

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和4年9月30日

【発行者名】 マニユライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
(Manulife Investment Management (Hong Kong) Limited)

【代表者の役職氏名】 取締役 マイケル・フロイド・ドマーマス
(Michael Floyd Dommermuth, Director)

【本店の所在の場所】 香港、銅鑼灣、希慎道33號、リー・ガーデン・ワン、10階（10/F,
Lee Garden One, 33 Hysan Avenue, Causeway Bay, Hong Kong）

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹 野 康 造
弁護士 廣 本 文 晴

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 竹 野 康 造
同 廣 本 文 晴
同 中 条 咲耶子

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

【電話番号】 03（6212）8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
マニユライフ・インベストメンツ・トラストー
US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
(Manulife Investments Trust- US Core Fixed Income Fund)

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
クラスA（米ドル建て）受益証券
100億米ドル（約1兆2,886億円）を上限とします。
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）受益証券
100億豪ドル（約9,170億円）を上限とします。
(注) 米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2022年4月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧
客電信売買相場の仲値（1米ドル＝128.86円および1豪ドル＝91.70円）によります。

【縦覧に供する場所】 該当事項ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2022年6月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により追加・更新するため、また、その他一部の情報を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 ファンドの性格	(3) ファンドの 仕組み ③ 管理会社の 概況 (iii) 資本金の 額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
5 運用状況	(1) 投資状況	1 ファンドの運用状況	(1) 投資状況 ① 資産及び地 域別の投資 状況	更新
	(2) 投資資産 ① 投資有価証 券の主要銘 柄 ② 投資不動産 物件 ③ その他投資 資産の主要 なもの		(1) 投資状況 ② 投資有価証 券の主要銘 柄 ② 投資不動産 物件 ③ その他投資 資産の主要 なもの	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加・ 更新
	(4) 販売及び買 戻しの実績	2 販売及び買戻しの実績		追加
第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表		3 ファンドの経理状況		追加
第三部 特別情報 第1 管理会社の概況 1 管理会社の概況	(1) 資本金の額	4 管理会社の概況	(1) 資本金の額	更新
2 事業の内容及び営業の概況			(2) 事業の内容 及び営業の 状況	更新
5 その他	(4) 訴訟事件そ の他の重要 事項		(3) その他	追加

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

（「5 管理会社の経理の概況」は訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

US・コア・フィクスト・インカム・ファンド（以下「ファンド」といいます。）は、アンブレラ・ファンドであるマニユライフ・インベストメント・トラスト（以下「トラスト」といいます。）のシリーズ・トラストです。ファンドは複数のクラスで構成されます。

ファンドの投資状況ならびにクラスA（米ドル建て）およびクラスA（豪ドル建てヘッジあり）の運用実績は次のとおりです。

（1）投資状況

① 資産別および地域別の投資状況

本表は、ファンドの全クラスの資産を合計して表示したものです。

（2022年7月末日現在）

資産の種類	国名／地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
変動利付債	アメリカ合衆国	67,915,223	53.46
	ケイマン諸島	2,120,804	1.67
	カナダ	422,870	0.33
	ドイツ	332,729	0.26
	イギリス	280,366	0.22
	ペルー	216,495	0.17
	日本	171,074	0.13
	パナマ	168,208	0.13
債券	アメリカ合衆国	29,093,762	22.90
	アイルランド	977,053	0.77
	イギリス	884,019	0.70
	サウジアラビア	547,096	0.43
	スペイン	510,409	0.40
	オランダ	477,913	0.38
	オーストラリア	380,539	0.30
	バミューダ	314,561	0.25
	カナダ	271,505	0.21
	フランス	259,805	0.20
	ノルウェー	252,329	0.20
	ルクセンブルグ	250,770	0.20
	カタール	225,382	0.18
	アラブ首長国連邦	179,438	0.14
	インド	159,596	0.13
	ジャージー	42,098	0.03
国債	アメリカ合衆国	17,569,913	13.83
小計		124,023,957	97.62
現金その他の資産（負債控除後）		3,020,612	2.38
合計 （純資産総額）		127,044,569 （約17,101百万円）	100.00

（注1）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。以下同じです。

（注2）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2022年7月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝134.61円および1豪ドル＝94.20円）によります。以下同じです。

- （注3）ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設立されていますが、受益証券は、米ドル建てまたは豪ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたは豪ドルをもって行います。
- （注4）本書の中で金額および比率を表示する場合、適宜の単位に四捨五入している場合があります。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。

