanley, 2.9430%, 期日 21/1/33	380,000	0.14	326,074
Morgan Stanley, 5.2970%, 期日 20/4/37	359,000	0.15	348,037
Morgan Stanley, 3.2170%, 期日 22/4/42	382,000	0.13	301,313
MSCI, Inc., 3.6250%, 期日 1/11/31	1,029,000	0.38	849,031
OWL Rock Core Income Corp., 4.7000%, 期日 8/2/27.....	1,250,000	0.51	1,141,264
		2.45	5,517,836
化学			
Axalta Coating Systems LLC, 3.3750%, 期日 15/2/29	914,000	0.33	747,305
GPD Cos., Inc., 10.1250%, 期日 1/4/26	1,135,000	0.48	1,082,869
Iris Holdings, Inc., 8.7500%, 期日 15/2/26.....	797,000	0.28	638,839
Vibrantz Technologies, Inc., 9.0000%, 期日 15/2/30.....	1,059,000	0.33	748,019
		1.42	3,217,032
商業サービス・用品			
Allied Universal Holdco LLC, 6.0000%, 期日 1/6/29	424,000	0.14	309,152
通信機器			
Ciena Corp., 4.0000%, 期日 31/1/30.....	417,000	0.16	360,419
建設・土木			
Arcosa, Inc., 4.3750%, 期日 15/4/29	302,000	0.11	256,718
Weekley Homes LLC, 4.8750%, 期日 15/9/28.....	392,000	0.14	310,148
		0.25	566,866
消費者金融			
FirstCash, Inc., 4.6250%, 期日 1/9/28	453,000	0.17	391,809
FirstCash, Inc., 5.6250%, 期日 1/1/30	554,000	0.21	479,277
OneMain Finance Corp., 3.8750%, 期日 15/9/28.....	1,385,000	0.47	1,061,499
		0.85	1,932,585

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
容器・包装			
LABL, Inc., 10.5000%, 期日 15/7/27.....	662,000	0.26	576,817
LABL, Inc., 8.2500%, 期日 1/11/29	1,075,000	0.36	813,641
		0.62	1,390,458
各種金融サービス			
Burford Capital Global Finance LLC, 6.2500%, 期日 15/4/28 ...	200,000	0.08	175,244
Burford Capital Global Finance LLC, 6.8750%, 期日 15/4/30 ...	200,000	0.08	176,082
		0.16	351,326
各種電気通信サービス			
CCO Holdings LLC, 4.5000%, 期日 15/8/30	1,175,000	0.43	979,343
CCO Holdings LLC, 4.7500%, 期日 1/2/32.....	853,000	0.31	700,569
Lumen Technologies, Inc., 7.5000%, 期日 1/4/24.....	714,000	0.31	705,968
Windstream Escrow LLC, 7.7500%, 期日 15/8/28.....	468,000	0.17	378,036
Zayo Group Holdings, Inc., 6.1250%, 期日 1/3/28	598,000	0.19	433,433
		1.41	3,197,349
電力事業			
American Electric Power Co., Inc., 3.8750%, 期日 15/2/62.....	1,581,000	0.56	1,251,297
IPALCO Enterprises, Inc., 4.2500%, 期日 1/5/30.....	624,000	0.26	580,245
NRG Energy, Inc., 3.3750%, 期日15/2/29.....	770,000	0.28	622,318
Toledo Edison Co. (The), 2.6500%, 期日 1/5/28	292,000	0.12	273,853
Xcel Energy, Inc., 4.6000%, 期日 1/6/32	622,000	0.27	617,474
		1.49	3,345,187
電子装置・機器・部品			
Allegion US Holding Co., Inc., 5.4110%, 期日 1/7/32	419,000	0.19	416,753
Vontier Corp., 2.9500%, 期日 1/4/31	810,000	0.28	636,514
		0.47	1,053,267
エンターテインメント			
Magallanes, Inc., 4.2790%, 期日 15/3/32	1,045,000	0.42	934,961
Netflix, Inc., 4.3750%, 期日 15/11/26	1,146,000	0.49	1,107,185
Netflix, Inc., 3.6250%, 期日 15/6/30.....	395,000	0.16	359,187
		1.07	2,401,333
不動産投資信託 (REITs)			
Broadstone Net Lease LLC, 2.6000%, 期日 15/9/31	647,000	0.23	528,365
Global Net Lease, Inc., 3.7500%, 期日 15/12/27.....	799,000	0.30	668,408
GLP Capital LP, 4.0000%, 期日 15/1/31	528,000	0.20	456,218
MPT Operating Partnership LP, 4.6250%, 期日 1/8/29.....	1,000,000	0.39	879,450
Safehold Operating Partnership LP, 2.8000%, 期日 15/6/31.....	1,312,000	0.48	1,069,574
VICI Properties LP, 4.9500%, 期日 15/2/30	1,694,000	0.71	1,608,504
VICI Properties LP, 5.1250%, 期日 15/5/32	243,000	0.10	229,494
		2.41	5,440,013
食品			
Smithfield Foods, Inc., 3.0000%, 期日 15/10/30.....	248,000	0.09	205,882
ヘルスケア・プロバイダー /ヘルスケア・サービス			
Centene Corp., 3.3750%, 期日 15/2/30.....	1,298,000	0.49	1,104,487
Community Health Systems, Inc., 6.8750%, 期日 15/4/29	656,000	0.19	425,029
Community Health Systems, Inc., 4.7500%, 期日 15/2/31	968,000	0.32	711,357
Hadrian Merger Sub, Inc., 8.5000%, 期日 1/5/26.....	1,604,000	0.68	1,527,217
HCA, Inc., 3.5000%, 期日 1/9/30	1,122,000	0.43	957,745
ModivCare Escrow Issuer, Inc., 5.0000%, 期日 1/10/29.....	395,000	0.14	319,609
Universal Health Services, Inc., 2.6500%, 期日 15/1/32.....	863,000	0.30	672,750
		2.55	5,718,194
ホテル・レストラン・レジャー			
Caesars Resort Collection LLC, 5.7500%, 期日 1/7/25	668,000	0.28	640,521
Fertitta Entertainment LLC, 6.7500%, 期日 15/1/30	706,000	0.24	543,888
Full House Resorts, Inc., 8.2500%, 期日 15/2/28	1,279,000	0.45	1,024,059
IRB Holding Corp., 7.0000%, 期日 15/6/25.....	1,307,000	0.57	1,281,383
Premier Entertainment Sub LLC, 5.6250%, 期日 1/9/29	1,014,000	0.32	723,469
Premier Entertainment Sub LLC, 5.8750%, 期日 1/9/31	1,016,000	0.31	706,525
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP, 5.8750%, 期日 15/5/25 ...	515,000	0.21	474,370
Wendy's International LLC, 7.0000%, 期日 15/12/25	1,395,000	0.63	1,427,978
		3.01	6,822,193

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
家庭用耐久財			
LGI Homes, Inc., 4.0000%, 期日 15/7/29.....	481,000	0.16	359,754
Newell Brands, Inc., 4.8750%, 期日 1/6/25	231,000	0.10	227,920
PulteGroup, Inc., 7.8750%, 期日 15/6/32	153,000	0.08	172,535
		0.34	760,209
インダストリアル・コングロマリット			
General Electric Co., 5.1589%, 期日 15/9/22	1,098,000	0.43	966,185
保険			
Berkshire Hathaway Finance Corp., 3.8500%, 期日 15/3/52	727,000	0.28	623,708
Brown & Brown, Inc., 4.9500%, 期日 17/3/52.....	451,000	0.18	396,649
NFP Corp., 6.8750%, 期日 15/8/28.....	602,000	0.22	498,372
Progressive Corp. (The), 3.0000%, 期日 15/3/32.....	528,000	0.21	473,556
Prudential Financial, Inc., 3.7000%, 期日 1/10/50	301,000	0.11	252,553
Ryan Specialty Group LLC, 4.3750%, 期日 1/2/30.....	1,099,000	0.43	957,504
		1.43	3,202,342
インタラクティブ・メディア/サービス			
Snap, Inc., 0.7500%, 期日 1/8/26.....	128,000	0.05	121,824
Twitter, Inc., 3.8750%, 期日 15/12/27	256,000	0.11	241,784
Twitter, Inc., 5.0000%, 期日 1/3/30	1,418,000	0.60	1,347,625
		0.76	1,711,233
ITサービス			
Virtusa Corp., 7.1250%, 期日 15/12/28	683,000	0.24	550,037
機械			
Mueller Water Products, Inc., 4.0000%, 期日 15/6/29	715,000	0.28	624,674
メディア			
Block Communications, Inc., 4.8750%, 期日 1/3/28.....	593,000	0.22	504,543
Charter Communications Operating LLC, 4.4000%, 期日 1/4/33...	513,000	0.20	458,689
CSC Holdings LLC, 7.5000%, 期日 1/4/28.....	496,000	0.18	415,469
CSC Holdings LLC, 4.6250%, 期日 1/12/30	1,040,000	0.31	698,646
GCI LLC, 4.7500%, 期日 15/10/28	796,000	0.31	690,835
Gray Escrow II, Inc., 5.3750%, 期日 15/11/31.....	615,000	0.22	494,094
Liberty Interactive LLC, 8.5000%, 期日 15/7/29.....	1,034,000	0.32	717,802
Univision Communications, Inc., 7.3750%, 期日 30/6/30	360,000	0.16	352,265
		1.92	4,332,343
金属・鉱業			
Arconic Corp., 6.1250%, 期日 15/2/28.....	326,000	0.14	305,089
Carpenter Technology Corp., 7.6250%, 期日 15/3/30	614,000	0.25	564,816
		0.39	869,905
総合公益事業			
CMS Energy Corp., 4.7500%, 期日 1/6/50.....	576,000	0.22	506,143
石油・ガス・消耗燃料			
CNX Resources Corp., 6.0000%, 期日 15/1/29.....	458,000	0.20	428,693
DCP Midstream Operating LP, 5.6000%, 期日 1/4/44.....	236,000	0.08	191,160
DT Midstream, Inc., 4.1250%, 期日 15/6/29	808,000	0.31	687,119
EnLink Midstream LLC, 5.6250%, 期日 15/1/28	784,000	0.32	720,509
EQM Midstream Partners LP, 4.7500%, 期日 15/1/31.....	813,000	0.29	650,697
EQT Corp., 3.1250%, 期日 15/5/26.....	1,068,000	0.44	1,001,522
Hess Midstream Operations LP, 4.2500%, 期日 15/2/30	582,000	0.22	488,502
Howard Midstream Energy Partners LLC, 6.7500%, 期日 15/1/27	1,021,000	0.39	881,188
NGL Energy Operating LLC, 7.5000%, 期日 1/2/26.....	779,000	0.31	703,846
Rockies Express Pipeline LLC, 4.9500%, 期日 15/7/29	152,000	0.06	130,221
Southwestern Energy Co., 5.3750%, 期日 15/3/30.....	621,000	0.25	572,581
Tallgrass Energy Partners LP, 6.0000%, 期日 1/9/31.....	92,000	0.03	76,039
Viper Energy Partners LP, 5.3750%, 期日 1/11/27	802,000	0.34	767,896
Western Midstream Operating LP, 4.5500%, 期日 1/2/30.....	685,000	0.26	594,440
		3.50	7,894,413
パーソナル用品			
BellRing Brands, Inc., 7.0000%, 期日 15/3/30.....	623,000	0.26	588,028
医薬品			
HLF Financing SARR LLC, 4.8750%, 期日 1/6/29.....	996,000	0.31	688,744

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
専門サービス			
AMN Healthcare, Inc., 4.0000%, 期日 15/4/29	810,000	0.30	685,928
KBR, Inc., 4.7500%, 期日 30/9/28.....	122,000	0.05	107,743
		0.35	793,671
陸運・鉄道			
PECF USS Intermediate Holding III Corp., 8.0000%, 期日 15/11/29.....	422,000	0.15	335,026
Watco Cos. LLC, 6.5000%, 期日 15/6/27	1,757,000	0.72	1,611,559
		0.87	1,946,585
専門小売り			
Carvana Co., 5.5000%, 期日 15/4/27.....	231,000	0.07	149,394
Carvana Co., 4.8750%, 期日 1/9/29	1,018,000	0.26	580,398
Lithia Motors, Inc., 4.3750%, 期日 15/1/31.....	562,000	0.21	480,060
LSF9 Atlantis Holdings LLC, 7.7500%, 期日 15/2/26	798,000	0.30	676,961
Rent-A-Center, Inc., 6.3750%, 期日 15/2/29.....	714,000	0.25	557,841
		1.09	2,444,654
貯蓄・抵当金融			
Rocket Mortgage LLC, 3.8750%, 期日 1/3/31	1,624,000	0.54	1,221,483
商社・代理店			
Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 6.5000%, 期日 1/10/25	295,000	0.12	278,884
Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 9.7500%, 期日 1/8/27.....	270,000	0.12	264,421
		0.24	543,305
ワイヤレス通信サービス			
T-Mobile USA, Inc., 3.3750%, 期日 15/4/29	1,444,000	0.56	1,267,695
T-Mobile USA, Inc., 3.3750%, 期日 15/4/29	567,000	0.22	497,772
		0.78	1,765,467
社債合計		48.01	108,114,291
政府発行証券 (2021年: 7.53% USD 21,200,021)			
米国財務省中期証券 / 長期証券			
0.0000%, 期日 5/7/22.....	14,300,000	6.35	14,298,627
政府発行証券合計		6.35	14,298,627
不動産担保証券 (2021年: 29.12% USD 82,012,732)			
Fannie Mae			
6.0000%, 期日 1/2/37.....	750	0.00	817
3.0000%, 期日 1/2/43.....	1,046,208	0.44	1,001,222
3.0000%, 期日 1/2/43.....	850	0.00	813
3.0000%, 期日 1/5/43.....	2,080	0.00	1,988
5.0000%, 期日 1/7/44.....	6,205	0.00	6,502
4.5000%, 期日 1/10/44	4,173	0.00	4,286
4.5000%, 期日 1/3/45.....	6,076	0.00	6,240
4.5000%, 期日 1/2/46.....	8,751	0.00	9,020
3.5000%, 期日 1/7/46.....	14,241	0.01	13,930
4.0000%, 期日 1/5/47.....	39,383	0.02	39,514
3.5000%, 期日 1/8/47.....	2,736	0.00	2,673
3.5000%, 期日 1/1/48.....	3,522	0.00	3,422
4.0000%, 期日 1/1/48.....	13,091	0.01	13,082
3.0000%, 期日 1/2/48.....	15,089	0.01	14,331
4.0000%, 期日 1/3/48.....	3,924	0.00	3,921
3.5000%, 期日 1/7/48.....	68,931	0.03	67,424
3.0000%, 期日 1/9/49.....	56,354	0.02	52,982
2.5000%, 期日 1/1/50.....	153,105	0.06	139,249
2.5000%, 期日 1/8/50.....	8,945	0.00	8,183
2.5000%, 期日 1/6/51.....	1,105,553	0.45	1,007,782
2.0000%, 期日 1/9/51.....	361,998	0.14	314,869
3.0000%, 期日 1/6/57.....	786	0.00	737
3.8236%, 期日 25/1/30	2,716,000	1.21	2,721,618
43.3212%, 期日 25/10/40	23,689	0.02	50,880
3.0000%, 期日 25/5/48	16,919	0.01	16,196
		2.43	5,501,681

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Freddie Mac			
3.5000%, 期日 1/1/47.....	2,040	0.00	2,008
5.3236%, 期日 25/12/30.....	496,000	0.22	485,669
3.9757%, 期日 25/1/34	526,000	0.20	454,856
6.7236%, 期日 25/6/50	545,518	0.25	559,129
6.8736%, 期日 25/9/50	669,000	0.31	690,306
7.1757%, 期日 25/10/33.....	664,000	0.24	543,315
4.9257%, 期日 25/11/50.....	558,570	0.24	531,874
6.9257%, 期日 25/8/33	992,000	0.35	792,656
3.2257%, 期日 25/8/33	579,000	0.24	547,752
		2.05	4,607,565
Freddie Mac Pool			
3.0000%, 期日 1/1/33.....	3,225	0.00	3,196
6.0000%, 期日 1/4/40.....	15,851	0.01	17,316
3.5000%, 期日 1/2/43.....	4,086	0.00	4,022
3.0000%, 期日 1/3/43.....	15,725	0.01	15,031
3.0000%, 期日 1/6/43.....	14,455	0.01	13,654
3.5000%, 期日 1/2/44.....	5,251	0.00	5,168
4.5000%, 期日 1/5/44.....	3,069	0.00	3,162
3.5000%, 期日 1/12/44	12,990	0.01	12,779
3.0000%, 期日 1/1/45.....	2,691	0.00	2,567
3.5000%, 期日 1/7/46.....	2,860	0.00	2,781
3.0000%, 期日 1/10/46	17,089	0.01	16,208
4.0000%, 期日 1/3/47.....	1,329	0.00	1,335
3.5000%, 期日 1/9/47.....	4,558	0.00	4,453
3.5000%, 期日 1/12/47	15,356	0.01	15,001
3.5000%, 期日 1/2/48.....	2,920	0.00	2,832
4.0000%, 期日 1/4/48.....	1,527	0.00	1,523
4.5000%, 期日 1/4/49.....	31,558	0.01	32,040
3.0000%, 期日 1/10/49	9,036	0.00	8,501
3.0000%, 期日 1/10/49	26,058	0.01	24,515
3.0000%, 期日 1/11/49	18,376	0.01	17,289
3.0000%, 期日 1/11/49	70,600	0.03	66,421
3.0000%, 期日 1/12/49	92,340	0.04	86,875
3.0000%, 期日 1/12/49	216,968	0.09	204,127
3.0000%, 期日 1/12/49	39,890	0.02	37,529
2.5000%, 期日 1/1/50.....	67,557	0.03	61,449
3.0000%, 期日 1/3/50.....	19,313	0.01	18,134
2.5000%, 期日 1/8/50.....	1,648	0.00	1,508
2.5000%, 期日 1/8/50.....	4,584	0.00	4,196
2.5000%, 期日 1/9/50.....	8,444	0.00	7,721
2.0000%, 期日 1/9/51.....	390,604	0.15	339,750
2.5000%, 期日 1/1/52.....	16,645	0.01	15,093
2.5000%, 期日 1/1/52.....	10,072	0.00	9,100
		0.47	1,055,276
Ginnie Mae			
4.5000%, 期日 15/8/46	11,705	0.01	12,083
4.0000%, 期日 15/7/47	3,558	0.00	3,593
4.0000%, 期日 15/8/47	353	0.00	356
4.0000%, 期日 15/11/47.....	780	0.00	788
4.0000%, 期日 15/12/47.....	2,067	0.00	2,088
4.5000%, 期日 20/2/48	26,382	0.01	27,142
4.5000%, 期日 20/5/48	956	0.00	977
4.5000%, 期日 20/5/48	2,750	0.00	2,809
3.0000%, 期日 15/7/52	8,368,772	3.50	7,886,892
3.5000%, 期日 15/7/52	9,437,700	4.07	9,170,819
4.0000%, 期日 15/7/52	1,592,197	0.70	1,585,425
		8.29	18,692,972
UMBS			
2.0000%, 期日 25/7/37	1,367,164	0.57	1,275,871
2.5000%, 期日 25/7/37	821,750	0.35	785,076
3.5000%, 期日 25/7/37	452,900	0.20	450,279

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.0000%, 期日 25/7/37	2,024,216	0.88	1,977,801
4.0000%, 期日 25/7/37	67,000	0.03	67,610
3.5000%, 期日 25/7/52	10,501,908	4.49	10,100,151
3.0000%, 期日 25/7/52	24,113,024	9.97	22,451,226
4.0000%, 期日 25/7/52	4,013,064	1.76	3,957,118
4.5000%, 期日 25/7/52	5,667,373	2.53	5,689,513
		20.78	46,754,645
不動産担保証券合計.....		34.02	76,612,139
優先株式 (2021年: 0.41% USD 1,145,893)			
米国			
ヘルスケア機器・用品			
Becton Dickinson and Co., 6.0000%, 期日 1/6/23.....	4,800	0.11	237,408
優先株式合計.....		0.11	237,408
トランシュ・ローン (2021年: 7.09% USD 20,058,550)			
ドイツ			
化学			
INEOS Styrolution Group Gmbh, 4.4200%, 期日 29/1/26	359,370	0.15	340,165
米国			
建設資材			
Cornerstone Building Brands, Inc., 4.5700%, 期日 12/4/28.....	508,618	0.19	424,378
資本市場			
Citadel Securities LP, 4.1400%, 期日 2/2/28	611,265	0.26	589,586
化学			
Aruba Investments Holdings LLC, 8.5000%, 期日 24/11/28.....	515,000	0.22	491,825
Geon Performance Solutions LLC, 6.1700%, 期日 18/8/28	419,260	0.18	398,297
Olympus Water US Holding Corp., 6.6500%, 期日 9/11/28	161,745	0.07	152,242
		0.47	1,042,364
各種電気通信サービス			
Acuris Finance US, Inc., 6.2000%, 期日 16/2/28.....	257,292	0.11	243,355
食品			
Sovos Brands Intermediate, Inc., 4.2500%, 期日 8/6/28	319,206	0.13	302,050
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス			
National Mentor Holdings, Inc., 9.5100%, 期日 2/3/29.....	57,753	0.02	51,978
Surgery Center Holdings, Inc., 4.9500%, 期日 31/8/26.....	767,213	0.32	717,106
		0.34	769,084
ホテル・レストラン・レジャー			
Enterprise Development Authority, 5.9200%, 期日 28/2/28	520,620	0.22	499,635
Golden Entertainment, Inc., 4.6300%, 期日 21/10/24.....	863,018	0.37	843,600
MIC Glen LLC, 7.2500%, 期日 20/7/29	707,594	0.30	677,521
		0.89	2,020,756
機械			
Fairbanks Morse Defense LLC, 9.0000%, 期日 25/6/29.....	1,052,990	0.44	995,076
複合小売り			
Driven Holdings LLC, 3.5200%, 期日 17/12/28	373,371	0.16	350,036
パーソナル用品			
Journey Personal Care Corp., 6.5000%, 期日 1/3/28	464,420	0.16	362,248
Olaplex, Inc., 4.8000%, 期日 23/2/29.....	700,000	0.29	663,250
		0.45	1,025,498
陸運・鉄道			
PECF USS Intermediate Holding III Corp., 5.9200%, 期日 15/12/28.....	913,239	0.37	827,431
ソフトウェア			
Cornerstone OnDemand, Inc., 5.4200%, 期日 16/10/28.....	426,930	0.17	383,170
Mitchell International, Inc., 5.3500%, 期日 15/10/28.....	676,305	0.27	617,974
		0.44	1,001,144
専門小売り			
Woof Holdings, Inc., 8.0000%, 期日 21/12/28	163,629	0.07	157,902
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Magenta Buyer LLC, 9.4800%, 期日 27/7/29.....	733,000	0.30	673,748

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
繊維・アパレル・贅沢品 Boardriders, Inc., 7.7400%, 期日 23/4/24.....	470,688	0.12	267,104
トランシュ・ローン合計.....		4.89	11,029,677
投資有価証券合計 (取得原価: USD 305,531,153).....		123.86	278,927,781

クレジット・デフォルト・スワップ[†] (2021年: 0.11% USD 303,486)

カウンターパーティ	参照資産	名目元本	終了日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	13,950,000	2027年 6 月20日	0.18	402,275
合計				0.18	402,275

先渡為替予約、2022年 6 月30日現在の建玉
(2021年: 0.03% USD 75,749)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
HSBC USD 6,660,359	EUR 6,307,696	6,623,623	2027年 8 月 4 日	0.02	36,736
J.P. Morgan EUR 133,000	USD 138,848	139,661	2027年 8 月 4 日	0.00	813
USD 2,468,926	GBP 2,000,000	2,435,914	2027年 8 月 4 日	0.01	33,012
合計				0.03	70,561

先物契約[°] (2021年: 0.09% USD 267,406)

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	(73) US 10 Year Ultra Bond	0.07	148,436
Goldman Sachs	(88) US 2 Year Note	0.05	104,421
Goldman Sachs	(64) US 5 Year Note	0.03	58,936
Goldman Sachs	(16) US Ultra Bond	0.02	57,481
合計		0.17	369,274
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計		124.24	279,769,891