② 投資有価証券の主要銘柄

本表は、ファンドの全クラスの投資有価証券のうち、上位30銘柄を表示したものです。

（2022年7月末日現在）

順位	銘柄	発行国 (発行地)	種類	利率 (%)	償還日	数量	(米ドル)				投資 比率 (%)
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
1	US TREASURY 2.25% 15/02/2052	アメリカ 合衆国	国債	2.250	2052年2月15日	8,603,000	0.88	7,536,985	0.84	7,248,325	5.71
2	US TREASURY 2.875% 15/05/2032	アメリカ 合衆国	国債	2.875	2032年5月15日	4,451,000	0.99	4,421,530	1.02	4,530,358	3.57
3	FNMA 30 YR JUL FRN 25/03/2043	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2043年3月25日	3,675,000	0.98	3,601,828	1.01	3,696,246	2.91
4	FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年10月1日	3,900,000	0.83	3,241,463	0.72	2,826,633	2.22
5	US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	アメリカ 合衆国	国債	2.500	2045年2月15日	2,791,000	1.13	3,161,716	0.87	2,419,849	1.90
6	US TREASURY 2.875% 15/05/2052	アメリカ 合衆国	国債	2.875	2052年5月15日	2,433,000	0.97	2,359,466	0.97	2,354,096	1.85
7	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年12月1日	3,100,000	0.83	2,583,988	0.73	2,254,215	1.77
8	FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2051年4月1日	2,789,000	0.89	2,489,286	0.81	2,253,736	1.77
9	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2052年1月1日	2,380,000	0.98	2,329,819	0.93	2,223,284	1.75
10	FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年11月1日	2,785,000	0.84	2,340,763	0.76	2,109,027	1.66
11	FANNIE MAE OR FREDDIE MAC FRN 15/07/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2051年7月15日	1,772,000	1.00	1,772,426	1.02	1,803,564	1.42
12	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.000	2051年3月1日	1,601,000	0.82	1,320,103	0.74	1,184,290	0.93
13	FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.000	2050年10月1日	1,345,000	0.88	1,189,763	0.76	1,017,004	0.80
14	US TREASURY 3.25% 15/05/2042	アメリカ 合衆国	国債	3.250	2042年5月15日	791,000	0.96	758,205	1.00	792,489	0.62
15	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年12月1日	925,000	0.90	835,447	0.78	724,963	0.57
16	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2049年12月1日	1,350,000	0.57	769,013	0.50	674,847	0.53
17	DLAA 2021-1 LLC SER 1A CL A3 FRN 17/04/2026	アメリカ 合衆国	変動利 付債	0.670	2026年4月17日	691,000	1.00	690,900	0.95	657,134	0.52
18	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.000	2051年3月1日	646,000	0.99	639,714	1.00	645,581	0.51
19	FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2050年4月1日	1,000,000	0.66	660,603	0.58	580,056	0.46
20	FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/04/2045	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2045年4月1日	2,580,000	0.25	637,323	0.22	579,825	0.46
21	BROADCOM INC (REG) 4.75% 15/04/2029	アメリカ 合衆国	債券	4.750	2029年4月15日	553,000	1.17	646,950	1.01	557,900	0.44
22	AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 2.45 % 29/10/2026	アイルラ ンド	債券	2.450	2026年10月29日	558,000	0.94	526,269	0.89	496,807	0.39

順位	銘柄	発行国 (発行地)	種類	利率 (%)	償還日	数量	(米ドル)				投資 比率 (%)
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
23	FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2050年2月1日	1,000,000	0.57	567,096	0.50	495,885	0.39
24	WELLS FARGO & COMPANY SER U (REG) VAR PERP 29/12/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.875	2049年12月29日	456,000	1.11	504,088	1.02	462,840	0.36
25	MORGAN STANLEY VAR 28/04/2026	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.188	2026年4月28日	471,000	1.04	489,452	0.95	449,183	0.35
26	GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 22/04/2032	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.615	2032年4月22日	489,000	1.00	489,000	0.86	422,786	0.33
27	MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 5.327% 06/02/2029	アメリカ 合衆国	債券	5.327	2029年2月6日	393,000	1.17	459,440	1.02	402,334	0.32
28	TRICON AMERICAN HOMES 2020-SFR1 SER SFR1 CL A FRN 17/07/2038	アメリカ 合衆国	変動利 付債	1.499	2038年7月17日	435,000	1.00	433,570	0.92	400,635	0.32
29	TOYOTA AUTO LOAN EXTENDED NOTE TRUST 2019-1 SER 1A CL A FRN 25/11/2031	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.560	2031年11月25日	407,000	1.06	433,390	0.98	400,139	0.31
30	ABBVIE INC (REG) 3.2% 21/11/2029	アメリカ 合衆国	債券	3.200	2029年11月21日	411,000	1.09	449,088	0.95	391,720	0.31