ジャナス・ヘンダーソン・マルチセクター・インカム・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年：(0.01)% USD (45,083))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan EUR					
25 6A	2,926 USD	3,090	3,070	2022年7月29日	0.00 (20)
EUR	374,000 USD	395,643	392,732	2022年8月4日	0.00 (2,911)
SGD	7,696 USD	5,549	5,540		0.00 (9)
25 6A			2022年7月29日		
合計				0.00	(2,940)

先物契約[○] (2021年：(0.14)% USD (407,438))

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Goldman Sachs	175 US 10 Year Note	(0.12)	(255,857)
Goldman Sachs	12 US Long Bond	(0.01)	(27,951)
合計		(0.13)	(283,808)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計		(0.13)	(286,748)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	7.80
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	85.71
規制市場において取引されている金融デリバティブ商品	0.26
OTC金融デリバティブ商品	0.02
その他の資産	6.21
資産合計	100.00

[†] ICE(セントラル・カウンターパーティー(「CCP」))を通じて清算されます。[○] 保有担保の詳細については、注記5(訳者注：Appendixの注記5．Cash at Bank)を参照してください。25
6A 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。[前へ](#)[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式 (2021年: 2.22% USD 12,442,646)			
米国			
資本市場			
Intercontinental Exchange, Inc.	11,126	0.25	1,046,289
通信機器			
Ciena Corp.	12,767	0.14	583,452
電子装置・機器・部品			
II-VI, Inc.	28,575	0.34	1,455,896
ホテル・レストラン・レジャー			
Bally's Corp.	56,646	0.26	1,120,458
Caesars Entertainment, Inc.	36,678	0.33	1,404,767
Six Flags Entertainment Corp.	76,297	0.39	1,655,645
		0.98	4,180,870
メディア			
Nexstar Media Group, Inc., A.....	8,014	0.31	1,305,320
金属・鉱業			
Freeport-McMoRan, Inc.....	28,247	0.19	826,507
半導体・半導体装置			
Advanced Micro Devices, Inc.....	23,225	0.42	1,776,017
NVIDIA Corp.....	7,387	0.26	1,119,795
		0.68	2,895,812
繊維・アパレル・贅沢品			
Quiksilver Americas, Inc.*.....	1,105,543	0.22	939,712
普通株式合計.....		3.11	13,233,858
社債 (2021年: 87.79% USD 495,860,338)			
オーストラリア			
金属・鉱業			
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 4.3750%, 期日 1/4/31 ...	1,892,000	0.36	1,547,788
FMG Resources August 2006 Pty. Ltd., 6.1250%, 期日 15/4/32...	2,504,000	0.53	2,258,570
		0.89	3,806,358
カナダ			
金属・鉱業			
First Quantum Minerals Ltd., 7.5000%, 期日 1/4/25	3,699,000	0.82	3,504,606
Hudbay Minerals, Inc., 4.5000%, 期日 1/4/26	3,700,000	0.73	3,101,599
Hudbay Minerals, Inc., 6.1250%, 期日 1/4/29	2,479,000	0.47	2,013,915
		2.02	8,620,120
ケイマン諸島			
ホテル・レストラン・レジャー			
Wynn Macau Ltd., 5.6250%, 期日 26/8/28.....	994,000	0.14	615,072
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Seagate HDD Cayman, 4.1250%, 期日 15/1/31	3,366,000	0.65	2,757,596
Seagate HDD Cayman, 3.3750%, 期日15/7/31.....	2,793,000	0.51	2,175,956
		1.16	4,933,552
フランス			
各種電気通信サービス			
Altice France SA, 5.1250%, 期日 15/7/29	2,808,000	0.50	2,128,871
Altice France SA, 5.5000%, 期日 15/10/29.....	832,000	0.15	638,132
		0.65	2,767,003

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
アイルランド メディア			
LCPR Senior Secured Financing DAC, 5.1250%, 期日 15/7/29.....	965,000	0.19	807,613
ルクセンブルク 化学			
Herens Holdco SARL, 4.7500%, 期日 15/5/28	490,000	0.10	407,829
容器・包装			
ARD Finance SA, 6.5000%, 期日 30/6/27	6,021,684	1.05	4,476,399
各種電気通信サービス			
Altice France Holding SA, 10.5000%, 期日 15/5/27.....	1,129,000	0.22	949,557
ITサービス			
ION Trading Technologies SARL, 5.7500%, 期日 15/5/28.....	3,715,000	0.70	2,975,882
メディア			
Altice Financing SA, 5.0000%, 期日 15/1/28.....	2,790,000	0.53	2,256,036
モーリシャス ITサービス			
CA Magnum Holdings, 5.3750%, 期日 31/10/26.....	3,236,000	0.66	2,812,344
オランダ 化学			
Diamond BC BV, 4.6250%, 期日 1/10/29.....	4,609,000	0.87	3,692,201
メディア			
Ziggo Bond Co. BV, 5.1250%, 期日 28/2/30.....	2,768,000	0.51	2,174,765
医薬品			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3.1500%, 期日 1/10/26.....	4,169,000	0.81	3,432,150
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4.7500%, 期日 9/5/27	1,453,000	0.29	1,242,850
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5.1250%, 期日 9/5/29	773,000	0.15 1.25	638,753 5,313,753
パナマ ホテル・レストラン・レジャー			
Carnival Corp., 7.6250%, 期日 1/3/26.....	2,624,000	0.48	2,038,520
国際 容器・包装			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC, 6.0000%, 期日 15/6/27	854,000	0.20	846,745
Ardagh Packaging Finance plc, 5.2500%, 期日 15/8/27	3,607,000	0.61 0.81	2,581,764 3,428,509
食品			
JBS USA LUX SA, 5.5000%, 期日 15/1/30	2,291,000	0.51	2,171,706
ワイヤレス通信サービス			
Connect Finco SARL, 6.7500%, 期日 1/10/26	3,274,000	0.69	2,953,164
スイス 資本市場			
Credit Suisse Group AG, 4.5000%, 期日 3/9/30.....	1,991,000	0.31	1,340,561
英国 自動車			
Jaguar Land Rover Automotive plc, 7.7500%, 期日 15/10/25.....	989,000	0.22	917,298
Jaguar Land Rover Automotive plc, 5.8750%, 期日 15/1/28	1,573,000	0.28 0.50	1,203,581 2,120,879
各種電気通信サービス			
Virgin Media Finance plc, 5.0000%, 期日 15/7/30	1,218,000	0.23	968,541
米国 航空宇宙産業及び防衛			
TransDigm, Inc., 4.8750%, 期日 1/5/29	2,671,000	0.51	2,178,922
航空貨物・物流			
Cargo Aircraft Management, Inc., 4.7500%, 期日 1/2/28	4,301,000	0.92	3,928,834
航空会社			
Delta Air Lines, Inc., 7.3750%, 期日 15/1/26.....	1,141,000	0.27	1,142,249
United Airlines Holdings, Inc., 4.8750%, 期日 15/1/25	1,798,000	0.39 0.66	1,673,417 2,815,666

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
自動車部品			
American Axle & Manufacturing, Inc., 6.2500%, 期日 15/3/26...	458,000	0.10	420,848
American Axle & Manufacturing, Inc., 6.8750%, 期日 1/7/28 ...	493,000	0.10	443,330
Dornoch Debt Merger Sub, Inc., 6.6250%, 期日 15/10/29	1,464,000	0.25	1,082,994
Goodyear Tire & Rubber Co. (The), 5.2500%, 期日 30/4/31	2,299,000	0.44	1,869,570
Goodyear Tire & Rubber Co. (The), 5.2500%, 期日 15/7/31	72,000	0.01	57,984
		0.90	3,874,726
自動車			
Ford Motor Co., 4.7500%, 期日 15/1/43	1,703,000	0.29	1,218,564
銀行			
Citigroup, Inc., 4.0000%, 期日 10/12/25	3,026,000	0.62	2,625,055
Citigroup, Inc., 3.8750%, 期日 18/2/26.....	1,415,000	0.28	1,177,988
SVB Financial Group, 4.2500%, 期日 15/11/26	3,286,000	0.58	2,485,549
		1.48	6,288,592
建設資材			
Builders FirstSource, Inc., 4.2500%, 期日 1/2/32.....	2,190,000	0.39	1,671,156
Builders FirstSource, Inc., 6.3750%, 期日 15/6/32	2,179,000	0.46	1,949,497
CP Atlas Buyer, Inc., 7.0000%, 期日 1/12/28	1,321,000	0.22	955,862
New Enterprise Stone & Lime Co., Inc., 5.2500%, 期日 15/7/28	2,928,000	0.57	2,411,164
Standard Industries, Inc., 3.3750%, 期日 15/1/31.....	5,989,000	1.04	4,429,183
Summit Materials LLC, 5.2500%, 期日 15/1/29	676,000	0.14	591,007
		2.82	12,007,869
資本市場			
Charles Schwab Corp. (The), 4.0000%, 期日 1/6/26.....	2,097,000	0.42	1,780,164
Coinbase Global, Inc., 3.3750%, 期日 1/10/28.....	2,529,000	0.38	1,599,087
Coinbase Global, Inc., 3.6250%, 期日 1/10/31.....	2,041,000	0.27	1,152,166
Jane Street Group, 4.5000%, 期日 15/11/29	3,103,000	0.65	2,767,271
LPL Holdings, Inc., 4.3750%, 期日 15/5/31	2,000,000	0.40	1,712,400
MSCI, Inc., 3.6250%, 期日 1/11/31	2,836,000	0.55	2,339,992
		2.67	11,351,080
化学			
Axalta Coating Systems LLC, 3.3750%, 期日 15/2/29	2,176,000	0.42	1,779,141
Element Solutions, Inc., 3.8750%, 期日 1/9/28	1,351,000	0.26	1,116,824
Kobe US Midco 2, Inc., 9.2500%, 期日 1/11/26.....	1,117,000	0.24	1,031,466
Olympus Water US Holding Corp., 6.2500%, 期日 1/10/29	1,852,000	0.30	1,289,455
Polar US Borrower LLC, 6.7500%, 期日 15/5/26.....	2,891,000	0.48	2,023,137
Vibrantz Technologies, Inc., 9.0000%, 期日 15/2/30.....	1,661,000	0.28	1,173,238
		1.98	8,413,261
商業サービス・用品			
Allied Universal Holdco LLC, 6.0000%, 期日 1/6/29	1,315,000	0.23	958,808
APX Group, Inc., 5.7500%, 期日 15/7/29.....	2,086,000	0.38	1,618,519
Covanta Holding Corp., 4.8750%, 期日 1/12/29.....	2,016,000	0.39	1,643,262
Madison IAQ LLC, 5.8750%, 期日 30/6/29.....	1,142,000	0.21	878,055
		1.21	5,098,644
通信機器			
Ciena Corp., 4.0000%, 期日 31/1/30.....	4,482,000	0.91	3,873,860
建設・土木			
Arcosa, Inc., 4.3750%, 期日 15/4/29	859,000	0.17	730,201
Tutor Perini Corp., 6.8750%, 期日 1/5/25.....	2,231,000	0.43	1,826,364
Weekley Homes LLC, 4.8750%, 期日 15/9/28.....	1,584,000	0.29	1,253,252
		0.89	3,809,817
消費者金融			
Ford Motor Credit Co. LLC, 4.1340%, 期日 4/8/25	1,360,000	0.30	1,291,986
Ford Motor Credit Co. LLC, 3.6250%, 期日 17/6/31.....	3,285,000	0.60	2,556,518
General Motors Financial Co., Inc., 5.7500%, 期日 30/9/27 ...	1,265,000		
		0.25	1,062,600
Navient Corp., 5.5000%, 期日 15/3/29.....	1,341,000	0.24	1,035,984
OneMain Finance Corp., 6.6250%, 期日 15/1/28.....	446,000	0.09	399,413
OneMain Finance Corp., 5.3750%, 期日 15/11/29	2,565,000	0.49	2,083,383
OneMain Finance Corp., 4.0000%, 期日 15/9/30.....	1,378,000	0.24	1,023,317
		2.21	9,453,201

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
容器・包装			
Ball Corp., 2.8750%, 期日 15/8/30	1,125,000	0.21	908,006
Ball Corp., 3.1250%, 期日 15/9/31	1,775,000	0.34	1,434,768
Graphic Packaging International LLC, 3.7500%, 期日 1/2/30 ...	1,368,000	0.27	1,161,100
LABL, Inc., 10.5000%, 期日 15/7/27.....	1,251,000	0.26	1,090,028
LABL, Inc., 8.2500%, 期日 1/11/29	3,298,000	0.59	2,496,174
		1.67	7,090,076
販売			
American Builders & Contractors Supply Co., Inc., 4.0000%, 期日 15/1/28.....	1,164,000	0.23	999,183
各種消費者サービス			
Service Corp. International, 3.3750%, 期日 15/8/30.....	3,287,000	0.63	2,696,178
Service Corp. International, 4.0000%, 期日 15/5/31.....	816,000	0.16	698,365
		0.79	3,394,543
各種金融サービス			
Burford Capital Global Finance LLC, 6.2500%, 期日 15/4/28 ...	317,000	0.07	277,762
Burford Capital Global Finance LLC, 6.8750%, 期日 15/4/30 ...	250,000	0.05	220,103
		0.12	497,865
各種電気通信サービス			
CCO Holdings LLC, 5.1250%, 期日 1/5/27.....	2,257,000	0.50	2,137,356
CCO Holdings LLC, 5.0000%, 期日 1/2/28.....	1,645,000	0.36	1,523,525
CCO Holdings LLC, 4.5000%, 期日 15/8/30	1,917,000	0.38	1,597,787
CCO Holdings LLC, 4.5000%, 期日 1/5/32.....	1,353,000	0.26	1,100,104
CCO Holdings LLC, 4.5000%, 期日 1/6/33.....	2,713,000	0.50	2,143,731
Consolidated Communications, Inc., 5.0000%, 期日 1/10/28.....	2,129,000	0.40	1,705,052
Level 3 Financing, Inc., 3.6250%, 期日 15/1/29.....	2,010,000	0.36	1,553,604
Windstream Escrow LLC, 7.7500%, 期日 15/8/28.....	1,702,000	0.32	1,374,825
Zayo Group Holdings, Inc., 4.0000%, 期日 1/3/27	2,232,000	0.44	1,855,796
Zayo Group Holdings, Inc., 6.1250%, 期日 1/3/28	1,427,000	0.24	1,034,297
		3.76	16,026,077
電気設備			
Atkore, Inc., 4.2500%, 期日 1/6/31.....	531,000	0.10	441,792
電子装置・機器・部品			
II-VI, Inc., 5.0000%, 期日 15/12/29	4,038,000	0.83	3,532,786
エネルギー設備・サービス			
Archrock Partners LP, 6.8750%, 期日 1/4/27.....	1,074,000	0.23	980,702
不動産投資信託 (REITs)			
Global Net Lease, Inc., 3.7500%, 期日 15/12/27.....	1,740,000	0.34	1,455,606
Iron Mountain, Inc., 4.8750%, 期日 15/9/27.....	1,297,000	0.28	1,175,562
Iron Mountain, Inc., 5.2500%, 期日 15/7/30.....	2,163,000	0.44	1,884,622
		1.06	4,515,790
食品・生活必需品小売り			
Albertsons Cos., Inc., 4.6250%, 期日 15/1/27.....	1,997,000	0.42	1,787,914
Albertsons Cos., Inc., 4.8750%, 期日 15/2/30.....	3,054,000	0.62	2,628,257
		1.04	4,416,171
食品			
Chobani LLC, 7.5000%, 期日 15/4/25.....	2,036,000	0.44	1,873,301
Chobani LLC, 4.6250%, 期日 15/11/28	801,000	0.16	677,946
		0.60	2,551,247
ヘルスケア機器・用品			
Medline Borrower LP, 5.2500%, 期日 1/10/29.....	7,372,000	1.43	6,077,624
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス			
Community Health Systems, Inc., 6.8750%, 期日 15/4/29	5,886,000	0.90	3,813,598
Community Health Systems, Inc., 5.2500%, 期日 15/5/30	1,605,000	0.29	1,222,561
Hadrian Merger Sub, Inc., 8.5000%, 期日 1/5/26.....	2,435,000	0.54	2,318,437
ModivCare Escrow Issuer, Inc., 5.0000%, 期日 1/10/29.....	2,845,000	0.54	2,301,992
ModivCare, Inc., 5.8750%, 期日 15/11/25	1,487,000	0.32	1,370,092
Surgery Center Holdings, Inc., 10.0000%, 期日 15/4/27	772,000	0.18	748,801
Tenet Healthcare Corp., 4.8750%, 期日 1/1/26.....	2,177,000	0.47	2,010,383
Tenet Healthcare Corp., 4.2500%, 期日 1/6/29.....	2,239,000	0.44	1,892,358
Tenet Healthcare Corp., 6.1250%, 期日 15/6/30	3,360,000	0.73	3,109,882
		4.41	18,788,104

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
ホテル・レストラン・レジャー			
Caesars Entertainment, Inc., 8.1250%, 期日 1/7/27	1,578,000	0.36	1,528,017
CDI Escrow Issuer, Inc., 5.7500%, 期日 1/4/30	1,142,000	0.24	1,041,630
Full House Resorts, Inc., 8.2500%, 期日 15/2/28	3,694,000	0.69	2,957,681
Life Time, Inc., 5.7500%, 期日 15/1/26.....	2,113,000	0.45	1,900,644
Life Time, Inc., 8.0000%, 期日 15/4/26.....	1,301,000	0.27	1,161,195
Premier Entertainment Sub LLC, 5.6250%, 期日 1/9/29	3,353,000	0.56	2,392,298
Premier Entertainment Sub LLC, 5.8750%, 期日 1/9/31	3,351,000	0.55	2,330,279
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP, 5.8750%, 期日 15/5/25 ...	1,297,000	0.28	1,194,675
Travel + Leisure Co., 6.6000%, 期日 1/10/25	1,973,000	0.45	1,918,510
Travel + Leisure Co., 6.6250%, 期日 31/7/26	1,693,000	0.38	1,608,206
Wendy's International LLC, 7.0000%, 期日 15/12/25	941,000	0.23	963,245
Yum! Brands, Inc., 3.6250%, 期日 15/3/31.....	1,351,000	0.27	1,137,988
Yum! Brands, Inc., 5.3750%, 期日 1/4/32	1,235,000	0.27	1,142,103
		5.00	21,276,471
家庭用耐久財			
Century Communities, Inc., 3.8750%, 期日 15/8/29.....	1,734,000	0.32	1,359,300
LGI Homes, Inc., 4.0000%, 期日 15/7/29.....	1,640,000	0.29	1,226,605
Shea Homes LP, 4.7500%, 期日 1/4/29	2,875,000	0.53	2,257,651
TopBuild Corp., 4.1250%, 期日 15/2/32	3,499,000	0.63	2,700,339
		1.77	7,543,895
保険			
Ryan Specialty Group LLC, 4.3750%, 期日 1/2/30.....	2,587,000	0.53	2,253,924
インタラクティブ・メディア/サービス			
Twitter, Inc., 5.0000%, 期日 1/3/30	3,846,000	0.86	3,655,123
インターネット販売・カタログ販売			
Match Group Holdings II LLC, 5.6250%, 期日 15/2/29.....	2,581,000	0.57	2,418,165
ITサービス			
Virtusa Corp., 7.1250%, 期日 15/12/28	2,620,000	0.50	2,109,952
ライフサイエンス・ツール/サービス			
Syneos Health, Inc., 3.6250%, 期日 15/1/29.....	2,252,000	0.45	1,909,873
機械			
TK Elevator US Newco, Inc., 5.2500%, 期日 15/7/27	1,625,000	0.34	1,451,613
メディア			
Block Communications, Inc., 4.8750%, 期日 1/3/28.....	3,154,000	0.63	2,683,534
CSC Holdings LLC, 5.3750%, 期日 1/2/28.....	2,141,000	0.44	1,857,403
CSC Holdings LLC, 7.5000%, 期日 1/4/28.....	1,772,000	0.35	1,484,298
Directv Financing LLC, 5.8750%, 期日 15/8/27.....	1,604,000	0.32	1,373,513
DISH DBS Corp., 5.1250%, 期日 1/6/29.....	1,498,000	0.21	914,978
DISH Network Corp., 2.3750%, 期日 15/3/24	814,000	0.17	719,373
GCI LLC, 4.7500%, 期日 15/10/28	2,929,000	0.60	2,542,031
Gray Escrow II, Inc., 5.3750%, 期日 15/11/31.....	1,136,000	0.21	912,668
Gray Television, Inc., 4.7500%, 期日 15/10/30	4,771,000	0.88	3,739,772
Lamar Media Corp., 3.6250%, 期日 15/1/31.....	2,128,000	0.41	1,745,056
Liberty Interactive LLC, 8.2500%, 期日 1/2/30	2,940,000	0.46	1,956,438
News Corp., 3.8750%, 期日 15/5/29	2,581,000	0.52	2,235,729
News Corp., 5.1250%, 期日 15/2/32	647,000	0.13	574,148
Nexstar Media, Inc., 4.7500%, 期日 1/11/28.....	1,734,000	0.35	1,490,434
Scripps Escrow II, Inc., 3.8750%, 期日 15/1/29.....	827,000	0.16	694,560
Scripps Escrow II, Inc., 5.3750%, 期日 15/1/31.....	3,027,000	0.57	2,417,892
Scripps Escrow, Inc., 5.8750%, 期日 15/7/27	1,186,000	0.24	1,039,808
Sirius XM Radio, Inc., 4.0000%, 期日 15/7/28.....	2,447,000	0.50	2,125,330
		7.15	30,506,965
金属・鉱業			
Allegheny Technologies, Inc., 5.1250%, 期日 1/10/31	3,102,000	0.56	2,381,008
Arconic Corp., 6.1250%, 期日 15/2/28.....	2,335,000	0.51	2,185,221
Carpenter Technology Corp., 7.6250%, 期日 15/3/30	969,000	0.21	891,379
Compass Minerals International, Inc., 4.8750%, 期日 15/7/24	1,099,000	0.24	1,021,182
Compass Minerals International, Inc., 6.7500%, 期日 1/12/27	1,514,000	0.32	1,371,737
Kaiser Aluminum Corp., 4.5000%, 期日 1/6/31	1,610,000	0.29	1,221,410
		2.13	9,071,937

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
複合小売り			
Nordstrom, Inc., 5.0000%, 期日 15/1/44.....	1,805,000	0.30	1,291,550
石油・ガス・消耗燃料			
Antero Resources Corp., 5.3750%, 期日 1/3/30.....	1,290,000	0.28	1,178,286
Apache Corp., 4.2500%, 期日 15/1/30	2,634,000	0.55	2,338,702
DT Midstream, Inc., 4.1250%, 期日 15/6/29	2,689,000	0.54	2,286,712
DT Midstream, Inc., 4.3750%, 期日 15/6/31	1,900,000	0.37	1,596,988
Endeavor Energy Resources LP, 6.6250%, 期日 15/7/25	1,509,000	0.36	1,518,575
EnLink Midstream LLC, 5.6250%, 期日 15/1/28	1,383,000	0.30	1,271,001
EnLink Midstream Partners LP, 4.1500%, 期日 1/6/25.....	1,174,000	0.26	1,095,107
EQM Midstream Partners LP, 4.7500%, 期日 15/1/31.....	1,364,000	0.26	1,091,698
FTAI Infra Escrow Holdings LLC, 10.5000%, 期日 1/6/27	2,469,000	0.55	2,335,304
Hess Midstream Operations LP, 5.1250%, 期日 15/6/28	1,807,000	0.38	1,625,216
Hess Midstream Operations LP, 4.2500%, 期日 15/2/30	963,000	0.19	808,294
Howard Midstream Energy Partners LLC, 6.7500%, 期日 15/1/27	1,678,000	0.34	1,448,221
Magnolia Oil & Gas Operating LLC, 6.0000%, 期日 1/8/26.....	2,551,000	0.57	2,407,366
NGL Energy Operating LLC, 7.5000%, 期日 1/2/26.....	3,548,000	0.75	3,205,707
Occidental Petroleum Corp., 6.3750%, 期日 1/9/28.....	958,000	0.23	971,537
Occidental Petroleum Corp., 6.6250%, 期日 1/9/30.....	2,559,000	0.62	2,640,427
Southwestern Energy Co., 5.3750%, 期日 15/3/30.....	1,374,000	0.30	1,266,869
Southwestern Energy Co., 4.7500%, 期日 1/2/32	1,394,000	0.28	1,194,574
Sunoco LP, 4.5000%, 期日 15/5/29.....	1,216,000	0.24	1,004,682
Sunoco LP, 4.5000%, 期日 30/4/30.....	4,342,000	0.83	3,513,475
Tallgrass Energy Partners LP, 5.5000%, 期日 15/1/28	3,086,000	0.62	2,627,976
Tallgrass Energy Partners LP, 6.0000%, 期日 1/9/31.....	2,988,000	0.58	2,469,612
TerraForm Power Operating LLC, 4.7500%, 期日 15/1/30.....	3,356,000	0.68	2,880,270
Viper Energy Partners LP, 5.3750%, 期日 1/11/27	2,321,000	0.52	2,222,304
Western Midstream Operating LP, 4.5500%, 期日 1/2/30.....	4,341,000	0.88	3,767,098
		11.48	48,766,001
パーソナル用品			
BellRing Brands, Inc., 7.0000%, 期日 15/3/30.....	1,458,000	0.32	1,376,155
医薬品			
HLF Financing SARL LLC, 4.8750%, 期日 1/6/29.....	1,916,000	0.31	1,324,933
Organon & Co., 4.1250%, 期日 30/4/28.....	3,231,000	0.67	2,871,470
Organon & Co., 5.1250%, 期日 30/4/31.....	4,159,000	0.85	3,603,649
Teva Pharmaceutical Finance Co. LLC, 6.1500%, 期日 1/2/36 ...	887,000	0.17	743,310
		2.00	8,543,362
専門サービス			
KBR, Inc., 4.7500%, 期日 30/9/28.....	1,598,000	0.33	1,411,262
陸運・鉄道			
PECF USS Intermediate Holding III Corp., 8.0000%, 期日 15/11/29.....	3,852,000	0.72	3,058,103
Watco Cos. LLC, 6.5000%, 期日 15/6/27	3,661,000	0.79	3,357,949
		1.51	6,416,052
半導体・半導体装置			
Entegris Escrow Corp., 5.9500%, 期日 15/6/30.....	1,125,000	0.25	1,072,733
Entegris, Inc., 3.6250%, 期日 1/5/29.....	2,706,000	0.53	2,267,019
		0.78	3,339,752
ソフトウェア			
NCR Corp., 5.1250%, 期日 15/4/29.....	1,462,000	0.29	1,239,586
専門小売り			
Carvana Co., 5.5000%, 期日 15/4/27.....	1,465,000	0.22	947,455
Carvana Co., 4.8750%, 期日 1/9/29	1,045,000	0.14	595,791
Carvana Co., 10.2500%, 期日 1/5/30.....	1,331,000	0.26	1,095,826
Lithia Motors, Inc., 4.3750%, 期日 15/1/31.....	3,287,000	0.66	2,807,755
LSF9 Atlantis Holdings LLC, 7.7500%, 期日 15/2/26	3,904,000	0.78	3,311,847
Michaels Cos., Inc. (The), 7.8750%, 期日 1/5/29	1,301,000	0.20	861,275
Rent-A-Center, Inc., 6.3750%, 期日 15/2/29.....	2,513,000	0.46	1,963,382
Victoria's Secret & Co., 4.6250%, 期日 15/7/29.....	3,357,000	0.60	2,534,132
		3.32	14,117,463

ジャナス・ヘンダーソン・ハイイールド・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
貯蓄・抵当金融			
Rocket Mortgage LLC, 3.8750%, 期日 1/3/31	3,225,000	0.57	2,425,668
商社・代理店			
Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 6.5000%, 期日 1/10/25	597,000	0.13	564,386
Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 9.7500%, 期日 1/8/27.....	1,760,000	0.40	1,723,636
		0.53	2,288,022
ワイヤレス通信サービス			
T-Mobile USA, Inc., 2.6250%, 期日 15/4/26	489,000	0.10	444,682
T-Mobile USA, Inc., 3.3750%, 期日 15/4/29	497,000	0.10	436,319
T-Mobile USA, Inc., 3.5000%, 期日 15/4/31	1,403,000	0.30	1,214,247
		0.50	2,095,248
社債合計.....		89.42	380,763,399
政府発行証券 (2021年: 0.66% USD 3,700,004)			
米国財務省中期証券 / 長期証券 0.0000%, 期日 5/7/22.....	9,500,000	2.23	9,499,088
政府発行証券合計.....		2.23	9,499,088
優先株式 (2021年: 1.86% USD 10,481,171)			
トランシュ・ローン (2021年: 4.29% USD 24,208,214)			
ケイマン諸島			
航空会社			
AAdvantage Loyalty IP Ltd., 5.8100%, 期日 20/4/28	892,000	0.20	853,292
米国			
化学			
Aruba Investments Holdings LLC, 8.5000%, 期日 24/11/28.....	1,048,000	0.23	1,000,840
Olympus Water US Holding Corp., 6.6500%, 期日 9/11/28	304,601	0.07	286,705
		0.30	1,287,545
各種金融サービス			
Tacala Investment Corp., 8.2500%, 期日 4/2/28	2,215,158	0.49	2,078,561
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス			
National Mentor Holdings, Inc., 9.5100%, 期日 2/3/29.....	108,384	0.02	97,546
ホテル・レストラン・レジャー			
MIC Glen LLC, 7.2500%, 期日 20/7/29	1,363,266	0.31	1,305,327
機械			
Fairbanks Morse Defense LLC, 9.0000%, 期日 25/6/29.....	993,000	0.22	938,385
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Magenta Buyer LLC, 9.4800%, 期日 27/7/29.....	1,215,000	0.26	1,116,785
繊維・アパレル・贅沢品			
Boardriders, Inc., 1.0000%, 期日 23/4/24*	126,436	0.03	126,435
トランシュ・ローン合計.....		1.83	7,803,876
投資有価証券合計 (取得原価: USD 485,823,675).....		96.59	411,300,221

クレジット・デフォルト・スワップ[†] (2021年: 0.13% USD 735,723)

カウンターパーティ	参照資産	名目元本	終了日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	4,800,000	2027年 6 月20日	0.03	138,417
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	4,700,000	2027年 6 月20日	0.03	135,534
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	4,700,000	2027年 6 月20日	0.03	135,533
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	4,650,000	2027年 6 月20日	0.03	134,092
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	4,450,000	2027年 6 月20日	0.03	128,324
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	2,250,000	2027年 6 月20日	0.02	64,883
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	2,250,000	2027年 6 月20日	0.02	64,883
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	2,250,000	2027年 6 月20日	0.02	64,883
Citigroup	Buy protection on CDX.NA.HY.38-V2 Pay USD fixed 5.00%	2,200,000	2027年 6 月20日	0.01	63,441
合計				0.22	929,990

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年 6 月30日現在の建玉

(2021年: 0.00% USD (7,902))

購入通貨		売却通貨		時価(米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan							
AUD ^(Z) _(CA)	6,318,629	USD	4,387,670	4,362,195	2022年 7 月29日	(0.01)	(25,475)
CNH ^(Z) _(CA)	258,321	USD	38,632	38,586	2022年 7 月29日	0.00	(46)
EUR ^(Z) _(CA)	20,615,915	USD	21,779,256	21,639,458	2022年 7 月29日	(0.03)	(139,798)
GBP ^(Z) _(CA)	12,496	USD	15,365	15,218	2022年 7 月29日	0.00	(147)
USD ^(Z) _(CA)	370,749	EUR	354,588	372,192	2022年 7 月29日	0.00	(1,443)
USD ^(Z) _(CA)	203	GBP	168	204	2022年 7 月29日	0.00	(1)
合計						(0.04)	(166,910)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(0.04)	(166,910)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	17.13
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	77.96
規制市場において取引されている金融デリバティブ商品	0.22
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	4.69
資産合計	100.00

* ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・プライシング・コミッティーにより2022年6月30日に公正価値評価されました。

† ICE(セントラル・カウンターパーティー(「CCP」))を通じて清算されます。

 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
資産担保 / 商業不動産担保証券 (2021年: 2.57% USD 215,977,613)			
280 Park Avenue Mortgage Trust, 2.0710%, 期日 15/9/34	5,141,778	0.07	5,034,688
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust, 2.1740%, 期日 15/9/34	850,000	0.01	829,432
BANK, 4.2550%, 期日 15/5/61	9,617,003	0.14	9,624,042
BANK, 4.2170%, 期日 15/8/61	3,315,000	0.05	3,310,685
BBCMS Mortgage Trust, 2.1740%, 期日 15/8/36	1,680,000	0.02	1,646,991
BBCMS Mortgage Trust, 4.3140%, 期日 15/12/51.....	6,197,000	0.09	6,185,967
BBCMS Trust, 4.1970%, 期日 10/8/35.....	1,966,000	0.03	1,940,668
BXP Trust, 3.3790%, 期日 13/6/39.....	3,902,000	0.05	3,651,059
COMM Mortgage Trust, 4.2280%, 期日 10/5/51.....	5,435,000	0.08	5,388,976
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.9257%, 期日 25/3/42...	3,293,234	0.05	3,229,717
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.0257%, 期日 25/3/42...	7,645,328	0.11	7,507,325
Connecticut Avenue Securities Trust, 4.0236%, 期日 25/4/31...	551,543	0.01	549,901
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9236%, 期日 25/8/31...	248,867	0.00	248,000
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.7736%, 期日 25/9/31...	334,304	0.00	332,786
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.7236%, 期日 25/10/39.....	429,050	0.01	427,538
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.4757%, 期日 25/10/41.....	4,104,000	0.05	3,820,360
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.5757%, 期日 25/12/41.....	2,956,000	0.04	2,629,311
Connecticut Avenue Securities Trust, 2.8257%, 期日 25/4/42	3,731,465	0.05	3,669,633
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9257%, 期日 25/1/42	3,544,000	0.05	3,263,959
Connecticut Avenue Securities Trust, 3.9257%, 期日 25/4/42...	2,661,000	0.04	2,522,869
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, 5.5400%, 期日 15/1/26	586,647	0.01	586,860
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 3.6680%, 期日 25/10/49.....	4,872,838	0.06	4,426,481
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4.1160%, 期日 25/7/48	2,594,885	0.04	2,527,052
DT Auto Owner Trust, 5.5400%, 期日 16/6/25.....	4,340,000	0.06	4,350,501
GS Mortgage Securities Corp. II, 4.1550%, 期日 10/7/51.....	9,881,526	0.14	9,797,315
GS Mortgage Securities Trust, 3.9920%, 期日 10/3/51	9,952,000	0.14	9,797,991
Jack in the Box Funding LLC, 4.9700%, 期日 25/8/49.....	1,387,438	0.02	1,285,591
Jack in the Box Funding LLC, 4.4760%, 期日 25/8/49.....	5,450,013	0.06	5,220,638
Morgan Stanley Capital I Trust, 3.8090%, 期日 15/12/48.....	10,657,000	0.15	10,478,495
Morgan Stanley Capital I Trust, 2.7820%, 期日 15/8/49	10,687,000	0.14	10,078,827
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.4070%, 期日 15/10/51.....	1,998,000	0.03	2,005,302
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.3100%, 期日 15/12/51.....	9,719,927	0.14	9,648,061
Morgan Stanley Capital I Trust, 4.1770%, 期日 15/7/51	9,855,147	0.14	9,778,701
New Residential Mortgage Loan Trust, 4.5000%, 期日 25/2/58...	356,270	0.01	356,797
NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, 3.1040%, 期日 25/7/26	2,871,467	0.04	2,614,586
Oak Street Investment Grade Net Lease Fund, 1.8500%, 期日 20/11/50.....	2,937,585	0.04	2,694,039
Sequoia Mortgage Trust, 2.5000%, 期日 25/5/43	556,996	0.01	507,522
WFRBS Commercial Mortgage Trust, 3.6310%, 期日 15/11/47	3,444,000	0.05	3,394,499
資産担保 / 商業不動産担保証券合計.....		2.23	155,363,165
普通株式 (2021年: 64.50% USD 5,398,139,549)			
アイルランド			
建設資材			
Trane Technologies plc.....	176,757	0.33	22,955,432
ヘルスケア機器・用品			
Medtronic plc	219,827	0.28	19,729,473
ITサービス			
Accenture plc, A.....	140,737	0.56	39,075,628

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
米国			
航空宇宙産業及び防衛			
General Dynamics Corp.....	236,697	0.75	52,369,211
L3Harris Technologies, Inc.	138,144	0.48	33,389,405
		1.23	85,758,616
航空貨物・物流			
United Parcel Service, Inc., B.....	429,449	1.12	78,391,620
銀行			
Bank of America Corp.	2,485,472	1.11	77,372,743
JPMorgan Chase & Co.....	388,248	0.63	43,720,607
		1.74	121,093,350
飲料			
Constellation Brands, Inc., A	87,383	0.29	20,365,482
Monster Beverage Corp.....	649,615	0.86	60,219,311
		1.15	80,584,793
バイオテクノロジー			
AbbVie, Inc.....	552,040	1.21	84,550,446
資本市場			
Charles Schwab Corp. (The).....	402,225	0.36	25,412,576
CME Group, Inc.	228,857	0.67	46,847,028
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	110,898	0.47	32,938,924
Morgan Stanley.....	833,321	0.91	63,382,395
		2.41	168,580,923
化学			
Corteva, Inc.	340,546	0.26	18,437,160
通信機器			
Motorola Solutions, Inc.....	115,633	0.35	24,236,677
消費者金融			
American Express Co.....	433,323	0.86	60,067,234
電気設備			
Rockwell Automation, Inc.	87,071	0.25	17,354,121
電子装置・機器・部品			
Corning, Inc.....	716,381	0.32	22,573,165
エンターテインメント			
Walt Disney Co. (The)	532,062	0.72	50,226,653
食品・生活必需品小売り			
Costco Wholesale Corp.....	143,208	0.98	68,636,730
Sysco Corp.	320,180	0.39	27,122,448
		1.37	95,759,178
食品			
Hershey Co. (The)	161,841	0.50	34,821,710
ヘルスケア機器・用品			
Abbott Laboratories	578,445	0.90	62,848,049
Align Technology, Inc.....	70,785	0.24	16,752,686
Edwards Lifesciences Corp.....	173,400	0.24	16,488,606
IDEXX Laboratories, Inc.....	39,272	0.20	13,773,869
Intuitive Surgical, Inc.....	67,163	0.19	13,480,286
Stryker Corp.	102,703	0.29	20,430,708
		2.06	143,774,204
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス			
UnitedHealth Group, Inc.....	312,124	2.30	160,316,250
ホテル・レストラン・レジャー			
Booking Holdings, Inc.....	18,561	0.47	32,463,003
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	327,286	0.52	36,472,752
McDonald's Corp.....	336,771	1.19	83,142,024
Starbucks Corp.	608,720	0.67	46,500,121
		2.85	198,577,900
家庭用品			
Procter & Gamble Co. (The).....	411,563	0.85	59,178,644
インダストリアル・コングロマリット			
Honeywell International, Inc.	305,538	0.76	53,105,560

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
保険			
Progressive Corp. (The)	783,858	1.31	91,139,170
インタラクティブ・メディア/サービス			
Alphabet, Inc., C	98,007	3.08	214,385,412
インターネット販売・カタログ販売			
Amazon.com, Inc.	1,329,049	2.02	141,158,294
ITサービス			
Cognizant Technology Solutions Corp., A	255,842	0.25	17,266,777
Fidelity National Information Services, Inc.	356,666	0.47	32,695,572
Mastercard, Inc., A	405,149	1.83	127,816,407
		2.55	177,778,756
レジャー用品			
Hasbro, Inc.	341,827	0.40	27,988,795
ライフサイエンス・ツール/サービス			
Thermo Fisher Scientific, Inc.	115,784	0.90	62,903,132
機械			
Deere & Co.	222,669	0.96	66,682,685
Parker-Hannifin Corp.	109,321	0.39	26,898,432
		1.35	93,581,117
メディア			
Comcast Corp., A.	1,854,947	1.04	72,788,120
複合小売り			
Dollar General Corp.	290,555	1.02	71,313,819
石油・ガス・消耗燃料			
ConocoPhillips.	246,936	0.32	22,177,322
パーソナル用品			
Estee Lauder Cos., Inc. (The), A.	131,913	0.48	33,594,284
医薬品			
Eli Lilly & Co.	273,688	1.27	88,737,860
Merck & Co., Inc.	648,206	0.85	59,096,941
Zoetis, Inc.	126,847	0.31	21,803,731
		2.43	169,638,532
不動産管理・開発			
CBRE Group, Inc., A	222,687	0.24	16,391,990
半導体・半導体装置			
Advanced Micro Devices, Inc.	515,877	0.57	39,449,114
Lam Research Corp.	179,320	1.10	76,417,218
NVIDIA Corp.	498,944	1.11	75,634,921
Texas Instruments, Inc.	327,026	0.72	50,247,545
		3.50	241,748,798
ソフトウェア			
Adobe, Inc.	161,825	0.85	59,237,661
Cadence Design Systems, Inc.	149,911	0.32	22,491,147
Microsoft Corp.	1,276,534	4.70	327,852,227
ServiceNow, Inc.	37,818	0.26	17,983,215
		6.13	427,564,250
専門小売り			
Home Depot, Inc. (The)	244,012	0.96	66,925,171
TJX Cos., Inc. (The)	666,486	0.53	37,223,243
		1.49	104,148,414
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Apple, Inc.	1,603,642	3.14	219,249,934
繊維・アパレル・贅沢品			
NIKE, Inc., B	414,607	0.61	42,372,835
普通株式合計		55.49	3,869,071,711

社債 (2021年: 10.19% USD 849,478,958)

オーストラリア

銀行

Commonwealth Bank of Australia, 3.7840%, 期日 14/3/32	6,680,000	0.08	5,892,394
National Australia Bank Ltd., 2.9900%, 期日 21/5/31	8,314,000	0.10	6,956,084
Westpac Banking Corp., 2.6680%, 期日 15/11/35	6,131,000	0.07	4,886,130
		0.25	17,734,608

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
カナダ			
銀行			
Bank of Montreal, 3.0880%, 期日 10/1/37	14,931,000	0.18	12,234,633
総合公益事業			
Algonquin Power & Utilities Corp., 4.7500%, 期日 18/1/82.....	6,663,000	0.08	5,559,083
フランス			
銀行			
BNP Paribas SA, 2.5910%, 期日 20/1/28	3,627,000	0.05	3,265,214
BNP Paribas SA, 3.1320%, 期日 20/1/33	3,098,000	0.04	2,596,730
		0.09	5,861,944
アイルランド			
消費者金融			
AerCap Ireland Capital DAC, 4.6250%, 期日 15/10/27.....	4,601,000	0.06	4,335,649
AerCap Ireland Capital DAC, 3.0000%, 期日 29/10/28.....	3,537,000	0.04	2,982,623
		0.10	7,318,272
ルクセンブルク			
食品			
JBS Finance Luxembourg SARL, 3.6250%, 期日 15/1/32.....	2,305,000	0.03	1,867,569
オランダ			
医薬品			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4.7500%, 期日 9/5/27	1,074,000	0.01	918,665
韓国			
半導体・半導体装置			
SK Hynix, Inc., 1.5000%, 期日 19/1/26	3,843,000	0.05	3,458,569
SK Hynix, Inc., 2.3750%, 期日 19/1/31	2,447,000	0.03	1,930,255
		0.08	5,388,824
国際			
食品			
JBS USA LUX SA, 6.5000%, 期日 15/4/29	1,201,000	0.02	1,210,206
JBS USA LUX SA, 5.5000%, 期日 15/1/30	5,804,000	0.08	5,501,781
JBS USA LUX SA, 3.0000%, 期日 15/5/32	3,847,000	0.04	2,960,116
JBS USA LUX SA, 4.3750%, 期日 2/2/52.....	6,154,000	0.06	4,364,601
		0.20	14,036,704
英国			
飲料			
Diageo Capital plc, 1.3750%, 期日 29/9/25	2,698,000	0.04	2,520,219
Diageo Capital plc, 2.0000%, 期日 29/4/30	2,541,000	0.03	2,169,895
Diageo Capital plc, 2.1250%, 期日 29/4/32	2,039,000	0.02	1,702,710
		0.09	6,392,824
バイオテクノロジー			
CSL Finance plc, 3.8500%, 期日 27/4/27.....	1,861,000	0.03	1,844,973
CSL Finance plc, 4.0500%, 期日 27/4/29.....	4,613,000	0.07	4,532,862
CSL Finance plc, 4.2500%, 期日 27/4/32.....	3,284,000	0.05	3,214,707
		0.15	9,592,542
医薬品			
Royalty Pharma plc, 3.5500%, 期日 2/9/50.....	4,774,000	0.05	3,342,913
Royalty Pharma plc, 3.3500%, 期日 2/9/51.....	2,028,000	0.02	1,378,361
		0.07	4,721,274
米国			
航空宇宙産業及び防衛			
General Dynamics Corp., 3.5000%, 期日 1/4/27.....	1,751,000	0.02	1,719,958
航空貨物・物流			
GXO Logistics, Inc., 1.6500%, 期日 15/7/26.....	3,722,000	0.05	3,253,454
GXO Logistics, Inc., 2.6500%, 期日 15/7/31.....	566,000	0.01	448,081
		0.06	3,701,535
銀行			
Bank of America Corp., 5.2000%, 期日 1/6/23	1,722,000	0.02	1,598,231
Bank of America Corp., 6.2500%, 期日 5/9/24	6,419,000	0.09	6,255,315
Bank of America Corp., 3.7050%, 期日 24/4/28.....	3,836,000	0.05	3,660,378

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Bank of America Corp., 4.3760%, 期日 27/4/28.....	9,441,000	0.13	9,302,982
Bank of America Corp., 3.9700%, 期日 5/3/29	2,836,000	0.04	2,707,246
Bank of America Corp., 2.0870%, 期日 14/6/29.....	6,371,000	0.08	5,461,812
Bank of America Corp., 2.5920%, 期日 29/4/31.....	14,882,000	0.18	12,634,844
Bank of America Corp., 4.5710%, 期日 27/4/33.....	9,777,000	0.14	9,526,590
Citigroup, Inc., 5.3500%, 期日 15/5/23.....	2,095,000	0.03	1,954,948
Citigroup, Inc., 6.3000%, 期日 15/5/24.....	478,000	0.01	447,896
Citigroup, Inc., 5.9500%, 期日 15/5/25.....	1,985,000	0.03	1,845,259
Citigroup, Inc., 3.8870%, 期日 10/1/28.....	9,839,000	0.14	9,467,401
Citigroup, Inc., 4.4120%, 期日 31/3/31.....	7,117,000	0.10	6,804,853
First Republic Bank, 4.6250%, 期日 13/2/47.....	1,370,000	0.02	1,254,464
JPMorgan Chase & Co., 5.0000%, 期日 1/8/24.....	1,720,000	0.02	1,518,975
JPMorgan Chase & Co., 4.6000%, 期日 1/2/25.....	1,815,000	0.02	1,537,343
JPMorgan Chase & Co., 2.0830%, 期日 22/4/26	2,249,000	0.03	2,105,810
JPMorgan Chase & Co., 4.0800%, 期日 26/4/26	6,333,000	0.09	6,262,765
JPMorgan Chase & Co., 3.9600%, 期日 29/1/27	6,969,000	0.10	6,811,613
JPMorgan Chase & Co., 4.5650%, 期日 14/6/30	5,353,000	0.08	5,260,019
JPMorgan Chase & Co., 2.9560%, 期日 13/5/31	6,932,000	0.09	5,990,938
JPMorgan Chase & Co., 2.9630%, 期日 25/1/33	10,356,000	0.13	8,897,199
JPMorgan Chase & Co., 4.5860%, 期日 26/4/33	2,589,000	0.04	2,545,714
SVB Financial Group, 4.2500%, 期日 15/11/26	11,293,000	0.12	8,542,090
SVB Financial Group, 4.1000%, 期日 15/2/31.....	6,887,000	0.07	4,770,724
US Bancorp, 2.4910%, 期日 3/11/36	6,868,000	0.08	5,604,238
		1.93	132,769,647
建設資材			
Standard Industries, Inc., 4.3750%, 期日 15/7/30.....	1,628,000	0.02	1,287,072
資本市場			
Ares Capital Corp., 2.8750%, 期日 15/6/27	4,799,000	0.06	4,009,712
Bank of New York Mellon Corp. (The), 4.7000%, 期日 20/9/25...	8,707,000	0.12	8,528,506
Charles Schwab Corp. (The), 5.3750%, 期日 1/6/25.....	15,708,000	0.22	15,590,190
Charles Schwab Corp. (The), 4.0000%, 期日 1/12/30	2,568,000	0.03	1,979,928
Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.5000%, 期日 1/4/25	10,588,000	0.15	10,392,762
Goldman Sachs Group, Inc. (The), 3.1020%, 期日 24/2/33.....	4,430,000	0.05	3,787,854
Morgan Stanley, 2.1880%, 期日 28/4/26	7,239,000	0.10	6,786,090
Morgan Stanley, 4.3500%, 期日 8/9/26.....	3,471,000	0.05	3,442,198
Morgan Stanley, 1.5930%, 期日 4/5/27.....	2,740,000	0.04	2,436,940
Morgan Stanley, 1.7940%, 期日 13/2/32	4,752,000	0.05	3,742,576
Morgan Stanley, 2.2390%, 期日 21/7/32	9,525,000	0.11	7,726,401
Morgan Stanley, 2.9430%, 期日 21/1/33	11,016,000	0.14	9,452,715
Morgan Stanley, 2.4840%, 期日 16/9/36	10,177,000	0.11	7,836,062
MSCI, Inc., 4.0000%, 期日 15/11/29	364,000	0.00	323,520
MSCI, Inc., 3.6250%, 期日 1/9/30.....	7,448,000	0.09	6,222,165
MSCI, Inc., 3.8750%, 期日 15/2/31	5,122,000	0.06	4,394,113
		1.38	96,651,732
化学			
Axalta Coating Systems LLC, 3.3750%, 期日 15/2/29	6,586,000	0.08	5,384,845
Element Solutions, Inc., 3.8750%, 期日 1/9/28	6,308,000	0.07	5,214,603
		0.15	10,599,448
商業サービス・用品			
Aramark Services, Inc., 6.3750%, 期日 1/5/25.....	7,364,000	0.10	7,219,850
消費者金融			
American Express Co., 4.9890%, 期日 26/5/33	8,219,000	0.12	8,232,088
Capital One Financial Corp., 3.7500%, 期日 28/7/26.....	7,616,000	0.10	7,291,948
		0.22	15,524,036
各種電気通信サービス			
AT&T, Inc., 3.8000%, 期日 1/12/57	3,117,000	0.03	2,414,519
AT&T, Inc., 3.6500%, 期日 15/9/59	516,000	0.01	387,602
		0.04	2,802,121