③ 投資不動産物件

該当事項はありません。（2022年7月末日現在）

④ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。（2022年7月末日現在）

（２）運用実績**① 純資産の推移**

2022年7月末日および同日前1年間における各月末の純資産の推移は次の通りです。

<クラスA（米ドル建て）>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2021年8月末日	127,774,504	17,199,726	99.19	13,352
9月末日	121,228,982	16,318,633	97.89	13,177
10月末日	118,160,257	15,905,552	97.53	13,129
11月末日	116,987,723	15,747,717	97.64	13,143
12月末日	112,882,397	15,195,099	97.36	13,106
2022年1月末日	112,547,928	15,150,077	95.26	12,823
2月末日	104,097,226	14,012,528	93.93	12,644
3月末日	99,161,455	13,348,123	90.67	12,205
4月末日	88,730,036	11,943,950	87.56	11,786
5月末日	91,522,778	12,319,881	87.22	11,741
6月末日	92,334,435	12,429,138	85.88	11,560
7月末日	92,734,312	12,482,966	87.38	11,762

（参考情報）
純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移（2022年7月末日現在）

【クラスA（米ドル建て）】



＜クラスA（豪ドル建てヘッジあり）＞

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	豪ドル	円
2021年8月末日	4,897,234	659,217	102.39	9,645
9月末日	7,034,074	946,857	101.02	9,516
10月末日	7,642,783	1,028,795	100.65	9,481
11月末日	7,661,968	1,031,378	100.79	9,494
12月末日	8,370,265	1,126,721	100.45	9,462
2022年1月末日	8,119,238	1,092,931	98.28	9,258
2月末日	8,509,520	1,145,466	96.89	9,127
3月末日	8,119,774	1,093,003	93.54	8,811
4月末日	7,294,760	981,948	90.26	8,502
5月末日	7,186,564	967,383	89.82	8,461
6月末日	6,480,514	872,342	88.34	8,322
7月末日	6,881,933	926,377	89.85	8,464

（参考情報）

純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移（2022年7月末日現在）

【クラスA（豪ドル建てヘッジあり）】



② 分配の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
2021年8月1日～2022年7月末日	1.00	135

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
第5会計年度中 （2022年1月1日～2022年7月末日）	0.50	67
設定来累計	1.50	202

（注）設定来累計とは、運用開始日である2020年9月25日から2022年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
2021年8月1日～2022年7月末日	1.00	94

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
第5会計年度中 （2022年1月1日～2022年7月末日）	0.50	47
設定来累計	1.00	94

（注）設定来累計とは、運用開始日である2021年4月9日から2022年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

③ 収益率の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	収益率（注）
2021年8月1日～2022年7月末日	－11.11%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：2022年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2021年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）



（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

＊2022年の場合は、7月末の1口当たり純資産価格（7月末までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

＊クラスA（米ドル建て）については、2020年の場合は、100米ドル

なお、ファンドにはベンチマークはありません。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

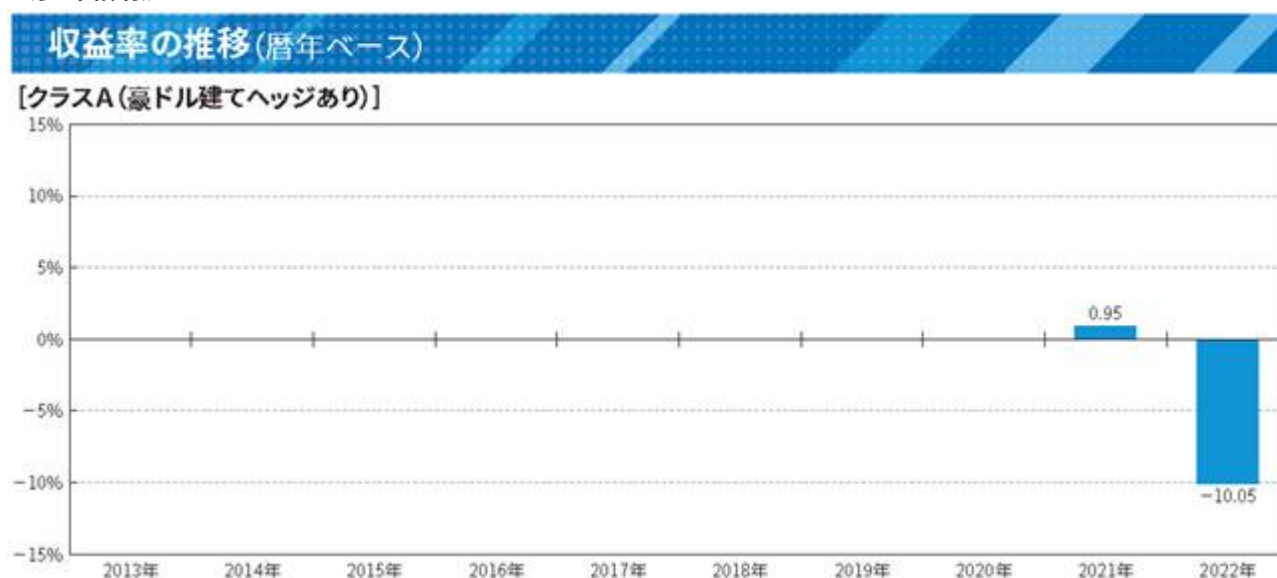
期間	収益率（注）
2021年8月1日～2022年7月末日	－11.52%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：2022年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2021年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）