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
電力事業			
Duquesne Light Holdings, Inc., 2.7750%, 期日 7/1/32	4,236,000	0.05	3,478,137
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 1.8750%, 期日 15/1/27	7,667,000	0.10	6,920,933
NextEra Energy Capital Holdings, Inc., 2.4400%, 期日 15/1/32	2,279,000	0.03	1,900,133
NRG Energy, Inc., 6.6250%, 期日 15/1/27	1,309,000	0.02	1,284,249
NRG Energy, Inc., 3.3750%, 期日 15/2/29	5,542,000	0.06	4,479,072
NRG Energy, Inc., 3.6250%, 期日 15/2/31	4,671,000	0.05	3,672,107
		0.31	21,734,631
電子装置・機器・部品			
Allegion US Holding Co., Inc., 5.4110%, 期日 1/7/32	6,583,000	0.09	6,547,694
Trimble, Inc., 4.7500%, 期日 1/12/24.....	4,494,000	0.07	4,519,590
Trimble, Inc., 4.9000%, 期日 15/6/28.....	2,762,000	0.04	2,695,209
		0.20	13,762,493
エンターテインメント			
Netflix, Inc., 4.8750%, 期日 15/4/28.....	1,737,000	0.02	1,638,304
Netflix, Inc., 5.8750%, 期日 15/11/28	6,079,000	0.09	5,958,697
		0.11	7,597,001
不動産投資信託 (REITs)			
Agree LP, 2.0000%, 期日 15/6/28	2,778,000	0.03	2,375,598
Agree LP, 2.9000%, 期日 1/10/30	1,766,000	0.02	1,500,407
Agree LP, 2.6000%, 期日 15/6/33	2,083,000	0.02	1,653,244
Equinix, Inc., 2.1500%, 期日 15/7/30.....	2,268,000	0.03	1,836,935
GLP Capital LP, 5.2500%, 期日 1/6/25.....	1,022,000	0.01	1,004,273
GLP Capital LP, 5.3750%, 期日 15/4/26	2,237,000	0.03	2,193,367
GLP Capital LP, 5.3000%, 期日 15/1/29	291,000	0.00	278,611
Invitation Homes Operating Partnership LP, 2.0000%, 期日 15/8/31	5,032,000	0.06	3,876,274
MPT Operating Partnership LP, 3.5000%, 期日 15/3/31	5,183,000	0.06	4,100,401
Rexford Industrial Realty LP, 2.1500%, 期日 1/9/31.....	5,851,000	0.07	4,606,017
Sun Communities Operating LP, 2.7000%, 期日 15/7/31	5,394,000	0.06	4,352,945
		0.39	27,778,072
食品・生活必需品小売り			
Performance Food Group, Inc., 4.2500%, 期日 1/8/29.....	8,060,000	0.10	6,746,059
食品			
Mondelez International, Inc., 2.7500%, 期日 13/4/30	281,000	0.00	247,060
Pilgrim's Pride Corp., 3.5000%, 期日 1/3/32	5,711,000	0.06	4,473,512
		0.06	4,720,572
ヘルスケア・プロバイダー /ヘルスケア・サービス			
Centene Corp., 4.2500%, 期日 15/12/27	15,984,000	0.21	14,970,135
Centene Corp., 2.4500%, 期日 15/7/28.....	4,410,000	0.05	3,690,001
Centene Corp., 3.0000%, 期日 15/10/30	4,638,000	0.06	3,855,964
CVS Health Corp., 5.0500%, 期日 25/3/48	2,189,000	0.03	2,098,569
HCA, Inc., 5.8750%, 期日 15/2/26.....	984,000	0.01	990,932
HCA, Inc., 5.3750%, 期日 1/9/26	1,973,000	0.03	1,959,761
HCA, Inc., 5.6250%, 期日 1/9/28	2,187,000	0.03	2,155,485
HCA, Inc., 5.8750%, 期日 1/2/29	1,648,000	0.02	1,652,499
HCA, Inc., 5.5000%, 期日 15/6/47.....	895,000	0.01	800,221
Molina Healthcare, Inc., 4.3750%, 期日 15/6/28.....	13,396,000	0.17	11,993,117
		0.62	44,166,684
保険			
Athene Global Funding, 1.7160%, 期日 7/1/25	2,949,000	0.04	2,754,362
Athene Global Funding, 1.7300%, 期日 2/10/26.....	9,241,000	0.12	8,026,725
Athene Global Funding, 2.7170%, 期日 7/1/29	6,076,000	0.07	5,173,062
Athene Global Funding, 2.6460%, 期日 4/10/31.....	8,912,000	0.10	7,124,414
Brown & Brown, Inc., 4.2000%, 期日 17/3/32.....	1,878,000	0.02	1,711,723
Brown & Brown, Inc., 4.9500%, 期日 17/3/52.....	5,509,000	0.07	4,845,098
Prudential Financial, Inc., 3.7000%, 期日 1/10/50	7,981,000	0.10	6,696,418
		0.52	36,331,802

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
インターネット販売・カタログ販売			
Amazon.com, Inc., 3.0000%, 期日 13/4/25	6,773,000	0.10	6,713,176
Amazon.com, Inc., 3.9500%, 期日 13/4/52	3,173,000	0.04	2,936,918
Amazon.com, Inc., 4.1000%, 期日 13/4/62	5,185,000	0.07	4,701,634
		0.21	14,351,728
ITサービス			
Global Payments, Inc., 4.8000%, 期日 1/4/26	2,775,000	0.04	2,778,619
Global Payments, Inc., 2.1500%, 期日 15/1/27	3,137,000	0.04	2,786,916
Global Payments, Inc., 2.9000%, 期日 15/11/31	4,706,000	0.06	3,859,209
PayPal Holdings, Inc., 1.6500%, 期日 1/6/25	1,904,000	0.03	1,797,933
		0.17	11,222,677
レジャー用品			
Hasbro, Inc., 3.9000%, 期日 19/11/29	7,623,000	0.10	7,007,319
Hasbro, Inc., 6.3500%, 期日 15/3/40	1,636,000	0.02	1,681,884
Hasbro, Inc., 5.1000%, 期日 15/5/44	1,043,000	0.01	935,691
		0.13	9,624,894
メディア			
Charter Communications Operating LLC, 2.8000%, 期日 1/4/31	3,891,000	0.04	3,120,175
Charter Communications Operating LLC, 6.4840%, 期日 23/10/45	851,000	0.01	829,083
Comcast Corp., 3.7500%, 期日 1/4/40	1,614,000	0.02	1,417,341
Fox Corp., 4.0300%, 期日 25/1/24	2,063,000	0.03	2,064,890
		0.10	7,431,489
金属・鉱業			
Allegheny Technologies, Inc., 5.8750%, 期日 1/12/27	3,422,000	0.04	3,034,927
Reliance Steel & Aluminum Co., 4.5000%, 期日 15/4/23	1,884,000	0.03	1,890,194
		0.07	4,925,121
複合小売り			
Dollar General Corp., 4.1250%, 期日 3/4/50	2,678,000	0.03	2,238,573
総合公益事業			
Dominion Energy, Inc., 4.3500%, 期日 15/1/27	3,416,000	0.04	2,826,740
石油・ガス・消耗燃料			
Energy Transfer LP, 4.9500%, 期日 15/6/28	149,000	0.00	146,973
Hess Midstream Operations LP, 5.1250%, 期日 15/6/28	5,103,000	0.07	4,589,638
Southwestern Energy Co., 4.7500%, 期日 1/2/32	3,471,000	0.04	2,974,439
		0.11	7,711,050
パーソナル用品			
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3.3750%, 期日 24/3/27	3,845,000	0.05	3,683,351
GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3.3750%, 期日 24/3/29	2,452,000	0.03	2,296,169
		0.08	5,979,520
半導体・半導体装置			
Advanced Micro Devices, Inc., 3.9240%, 期日 1/6/32	2,481,000	0.04	2,444,323
Analog Devices, Inc., 2.9500%, 期日 1/4/25	2,392,000	0.03	2,345,411
Broadcom, Inc., 4.3000%, 期日 15/11/32	3,526,000	0.05	3,207,107
Marvell Technology, Inc., 1.6500%, 期日 15/4/26	3,140,000	0.04	2,817,056
Marvell Technology, Inc., 4.8750%, 期日 22/6/28	4,651,000	0.07	4,591,334
Microchip Technology, Inc., 2.6700%, 期日 1/9/23	5,479,000	0.08	5,390,179
TSMC Arizona Corp., 3.8750%, 期日 22/4/27	4,713,000	0.07	4,701,299
		0.38	25,496,709
ソフトウェア			
Cadence Design Systems, Inc., 4.3750%, 期日 15/10/24	1,400,000	0.02	1,413,634
Workday, Inc., 3.5000%, 期日 1/4/27	2,471,000	0.03	2,365,021
Workday, Inc., 3.7000%, 期日 1/4/29	1,855,000	0.02	1,736,950
Workday, Inc., 3.8000%, 期日 1/4/32	4,032,000	0.05	3,688,352
		0.12	9,203,957
専門小売り			
Lithia Motors, Inc., 3.8750%, 期日 1/6/29	8,848,000	0.11	7,534,647

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
貯蓄・抵当金融			
Rocket Mortgage LLC, 2.8750%, 期日 15/10/26	5,146,000	0.06	4,267,218
Rocket Mortgage LLC, 3.6250%, 期日 1/3/29	2,676,000	0.03	2,109,116
Rocket Mortgage LLC, 3.8750%, 期日 1/3/31	3,702,000	0.04	2,784,441
Rocket Mortgage LLC, 4.0000%, 期日 15/10/33	3,909,000	0.04	2,784,185
		0.17	11,944,960
商社・代理店			
Air Lease Corp., 1.8750%, 期日 15/8/26.....	5,534,000	0.07	4,791,300
Air Lease Corp., 3.0000%, 期日 1/2/30	3,450,000	0.04	2,818,744
		0.11	7,610,044
社債合計.....		9.39	654,841,764

政府発行証券合計 (2021年: 19.01% USD 1,589,598,637)

米国財務省中期証券 / 長期証券

0.1250%, 期日 28/2/23	43,092,000	0.62	42,361,164
0.1250%, 期日 31/3/23	122,555,000	1.72	120,180,146
0.1250%, 期日 31/8/23	138,475,000	1.92	134,020,540
0.3750%, 期日 31/10/23.....	44,977,000	0.62	43,469,568
0.8750%, 期日 31/1/24	12,175,000	0.17	11,783,117
1.5000%, 期日 29/2/24	54,397,000	0.76	53,119,946
1.5000%, 期日 15/2/25	5,902,000	0.08	5,673,528
1.7500%, 期日 15/3/25	1,355,000	0.02	1,310,169
0.3750%, 期日 31/1/26	55,090,000	0.72	50,098,545
0.7500%, 期日 30/4/26	48,322,000	0.64	44,303,346
0.8750%, 期日 30/6/26	57,834,000	0.76	53,098,841
0.6250%, 期日 31/7/26	19,102,000	0.25	17,324,992
0.8750%, 期日 30/9/26	35,071,600	0.46	32,035,715
1.2500%, 期日 30/11/26.....	54,132,300	0.72	50,130,529
2.7500%, 期日 30/4/27	242,959,900	3.44	239,704,616
3.2500%, 期日 30/6/27	59,372,000	0.86	59,956,443
2.8750%, 期日 30/4/29	23,379,000	0.33	23,108,680
2.7500%, 期日 31/5/29	5,585,000	0.08	5,475,918
2.8750%, 期日 15/5/32	216,165,800	3.07	213,767,711
1.3750%, 期日 15/11/40.....	10,217,000	0.11	7,362,227
1.7500%, 期日 15/8/41	87,407,000	0.95	66,521,507
2.0000%, 期日 15/11/41.....	55,873,000	0.64	44,397,210
2.3750%, 期日 15/2/42	39,821,000	0.48	33,779,408
2.7500%, 期日 15/8/42	20,353,400	0.26	18,279,102
1.3750%, 期日 15/8/50	46,608,000	0.44	30,700,289
1.8750%, 期日 15/2/51	27,239,700	0.29	20,445,736
2.2500%, 期日 15/2/52	54,532,000	0.64	44,895,173
0.0000%, 期日 5/7/22.....	343,800,000	4.93	343,766,988
政府発行証券合計.....		25.98	1,811,071,154

不動産担保証券 (2021年: 5.40% USD 456,870,444)

Fannie Mae

3.0000%, 期日 1/10/34	304,776	0.00	299,776
2.5000%, 期日 1/11/34	765,737	0.01	737,607
3.0000%, 期日 1/11/34	135,356	0.00	133,135
3.0000%, 期日 1/12/34	144,266	0.00	141,899
6.0000%, 期日 1/2/37.....	25,256	0.00	27,517
3.0000%, 期日 1/9/42.....	1,018,610	0.01	974,810
4.5000%, 期日 1/11/42	216,466	0.00	223,119
3.0000%, 期日 1/1/43.....	1,401,359	0.02	1,341,101
3.0000%, 期日 1/1/43.....	129,431	0.00	123,865
3.0000%, 期日 1/2/43.....	585,282	0.01	560,115
3.0000%, 期日 1/2/43.....	38,652	0.00	36,945
3.0000%, 期日 1/3/43.....	492,086	0.01	470,357
3.0000%, 期日 1/3/43.....	1,726,705	0.02	1,650,458
3.0000%, 期日 1/5/43.....	407,549	0.01	389,553
3.0000%, 期日 1/5/43.....	175,788	0.00	168,026
5.0000%, 期日 1/7/44.....	11,848	0.00	12,416

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
4.5000%, 期日 1/10/44	531,321	0.01	545,637
4.5000%, 期日 1/3/45.....	773,923	0.01	794,776
4.5000%, 期日 1/6/45.....	401,046	0.01	413,188
3.0000%, 期日 1/7/45.....	2,218,257	0.03	2,120,303
3.5000%, 期日 1/12/45	363,350	0.01	355,811
3.0000%, 期日 1/1/46.....	26,665	0.00	25,325
4.5000%, 期日 1/2/46.....	839,402	0.01	865,200
3.5000%, 期日 1/7/46.....	300,727	0.00	294,153
3.0000%, 期日 1/9/46.....	2,072,968	0.03	1,981,430
3.0000%, 期日 1/9/46.....	1,001,426	0.01	958,365
3.0000%, 期日 1/11/46	298,316	0.00	283,833
3.0000%, 期日 1/1/47.....	50,944	0.00	48,471
3.0000%, 期日 1/2/47.....	1,340,198	0.02	1,281,018
3.5000%, 期日 1/3/47.....	315,504	0.00	308,958
3.0000%, 期日 1/3/47.....	644,013	0.01	610,797
3.5000%, 期日 1/7/47.....	279,531	0.00	273,731
3.5000%, 期日 1/8/47.....	128,514	0.00	125,845
3.5000%, 期日 1/8/47.....	97,088	0.00	94,847
3.5000%, 期日 1/12/47	61,512	0.00	60,234
3.5000%, 期日 1/12/47	37,135	0.00	36,364
3.5000%, 期日 1/1/48.....	289,581	0.00	281,341
4.0000%, 期日 1/1/48.....	1,297,270	0.02	1,296,418
4.0000%, 期日 1/1/48.....	627,224	0.01	625,721
3.0000%, 期日 1/2/48.....	258,837	0.00	245,825
3.5000%, 期日 1/3/48.....	54,950	0.00	53,739
4.5000%, 期日 1/3/48.....	24,047	0.00	24,464
4.0000%, 期日 1/3/48.....	362,382	0.01	362,144
5.0000%, 期日 1/5/48.....	735,333	0.01	754,134
3.5000%, 期日 1/7/48.....	7,204,514	0.10	7,047,020
4.5000%, 期日 1/8/48.....	13,779	0.00	14,017
4.0000%, 期日 1/2/49.....	226,255	0.00	226,235
3.0000%, 期日 1/8/49.....	160,024	0.00	150,552
3.0000%, 期日 1/9/49.....	191,079	0.00	179,647
2.5000%, 期日 1/1/50.....	516,441	0.01	469,702
2.5000%, 期日 1/8/50.....	726,350	0.01	664,514
2.5000%, 期日 1/10/50	845,006	0.01	765,527
2.5000%, 期日 1/1/52.....	4,320,301	0.06	3,914,819
3.0000%, 期日 1/2/52.....	4,146,027	0.06	3,870,064
2.5000%, 期日 1/2/52.....	21,287,286	0.28	19,264,635
2.5000%, 期日 1/3/52.....	604,381	0.01	546,955
2.5000%, 期日 1/3/52.....	8,486,653	0.11	7,680,278
2.5000%, 期日 1/3/52.....	696,245	0.01	628,701
2.5000%, 期日 1/3/52.....	242,065	0.00	218,872
2.5000%, 期日 1/3/52.....	758,594	0.01	684,854
2.5000%, 期日 1/3/52.....	3,153,722	0.04	2,854,491
2.5000%, 期日 1/3/52.....	8,740,751	0.11	7,892,795
3.0000%, 期日 1/3/52.....	4,668,107	0.06	4,357,648
3.0000%, 期日 1/3/52.....	14,676,479	0.20	13,682,226
3.0000%, 期日 1/3/52.....	4,235,779	0.06	3,957,495
3.0000%, 期日 1/4/52.....	3,136,114	0.04	2,929,871
3.0000%, 期日 1/4/52.....	3,555,637	0.05	3,324,544
3.0000%, 期日 1/4/52.....	11,171,225	0.15	10,412,265
3.5000%, 期日 1/4/52.....	3,105,441	0.04	3,006,108
3.5000%, 期日 1/4/52.....	497,875	0.01	481,866
3.5000%, 期日 1/4/52.....	648,087	0.01	627,288
3.5000%, 期日 1/4/52.....	1,725,903	0.02	1,670,408
3.5000%, 期日 1/4/52.....	1,066,948	0.02	1,032,820
3.5000%, 期日 1/5/52.....	1,770,762	0.02	1,713,984
3.5000%, 期日 1/6/52.....	9,424,588	0.13	9,173,953
3.5000%, 期日 1/6/52.....	3,569,739	0.05	3,436,024
3.5000%, 期日 1/6/52.....	11,222,289	0.16	10,803,066
3.5000%, 期日 1/7/52.....	1,344,338	0.02	1,308,587

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.5000%, 期日 1/5/56.....	1,154,907	0.02	1,134,541
3.5000%, 期日 1/8/56.....	2,771,067	0.04	2,722,201
3.5000%, 期日 1/8/56.....	1,053,943	0.02	1,035,358
3.0000%, 期日 1/2/57.....	1,883,293	0.03	1,771,364
3.0000%, 期日 1/6/57.....	43,329	0.00	40,590
6.5236%, 期日 25/11/24.....	2,514,331	0.04	2,595,934
5.9236%, 期日 25/2/25	1,317,751	0.02	1,318,237
5.6236%, 期日 25/5/25	2,368,762	0.03	2,371,490
6.6236%, 期日 25/7/25	1,454,872	0.02	1,465,281
7.3236%, 期日 25/4/28	843,224	0.01	891,306
5.8736%, 期日 25/4/29	1,103,404	0.02	1,151,435
5.1736%, 期日 25/7/29	2,474,180	0.04	2,540,257
2.9257%, 期日 25/11/41.....	8,950,000	0.12	8,010,591
3.0000%, 期日 25/5/48	1,934,046	0.03	1,851,410
3.0000%, 期日 25/11/49.....	2,521,431	0.04	2,440,208
		2.63	182,744,805
Freddie Mac			
3.5000%, 期日 1/1/47.....	214,760	0.00	211,455
4.5736%, 期日 25/11/49.....	6,810,275	0.09	6,521,375
4.7236%, 期日 25/3/50	1,356,081	0.02	1,333,344
3.0257%, 期日 25/3/42	3,341,587	0.05	3,313,539
3.1757%, 期日 25/8/33	5,724,000	0.08	5,310,443
3.5736%, 期日 25/10/49.....	129,902	0.00	128,861
4.7736%, 期日 25/9/50	188,155	0.00	188,223
2.9257%, 期日 25/12/50.....	3,801,000	0.05	3,747,312
3.7292%, 期日 25/6/42	4,865,000	0.07	4,871,091
3.2257%, 期日 25/8/33	1,448,000	0.02	1,369,854
3.5257%, 期日 25/11/50.....	4,303,805	0.06	4,271,773
		0.44	31,267,270
Freddie Mac Pool			
3.0000%, 期日 1/5/31.....	2,269,469	0.03	2,253,936
3.0000%, 期日 1/9/32.....	625,802	0.01	619,899
3.0000%, 期日 1/10/32	368,858	0.01	365,378
3.0000%, 期日 1/1/33.....	415,556	0.01	411,636
2.5000%, 期日 1/12/33	2,140,137	0.03	2,096,145
3.0000%, 期日 1/10/34	653,372	0.01	642,657
3.0000%, 期日 1/10/34	300,555	0.00	295,625
2.5000%, 期日 1/11/34	849,005	0.01	817,848
2.5000%, 期日 1/11/34	1,053,843	0.01	1,015,168
6.0000%, 期日 1/4/40.....	352,693	0.01	385,295
3.5000%, 期日 1/7/42.....	155,029	0.00	152,498
3.5000%, 期日 1/8/42.....	177,857	0.00	174,954
3.5000%, 期日 1/8/42.....	165,073	0.00	162,378
3.5000%, 期日 1/2/43.....	160,518	0.00	157,995
3.0000%, 期日 1/2/43.....	4,203	0.00	4,017
3.0000%, 期日 1/3/43.....	536,338	0.01	512,657
3.0000%, 期日 1/3/43.....	2,420	0.00	2,314
3.0000%, 期日 1/6/43.....	59,758	0.00	56,447
3.0000%, 期日 1/11/43	4,259,364	0.06	4,076,231
3.5000%, 期日 1/2/44.....	184,067	0.00	181,173
4.5000%, 期日 1/5/44.....	263,581	0.00	271,550
3.5000%, 期日 1/12/44	1,251,216	0.02	1,230,909
3.0000%, 期日 1/1/45.....	322,944	0.00	308,006
3.0000%, 期日 1/1/46.....	795,757	0.01	760,622
3.5000%, 期日 1/7/46.....	246,744	0.00	239,878
3.0000%, 期日 1/10/46	537,518	0.01	509,828
4.0000%, 期日 1/3/47.....	228,929	0.00	229,929
3.5000%, 期日 1/4/47.....	99,983	0.00	97,794
3.0000%, 期日 1/4/47.....	335,999	0.00	318,690
3.5000%, 期日 1/9/47.....	436,000	0.01	425,932
3.5000%, 期日 1/12/47	583,526	0.01	570,051
3.5000%, 期日 1/2/48.....	244,186	0.00	236,814

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
4.5000%, 期日 1/3/48.....	21,247	0.00	21,615
4.0000%, 期日 1/3/48.....	361,123	0.01	360,886
4.0000%, 期日 1/4/48.....	212,155	0.00	212,137
4.0000%, 期日 1/4/48.....	305,586	0.00	304,854
4.0000%, 期日 1/5/48.....	363,464	0.01	363,433
4.5000%, 期日 1/7/48.....	157,662	0.00	160,395
5.0000%, 期日 1/9/48.....	14,636	0.00	15,012
4.5000%, 期日 1/12/48	290,060	0.00	296,828
4.5000%, 期日 1/5/49.....	1,155,307	0.02	1,172,967
3.0000%, 期日 1/8/49.....	53,036	0.00	49,897
3.0000%, 期日 1/8/49.....	102,780	0.00	96,698
3.0000%, 期日 1/12/49	176,220	0.00	165,791
3.0000%, 期日 1/12/49	312,149	0.00	293,676
2.5000%, 期日 1/1/50.....	227,879	0.00	207,273
3.5000%, 期日 1/3/50.....	395,329	0.01	382,218
3.0000%, 期日 1/3/50.....	732,829	0.01	688,107
2.5000%, 期日 1/8/50.....	372,217	0.01	340,726
2.5000%, 期日 1/8/50.....	133,847	0.00	122,456
2.5000%, 期日 1/9/50.....	685,680	0.01	626,981
2.5000%, 期日 1/1/52.....	1,351,640	0.02	1,225,610
2.5000%, 期日 1/1/52.....	817,948	0.01	738,967
2.5000%, 期日 1/2/52.....	1,949,766	0.03	1,764,501
3.5000%, 期日 1/2/52.....	3,395,976	0.05	3,274,414
3.0000%, 期日 1/2/52.....	850,999	0.01	795,817
3.0000%, 期日 1/2/52.....	1,131,226	0.02	1,057,148
2.5000%, 期日 1/3/52.....	298,248	0.00	269,313
3.0000%, 期日 1/3/52.....	1,172,034	0.02	1,095,958
3.5000%, 期日 1/4/52.....	431,370	0.01	417,536
3.5000%, 期日 1/4/52.....	1,319,751	0.02	1,277,566
3.5000%, 期日 1/4/52.....	1,195,835	0.02	1,157,612
3.5000%, 期日 1/4/52.....	361,247	0.01	349,639
3.5000%, 期日 1/5/52.....	8,992,422	0.12	8,665,743
3.5000%, 期日 1/6/52.....	5,433,628	0.08	5,275,266
		0.76	52,831,294
Ginnie Mae			
4.0000%, 期日 15/1/45	1,371,388	0.02	1,393,528
4.5000%, 期日 15/8/46	1,515,421	0.02	1,564,460
4.0000%, 期日 15/7/47	185,440	0.00	187,310
4.0000%, 期日 15/8/47	22,839	0.00	23,069
4.0000%, 期日 20/8/47	18,062	0.00	18,206
4.0000%, 期日 20/8/47	157,835	0.00	159,085
4.0000%, 期日 20/8/47	21,644	0.00	21,815
4.0000%, 期日 15/11/47.....	31,134	0.00	31,448
4.0000%, 期日 15/12/47.....	78,588	0.00	79,381
4.5000%, 期日 20/2/48	167,227	0.00	172,045
4.5000%, 期日 20/5/48	39,015	0.00	39,853
4.5000%, 期日 20/5/48	262,521	0.00	268,157
4.0000%, 期日 20/5/48	3,031,985	0.04	3,043,629
4.0000%, 期日 20/6/48	1,589,461	0.02	1,594,074
5.0000%, 期日 20/8/48	844,772	0.01	883,541
3.0000%, 期日 20/7/51	7,754,184	0.11	7,325,959
3.0000%, 期日 20/8/51	16,090,661	0.22	15,209,806
2.5000%, 期日 15/7/52	27,354,580	0.36	25,014,244
3.0000%, 期日 15/7/52	1,411,464	0.02	1,330,191
3.5000%, 期日 15/7/52	17,902,858	0.25	17,396,598
		1.07	75,756,399
UMBS			
2.0000%, 期日 25/7/37	13,738,257	0.18	12,820,880
2.5000%, 期日 25/7/37	9,199,380	0.13	8,788,818
3.0000%, 期日 25/7/37	4,808,798	0.07	4,698,533
2.5000%, 期日 25/7/52	16,936,855	0.22	15,226,478
3.0000%, 期日 25/7/52	75,994,830	1.03	70,757,492

ジャナス・ヘンダーソン・バランス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
3.5000%, 期日 25/7/52	130,093,322	1.79	125,116,520
4.0000%, 期日 25/7/52	60,036,855	0.85	59,199,886
4.5000%, 期日 25/7/52	62,087,628	0.89	62,330,178
		5.16	358,938,785
不動産担保証券合計.....		10.06	701,538,553

トランシュ・ローン (2021年: 0.93% USD 77,547,396)

米国

ヘルスケア機器・用品

Medline Borrower LP, 4.9200%, 期日 23/10/28 11,818,249 0.16 10,996,526

トランシュ・ローン合計..... 0.16 10,996,526

投資有価証券合計 (取得原価: USD 6,889,937,632)..... 103.31 7,202,882,873

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉[○]

(2021年: 0.32% USD 27,543,334)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD ^(Z) _(CA) 5,400	USD 3,713	3,728	2022年7月29日	0.00	15
BRL ^(Z) _(CA) 36,901,881	USD 6,986,443	6,997,827	2022年7月29日	0.00	11,384
CAD ^(Z) _(CA) 51,835,914	USD 40,139,991	40,269,447	2022年7月29日	0.00	129,456
EUR ^(Z) _(CA) 327,485	USD 342,430	343,746	2022年7月29日	0.00	1,316
USD ^(Z) _(CA) 110,744	AUD 159,305	109,979	2022年7月29日	0.00	765
USD ^(Z) _(CA) 115,715	BRL 609,007	115,488	2022年7月29日	0.00	227
USD ^(Z) _(CA) 26,536,309	EUR 25,212,718	26,464,490	2022年7月29日	0.00	71,819
USD ^(Z) _(CA) 50,746	GBP 41,635	50,703	2022年7月29日	0.00	43
合計				0.00	215,025

先物契約[○] (2021年: 0.00% USD -)

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
Goldman Sachs	1,038 US 5 Year Note	0.00	236,784
合計		0.00	236,784
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計		103.31	7,203,334,682

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉[○]
 (2021年：0.00% USD (667,227))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD ⁽²⁾ _(CA) 37,253,664	USD 25,868,539	25,718,825	2022年7月29日	0.00	(149,714)
CNH ⁽²⁾ _(CA) 418,302	USD 62,558	62,483	2022年7月29日	0.00	(75)
EUR ⁽²⁾ _(CA) 1,361,576,138	USD 1,438,469,354	1,429,176,029	2022年7月29日	(0.13)	(9,293,325)
GBP ⁽²⁾ _(CA) 2,380,325	USD 2,926,765	2,898,780	2022年7月29日	0.00	(27,985)
SGD ⁽²⁾ _(CA) 3,587,362	USD 2,586,343	2,582,180	2022年7月29日	0.00	(4,163)
USD ⁽²⁾ _(CA) 440,814	AUD 640,415	442,123	2022年7月29日	0.00	(1,309)
USD ⁽²⁾ _(CA) 891,227	CAD 1,148,420	892,165	2022年7月29日	0.00	(938)
USD ⁽²⁾ _(CA) 1,060	CNH 7,117	1,063	2022年7月29日	0.00	(3)
USD ⁽²⁾ _(CA) 66,779	EUR 63,866	67,036	2022年7月29日	0.00	(257)
USD ⁽²⁾ _(CA) 45,142	SGD 62,715	45,142	2022年7月29日	0.00	0
合計				(0.13)	(9,477,769)

先物契約[○] (2021年：0.00% USD -)

カウンターパーティ	契約数	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
Goldman Sachs	445 US 10 Year Note	(0.01)	(765,333)
Goldman Sachs	(351) US 10 Year Ultra Bond	(0.01)	(256,395)
Goldman Sachs	(1,050) US 2 Year Note	0.00	(97,927)
Goldman Sachs	448 US Ultra Bond	(0.01)	(945,365)
合計		(0.03)	(2,065,020)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計		(0.16)	(11,542,789)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	72.65
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	22.85
規制市場において取引されている金融デリバティブ商品	0.00
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	4.50
資産合計	100.00

[○] 保有担保の詳細については、注記5（訳者注：Appendixの注記5．Cash at Bank）を参照してください。

⁽²⁾_(CA) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

[次へ](#)

US スモール・ミッド・キャップ・バリュー・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式 (2021年: 97.44% USD 207,665,244)			
英国領、ヴァージン諸島			
食品			
Nomad Foods Ltd.....	285,399	3.35	5,705,126
ジャージー			
自動車部品			
Aptiv plc	22,602	1.18	2,013,160
米国			
航空宇宙産業及び防衛			
BWX Technologies, Inc.....	73,088	2.36	4,026,418
航空会社			
Southwest Airlines Co.....	66,727	1.41	2,410,179
自動車部品			
Autoliv, Inc.	47,416	1.99	3,393,563
銀行			
Ameris Bancorp.....	122,614	2.89	4,926,631
First Horizon Corp.	182,167	2.34	3,982,171
First Interstate BancSystem, Inc., A.....	162,620	3.64	6,197,448
Synovus Financial Corp.	72,378	1.53	2,609,227
		10.40	17,715,477
バイオテクノロジー			
Exelixis, Inc.....	118,850	1.45	2,474,457
建設資材			
Carlisle Cos., Inc.	14,482	2.03	3,455,550
Fortune Brands Home & Security, Inc.....	43,111	1.52	2,581,487
		3.55	6,037,037
化学			
Innospec, Inc.....	37,664	2.12	3,607,835
通信機器			
F5, Inc.....	17,545	1.58	2,685,087
建設資材			
Eagle Materials, Inc.	23,383	1.51	2,570,727
容器・包装			
Graphic Packaging Holding Co.	199,941	2.41	4,098,790
電気設備			
Acuity Brands, Inc.	20,648	1.87	3,180,618
Encore Wire Corp.	25,776	1.57	2,678,642
		3.44	5,859,260
電子装置・機器・部品			
Vontier Corp.	161,915	2.18	3,722,426
エネルギー設備・サービス			
ChampionX Corp.	194,110	2.26	3,853,083
エンターテインメント			
Take-Two Interactive Software, Inc.	28,308	2.04	3,468,579
不動産投資信託 (REITs)			
Apple Hospitality REIT, Inc.....	188,304	1.62	2,762,420
Equity LifeStyle Properties, Inc.	57,957	2.40	4,084,230
Lamar Advertising Co., A.....	32,706	1.69	2,877,147
PotlatchDeltic Corp.....	77,798	2.02	3,437,894
		7.73	13,161,691
食品・生活必需品小売り			
Casey's General Stores, Inc.....	26,077	2.83	4,823,723
ガス			
ONE Gas, Inc.	52,700	2.51	4,278,713

U S モール・ミッド・キャップ・バリュー・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
ヘルスケア機器・用品			
Embecka Corp.	116,286	1.73	2,944,362
Envista Holdings Corp.....	102,385	2.32	3,945,918
Globus Medical, Inc., A	81,471	2.68	4,573,782
		6.73	11,464,062
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス			
Cardinal Health, Inc.	79,359	2.43	4,148,095
Henry Schein, Inc.....	41,873	1.89	3,213,334
		4.32	7,361,429
保険			
Hartford Financial Services Group, Inc. (The)	65,409	2.51	4,279,711
Reinsurance Group of America, Inc.....	28,231	1.94	3,311,214
		4.45	7,590,925
機械			
Hillenbrand, Inc.	92,444	2.22	3,786,506
Lincoln Electric Holdings, Inc.	21,509	1.56	2,653,350
Watts Water Technologies, Inc., A	27,827	2.01	3,418,269
		5.79	9,858,125
金属・鉱業			
Commercial Metals Co.	89,930	1.75	2,976,683
石油・ガス・消耗燃料			
Denbury, Inc.	35,303	1.24	2,117,827
Gulfport Energy Corp.	30,426	1.42	2,419,171
Magnolia Oil & Gas Corp., A	212,702	2.62	4,464,615
		5.28	9,001,613
医薬品			
Viatis, Inc.	0	0.00	3
半導体・半導体装置			
MKS Instruments, Inc.	12,185	0.73	1,250,547
Teradyne, Inc.....	30,142	1.58	2,699,216
		2.31	3,949,763
ソフトウェア			
Black Knight, Inc.....	48,777	1.87	3,189,528
専門小売り			
Burlington Stores, Inc.	14,132	1.13	1,925,202
繊維・アパレル・贅沢品			
Hanesbrands, Inc.	285,453	1.72	2,937,311
貯蓄・抵当金融			
WSFS Financial Corp.....	77,872	1.83	3,121,888
商社・代理店			
GATX Corp.....	24,540	1.36	2,310,686
H&E Equipment Services, Inc.....	76,384	1.30	2,212,844
MSC Industrial Direct Co., Inc., A.....	41,282	1.82	3,100,691
		4.48	7,624,221
普通株式合計		97.96	166,906,084
政府発行証券 (2021年: 2.20% USD 4,700,005)			
米国財務省中期証券 / 長期証券			
0.0000%, 期日 5/7/22.....	2,200,000	1.29	2,199,789
政府発行証券合計		1.29	2,199,789
投資有価証券合計 (取得原価: USD 185,833,351)		99.25	169,105,873

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉
(2021年：0.07% USD 184,235)

損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計	99.25	169,105,873
-----------------------	-------	-------------

損益を通じて公正価値で測定する金融負債
先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉
(2021年：0.00% USD (12,086))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
EUR ^(ZS) _(CA)	8,421,558 USD	8,897,146	8,839,674	2022年 7 月29日	(0.03) (57,472)
USD ^(ZS) _(CA)	129,349 EUR	123,712	129,855	2022年 7 月29日	0.00 (506)
合計				(0.03)	(57,978)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.03)	(57,978)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	97.09
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	1.28
その他の資産	1.63
資産合計	100.00

^(ZS)_(CA) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

[次へ](#)

ジャナス・フォーティ・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式（2021年：97.56% USD 1,177,969,397）			
ケイマン諸島			
陸運・鉄道			
Grab Holdings Ltd., A	1	0.00	3
フランス			
繊維・アパレル・贅沢品			
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	24,096	1.82	14,688,741
オランダ			
半導体・半導体装置			
ASML Holding NV	54,920	3.24	26,135,330
台湾			
半導体・半導体装置			
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	126,413	1.28	10,334,263
英国			
ソフトウェア			
Atlassian Corp. plc, A.....	86,435	2.01	16,197,919
米国			
自動車			
Rivian Automotive, Inc., A.....	142,676	0.46	3,672,480
バイオテクノロジー			
AbbVie, Inc.....	194,687	3.69	29,818,261
資本市場			
Blackstone, Inc., A	269,534	3.05	24,589,587
化学			
Sherwin-Williams Co. (The).....	62,753	1.74	14,051,024
エンターテインメント			
Walt Disney Co. (The)	80,602	0.94	7,608,829
不動産投資信託（REITs）			
American Tower Corp.....	114,024	3.61	29,143,394
ヘルスケア機器・用品			
Align Technology, Inc.....	49,118	1.44	11,624,757
Dexcom, Inc.....	168,888	1.56	12,587,223
Edwards Lifesciences Corp.....	142,894	1.68	13,587,790
		4.68	37,799,770
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス			
UnitedHealth Group, Inc.....	44,535	2.83	22,874,512
ホテル・レストラン・レジャー			
Booking Holdings, Inc.....	9,850	2.13	17,227,551
Caesars Entertainment, Inc.	145,366	0.69	5,567,518
		2.82	22,795,069
家庭用品			
Procter & Gamble Co. (The).....	63,044	1.12	9,065,097
インタラクティブ・メディア／サービス			
Alphabet, Inc., C	18,050	4.89	39,483,473
Match Group, Inc.	195,229	1.69	13,605,509
Meta Platforms, Inc., A	132,933	2.66	21,435,446
Snap, Inc., A	971,772	1.58	12,759,366
		10.82	87,283,794
インターネット販売・カタログ販売			
Amazon.com, Inc.....	605,800	7.97	64,342,018
ITサービス			
Block, Inc., A.....	63,249	0.48	3,887,284
Mastercard, Inc., A	155,885	6.09	49,178,600
Twilio, Inc., A	151,478	1.57	12,695,371
		8.14	65,761,255
ライフサイエンス・ツール／サービス			
Danaher Corp.	136,893	4.30	34,705,113
機械			
Deere & Co.	85,894	3.19	25,722,676

ジャナス・フォーティ・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
金属・鉱業			
Freeport-McMoRan, Inc.	289,208	1.05	8,462,226
専門サービス			
CoStar Group, Inc.	340,985	2.55	20,598,904
半導体・半導体装置			
NVIDIA Corp.	59,481	1.12	9,016,725
Texas Instruments, Inc.	122,095	2.32	18,759,897
		3.44	27,776,622
ソフトウェア			
Microsoft Corp.	317,869	10.11	81,638,296
Workday, Inc., A.	203,266	3.51	28,371,868
		13.62	110,010,164
専門小売り			
TJX Cos., Inc. (The)	353,213	2.44	19,726,946
テクノロジー ハードウェア・コンピュータ記憶装置・周辺機器			
Apple, Inc.	289,166	4.90	39,534,775
繊維・アパレル・贅沢品			
NIKE, Inc., B	106,657	1.35	10,900,345
普通株式合計		97.06	783,599,117
政府発行証券 (2021年: 1.57% USD 18,900,018)			
米国財務省中期証券 / 長期証券			
0.0000%, 期日 5/7/22.	15,800,000	1.96	15,798,483
政府発行証券合計		1.96	15,798,483
投資有価証券合計 (取得原価: USD 827,691,881)		99.02	799,397,600

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年: 0.10% USD 1,260,053)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan					
EUR ^{EUR} 358,589	USD 374,952	376,393	2022年7月29日	0.00	1,441
USD ^{USD} 1,913,657	EUR 1,815,136	1,905,255	2022年7月29日	0.00	8,402
合計				0.00	9,843
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				99.02	799,407,443

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年：0.00% USD (82,099))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD ^(注)	7,505 USD	5,211	5,181	2022年7月29日	0.00 (30)
EUR ^(注)	44,853,573 USD	47,388,650	47,080,476	2022年7月29日	(0.04) (308,174)
USD ^(注)	153 AUD	223	152	2022年7月29日	0.00 (1)
合計				(0.04)	(308,205)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.04)	(308,205)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	96.75
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	1.95
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	1.30
資産合計	100.00

^(注) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式（2021年：98.90% USD 4,616,736,143）			
バミューダ			
バイオテクノロジー			
Myovant Sciences Ltd.	1,274,423	0.43	15,841,078
英国領、ヴァージン諸島			
バイオテクノロジー			
Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd.....	48,955	0.20	7,133,233
カナダ			
バイオテクノロジー			
Clementia Pharmaceuticals, Inc.*.....	502,243	—	—
Essa Pharma, Inc.	361,089	0.03	1,137,430
		0.03	1,137,430
ケイマン諸島			
バイオテクノロジー			
Canbridge Pharmaceuticals, Inc.	1,209,257	0.02	616,434
Canbridge Pharmaceuticals, Inc., Private Placement.....	2,531,300	0.04	1,290,360
Zai Lab Ltd.....	615,424	0.58	21,342,904
		0.64	23,249,698
デンマーク			
バイオテクノロジー			
Ascendis Pharma A/S	469,570	1.18	43,651,227
医薬品			
Novo Nordisk A/S, B	556,876	1.67	61,763,959
フランス			
医薬品			
Euroapi SA.....	1	0.00	10
Sanofi.....	889,911	2.42	89,844,972
		2.42	89,844,982
ドイツ			
医薬品			
Bayer AG, Registered.....	236,568	0.38	14,061,537
アイルランド			
バイオテクノロジー			
Horizon Therapeutics plc.....	597,437	1.28	47,651,575
ヘルスケア機器・用品			
Medtronic plc	347,683	0.84	31,204,549
STERIS plc.....	148,062	0.82	30,522,983
		1.66	61,727,532
ライフサイエンス・ツール/サービス			
ICON plc.....	83,440	0.49	18,081,448
医薬品			
Jazz Pharmaceuticals plc.....	327,044	1.37	51,022,134
日本			
医薬品			
Astellas Pharma, Inc.	2,623,100	1.10	40,889,273
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.....	871,115	0.66	24,512,950
		1.76	65,402,223
オランダ			
バイオテクノロジー			
Argenx SE	154,054	1.57	58,367,980
スイス			
医薬品			
Novartis AG	1,013,034	2.31	85,631,764
Roche Holding AG.....	290,467	2.61	96,923,755
		4.92	182,555,519

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
英国			
バイオテクノロジー			
Bicycle Therapeutics plc.....	426,436	0.19	7,155,596
Centessa Pharmaceuticals plc.....	719,600	0.09	3,504,452
		0.28	10,660,048
医薬品			
AstraZeneca plc	1,345,314	4.77	176,866,279
Royalty Pharma plc, A	841,489	0.95	35,376,198
		5.72	212,242,477
米国			
バイオテクノロジー			
4D Molecular Therapeutics, Inc.	324,793	0.06	2,267,055
AbbVie, Inc.....	975,339	4.03	149,382,921
Akero Therapeutics, Inc.....	857,464	0.22	8,103,032
Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	125,296	0.49	18,274,422
Amicus Therapeutics, Inc.	3,005,812	0.87	32,282,421
Arbor Biotechnologies, Inc., Private Placement*	145,324	0.07	2,408,019
Asher Biotherapeutics, Inc., Private Placement*	1,125,753	0.05	1,808,860
Attralus, Inc., Private Placement*.....	618,724	0.09	3,217,365
BioAtla, Inc.	452,212	0.03	1,288,804
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	594,056	1.33	49,229,421
Biomea Fusion, Inc.....	590,748	0.19	7,077,161
Black Diamond Therapeutics, Inc.....	0	0.00	1
C4 Therapeutics, Inc.	305,522	0.06	2,303,636
Design Therapeutics, Inc.	352,053	0.13	4,928,742
Disc Medicine, Inc., Private Placement*	998,749	0.06	2,396,998
DTX Pharma, Inc., Private Placement*.....	1,692,219	0.07	2,500,000
Element Biosciences, Inc., Private Placement*	377,635	0.17	6,212,096
Fate Therapeutics, Inc.	193,313	0.13	4,790,296
Flame Biosciences, Inc., Private Placement*	658,320	0.06	2,161,924
Galecto, Inc.	1	0.00	1
Gilead Sciences, Inc.	470,047	0.78	29,053,605
Global Blood Therapeutics, Inc.	929,863	0.80	29,709,123
Hemoshear Therapeutics LLC, Private Placement*.....	238,136	0.09	3,160,601
Icosavax, Inc.....	267,168	0.04	1,530,873
Insmmed, Inc.....	1,472,731	0.78	29,042,255
IVERIC bio, Inc.....	2,251,100	0.58	21,655,582
Janux Therapeutics, Inc.....	548,229	0.18	6,693,876
Mirati Therapeutics, Inc.	111,576	0.20	7,490,097
Moderna, Inc.	72,629	0.28	10,375,053
Neurocrine Biosciences, Inc.....	593,497	1.56	57,854,088
Neurogene, Inc., Private Placement*	1,025,013	0.07	2,501,032
Nuvalent, Inc., A	449,518	0.16	6,095,464
Olema Pharmaceuticals, Inc.	669,989	0.07	2,726,855
PTC Therapeutics, Inc.....	543,649	0.59	21,778,579
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	45,410	0.72	26,843,213
Rhythm Pharmaceuticals, Inc.....	666,917	0.07	2,767,706
Sage Therapeutics, Inc.	228,365	0.20	7,376,189
Sarepta Therapeutics, Inc.....	1,046,619	2.12	78,454,560
Seres Therapeutics, Inc.....	1,305,798	0.12	4,478,887
Shoreline Biosciences, Inc., Private Placement*	693,106	0.15	5,582,206
Sonoma Biotherapeutics, Inc., Private Placement*.....	1,134,227	0.06	2,241,573
SyntheKine, Inc., Private Placement*.....	1,903,567	0.15	5,460,001
Traverse Therapeutics, Inc.....	898,471	0.59	21,769,952
Tyra Biosciences, Inc.....	275,075	0.05	1,966,786
United Therapeutics Corp.	142,078	0.90	33,479,260
ValenzaBio, Inc., Private Placement*.....	591,513	0.14	5,264,720
Vaxcyte, Inc.	372,290	0.22	8,101,040
Vertex Pharmaceuticals, Inc.....	318,512	2.42	89,753,496
		22.20	823,839,847