（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

＊2022年の場合は、7月末の1口当たり純資産価格（7月末までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

＊クラスA（豪ドル建てヘッジあり）については、2021年の場合は、100豪ドル

なお、ファンドにはベンチマークはありません。

2 販売及び買戻しの実績

2022年7月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2022年7月末日現在の発行済口数は次のとおりです。

<クラスA（米ドル建て）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
459,784 (459,784)	616,227 (616,227)	1,061,236 (1,061,236)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
96,132 (96,132)	37,261 (37,261)	109,502 (109,502)

（注）（ ）内の数字は本邦における販売・買戻しおよび発行済口数です。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、香港財務報告基準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（ただし、円換算部分を除きます。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものです。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいいます。）の監査を受けていません。
- c. ファンドの中間財務書類において記載されているクラスA（円ヘッジあり）およびクラスA（円ヘッジなし）は、本書に基づく開示の対象ではなく、参考情報として記載されています。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、別途記載される場合を除き、米ドル、日本円または豪ドルで表示されています。日本語の中間財務書類には、主要な金額について2022年7月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=134.61円および1豪ドル=94.20円）で換算された円換算額が併記されています。なお、千円未満の金額は四捨五入されているため、円換算額は合計欄の数値が総数と一致しない場合があります。

[次へ](#)

（１）資産及び負債の状況

マニユライフ・インベストメント・トラストー
 ＵＳ・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 財政状態計算書
 2022年６月30日現在（未監査）

	2022年６月30日現在（未監査）	
	米ドル	千円
資産		
損益を通じて公正価値で測定される投資	125,601,373	16,907,201
デリバティブ金融資産	0	0
利付証券に係る未収利息	680,260	91,570
未収預金利息	58	8
受益証券発行未収金	1,112,599	149,767
投資対象売却未収金	4,020,141	541,151
その他の未収金	662	89
現金および現金同等物	6,031,701	811,927
資産合計	137,446,794	18,501,713
負債		
デリバティブ金融負債	135,218	18,202
受益証券買戻未払金	1,283,203	172,732
投資対象購入未払金	9,107,930	1,226,018
その他の未払金	116,123	15,631
負債合計（受益者に帰属する純資産を除く）	10,642,474	1,432,583
受益者に帰属する純資産	126,804,320	17,069,130
発行済受益証券口数		
クラスA（円ヘッジあり）	2,434,673 口	
クラスA（円ヘッジなし）	1,832,710 口	
クラスA（米ドル建て）	1,085,695 口	
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）	106,702 口	
受益証券１口当たり純資産価格		
クラスA（円ヘッジあり）	786 円	
クラスA（円ヘッジなし）	997 円	
クラスA（米ドル建て）	85.88 米ドル	11,560 円
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）	88.34 豪ドル	8,322 円

マニユライフ・インベストメント・トラストー
U S ・ コ ア ・ フィク ス ド ・ インカム ・ ファ ン ド
包括利益計算書
2022年1月1日から2022年6月30日までの期間

	2022年1月1日から2022年6月30日 までの期間（未監査）	
	米ドル	千円
収益		
利付証券利息	3,472,539	467,438
銀行利息	271	36
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る実現純損失	(9,551,161)	(1,285,682)
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る未実現損失の純変動	(13,483,813)	(1,815,056)
為替差益の純額	5,498	740
	<u>(19,556,666)</u>	<u>(2,632,523)</u>
費用		
運用報酬	(168,997)	(22,749)
保管および手続費用	(36,820)	(4,956)
受託会社報酬	(5,952)	(801)
監査報酬	(16,092)	(2,166)
評価費用	(46,000)	(6,192)
取引取扱手数料	(5,078)	(684)
年次費用	(1,458)	(196)
会計およびその他の専門家報酬	(3,396)	(457)
設立費用	0	0
販売報酬および管理会社代行サービス会社報酬	(364,976)	(49,129)
その他の運用費用	(8,865)	(1,193)
運用費用合計	<u>(657,634)</u>	<u>(88,524)</u>
運用損失	(20,214,300)	(2,721,047)
財務費用		
受益者への分配	<u>(1,215,879)</u>	<u>(163,669)</u>
分配後および税引前損失	<u>(21,430,179)</u>	<u>(2,884,716)</u>
税金		
源泉税	<u>(14,456)</u>	<u>(1,946)</u>
当期包括損失合計	<u><u>(21,444,635)</u></u>	<u><u>(2,886,662)</u></u>

マニユライフ・インベストメント・トラスト
 US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 受益者に帰属する純資産変動計算書
 2022年1月1日から2022年6月30日までの期間（未監査）