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
ヘルスケア機器・用品			
Abbott Laboratories	860,431	2.52	93,485,828
Align Technology, Inc.....	158,578	1.01	37,530,655
Bigfoot Biomedical, Inc., Private Placement*.....	216,099	0.06	2,046,295
Boston Scientific Corp.	2,169,309	2.18	80,850,146
Cooper Cos., Inc. (The)	102,857	0.87	32,206,584
DENTSPLY SIRONA, Inc.	665,046	0.64	23,762,094
Dexcom, Inc.....	352,538	0.71	26,274,657
Edwards Lifesciences Corp.....	530,190	1.36	50,415,767
Globus Medical, Inc., A	440,665	0.67	24,738,933
ICU Medical, Inc.	81,691	0.36	13,429,183
Insulet Corp.	84,682	0.50	18,455,595
Intuitive Surgical, Inc.....	129,411	0.70	25,974,082
Lexeo Therapeutics, Inc., Private Placement*.....	1,441,449	0.07	2,479,999
Magnolia Medical Technologies, Inc., Private Placement*	1,712,518	0.08	2,907,308
Magnolia Medical Technologies, Inc., Private Placement, Warrant, 期日 31/12/22*	1	-	-
Penumbra, Inc.....	126,194	0.42	15,713,677
Silk Road Medical, Inc.	254,490	0.25	9,260,891
Stryker Corp.	168,824	0.91	33,584,158
Tandem Diabetes Care, Inc.....	105,985	0.17	6,273,252
Teleflex, Inc.....	177,713	1.18	43,690,741
		14.66	543,079,845
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス			
AmerisourceBergen Corp.	299,415	1.14	42,361,234
Centene Corp.....	842,517	1.92	71,285,363
Elevance Health, Inc.	156,663	2.04	75,602,431
Freenome Holdings, Inc., Private Placement*	320,124	0.10	3,735,847
Humana, Inc.....	163,490	2.06	76,524,764
LifeStance Health Group, Inc.	955,548	0.14	5,312,847
Privia Health Group, Inc.	408,219	0.32	11,887,337
Quest Diagnostics, Inc.	103,906	0.37	13,817,420
UnitedHealth Group, Inc.....	472,233	6.54	242,553,036
		14.63	543,080,279
ヘルスケア・テクノロジー			
Health Catalyst, Inc.	382,223	0.15	5,538,411
ライフサイエンス・ツール / サービス			
Danaher Corp.	320,955	2.19	81,368,512
Illumina, Inc.....	182,685	0.91	33,679,807
IQVIA Holdings, Inc.....	149,901	0.88	32,527,018
SomaLogic, Inc.	924,197	0.11	4,177,370
SomaLogic, Inc., Private Placement.....	554,342	0.00	11,087
Sotera Health Co.	366,355	0.19	7,176,894
Thermo Fisher Scientific, Inc.....	180,030	2.64	97,806,698
		6.92	256,747,386
医薬品			
Artiva Biotherapeutics, Inc., Private Placement*.....	205,690	0.04	1,583,813
Bristol-Myers Squibb Co.....	1,323,249	2.75	101,890,173
Catalent, Inc.....	195,837	0.57	21,011,352
Collegium Pharmaceutical, Inc.....	655,393	0.31	11,613,564
DICE Therapeutics, Inc.	334,665	0.14	5,194,001
Edgewise Therapeutics, Inc.	379,302	0.08	3,019,244
Elanco Animal Health, Inc.....	1,152,661	0.61	22,626,735
Eli Lilly & Co.	351,922	3.08	114,103,670
Harmony Biosciences Holdings, Inc.....	376,600	0.50	18,366,782
Johnson & Johnson	249,013	1.19	44,202,298
Merck & Co., Inc.	1,113,509	2.74	101,518,616
Neurogene, Inc., Private Placement*	1,382,125	0.09	3,372,385
Organon & Co.	1,258,193	1.15	42,464,014
Pfizer, Inc.....	928,742	1.31	48,693,943

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
Phathom Pharmaceuticals, Inc.	378,011	0.09	3,190,413
Ventyx Biosciences, Inc.	451,886	0.15	5,526,566
Zogenix, Inc.*	280,363	0.01	353,257
		14.81	548,730,826
専門サービス			
Dice, Inc., Private Placement	178,241	0.07	2,766,300
ソフトウェア			
Ventyx Energy LLC, Private Placement.....	59,254	0.02	724,676
普通株式合計		99.46	3,688,901,650
政府発行証券 (2021年: 0.26% USD 12,200,012)			
米国財務省中期証券 / 長期証券			
0.0000%, 期日 5/7/22.....	7,500,000	0.20	7,499,280
政府発行証券合計		0.20	7,499,280

優先株式 (2021年: 0.27% USD 12,558,013)

英国

陸運・鉄道

Bigfoot Ltd., Private Placement*..... 548,201 0.14 5,191,052

米国

ヘルスケア機器・用品

Lexeo Therapeutics, Inc., Private Placement*..... 2,660,459 0.12 4,577,293

ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス

Freenome Holdings, Inc., Private Placement* 239,046 0.08 2,789,667

優先株式合計
| | | 0.34 | 12,558,012 |
| 投資有価証券合計 (取得原価: USD 3,292,356,710)..... | | 100.00 | 3,708,958,942 |

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年: 0.23% USD 10,745,498)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan					
SGD ²³ / _{EA}	3,799 USD	2,726	2,735	2022年7月29日	0.00 9
USD ²³ / _{EA}	8,781,300 EUR	8,342,121	8,756,294	2022年7月29日	0.00 25,006
USD ²³ / _{EA}	6,179 SGD	8,564	6,165	2022年7月29日	0.00 14
合計				0.00	25,029
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				100.00	3,708,983,971

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・ライフサイエンス・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年：0.00% USD (358,951))

購入通貨		売却通貨		時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める 割合(%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan							
AUD ^(注1)	9,652,580	USD	6,702,635	6,663,855	2022年 7 月29日	0.00	(38,780)
CNH ^(注1)	3,244,989	USD	485,295	484,716	2022年 7 月29日	0.00	(579)
EUR ^(注1)	480,610,695	USD	507,752,832	504,472,179	2022年 7 月29日	(0.09)	(3,280,653)
SGD ^(注1)	33,045,805	USD	23,824,753	23,786,352	2022年 7 月29日	0.00	(38,401)
USD ^(注1)	110,195	AUD	160,103	110,530	2022年 7 月29日	0.00	(335)
USD ^(注1)	7,321	CNH	49,160	7,343	2022年 7 月29日	0.00	(22)
USD ^(注1)	129,603	EUR	123,947	130,101	2022年 7 月29日	0.00	(498)
USD ^(注1)	370,552	SGD	514,803	370,554	2022年 7 月29日	0.00	(2)
合計						(0.09)	(3,359,270)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計						(0.09)	(3,359,270)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳:	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	97.19
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	2.25
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	0.56
資産合計	100.00

* ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・プライシング・コミッティーにより2022年6月30日に公正価値評価されました。

^(注1) 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)[次へ](#)

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエスレート・ファンド

投資有価証券明細表

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
損益を通じて公正価値で測定する金融資産			
普通株式 (2021年: 97.93% USD 313,480,714)			
オーストラリア			
不動産投資信託 (REITs)			
Goodman Group	100,603	0.49	1,238,831
HealthCo REIT	2,388,027	0.89	2,266,461
Stockland	727,622	0.72	1,813,090
Vicinity Centres.....	2,171,751	1.09	2,750,759
		3.19	8,069,141
ベルギー			
不動産管理・開発			
VGP NV.....	6,000	0.38	955,730
バミューダ			
不動産管理・開発			
Kerry Properties Ltd.	518,500	0.57	1,440,498
カナダ			
不動産投資信託 (REITs)			
Dream Industrial Real Estate.....	531,110		
Investment Trust.....		1.97	4,984,314
Granite Real Estate Investment Trust.....	137,146	3.32	8,411,806
		5.29	13,396,120
フランス			
不動産投資信託 (REITs)			
Gecina SA	17,750	0.65	1,655,499
ICADE	30,000	0.58	1,463,148
		1.23	3,118,647
ドイツ			
不動産管理・開発			
LEG Immobilien SE	26,500	0.87	2,197,216
LEG Immobilien SE, Rights, 期日 6/7/22.....	31,250	0.05	118,313
		0.92	2,315,529
香港			
不動産投資信託 (REITs)			
Link REIT	471,500	1.52	3,845,644
日本			
不動産投資信託 (REITs)			
Activia Properties, Inc.....	844	0.99	2,516,200
Advance Residence Investment Corp.....	592	0.62	1,575,118
Hulic Reit, Inc.....	2,045	0.95	2,408,542
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	1,328	0.69	1,756,899
Japan Hotel REIT Investment Corp.	6,455	1.27	3,225,597
Japan Metropolitan Fund Invest.....	4,716	1.45	3,673,948
LaSalle Logiport REIT	1,252	0.61	1,536,394
Orix JREIT, Inc.....	1,828	0.98	2,481,704
		7.56	19,174,402
オランダ			
不動産管理・開発			
CTP NV.....	98,000	0.45	1,129,690
シンガポール			
不動産投資信託 (REITs)			
CapitaLand China Trust.....	1,649,500	0.54	1,365,382
CapitaLand Integrated Commercial Trust.....	2,528,300	1.56	3,949,047
Lendlease Global Commercial REIT.....	4,932,800	1.11	2,822,699
		3.21	8,137,128
スペイン			
各種電気通信サービス			
Cellnex Telecom SA.....	30,000	0.46	1,164,168
不動産投資信託 (REITs)			
Merlin Properties Socimi SA	290,000	1.10	2,797,450

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

銘柄	株数又は 元本価額	純資産に 占める割合 (%)	公正価値 (米ドル)
英国			
不動産投資信託 (REITs)			
Land Securities Group plc	205,000	0.65	1,656,989
Safestore Holdings plc.....	113,000	0.58	1,459,457
Segro plc	228,901	1.07	2,721,767
Supermarket Income Reit plc	804,000	0.46	1,169,557
UNITE Group plc (The)	137,000	0.70	1,774,434
		3.46	8,782,204
不動産管理・開発			
Helical plc	270,000	0.49	1,230,873
米国			
不動産投資信託 (REITs)			
Agree Realty Corp.....	122,051	3.47	8,803,539
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	47,786	2.73	6,930,404
CubeSmart	321,420	5.42	13,731,062
Digital Realty Trust, Inc.....	80,850	4.14	10,496,755
Equity LifeStyle Properties, Inc.	58,319	1.62	4,109,740
Essex Property Trust, Inc.....	21,274	2.20	5,563,364
First Industrial Realty Trust, Inc.	82,557	1.55	3,919,806
Healthcare Trust of America, Inc., A.....	140,697	1.55	3,926,853
Invitation Homes, Inc.....	362,533	5.09	12,898,924
Life Storage, Inc.....	103,789	4.57	11,589,080
Medical Properties Trust, Inc.....	404,148	2.44	6,171,340
National Retail Properties, Inc.....	277,718	4.71	11,941,874
Physicians Realty Trust	438,848	3.02	7,657,898
Prologis, Inc.....	40,717	1.89	4,790,355
SITE Centers Corp.....	391,083	2.08	5,267,888
SL Green Realty Corp.	68,839	1.25	3,176,925
Spirit Realty Capital, Inc.	295,291	4.40	11,156,094
Sun Communities, Inc.	49,731	3.13	7,925,132
UDR, Inc.	156,141	2.84	7,188,732
VICI Properties, Inc.	565,216	6.64	16,837,785
Welltower, Inc.	141,502	4.60	11,652,690
		69.34	175,736,240
普通株式合計.....		99.17	251,293,464
投資有価証券合計 (取得原価: USD 269,142,392)		99.17	251,293,464

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年: 0.10% USD 335,274)

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価益 (米ドル)
J.P. Morgan USD 円 570,195	EUR 539,113	565,879	2022年7月29日	0.00	4,316
合計				0.00	4,316
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計				99.17	251,297,780

ジャナス・ヘンダーソン・グローバル・リアルエステート・ファンド

損益を通じて公正価値で測定する金融負債

先渡為替予約、2022年6月30日現在の建玉

(2021年：0.00% USD (10,566))

購入通貨	売却通貨	時価 (米ドル)	決済日	純資産に 占める割合 (%)	未実現評価損 (米ドル)
J.P. Morgan					
AUD ^[注]	240,883 USD	167,266	166,299	2022年7月29日	0.00 (967)
EUR ^[注]	18,597,465 USD	19,647,790	19,520,796	2022年7月29日	(0.05) (126,994)
GBP ^[注]	442,210 USD	543,727	538,527	2022年7月29日	0.00 (5,200)
合計				(0.05)	(133,161)
損益を通じて公正価値で測定する金融負債合計				(0.05)	(133,161)

ポートフォリオ分析

資産合計の内訳：	資産合計に 占める割合 (%)
公的な証券取引所への上場が承認されている譲渡性有価証券	97.67
他の規制市場において取引されている譲渡性有価証券	0.05
OTC金融デリバティブ商品	0.00
その他の資産	2.28
資産合計	100.00

^[注] 当該先渡為替予約は、シェアクラスレベルでのヘッジを目的としています。

[前へ](#)

4 【管理会社の概況】

(1) 【資本金の額】

200,000米ドル（約26,922千円）（2022年7月末現在）

（ ） 発行する株式の総数

200株

（ ） 発行済株式の総数

200株

(2) 【事業の内容及び営業の状況】

アイルランド中央銀行の事前の承認を得た上で、信託証書は管理会社が管理事務を他者に委託することを承認しています。管理会社は管理事務代行会社を管理事務を代行する者として任命し、名義書換代理人、投資顧問会社及び総販売会社を任命しました。

管理会社は、ルクセンブルクAIFM法に従い、CSSFからAIFMとして認可を受けており、当ファンドのAIFMです。AIFMは、AIFM指令を遵守する義務を負い、この義務には、様々な組織的な要件を満たし、事業行為規範に従うこと、活動プログラム、様々な方針及び手続(リスク管理、流動性管理及び報酬等の分野に関するもの)を採用及び実施すること、並びに現在の資本、報告及び透明性の義務を遵守することが含まれますが、これらに限定されません。

(3) 【その他】

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を及ぼした事実または及ぼすことが予想される事実はありません。

5【管理会社の経理の概況】

1. 管理会社の直近2事業年度の日本文の財務諸表は、ルクセンブルグの法令に準拠して作成された原文（英語）の財務諸表を翻訳したものです。これは、「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」（平成5年大蔵省令第22号）に基づき「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）第131条第5項但し書きの規定の適用によるものです。
2. 管理会社の原文（英語）の財務諸表は、ルクセンブルグにおける独立監査人であり、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項に規定される外国監査法人等をいいます。以下同じ。）であるプライスウォーターハウスクーパース・ソシエテ・コーポラティブの監査を受けており、金融商品取引法第193条の2第1項第1号に規定される監査証明に相当すると認められる証明に係るその独立監査人の監査報告書を添付のとおり受領しています。本財務書類諸表に関する解釈は原文にのみ基づきます。
3. 管理会社の原文（英語）の財務諸表は米ドル（US\$）及びユーロ（€）で表示されています。日本文の財務諸表には円貨換算額を記載しています。円換算に用いた為替レートは、株式会社三菱UFJ銀行が発表した2022年3月31日の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝136.70円）を用いて算出した値を使用しています。金額は千円単位（単位金額未満は四捨五入）で表示されています。なお、日本円に換算された金額は、四捨五入のため合計欄の数値が総和と一致しない場合があります。
4. 管理会社には子会社がないため、連結財務諸表を作成していません。

[次へ](#)

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー
有限責任会社
マネジメント・レポート
2021年12月31日終了会計年度

業績及び配当

2021年12月31日に終了した会計年度において、ヘンダーソン・マネジメント・エスエー(以下「当社」という。)は、収益合計447.7百万ユーロ(2020年:255.3百万ユーロ)を計上した。

当会計年度に支払われた配当金はなかった(2020年:なし)。

リスク及び不確実性**取引先リスク**

現金残高は、ジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーにより承認された取引先かつ現行の信用格付A+を保有しているBNPパリバ・セキュリティーズ・サービスのルクセンブルク支店及びバンク・オブ・アメリカに預金されている。

流動性リスク

流動性リスクとは、支払期日が到来した時点で、当社が支払義務を履行できなくなるリスクである。当社の流動性は、当社が負債を充足するのに十分な現金を確保することにより管理されている。

その他のリスク

2021年において、COVID-19の発生が世界的なパンデミックに発展したことは、ウイルス自体の影響とその拡大を制限するために各国政府が講じた措置の両方を通じて、ルクセンブルクを含む多くの世界経済に重大な影響を及ぼしている。

現段階では、その影響の範囲や期間を予想し財務上の影響を見積もることは不可能であり、世界の経済状況が当社の収益を直接牽引する当社のAUM(受託資産残高)の構成、市場価値及びレベルに影響を与えることから予想することは困難である。

自己株式

当社は、自己株式を保有していない。

継続事業

財務諸表の承認日現在、取締役の見解では、当社は事業を継続する意思であり、管理会社/AIFMとして運用中の当ファンドにサービスを提供し続け、またインスティテューショナル・マンドートに投資管理サービスを提供する。

(署名)

ルクセンブルク、2022年6月1日
ヘンダーソン・マネジメント・エスエー

(1) 【資産及び負債の状況】

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー
有限責任会社
貸借対照表
2021年12月31日現在

	注	2021年		2020年	
		ユーロ	千円	ユーロ	千円
資産					
固定資産					
無形資産	3	13,589,750	1,857,719	16,309,368	2,229,491
有形資産	4	105,056	14,361	215,740	29,492
その他の非流動資産	5	1,336,835	182,745	1,838,894	251,377
金融資産					
関連会社株式	6	931,777	127,374	931,777	127,374
		15,963,418	2,182,199	19,295,779	2,637,733
流動資産					
債権					
営業債権	7	28,184,463	3,852,816	25,944,673	3,546,637
関連会社に対する債権		3,973,065	543,118	10,631,325	1,453,302
その他の債権		35,965,478	4,916,481	56,037,377	7,660,309
投資					
その他の投資	8	73,619	10,064	73,619	10,064
現金預金及び手許現金		45,404,845	6,206,842	39,330,484	5,376,477
		113,601,470	15,529,321	132,017,478	18,046,789
資産合計		129,564,889	17,711,520	151,313,257	20,684,522
資本準備金及び負債					
資本金及び準備金					
払込資本	9	174,952	23,916	174,952	23,916
準備金:					
法定準備金	10	30,617	4,185	30,617	4,185
その他の準備金(公正価値準備金を含む)	11	17,919,010	2,449,529	17,441,111	2,384,200
繰越剰余金	12	26,780,831	3,660,940	20,427,793	2,792,479
当期利益	13	13,626,802	1,862,784	6,892,013	942,138
		58,532,213	8,001,354	44,966,486	6,146,919
債務					
関連会社に対する債務		53,733,039	7,345,306	96,287,182	13,162,458
その他の債務					
未払税金		6,203,082	847,961	2,041,004	279,005
未払社会保険		764,538	104,512	604,967	82,699
その他の債務		10,332,017	1,412,387	7,413,618	1,013,442
		71,032,676	9,710,167	106,346,771	14,537,604
資本準備金及び負債合計		129,564,889	17,711,520	151,313,257	20,684,522

添付の注記は、当年次財務諸表の一部を構成する。

(2) 【損益の状況】

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー
有限責任会社
損益計算書

2021年12月31日終了会計年度

	注	2021年		2020年	
		ユーロ	千円	ユーロ	千円
純収益	14	447,641,426	61,192,583	255,277,673	34,896,458
その他受取利息及び類似の収益		63,194	8,639	4	1
その他の外部委託費用	15	(412,602,708)	(56,402,790)	(228,710,530)	(31,264,729)
人件費	16	(11,229,380)	(1,535,056)	(9,993,641)	(1,366,131)
支払利息及び類似の費用		(207,115)	(28,313)	(149,647)	(20,457)
その他の営業費用	17	(4,946,457)	(676,181)	(6,387,413)	(873,159)
法人所得税	19	(5,092,158)	(696,098)	(3,144,433)	(429,844)
当期利益		13,626,802	1,862,784	6,892,013	942,138

添付の注記は、当年次財務諸表の一部を構成する。

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー
有限責任会社
年次財務諸表に対する注記

1. 概要

ヘンダーソン・マネジメント・エスエー(以下「当社」という。)は、1985年5月30日に無期限のソシエテ・アノニムとしてルクセンブルクで設立された。当社の登記上の事務所はルクセンブルクに設立された。当社の会計年度は、毎年1月1日から12月31日までである。

当社は、1985年5月30日及び2000年9月26日にルクセンブルクでそれぞれ設立された「変動資本を有する会社型投資信託」(SICAV)であるジャナス・ヘンダーソン・ホライゾン・ファンド及びジャナス・ヘンダーソン・ファンドの管理会社として業務を行っている。また当社は、ジャナス・ヘンダーソン・キャピタル・ファンズ・ピーエルシー、アイリッシュ・インベストメント・カンパニー並びにジャナス・セレクション(アイルランドのユニット・トラスト)と2つのプールされたヘッジ・ファンドのAIFMのUCITS管理会社として業務を行っている。また、当社は複数の分離口座の投資管理会社として業務を行っている。2013年10月18日、ヘンダーソン・マネジメント・エスエーは、倒産法第15章(Chapter 15)に基づく管理会社としてCSSFにより承認されている。

当社は、ジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーの子会社である。

ジャージー島で登記されたジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーは、自社を最終的な持株会社とみなし、当社の業績を連結年次財務諸表に含めている。ジャナス・ヘンダーソン・グループ・ピーエルシーの年次報告書及び年次財務諸表は、13 キャッスル・ストリート、セント・ヘリア、ジャージー島、郵便番号JE1 1ESから入手することができる。

２．重要な会計方針の要約

年次財務諸表は、取得原価に基づき、ルクセンブルグ大公国で有効な一般に公正妥当と認められる会計原則及び規則に準拠して作成される。

会計方針及び評価基準は、2002年12月19日の法律に規定されたものに加えて、取締役会により改正、決定及び適用される。

年次財務諸表の作成には、特定の会計上の見積りを使用する必要がある。また、会計方針を適用する過程において、取締役会の判断が必要な場合がある。

仮定の変更は、仮定が変更された期間の年次財務諸表に重要な影響を及ぼす可能性がある。

経営者は、基礎となる仮定は適切であると考えており、したがって、年次財務諸表は、財政状態及び業績を公正に表示するものであると考えている。

当社は、翌会計年度の資産及び負債の報告金額に影響を与える見積り及び仮定を行っている。見積り及び判断は、継続的に評価され、過去の経験及びその状況下で合理的であると考えられる将来事象の予測を含むその他の要因に基づいて行われる。