	2022年1月1日から2022年6月30日 までの期間（未監査）	
	米ドル	千円
期首現在受益者に帰属する純資産	156,560,201	21,074,569
受益証券の発行による受取額	21,337,828	2,872,285
分配金再投資による受取額	625,247	84,164
受益証券の買戻しによる支払額	(30,274,321)	(4,075,226)
	(8,311,246)	(1,118,777)
当期包括損失合計	(21,444,635)	(2,886,662)
期末現在受益者に帰属する純資産	126,804,320	17,069,130

（２）投資有価証券明細表等

ファンドの財務書類原文には、投資有価証券明細表の開示が行われていないため、記載することができません。ファンドの組入銘柄の詳細につきましては、次ページ＜参考情報＞をご参照ください。

[次へ](#)

＜参考情報＞

投資サマリー（2022年6月末時点）

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
US TREASURY 2.25% 15/02/2052	9,090,000	82.315013	7,559,273	アメリカ合衆国	5.96
US TREASURY 2.875% 15/05/2032	5,400,000	98.891869	5,359,861	アメリカ合衆国	4.23
FNMA 30YR CONV FRN 25/02/2043	3,921,000	98.70312	3,870,149	アメリカ合衆国	3.05
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2050	3,900,000	70.909678	2,771,810	アメリカ合衆国	2.19
US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	2,791,000	84.886891	2,395,407	アメリカ合衆国	1.89
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2051	2,789,000	79.060643	2,210,035	アメリカ合衆国	1.74
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	3,100,000	70.57893	2,192,992	アメリカ合衆国	1.73
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	2,380,000	91.116935	2,174,380	アメリカ合衆国	1.71
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2050	2,785,000	74.15549	2,070,022	アメリカ合衆国	1.63
US TREASURY 2.875% 15/05/2052	1,862,000	94.443307	1,765,371	アメリカ合衆国	1.39
US TREASURY 2.5% 31/05/2024	1,661,000	99.127761	1,650,029	アメリカ合衆国	1.30
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	1,601,000	71.940002	1,153,985	アメリカ合衆国	0.91
FANNIE MAE OR FREDDIE MAC FRN 15/07/2051	1,102,000	100.46875	1,107,166	アメリカ合衆国	0.87
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2050	1,345,000	73.986367	997,025	アメリカ合衆国	0.79
US TREASURY 2.625% 31/05/2027	1,006,000	98.131805	989,443	アメリカ合衆国	0.78
US TREASURY 3.25% 15/05/2042	791,000	97.685668	775,977	アメリカ合衆国	0.61
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	925,000	76.380649	707,864	アメリカ合衆国	0.56
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	1,350,000	49.075775	664,281	アメリカ合衆国	0.52
DLAA 2021-1 LLC SER 1A CL A3 FRN 17/04/2026	691,000	95.58417	660,667	アメリカ合衆国	0.52
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/04/2045	2,580,000	22.231947	575,319	アメリカ合衆国	0.45
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2050	1,000,000	57.048004	571,997	アメリカ合衆国	0.45
BROADCOM INC (REG) 4.75% 15/04/2029	553,000	97.6162	545,363	アメリカ合衆国	0.43
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 2.45 % 29/10/2026	558,000	87.12085	488,489	アイルランド	0.39
FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2050	1,000,000	48.327886	484,587	アメリカ合衆国	0.38
ABBVIE INC (REG) 3.2% 21/11/2029	500,000	92.98285	466,692	アメリカ合衆国	0.37
MORGAN STANLEY VAR 28/04/2026	471,000	94.01085	444,595	アメリカ合衆国	0.35
WELLS FARGO & COMPANY SER U (REG) VAR PERP 29/12/2049	456,000	98	448,071	アメリカ合衆国	0.35
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 22/04/2 032	489,000	83.04235	408,528	アメリカ合衆国	0.32
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 5.327% 06/02/2029	393,000	100.25	402,415	アメリカ合衆国	0.32
TOYOTA AUTO LOAN EXTENDED NOTE TRUS T 2019-1 SER 1A CL A FRN 25/11/2031	407,000	97.92459	398,727	アメリカ合衆国	0.31
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% (REG) 08/05/2025	394,000	99.84155	395,957	イギリス	0.31
TRICON AMERICAN HOMES 2020-SFRI SER SFRI CL A FRN 17/07/2038	435,000	91.00016	396,393	アメリカ合衆国	0.31
MMAF EQUIPMENT FINANCE LLC 2021-A SER A CL A3 FRN 13/06/2028	400,000	94.05866	376,347	アメリカ合衆国	0.30
ENERGY TRANSFER OPERATNG (REG) 5.25 % 15/04/2029	364,000	99.44625	366,019	アメリカ合衆国	0.29
GOLDMAN SACHS GROUP INC (REG) 3.85% 26/01/2027	374,000	96.6888	367,816	アメリカ合衆国	0.29
BANK OF AMERICA CORP (REG) VAR 23/07/2029	356,000	96.37535	349,769	アメリカ合衆国	0.28
HOST HOTELS & RESORTS LP (REG) 3.87 5% 01/04/2024	356,000	98.98645	354,154	アメリカ合衆国	0.28
VERIZON COMMUNICATIONS (REG) 4.329% 21/09/2028	356,000	99.5127	358,546	アメリカ合衆国	0.28
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) VAR 02/06/2028	393,000	89.5246	352,589	アメリカ合衆国	0.28
BANK OF AMERICA CORP VAR 22/04/2032	400,000	84.1421	338,628	アメリカ合衆国	0.27
BOEING CO 5.15% 01/05/2030	346,000	95.95735	334,982	アメリカ合衆国	0.26