重要な会計方針は以下のとおりである。

無形資産

無形資産は、取得価額から償却累計額を控除した金額で計上される。償却は、資産の残存期間にわたり定額法で以下のように認識される。

- 欧州支店の事業の買収に伴い認識されたのれん - 10年

有形資産

有形固定資産は、建物付属設備、器具及び備品、事務機器からなり、取得原価から減価償却累計額を控除した額で表示される。資産の減価償却費は、見積耐用年数にわたって定額法で計算される。

金融資産

固定資産として保有されている投資は、取得原価から減損引当金を控除した金額で表示される。

外貨換算

当社の財務諸表は、ユーロで表示される。他の通貨建の取引は、取引日の実勢為替レートでユーロに換算されている。他の通貨建の投資は、取得日の為替レートでユーロに換算される。他の通貨建のその他の資産及び負債は、貸借対照表日の為替レートでユーロに換算される。為替差損益は損益計算書に反映される。

債権

債権はその額面価額で評価される。債務は、その支払い金額が変動した場合には、評価の調整の対象となる。こうした評価調整は、その理由がもはや該当しなくなった場合には継続されない。

譲渡可能証券

投資は、取得原価から減損引当金を控除した金額で計上される。

債務

債務は、その額面価額で評価される。債務は、その支払い金額が変動した場合には、評価の調整の対象となる。こうした評価調整は、その理由がもはや該当しなくなった場合には継続されない。

収益及び費用

収益及び費用は発生主義で会計処理される。

リース

当社は、開始時に契約がリースであるか否かを判断する。使用权(以下「ROU」という。)資産は、リース期間中に原資産を使用する当社の権利を表し、リース債務は、当該リースから生じるリース料を支払う当社の債務を表している。ROU資産は、当社の貸借対照表のその他の非流動資産に含まれている。リース債務はその他の債務に含まれている。

3. 無形資産

	2021年 ユーロ	支店ののれん ユーロ	投資管理契約 ユーロ	2020年 ユーロ
取得原価				
1月1日現在	17,807,952	7,100,000	10,707,952	7,100,000
増加	—	—	—	10,707,952
12月31日現在	17,807,952	7,100,000	10,707,952	17,807,952
償却				
1月1日現在	(1,498,584)	(1,242,500)	(256,084)	(532,500)
当期償却費用	(2,719,619)	(710,000)	(2,009,618)	(966,084)
12月31日現在	(4,218,202)	(1,952,500)	(2,265,702)	(1,498,584)
正味帳簿価額				
1月1日現在	16,309,368	5,857,500	10,451,868	6,567,500
12月31日現在	13,589,750	5,147,500	8,442,250	16,309,368

4. 有形資産

全ての有形資産は、建物付属設備、什器備品及び事務用機器により構成されている。

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
取得原価		
1月1日現在	724,239	636,840
増加	320,686	87,399
12月31日現在	1,044,925	724,239
減価償却費		
1月1日現在	(508,499)	(187,814)
当期償却費用	(431,369)	(320,685)
12月31日現在	(939,868)	(508,499)
正味帳簿価額		
1月1日現在	215,740	449,026
12月31日現在	105,056	215,740

5. その他の非流動資産

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
オペレーティング・リース資産	1,175,394	1,677,454
長期差入保証金	161,440	161,440
	1,336,835	1,838,894

6. 関連会社株式

2021年12月31日現在、当社はヘンダーソン・ファンド・マネジメント(ルクセンブルク)エスエーの株式を100%保有していた。同社は2014年12月1日より清算中である。

同社への投資の帳簿価額は、0.9百万ユーロ(2020年:0.9百万ユーロ)である。帳簿価額は、2021年12月31日現在の同社の純資産価額を表している。

7. 営業債権

営業債権及びその他の債権は、主にジャナス・ヘンダーソン・ホライゾン・ファンド、ジャナス・ヘンダーソン・ファンド、アイリッシュ・インベストメント・カンパニー・ファンド、プールされたヘッジ・ファンド及びインスティテューショナル・マンドートからの未収管理会社報酬からなる取引債権から構成されている。

8. その他の投資

2021年12月31日現在、当社はジャナス・ヘンダーソン・ホライゾン・ファンドの受益証券を取得価額73,619ユーロ(2020年:73,619ユーロ)計上している。(市場価額は200,195ユーロ(2020年:177,640ユーロ)である。)

9. 払込資本

	2021年 ユーロ	2021年 米ドル	2020年 ユーロ	2020年 米ドル
授權・発行・全額払込済: 1口当たり1,000米ドルの200口	174,952	200,000	174,952	200,000

当社の資本金は、AIFM及びUCITS管理会社に必要な最低資本金額125,000ユーロ(150,105米ドル)を満たしている。

当社は、自己株式を保有していない。

10. 法定準備金

ルクセンブルクの会社は、繰越損失を控除した後の当期利益の最低5%を、当該準備金が払込株式資本の額面価額の10%に達するまで、法定準備金として積み立てることが要求されている。この準備金は、現金配当あるいはその他の形で、会社の存続期間中に分配することはできない。法定準備金の積み立てを行うには、年次株主総会の承認が必要である。

法定準備金が払込株式資本の額面価額の10%を超えているため、追加の準備金の積み立ては必要ない。

11. その他の準備金（公正価値準備金を含む）

	純資産税の減額 ユーロ	制限付準備金 ユーロ
2017年	51,400	257,000
2018年	42,545	212,725
2019年	78,217	391,083
2020年	121,118	605,591
2021年	216,990	1,084,950
	510,270	2,551,349

2021年に、ルクセンブルグ純資産税法の第8a項に従い、当社の純資産税は216,990ユーロ減額された。年次株主総会の承認を前提として、制限付準備金には2021年の純資産税の5倍に相当する1,084,950ユーロが割り当てられていた。

2022年に、当社の純資産税は278,765ユーロ減額されると予想されている。年次株主総会の承認を受けて、制限付準備金には2022年の潜在的な純資産税債務の5倍に5%のバッファを加えたものに相当する1,464,094ユーロが割り当てられる予定である。さらに、2017年の制限付準備金257,000ユーロのリリースについても、必要な期間である5年間にわたって保有されていたため、承認が要請されている。

12. 繰越剰余金

当期繰越剰余金の増減は以下のとおりである。

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
12月31日現在の繰越剰余金	20,427,793	14,716,491
12月31日終了会計年度の当期利益	6,892,013	6,177,668
配当金	—	—
その他の準備金への振替(注記11)	(1,084,950)	(605,591)
その他の準備金からの振替	545,975	139,225
12月31日現在の繰越剰余金	26,780,831	20,427,793

13. 累積利益の配分案

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
12月31日現在の繰越損益(当期損益配分前)	26,780,828	20,427,793
12月31日終了会計年度の当期利益	13,626,802	6,892,011
制限付準備金への振替(注記11)	(1,464,094)	(1,084,950)
制限付準備金からの振替(注記11)	257,000	545,975
12月31日現在の繰越損益	39,200,537	26,780,828

定款の定めに従い、取締役会又は株主総会は、中間配当を支払うことを承認することができる。ただし、(i)十分な資金が利用可能であることを示す中間財務諸表が作成されていること、及び(ii)分配される金額が、年次財務諸表が承認された前会計年度末以降に行われた利益の合計に、繰越利益及びこの目的のために利用可能な準備金から繰越欠損金及び準備金に分配すべき金額を控除した金額を超過しないことを条件とする。2021年中に支払われた配当金はない。

14. 純収益

純収益は、主に受取管理会社報酬からなる。

当社とジャナス・ヘンダーソン・ホライゾン・ファンド、ジャナス・ヘンダーソン・ファンド及びアイリッシュ・インベストメント・カンパニー・ファンドの間の管理契約に基づき、当社は当ファンドから管理会社報酬を受け取る権利を有している。これはファンドによって異なり、報酬の年率の範囲は以下のとおりである。

ジャナス・ヘンダーソン・ホライゾン・ファンド:管理者報酬は該当する受益証券のクラスの純資産価値の年率0.15%から1.75%である。

ジャナス・ヘンダーソン・ファンド:管理者報酬は該当する受益証券のクラスの純資産価値の年率0.65%から2.25%。

アイリッシュ・インベストメント・カンパニー:管理者報酬は該当する受益証券のクラスの純資産価値の年率0.35%から1.50%。

プールされたヘッジ・ファンド:管理者報酬は該当する受益証券のクラスの純資産価値の年率0.20%から1.30%。

インスティテューショナル・マンドート:管理者報酬は該当する受益証券のクラスの純資産価値の年率0.15%から0.4%。

15. その他の外部委託費用

グループ移転価格方針に従い、当社は、ジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・UK・リミテッド、ジャナス・キャピタル・マネジメント及びジャナス・ヘンダーソン・インベスターズ・インターナショナルに投資管理及び販売業務を再委託し収益の一部を移転している。

16. 人件費

以下の人件費は、ルクセンブルグ及び支店に拠点を置く従業員の報酬に関連している。全ての従業員は、当社又は支店のいずれかと雇用契約を締結している。

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
給与、賃金及び賞与	8,480,291	7,982,411
社会保険及び年金費用	2,749,089	2,011,230
	11,229,380	9,993,641

当社の年間平均雇用従業員数は48人(2020年: 46人)である。

17. その他の営業費用

その他の営業費用の内訳:

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
為替差損 / (益)	(1,361,990)	1,829,336
その他の営業費用	6,308,446	4,558,077
	4,946,457	6,387,413

18. 監査報酬

2021年に、当社は28,360ユーロ(2020年:27,000ユーロ)の監査報酬を計上した。2021年のLFR及びAMLのレポートに関連する報酬は23,000ユーロ(2020年:なし)であり、これはその他の営業費用に含まれている。

19. 法人所得税

	2021年 ユーロ	2020年 ユーロ
ルクセンブルクの税金:		
法人所得税	3,109,362	1,525,359
地方事業税	1,152,650	566,069
純資産税	—	64,772
前年調整	(1,215)	87
ルクセンブルグの当期税金合計	4,260,797	2,156,287
外国税:		
当期税金	808,897	654,494
前年調整	22,463	333,653
当期外国税合計	831,360	988,146
法人所得税費用合計	5,092,158	3,144,433

20. 後発事象

取締役会は、年次財務諸表の承認日である2022年6月1日の時点で、報告日に重要な状況に関する情報が存在することを認識しておらず、これは表示されている年次財務諸表に反映されていない。

2022年2月24日、ロシアはウクライナに侵攻した。この侵攻は国際的に広く非難され、ロシアに対する経済制裁につながった。当グループは、ウクライナまたはロシアに従業員や事務所を保有しておらず、これらの国に拠点を置く資産に対するエクスポージャーは非常に限られている。当グループは、このような状況に対応するためのプロセスを文書化及びテストし、当グループの事業に対する潜在的な混乱を最小限に抑え、課せられるすべての適用可能な制裁が適時に実施されるように取り組んできた。また、当グループは、顧客の資産を保護し続けるために、情報セキュリティ・プロセス及びシステムを強化するための措置を講じている。制裁の影響はさらなるインフレ圧力をもたらし、金融市場に幅広い影響を与える可能性があるため、この侵攻は世界経済にも重大な影響を与える可能性がある。そのような影響は不確実性が高く、急速に変化するものであり、当グループの業績及び事業運営に悪影響を及ぼす可能性がある範囲を予測することはできない。当グループの経営陣は、可能な限りリスクを軽減することを目的として、状況及び関連するリスクを監視している。

[次へ](#)

MANAGEMENT REPORT**For the year ended 31 December 2021****RESULTS AND DIVIDENDS**

During the year ended 31 December 2021, Henderson Management S.A. ("the Company") recorded total income of €447.7m (2020: €255.3m).

There were no dividends paid in the year (2020: nil).

RISKS & UNCERTAINTIES**Counterparty risk**

Cash balances are held with BNP Paribas Securities Services Luxembourg Branch and Bank of America which are approved counterparties of Janus Henderson Group plc and hold a current credit rating of A+.

Liquidity risk

Liquidity risk is the risk that the Company may be unable to meet its payment obligations as they fall due. The Company's liquidity is managed to ensure that the Company has sufficient cash to meet its liabilities.

Other risk

During 2021, the development of the COVID-19 outbreak to a global pandemic has had significant implications on many global economies including Luxembourg, both through the effects of the virus itself and the measures taken by governments to restrict its spread.

While it is too early to determine the full extent and duration of this or make an estimate of its financial effect, global economic conditions impact the mix, market values and levels of the Company's AUM which directly drive the Company's revenue, and are difficult to predict.

OWN SHARES

The Company has not acquired any of its own shares.

ON-GOING OPERATIONS

As at the date of approving the accounts, it is the view of the Directors that the on-going operations of the Company remain unchanged and it will continue to provide services as Management Company/AIFM to the Funds under management as well as providing investment management services to the Institutional Mandates.

Luxembourg, 1 June 2022

Henderson Management S.A

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

BALANCE SHEET

As at 31 December 2021

	Note	2021 €	2020 €
ASSETS			
Fixed assets			
Intangible assets	3	13,589,750	16,309,368
Tangible assets	4	105,056	215,740
Other non-current assets	5	1,336,835	1,838,894
Financial assets			
Shares in affiliated undertakings	6	931,777	931,777
		<u>15,963,418</u>	<u>19,295,779</u>
Current assets			
Debtors			
Trade debtors	7	28,184,463	25,944,673
Amounts owed by affiliated undertakings		3,973,065	10,631,325
Other debtors		35,965,478	56,037,377
Investments			
Other investments	8	73,619	73,619
Cash at bank and in hand		45,404,845	39,330,484
		<u>113,601,470</u>	<u>132,017,478</u>
Total (assets)		<u>129,564,889</u>	<u>151,313,257</u>
CAPITAL, RESERVES AND LIABILITIES			
Capital and reserves			
Subscribed capital	9	174,952	174,952
Reserves:			
Legal reserve	10	30,617	30,617
Other reserves, including the fair value reserve	11	17,919,010	17,441,111
Profit or loss brought forward	12	26,780,831	20,427,793
Profit or loss for the financial year	13	13,626,802	6,892,013
		<u>58,532,213</u>	<u>44,966,486</u>
Creditors			
Amounts owed to affiliated undertakings		53,733,039	96,287,182
Other creditors			
Tax authorities		6,203,082	2,041,004
Social security authorities		764,538	604,967
Other creditors		10,332,017	7,413,618
		<u>71,032,676</u>	<u>106,346,771</u>
Total (capital, reserves and liabilities)		<u>129,564,889</u>	<u>151,313,257</u>

The accompanying notes form an integral part of these annual accounts.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

PROFIT AND LOSS ACCOUNT

For the year ended 31 December 2021

	Note	<u>2021</u>	2020
		€	€
Net turnover	14	447,641,426	255,277,673
Other interest receivable and similar income		63,194	4
Other external expenses	15	(412,602,708)	(228,710,530)
Staff costs	16	(11,229,380)	(9,993,641)
Interest payable and similar expenses		(207,115)	(149,647)
Other operating expenses	17	(4,946,457)	(6,387,413)
Tax on profit or loss	19	(5,092,158)	(3,144,433)
Profit or loss for the financial year		13,626,802	6,892,013

The accompanying notes form an integral part of these annual accounts.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

NOTES TO THE ANNUAL ACCOUNTS

1. GENERAL INFORMATION

Henderson Management S.A. ("the Company") was incorporated in Luxembourg on 30 May 1985 as a société anonyme for an unlimited period. The registered office of the Company is established in Luxembourg. The Company's financial year starts on 1st January and ends on the 31st December of each year.

The Company acts as a management company for the Janus Henderson Horizon Fund and the Janus Henderson Fund, both "sociétés d'investissement à capital variable" (SICAV), incorporated in Luxembourg on 30 May 1985 and 26 September 2000 respectively. The company also acts as UCITS Manager for the Janus Henderson Capital Funds plc, an Irish Investment Company as well as AIFM for both the Janus Selection (an Irish unit trust) and two Pooled Hedge Funds. Finally, the Company acts as Investment Manager for a number of segregated accounts. On 18 October 2013 Henderson Management S.A. was approved by the CSSF as a Chapter 15 Management Company.

The Company is a subsidiary of Janus Henderson Group plc.

Janus Henderson Group plc, registered in Jersey includes the results of the Company in its consolidated annual accounts. Copies of the Annual Report and Accounts of Janus Henderson Group plc may be obtained from 13 Castle Street, St Helier, Jersey, postal code JE1 1ES.

2. SUMMARY OF SIGNIFICANT ACCOUNTING POLICIES

The annual accounts are prepared in accordance with the generally accepted accounting principles and regulations in force in the Grand Duchy of Luxembourg under the historical cost.

Accounting policies and valuation rules are, besides the ones laid down by the law of 19 December 2002, as amended, determined and applied by the Board of Directors.

The preparation of annual accounts requires the use of certain accounting estimates. It also requires the Board of Directors to exercise its judgement in the process of applying the accounting policies.

Changes in assumptions may have a significant impact on the annual accounts in the period in which the assumptions changed.

Management believes that the underlying assumptions are appropriate and that the annual accounts therefore present the financial position and results fairly.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

2. SIGNIFICANT ACCOUNTING POLICIES (continued)

The Company makes estimates and assumptions that affect the reported amounts of assets and liabilities in the next financial year. Estimates and judgements are continually evaluated and are based on historical experience and other factors, including expectations of future events that are believed to be reasonable under the circumstances.

The significant accounting policies are as follows:

Intangible assets

Intangible fixed assets are carried at purchase price less accumulated amortisation. Amortisation is recognised on a straight-line basis over the remaining life of the assets as follows:

- Goodwill recognised on the acquisition of the European branch businesses - 10 years.

Tangible assets

Property, plant and equipment are comprised of leasehold improvements, fixtures & fittings and office equipment which are shown at cost less accumulated depreciation. The depreciation of the assets is calculated over their expected useful lives on a straight line basis.

Financial assets

Investments held as fixed assets are shown at cost less any provision for permanent diminution in value.

Foreign currency translation

The accounts of the Company are expressed in Euros (EUR or €). Transactions in other currencies are translated into Euros at the rates of exchange that the actual rates prevailing on the dates of the transactions. Investments acquired in other currencies are translated into Euros at the exchange rates prevailing at the date of acquisition. Other assets and liabilities denominated in other currencies are translated into Euros at the balance sheet date exchange rate. Exchange gains and losses are reflected in the profit and loss account.

Debtors

Debtors are valued at their nominal value. They are subject to value adjustments where their recovery is compromised. These value adjustments are not continued if the reasons for which the value adjustments were made have ceased to apply.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

2. SIGNIFICANT ACCOUNTING POLICIES (continued)

Transferable securities

Investments are stated at cost less any provision for permanent diminution in value.

Creditors

Amounts due to creditors are valued at their nominal value. They are subject to value adjustments where their recovery is compromised. These value adjustments are not continued if the reasons for which the value adjustments were made have ceased to apply.

Income and expenses

Income and expenses are accounted on an accruals basis.

Leases

The Company determines if an arrangement is a lease at inception. Right-of-use ("ROU") assets represent the Company's right to use an underlying asset for the lease term, and lease liabilities represent the Company's obligation to make lease payments arising from the lease. ROU assets are included in other non-current assets in the Company's Balance Sheet. Lease liabilities are included in other creditors.

3. INTANGIBLE ASSETS

Cost	2021 €	Branch goodwill €	Investment Management Contracts €	2020 €
At 1 January	17,807,952	7,100,000	10,707,952	7,100,000
Additions	-	-	-	10,707,952
At 31 December	17,807,952	7,100,000	10,707,952	17,807,952
Amortisation				
At 1 January	(1,498,584)	(1,242,500)	(256,084)	(532,500)
Charge for the year	(2,719,619)	(710,000)	(2,009,618)	(966,084)
At 31 December	(4,218,202)	(1,952,500)	(2,265,702)	(1,498,584)
Net book value				
At 1 January	16,309,368	5,857,500	10,451,868	6,567,500
At 31 December	13,589,750	5,147,500	8,442,250	16,309,368

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

4. TANGIBLE ASSETS

All tangible assets consist of leasehold improvements, fixtures & fittings and office equipment.

	2021 €	2020 €
Cost		
At 1 January	724,239	636,840
Additions	320,686	87,399
At 31 December	1,044,925	724,239
Depreciation		
At 1 January	(508,499)	(187,814)
Charge for the year	(431,369)	(320,685)
At 31 December	(939,868)	(508,499)
Net book value		
At 1 January	215,740	449,026
At 31 December	105,056	215,740

5. OTHER NON-CURRENT ASSETS

	2021 €	2020 €
Operating lease asset	1,175,394	1,677,454
Rental deposits	161,440	161,440
	1,336,835	1,838,894

6. SHARES IN AFFILIATED UNDERTAKINGS

As at 31 December 2021, the Company held 100% of Henderson Fund Management (Luxembourg) S.A.. The entity has been in liquidation since 1 December 2014.

The carrying value of the investment in the company amounts to €0.9m (2020: €0.9m). The carrying value was supported by the net assets of the company as at 31 December 2021.

7. TRADE DEBTORS

Trade and other receivables mainly comprise of trade debtors which relate to management fees receivable from the Janus Henderson Horizon Funds, Janus Henderson Fund, Irish Investment Company funds, Pooled Hedge Funds and institutional Mandates.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

8. OTHER INVESTMENTS

As at 31 December 2021, the Company held shares in Janus Henderson Horizon Fund at a cost of €73,619 (2020: €73,619) and a market value of €200,195 (2020: €177,640).

9. SUBSCRIBED CAPITAL

	2021 €	2021 \$	2020 €	2020 \$
Authorised, issued and fully paid 200 shares of \$1,000 each	174,952	200,000	174,952	200,000

The capital of the Company exceeded the minimum of EUR 125,000 (USD 150,105) required for an AIMF and UCITS management company.

The Company has not acquired any of its own shares.

10. LEGAL RESERVE

Luxembourg companies are required to appropriate to the legal reserve a minimum of 5% of the annual net income, after deducting any losses brought forward, until this reserve equals 10% of the nominal value of the subscribed share capital. This reserve may not be distributed in the form of cash dividends, or otherwise, during the life of the Company. The appropriation to legal reserve is effected after approval at the general meeting of shareholders.

As the legal reserve is above 10% of the nominal value of the subscribed share capital, no additional appropriation is required.

11. OTHER RESERVES, INCLUDING THE FAIR VALUE RESERVE

	Reduction in net worth tax €	Restricted reserve €
2017	51,400	257,000
2018	42,545	212,725
2019	78,217	391,083
2020	121,118	605,591
2021	216,990	1,084,950
	510,270	2,551,349

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

In 2021, the net worth tax of the Company was reduced by an amount of EUR 216,990 in accordance with paragraph 8a of the Luxembourg Net Wealth Tax Law. Subject to approval of this by the Annual General Meeting of the Shareholders an amount of EUR 1,084,950 has been allocated to restricted reserves corresponding to five times the amount of the 2021 net worth tax.

In 2022, the net worth tax of the Company is expected to be reduced by an amount of EUR 278,765. Upon approval of this by the Annual General Meeting of the Shareholders an amount of EUR 1,464,094 will be allocated to restricted reserves corresponding to five times the potential 2022 net worth tax liability plus a 5% buffer. In addition, approval is also requested for the release of the 2017 restricted reserve amounting to EUR 257,000 as this has been held for the required five-year period.

12. PROFIT OR LOSS BROUGHT FORWARD

The movement for the year of the profit brought forward is as follows:

	2021 €	2020 €
Results brought forward as at 31 December	20,427,793	14,716,491
Profit for the financial year ended 31 December	6,892,013	6,177,668
Dividend	-	-
Transfer to Restricted Reserve (Note 11)	(1,084,950)	(605,591)
Transfer from Restricted Reserve	545,975	139,225
Results brought forward as at 31 December	26,780,831	20,427,793

13. PROPOSED ALLOCATION OF THE ACCUMULATED PROFIT

	2021 €	2020 €
Results brought forward as at 31 December (before allocation of the current year results)	26,780,828	20,427,793
Profit for the financial year ended 31 December	13,626,802	6,892,011
Transfer to Restricted Reserve (Note 11)	(1,464,094)	(1,084,950)
Transfer from Restricted Reserve (Note 11)	257,000	545,975
Results carried forward as at 31 December	39,200,537	26,780,828

In accordance with the Articles of Incorporation, the Board of Directors or the general meeting of shareholders may approve the payment of interim dividends, under the reservation that (i) interim accounts have been drawn-up showing that sufficient funds are available and (ii) the amount to be distributed does not exceed total profits made since the end of the last financial year for which the annual accounts have been approved, plus any profits carried forward and sums drawn from reserves available for this purpose, less losses carried forward and any sums to be allocated to reserve. There were no dividends paid in 2021.