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
BXHP TRUST FRN 15/08/2036	358,000	95.9215	343,713	アメリカ合衆国	0.27
CARLYLE US CLO 2019-2 LTD SER 2A CL AIR FRN 15/07/2032	345,000	97.9054	338,778	ケイマン諸島	0.27
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2050	450,000	74.700036	336,795	アメリカ合衆国	0.27
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2050	459,000	74.780742	343,896	アメリカ合衆国	0.27
CF HIPPOLYTA LLC SER 1 CL A1 FRN 15/07/2060	391,000	83.452985	326,572	アメリカ合衆国	0.26
CITIGROUP INC (REG) 4.6% 09/03/2026	325,000	99.65805	328,540	アメリカ合衆国	0.26
CLI FUNDING VI LLC SER 1A CL A FRN 18/09/2045	442,000	73.204035	323,838	アメリカ合衆国	0.26
EXPEDIA INC SER WI (REG) 3.8% 15/02/2028 W/I	353,000	91.10715	326,676	アメリカ合衆国	0.26
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2050	500,000	65.760461	329,426	アメリカ合衆国	0.26
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 3.6% 2 1/06/2030	376,000	86.707	326,394	アメリカ合衆国	0.26
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST SER SFR2 CL A FRN 19/04/2038	357,000	90.494	323,524	アメリカ合衆国	0.26
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 3.244% 05/10/2026	344,000	94.0874	326,327	アメリカ合衆国	0.26
SMRT 2022-MINI SER MINI CL A FRN 15/01/2024	342,000	96.14	329,070	アメリカ合衆国	0.26
UNITED AIR 2020-1 A PTT (SER 20-1) 5.875% 15/10/2027	394,000	83.202193	332,349	アメリカ合衆国	0.26
BPR TRUST 2022-OANA SER OANA CL A FRN 15/04/2037	323,000	97.959	316,792	アメリカ合衆国	0.25
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 5.75% 01/04/2048	342,000	89.7136	311,737	アメリカ合衆国	0.25
DOLLAR TREE INC (REG) 4.2% 15/05/2028	320,000	97.068	312,335	アメリカ合衆国	0.25
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	363,000	87.594099	318,701	アメリカ合衆国	0.25
ORACLE CORP (REG) 2.95% 01/04/2030	370,000	85.52435	319,169	アメリカ合衆国	0.25
SAUDI INTERNATIONAL BOND (SER 144A) (REG) 4.375% 16/04/2029	314,000	101.5946	321,869	サウジアラビア	0.25
BENEFIT STREET PARTNERS CLO XX LTD SER 20A CL AR FRN 15/07/2034	310,000	96.8519	301,177	ケイマン諸島	0.24
DB MASTER FINANCE LLC FRN 20/11/2051	338,000	88.079579	298,496	アメリカ合衆国	0.24
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2050	445,000	68.275545	304,536	アメリカ合衆国	0.24
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 2.4% 1 5/10/2028	360,000	83.20455	301,360	アメリカ合衆国	0.24
LIFE MORTGAGE TRUST US SER BMR2 CL A1 FRN 15/05/2039	305,000	97.492902	297,637	アメリカ合衆国	0.23
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 4.185% 15/02/2027	303,000	97.875	301,352	アメリカ合衆国	0.24
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 3.45% 02/06/2025	316,000	96.58495	306,087	アメリカ合衆国	0.24
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST 20 19-B SER B CL A2A FRN 15/06/2037	475,000	64.84784	308,457	アメリカ合衆国	0.24
TELEFONICA EMISIONES SAU (REG) 5.213% 08/03/2047	333,000	90	305,149	スペイン	0.24
CITIGROUP INC (REG) 3.2% 21/10/2026	299,000	95.2688	286,714	アメリカ合衆国	0.23
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 4.9% 01/10/2026	285,000	99.90545	288,222	アメリカ合衆国	0.23
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2051	343,000	83.42377	286,804	アメリカ合衆国	0.23
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2051	329,000	86.925018	286,644	アメリカ合衆国	0.23
PFS FINANCING CORP SER E CL A FRN 1 5/10/2025	300,000	96.34614	289,172	アメリカ合衆国	0.23
SANTANDER REVOLVING AUTO LOAN TRUST 2019-A SER A CL A FRN 26/01/2032	300,000	95.73621	287,334	アメリカ合衆国	0.23
TRICON AMERICAN HOMES 2020-SFR2 TRUST SER SFR2 CL A FRN 17/11/2039	350,000	83.852583	293,903	アメリカ合衆国	0.23
AVIS BUDGET RENTAL CAR FUNDING AESOP LLC SER 3A CL A FRN	294,000	95.49254	280,960	アメリカ合衆国	0.22
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2021-CIP SER CIP CL A FRN	289,000	96.626	279,480	アメリカ合衆国	0.22
DATABANK ISSUER SER 1A CL A2 FRN 27/02/2051	312,000	90.412569	282,194	アメリカ合衆国	0.22