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

14. NET TURNOVER

Net turnover relates to management fees received

Under the terms of a management agreement between the Company the Janus Henderson Horizon Funds, the Janus Henderson Fund and the Irish Investment Company Fund, the Company is entitled to receive management fees from the Funds. This varies between the Funds and ranges and the fee rate per annum is as follows:

Janus Henderson Horizon Funds: management fee between 0.15% and 1.75% per annum of the net asset value of the relevant classes of units.

Janus Henderson Fund: management fee between 0.65% and 2.25% per annum of the net asset value of the relevant classes of units.

Irish Investment Company: management fee between 0.35% and 1.50 % per annum of the net asset value of the relevant classes of units.

Pooled Hedge Funds: management fee between 0.20% and 1.30% per annum of the net asset value of the relevant classes of units.

Institutional Mandates: management fee between 0.15% and 0.45% per annum of the net asset value of the relevant classes of units.

15. OTHER EXTERNAL EXPENSES

In line with the group transfer pricing policy, the Company shared revenue with Janus Henderson Investors UK Limited, Janus Capital Management and Janus Henderson Investors International income for investment management and distribution services.

16. STAFF COSTS

The following staff costs relate to the remuneration of employees based in Luxembourg and the branches. All employees have contracts of employment with either the Company or its branches.

	2021	2020
	€	€
Salaries, wages and bonuses	8,480,291	7,982,411
Social security and pension costs	2,749,089	2,011,231
	<u>11,229,380</u>	<u>9,993,642</u>

Average number of persons employed by the Company during the year is 48 (2020: 46)

HENDERSON MANAGEMENT S.A.
Société Anonyme

17. OTHER OPERATING EXPENSES

Other operating expenses consists of:

	2021	2020
	€	€
Exchange loss/(gain)	(1,361,990)	1,829,336
Other operating charges	6,308,446	4,558,077
	<u>4,946,457</u>	<u>6,387,413</u>

18. AUDIT FEES

In 2021, the Company recorded an audit fee expense amounting to €28,360 (2020: €27,000) the fees related to the LFR and AML report 2021 amounted to €23,000 (2020: NIL) and this is included in other operating expenses.

19. TAX ON PROFIT OR LOSS

	2021	2020
	€	€
Luxembourg taxes:		
Corporate Income Tax	3,109,362	1,525,359
Municipal Business Tax	1,152,650	566,069
Net Wealth Tax	-	64,772
Prior year adjustment	(1,215)	87
Total Luxembourg current taxes	<u>4,260,797</u>	<u>2,156,287</u>
Foreign taxes:		
Current tax	808,897	654,494
Prior year adjustment	22,463	333,653
Total Foreign current taxes	<u>831,360</u>	<u>988,146</u>
Total income tax charge	<u>5,092,158</u>	<u>3,144,433</u>

20. POST BALANCE SHEET EVENTS

The Board of Directors is not aware of, as at 1 June 2022, being the date the annual accounts were approved, any information concerning significant conditions in existence at the reporting date, which have not been reflected in the annual accounts as presented.

On 24 February 2022, Russia invaded Ukraine. The invasion was widely condemned internationally and resulted in economic sanctions against Russia. The Group does not have employees or offices in Ukraine or Russia and has very limited exposure to assets based in those countries. The Group has documented and tested processes in place for situations of this nature and has been working to ensure that any potential disruption to its business is minimised and to ensure that all applicable sanctions imposed are implemented in a timely manner. The Group has also taken measures to reinforce its information security processes and systems to continue to protect its clients' assets. The invasion could also have significant impact on the global economy as the effect of sanctions could result in further inflationary pressures and have a broader impact on financial markets. Any such impacts are highly uncertain and rapidly changing and it is not possible to predict the extent to which this could adversely impact our financial results and business operations. The Group's management are monitoring the situation and the associated risks with the intention of mitigating the risks, where possible.

(訳文)

独立監査人の監査報告書

ジャナス・セレクションのサブ・ファンドの受益者に対する独立監査人の監査報告書

財務諸表監査に関する報告書

監査意見

私どもの意見では、ジャナス・セレクションの財務諸表（以下「財務諸表」という。）は、

- ・ ファンドの2020年12月31日現在の資産、負債及び財政状態並びに同日終了会計年度の経営成績について、真実かつ公正な概観を与えている。また、
- ・ アイルランドにおいて一般に公正妥当と認められる会計慣行（財務報告基準第102号「英国及びアイルランドにおいて適用される財務報告基準」を含む、英国財務報告評議会が発行した会計基準及びアイルランドの法律）に準拠して適切に作成されている。

私どもは、年次報告書に含まれる財務諸表を監査した。当該財務書類は、以下により構成されている。

- ・ 2020年12月31日現在の貸借対照表
- ・ 同日終了会計年度における包括利益計算書
- ・ 同日終了会計年度における買戻可能受益証券の受益者に帰属する純資産変動計算書
- ・ 2020年12月31日現在の各ファンドの投資有価証券明細表
- ・ 重要な会計方針に関する説明を含む各ファンドの財務諸表に対する注記

監査意見の根拠

私どもは国際監査基準（アイルランド）（以下「ISA(アイルランド)」という。）及び適用される法律に従って監査を実施した。

ISA(アイルランド)のもとでの私どもの責任は、本報告書の「財務諸表監査に対する監査人の責任」区分に詳述されている。私どもは、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

独立性

私どもは、IAASAの倫理基準を含む、私どもの財務諸表監査に関連するアイルランドの職業倫理規定に基づき、トラストに対して独立性を保持しており、また、当該規定で定められるその他の倫理上の責任を果たしている。

継続企業の前提に関する結論

私どもは、実施した監査手続きに基づき、財務諸表の承認日から少なくとも12ヶ月間にわたりファンドが継続企業として存続する能力について、単独でまた複合して、重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関する重要な不確実性を識別していない。

財務諸表の監査において、私どもは、管理会社が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であると結論付けた。

しかしながら、全ての将来の事象や状況を予測することは不可能であることから、この結論はファンドが継続企業として存続する能力に関して何ら保証するものではない。

継続企業に関する私どもの責任と管理会社の責任は、本報告書の関連セクションに記載されている。

その他の記載内容に関する報告

その他の記載内容は、財務諸表及び監査報告書を除く、年次報告書の全ての情報により構成されている。管理会社は、その他の記載内容に対して責任を有している。私どもの監査意見の対象範囲には、その他の記載内容は含まれておらず、したがって、私どもはその他の記載内容に対して監査意見を表明せず、また、本報告書に明示的に記載されている場合を除き、当該その他の記載内容に対していかなる保証も表明しない。財務諸表監査における私どもの責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は私どもが監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか考慮すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な虚偽記載の兆候があるかどうか留意することにある。私どもが明白かつ重要な不整合又は重要な虚偽表示を識別した場合、私どもは、財務諸表の重要な虚偽表示又はその他の情報の重要な虚偽表示があるかどうかを結論付けるための手続を実施することが要求されている。私どもは、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な虚偽記載があると判断した場合には、当該事実を報告することが求められている。私どもは、その他の記載内容に関して報告すべき事項はない。

財務諸表及び監査に関する責任

財務諸表に対する管理会社の責任

「管理会社の責任に関する説明」で詳述されている通り、管理会社は適用される財務報告のフレームワークに従って真実及び公正な概観を与える財務諸表を作成する責任を負っている。

管理会社はまた、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成するために管理会社が必要と判断した内部統制を整備及び運用する責任を有している。

財務諸表を作成するに当たり、管理会社は、ファン드가継続企業として存続する能力があるかどうかを評価し、必要がある場合には当該継続企業の前提に関する事項を開示する責任を有し、また、管理会社に事業停止の意図があるか、又はそうする以外に現実的な代替案がない場合を除き、継続企業の前提に基づいて財務諸表を作成する責任を有している。

財務諸表監査に対する監査人の責任

私どもの監査の目的は、全体としての財務諸表に、不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかに関する合理的な保証を得て、監査意見を表明することにある。合理的な保証は、高い水準の保証であるが、ISA（アイルランド）に準拠して行った監査が、全ての重要な虚偽表示を常に発見することを保証するものではない。虚偽表示は、不正又は誤謬から発生する可能性があり、個別に又は集計すると、当該財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

私どもの監査手続には、データ監査技術を使用して、特定の取引と残高の完全な母集団をテストすることが含まれる場合がある。ただし、通常は、完全な母集団をテストするのではなく、限られた数の項目をテスト対象として選択する。私どもは、規模又はリスク特性に基づいて、特定の項目をテストの対象として抽出することが多い。もしくは、監査サンプリングを使用して、選択されたサンプルテストの結果から母集団について結論を導き出すことも可能である。

財務諸表監査に対する私どもの責任の他の詳細は、以下のIAASAのウェブサイトに掲載されている。
https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf

この記載は、私どもの監査報告書の一部を構成する。

本報告書の利用

監査意見を含む本報告書は、2013年欧州連合(オルタナティブ投資ファンド運営者)規則に準拠して、各ファンドの受益者のためにのみに作成されたものであり、それ以外の目的には適合しないことがある。私どもは、この監査意見を表明するにあたり、それ以外の目的のために、もしくは、書面による我々の事前承諾による特別な同意のもとで本報告書を利用したり、又は本報告書を手元に保有するいかなる相手に対しても、責任を認め、責任を負うものではない。

プライスウォーターハウスクーパース

勅許会計士及び登録済監査人

ダブリン

2021年4月23日

[次へ](#)

Independent auditors' report to the unitholders of the Funds of Janus Selection

Report on the audit of the financial statements

Opinion

In our opinion, Janus Selection's financial statements:

- give a true and fair view of the Funds' assets, liabilities and financial position as at 31 December 2020 and of their results for the year then ended; and
- have been properly prepared in accordance with Generally Accepted Accounting Practice in Ireland (accounting standards issued by the Financial Reporting Council of the UK, including Financial Reporting Standard 102 "The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland" and Irish law).

We have audited the financial statements, included within the Annual Report & Accounts, which comprise:

- the Statement of Financial Position as at 31 December 2020;
- the Statement of Comprehensive Income for the year then ended;
- the Statement of Changes in Net Assets Attributable to Holders of Redeemable Units for the year then ended;
- the Portfolio Investments for each of the Funds as at 31 December 2020; and
- the notes to the financial statements for each of the Funds, which include a description of the significant accounting policies.

Basis for opinion

We conducted our audit in accordance with International Standards on Auditing (Ireland) ("ISAs (Ireland)") and applicable law.

Our responsibilities under ISAs (Ireland) are further described in the Auditors' responsibilities for the audit of the financial statements section of our report. We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion.

Independence

We remained independent of the Trust in accordance with the ethical requirements that are relevant to our audit of the financial statements in Ireland, which includes IAASA's Ethical Standard, and we have fulfilled our other ethical responsibilities in accordance with these requirements.

Conclusions relating to going concern

Based on the work we have performed, we have not identified any material uncertainties relating to events or conditions that, individually or collectively, may cast significant doubt on the Funds' ability to continue as a going concern for a period of at least twelve months from the date on which the financial statements are authorised for issue.

In auditing the financial statements, we have concluded that the manager's use of the going concern basis of accounting in the preparation of the financial statements is appropriate.

However, because not all future events or conditions can be predicted, this conclusion is not a guarantee as to the Funds' ability to continue as a going concern.

Our responsibilities and the responsibilities of the manager with respect to going concern are described in the relevant sections of this report.

Reporting on other information

The other information comprises all of the information in the Annual Report & Accounts other than the financial statements and our auditors' report thereon. The manager is responsible for the other information. Our opinion on the financial statements does not cover the other information and, accordingly, we do not express an audit opinion or, except to the extent otherwise explicitly stated in this report, any form of assurance thereon. In connection with our audit of the financial statements, our responsibility is to read the other information and, in doing so, consider whether the other information is materially inconsistent with the financial statements or our knowledge obtained in the audit, or otherwise appears to be materially misstated. If we identify an apparent material inconsistency or material misstatement, we are required to perform procedures to conclude whether there is a material misstatement of the financial statements or a material misstatement of the other information. If, based on the work we have performed, we conclude that there is a material misstatement of this other information, we are required to report that fact. We have nothing to report based on these responsibilities.

Responsibilities for the financial statements and the audit

Responsibilities of the manager for the financial statements

As explained more fully in the Statement of Manager's Responsibilities set out on page 10, the manager is responsible for the preparation of the financial statements in accordance with the applicable framework giving a true and fair view.

The manager is also responsible for such internal control as the manager determines is necessary to enable the preparation of financial statements that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

In preparing the financial statements, the manager is responsible for assessing the Funds' ability to continue as going concerns, disclosing as applicable, matters related to going concern and using the going concern basis of accounting unless the manager intends to cease operations, or has no realistic alternative but to do so.

Auditors' responsibilities for the audit of the financial statements

Our objectives are to obtain reasonable assurance about whether the financial statements as a whole are free from material misstatement, whether due to fraud or error, and to issue an auditors' report that includes our opinion. Reasonable assurance is a high level of assurance, but is not a guarantee that an audit conducted in accordance with ISAs (Ireland) will always detect a material misstatement when it exists. Misstatements can arise from fraud or error and are considered material if, individually or in the aggregate, they could reasonably be expected to influence the economic decisions of users taken on the basis of these financial statements.

Our audit testing might include testing complete populations of certain transactions and balances, possibly using data auditing techniques. However, it typically involves selecting a limited number of items for testing, rather than testing complete populations. We will often seek to target particular items for testing based on their size or risk characteristics. In other cases, we will use audit sampling to enable us to draw a conclusion about the population from which the sample is selected.

A further description of our responsibilities for the audit of the financial statements is located on the IAASA website at:

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

This description forms part of our auditors' report.

Use of this report

This report, including the opinion, has been prepared for and only for the unitholders of each of the Funds as a body in accordance with the European Union (Alternative Investment Fund Managers) Regulations 2013 and for no other purpose. We do not, in giving this opinion, accept or assume responsibility for any other purpose or to any other person to whom this report is shown or into whose hands it may come save where expressly agreed by our prior consent in writing.

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants and Registered Auditors
Dublin
23 April 2021

（ ）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は本書提出会社が別途保管しております。

[次へ](#)

(訳文)
監査報告書

ヘンダーソン・マネジメント・エスエイの株主各位

年次財務諸表監査に関する報告書

監査意見

私どもは、添付の年次財務諸表が、年次財務諸表の作成及び表示に関するルクセンブルグの法令に準拠して、ヘンダーソン・マネジメント・エスエイ(以下「会社」という。)の2020年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了した会計年度の経営成績を真実かつ適正に表示しているものと認める。

監査意見の対象範囲

会社の財務諸表は、以下により構成されている。

- ・ 2020年12月31日現在の貸借対照表
- ・ 同日をもって終了した会計年度における損益計算書
- ・ 年次財務諸表に対する注記(重要な会計方針の要約を含む)

監査意見の根拠

私どもは、職業的専門家としての監査人に関する2016年7月23日付の法律(以下「2016年7月23日付の法律」という。)及びルクセンブルグで金融監督委員会(Commission de Surveillance du Secteur Financier)(以下「CSSF」という。)が採用した国際監査基準に準拠して監査を行った。2016年7月23日付の法律及びルクセンブルグでCSSFが採用した国際監査基準のもとでの私どもの責任は、本報告書の「年次財務諸表監査に対する承認された監査人(Réviseur d'entreprises agréé)の責任」区分に詳述されている。

私どもは、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

私どもは、ルクセンブルグでCSSFが採用した国際倫理基準審議会の定める倫理規程(IESBA Code)及び私どもの年次財務諸表監査に関連する倫理要件に基づき会社に対して独立性を保持している。私どもは、これらの倫理要件のもとでのその他の倫理上の責任を果たした。

その他の記載内容

取締役会は、その他の記載内容に対して責任を有している。その他の記載内容は、マネジメント・レポートに記載された情報のうち、年次財務諸表及び監査報告書以外の情報である。

私どもの監査意見の対象範囲には、その他の記載内容は含まれておらず、したがって、私どもは当該その他の記載内容に対していかなる保証の結論も表明しない。

年次財務諸表監査における私どもの責任は、上記で特定したその他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と年次財務諸表又は私どもが監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか考慮すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な虚偽記載の兆候があるかどうか留意することにある。私どもは、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な虚偽表示があると判断した場合には、当該事実を報告することが求められている。私どもは、その他の記載内容に関して報告すべき事項はない。

年次財務諸表に対する取締役会の責任

取締役会は、年次財務諸表の作成及び表示に関するルクセンブルグの法令に準拠して財務書類を作成し適正に表示すること、並びに不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない年次財務諸表を作成するために取締役会が必要と判断した内部統制を整備及び運用する責任を有している。

年次財務諸表を作成するに当たり、取締役会は、会社が継続企業として存続する能力があるかどうかを評価し、必要がある場合には当該継続企業の前提に関する事項を開示する責任を有し、また、取締役会が会社の清算又は運用停止の意図があるか、又はそうする以外に現実的な代替案がない場合を除き、継続企業の前提に基づいて年次財務諸表を作成する責任を有している。

年次財務諸表監査に対する承認された監査人(Réviseur d'entreprises agréé)の責任

私どもの監査の目的は、全体としての年次財務諸表に、不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかに関する合理的な保証を得て、監査意見を表明することにある。合理的な保証は、高い水準の保証であるが、2016年7月23日付の法律及びルクセンブルグでCSSFが採用した国際監査基準に準拠して行った監査が、すべての重要な虚偽表示を常に発見することを保証(guarantee)するものではない。虚偽表示は、不正又は誤謬から発生する可能性があり、個別に又は集計すると、当該年次財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

私どもは、2016年7月23日付の法律及びルクセンブルグでCSSFが採用した国際監査基準に準拠して実施する監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持し、また、以下を行う。

- ・ 不正又は誤謬による年次財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別、評価し、当該リスクに対応した監査手続を立案、実施し、監査意見の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。不正による重要な虚偽表示リスクを発見できないリスクは、誤謬による重要な虚偽表示を発見できないリスクよりも高くなる。これは、不正には、共謀、文書の偽造、取引等の記録からの除外、虚偽の陳述、又は内部統制の無効化が伴うためである。
- ・ 状況に応じて適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を理解する。ただし、これは、会社の内部統制の有効性に対する意見を表明するためではない。
- ・ 取締役会が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに取締役会によって行われた会計上の見積りの合理性を評価し、関連する開示の妥当性を検討する。
- ・ 取締役会が継続企業を前提として年次財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、会社の継続企業として存続する能力に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうかを結論付ける。重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において年次財務諸表の開示に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する年次財務諸表の開示が適切でない場合は、年次財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。私どもの結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、会社は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 年次財務諸表の表示方法が適切であるかどうかを評価すること、関連する注記を含めた全体としての年次財務諸表の表示、構成及び内容を検討し、年次財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

私どもは、統治責任者に対して、特に、計画した監査の範囲とその実施時期、及び監査の過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項を報告している。

法令等が要求するその他の事項に関する報告

マネジメント・レポートは、年次財務諸表と整合性があり、適用される法律上の要求に従って作成されている。

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

ルクセンブルグ、2021年6月4日
代表者

ジョン・マイケル・デラノ

[前へ](#)

[次へ](#)

AUDIT REPORT

To the Shareholders of

Henderson Management S.A.

Report on the audit of the annual accounts

Our opinion

In our opinion, the accompanying annual accounts give a true and fair view of the financial position of Henderson Management S.A. (the “Company”) as at 31 December 2020, and of the results of its operations for the year then ended in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the annual accounts.

What we have audited

The Company’s annual accounts comprise:

- the balance sheet as at 31 December 2020;
- the profit and loss account for the year then ended; and
- the notes to the annual accounts, which include a summary of significant accounting policies.

Basis for opinion

We conducted our audit in accordance with the Law of 23 July 2016 on the audit profession (Law of 23 July 2016) and with International Standards on Auditing (ISAs) as adopted for Luxembourg by the “Commission de Surveillance du Secteur Financier” (CSSF). Our responsibilities under the Law of 23 July 2016 and ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF are further described in the “Responsibilities of the “Réviseur d’entreprises agréé” for the audit of the annual accounts” section of our report.

We believe that the audit evidence we have obtained is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion.

We are independent of the Company in accordance with the International Ethics Standards Board for Accountants’ Code of Ethics for Professional Accountants (IESBA Code) as adopted for Luxembourg by the CSSF together with the ethical requirements that are relevant to our audit of the annual accounts. We have fulfilled our other ethical responsibilities under those ethical requirements.

Other information

The Board of Directors is responsible for the other information. The other information comprises the information stated in the management report but does not include the annual accounts and our audit report thereon.

Our opinion on the annual accounts does not cover the other information and we do not express any form of assurance conclusion thereon.

In connection with our audit of the annual accounts, our responsibility is to read the other information identified above and, in doing so, consider whether the other information is materially inconsistent with the annual accounts or our knowledge obtained in the audit, or otherwise appears to be materially misstated. If, based on the work we have performed, we conclude that there is a material misstatement of this other information, we are required to report that fact. We have nothing to report in this regard.

Responsibilities of the Board of Directors for the annual accounts

The Board of Directors is responsible for the preparation and fair presentation of the annual accounts in accordance with Luxembourg legal and regulatory requirements relating to the preparation and presentation of the annual accounts, and for such internal control as the Board of Directors determines is necessary to enable the preparation of annual accounts that are free from material misstatement, whether due to fraud or error.

In preparing the annual accounts, the Board of Directors is responsible for assessing the Company's ability to continue as a going concern, disclosing, as applicable, matters related to going concern and using the going concern basis of accounting unless the Board of Directors either intends to liquidate the Company or to cease operations, or has no realistic alternative but to do so.

Responsibilities of the “Réviseur d’entreprises agréé” for the audit of the annual accounts

The objectives of our audit are to obtain reasonable assurance about whether the annual accounts as a whole are free from material misstatement, whether due to fraud or error, and to issue an audit report that includes our opinion. Reasonable assurance is a high level of assurance, but is not a guarantee that an audit conducted in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF will always detect a material misstatement when it exists. Misstatements can arise from fraud or error and are considered material if, individually or in the aggregate, they could reasonably be expected to influence the economic decisions of users taken on the basis of these annual accounts.

As part of an audit in accordance with the Law of 23 July 2016 and with ISAs as adopted for Luxembourg by the CSSF, we exercise professional judgment and maintain professional scepticism throughout the audit. We also:

- identify and assess the risks of material misstatement of the annual accounts, whether due to fraud or error, design and perform audit procedures responsive to those risks, and obtain audit evidence that is sufficient and appropriate to provide a basis for our opinion. The risk of not detecting a material misstatement resulting from fraud is higher than for one resulting from error, as fraud may involve collusion, forgery, intentional omissions, misrepresentations, or the override of internal control;
- obtain an understanding of internal control relevant to the audit in order to design audit procedures that are appropriate in the circumstances, but not for the purpose of expressing an opinion on the effectiveness of the Company's internal control;
- evaluate the appropriateness of accounting policies used and the reasonableness of accounting estimates and related disclosures made by the Board of Directors;

·conclude on the appropriateness of the Board of Directors' use of the going concern basis of accounting and, based on the audit evidence obtained, whether a material uncertainty exists related to events or conditions that may cast significant doubt on the Company's ability to continue as a going concern. If we conclude that a material uncertainty exists, we are required to draw attention in our audit report to the related disclosures in the annual accounts or, if such disclosures are inadequate, to modify our opinion. Our conclusions are based on the audit evidence obtained up to the date of our audit report. However, future events or conditions may cause the Company to cease to continue as a going concern;

·evaluate the overall presentation, structure and content of the annual accounts, including the disclosures, and whether the annual accounts represent the underlying transactions and events in a manner that achieves fair presentation.

We communicate with those charged with governance regarding, among other matters, the planned scope and timing of the audit and significant audit findings, including any significant deficiencies in internal control that we identify during our audit.

Report on other legal and regulatory requirements

The Management report is consistent with the annual accounts and has been prepared in accordance with applicable legal requirements.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

Luxembourg, 4 June 2021

Represented by

John Michael Delano

（ ）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は本書提出会社が別途保管しております。

[前へ](#)