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FIRSTKEY HOMES 2020-SFR2 TRUST SER SFR2 CL A FRN 19/10/2037	296,000	91.653237	271,604	アメリカ合衆国	0.21
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER E) 4% 15/06/2025	279,000	98.4582	275,194	アメリカ合衆国	0.22
MADISON PARK FUNDING XXIII LTD SER 23A CL AR FRN 27/07/2031	276,000	98.6451	273,354	ケイマン諸島	0.22
WINGSTOP FUNDING LLC FRN 05/12/2050	316,000	88.331373	279,772	アメリカ合衆国	0.22
ALIGNED DATA CENTERS ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 15/08/2046	299,000	88.48939	264,841	アメリカ合衆国	0.21
APEX CREDIT CLO 2020 LTD SER 1A CL A1R FRN 20/10/2031	276,000	97.79799	271,071	ケイマン諸島	0.21
BROADCOM INC (SER 144A) 4.926% 15/0 5/2037	294,000	89.60325	266,370	アメリカ合衆国	0.21
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.8% 01/03 /2050	329,000	79.50465	266,834	アメリカ合衆国	0.21
CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC/CAP (REG) 6.484% 23/10/2045	274,000	97.48865	270,475	アメリカ合衆国	0.21
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2051	310,000	84.669303	263,081	アメリカ合衆国	0.21
GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT US CLO 6 LTD SER 6A CL AR FRN 20/04/2035	269,000	95.95028	258,946	ケイマン諸島	0.20
JPMORGAN CHASE & CO SER (S) (REG) VAR 29/12/2049	262,000	100.75	271,334	アメリカ合衆国	0.21
MARRIOTT INTERNATIONAL (SER AA) (RE G) 4.65% 01/12/2028	274,000	97.66515	268,664	アメリカ合衆国	0.21
PRUDENTIAL FINANCIAL INC (REG) VAR 15/09/2042	268,000	98.76855	269,336	アメリカ合衆国	0.21
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.5% 15/05/2030	279,000	96.125	269,793	アメリカ合衆国	0.21
T-MOBILE USA INC (REG) 3.875% 15/04 /2030	278,000	93.6178	262,532	アメリカ合衆国	0.21
TACO BELL FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 25/08/2051	302,000	86.340537	261,335	アメリカ合衆国	0.21
TIF FUNDING II LLC SER 1A CL A FRN 20/08/2045	344,000	77.697217	267,470	アメリカ合衆国	0.21
VISTRA CORP (SER 144A) (REG) 3.7% 3 0/01/2027	289,000	92	270,365	アメリカ合衆国	0.21
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (RE G) VAR 30/10/2030	299,000	87.9386	264,395	アメリカ合衆国	0.21
ABENGOA TRANSMISION SUR SER 144A 6.875% 30/04/2043	222,000	113.062579	253,472	ペルー	0.20
APPLEBEE'S FUNDING LLC / IHOP FUNDI NG LLC SER 1A CL A2I FRN 07/06/2049	253,000	97.0249	246,232	アメリカ合衆国	0.19
ATHENE HOLDING LTD 3.5% 15/01/2031	293,000	84.74245	253,024	バミューダ	0.20
EQUINIX INC 2.5% 15/05/2031	316,000	81.1889	257,566	アメリカ合衆国	0.20
GS MORTGAGE SECURITIES CORP TRUST 2021-STAR SER STAR CL A FRN	269,000	96.00595	258,474	アメリカ合衆国	0.20
NEIGHBORLY ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 30/04/2051	288,000	88.016846	255,220	アメリカ合衆国	0.20
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST SER SFR5 CL A FRN 16/07/2026	285,000	89.298903	254,841	アメリカ合衆国	0.20
T-MOBILE USA INC (SER 144A) (REG) 3 .4% 15/10/2052	344,000	74.03155	257,138	アメリカ合衆国	0.20
AGL CLO 5 LTD SER 5A CL A1R FRN 20/ 07/2034	250,000	97.1663	243,562	ケイマン諸島	0.19
BOEING CO 5.04% 01/05/2027	240,000	98.57805	238,603	アメリカ合衆国	0.19
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2022-AHP SER AHP CL A FRN	244,000	98.92	241,557	アメリカ合衆国	0.19
CITIZENS FINANCIAL GROUP (REG) 3.25% 30/04/2030	260,000	89.30615	233,628	アメリカ合衆国	0.18
CROWN CASTLE INTL CORP (REG) 3.65% 01/09/2027	255,000	94.73065	244,666	アメリカ合衆国	0.19
FIRSTKEY HOMES 2020-SFRI TRUST SER SFR1 CL A FRN 17/09/2025	264,000	92.405877	244,244	アメリカ合衆国	0.19
FLORIDA ST BRD OF ADMIN FIN CO 1.705% 01/07/2027	267,000	90.768	244,627	アメリカ合衆国	0.19
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	634,923	37.901569	241,373	アメリカ合衆国	0.19
HYUNDAI AUTO RECEIVABLES TRUST SER A CL A4 FRN 17/05/2027	255,000	93.52414	238,557	アメリカ合衆国	0.19

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
MONROE CAPITAL ABS FUNDING 2021-1 LTD SER 1A CL A2 FRN 22/04/2031	257,000	93.2626	241,072	ケイマン諸島	0.19
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2020-H SER HA CL A FRN	585,000	41.441994	242,587	アメリカ合衆国	0.19
NXP BV/NXP FDG/NXP USA (REG) 3.875% 18/06/2026	243,000	96.375	234,531	オランダ	0.18
VISTRA OPERATIONS CO LLC (SER 144A) (REG) 3.55% 15/07/2024	240,000	96.625	235,829	アメリカ合衆国	0.19
BANK OF AMERICA CORP (SER MTN) (REG) VAR 14/06/2029	264,000	86.11885	227,614	アメリカ合衆国	0.18
CANTOR COMMERCIAL REAL ESTATE LENDING 2019-CF1 SER CF1 CL A2 FRN	227,000	98.03	223,214	アメリカ合衆国	0.18
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 4.2% 15/03/2028	242,000	94.283324	231,158	アメリカ合衆国	0.18
DOMINOS PIZZA MASTER ISSUER LL FRN 25/07/2047	250,000	91.892883	231,558	アメリカ合衆国	0.18
EXPEDIA INC SER WI (REG) 5% 15/02/2026 W/I	226,000	100.02775	230,332	アメリカ合衆国	0.18
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2047	470,000	47.925264	225,854	アメリカ合衆国	0.18
FIRSTKEY HOMES 2020-SFR1 TRUST SER SFR1 CL C FRN 17/08/2028	254,000	89.551	227,859	アメリカ合衆国	0.18
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 2.375% 16/02/2031	286,000	78.875	228,130	アメリカ合衆国	0.18
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 3.75% 15/06/2029	250,000	90.25	226,042	アメリカ合衆国	0.18
HCA INC (REG) 4.125% 15/06/2029	254,000	91.5	232,876	アメリカ合衆国	0.18
HOME PARTNERS OF AMERICA TRUST FRN 19/09/2029	286,000	77.510404	222,041	アメリカ合衆国	0.18
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 29/01 /2027	232,000	97.9464	231,115	アメリカ合衆国	0.18
MAGALLANES INC (SER 144A) 4.279% 15 /03/2032	249,000	89.2981	225,489	アメリカ合衆国	0.18
MARYLAND HLTH & HGR EDUCTNL 3.197% 01/07/2050	300,000	75.7118	231,931	アメリカ合衆国	0.18
MORGAN STANLEY VAR 16/09/2036	296,000	76.7985	229,468	アメリカ合衆国	0.18
NATWEST MARKETS PLC (SER 144A) 1.6% 29/09/2026	261,000	88.275817	231,467	イギリス	0.18
NEW ECONOMY ASSETS PHASE 1 SPONSOR LLC SER 1 CL A1 FRN 20/10/2061	264,000	87.52615	231,223	アメリカ合衆国	0.18
SANTANDER HOLDINGS USA (SER FXD) (R EG) 3.5% 07/06/2024	237,000	98.32915	233,593	アメリカ合衆国	0.18
SLG OFFICE TRUST 2021-OVA SER OVA CL C FRN 15/07/2041	276,000	82.5425	228,473	アメリカ合衆国	0.18
T-MOBILE USA INC (REG) 2.05% 15/02/ 2028	260,000	86.9043	227,965	アメリカ合衆国	0.18
VMWARE INC (REG) 4.7% 15/05/2030	239,000	96.51885	232,115	アメリカ合衆国	0.18
AMERICAN TOWER CORP 3.8% 15/08/2029	225,000	91.88165	209,964	アメリカ合衆国	0.17
AMSR 2020-SFR4 TRUST SER SFR4 CL A FRN 17/11/2037	232,000	91.693	212,990	アメリカ合衆国	0.17
BANK OF AMERICA CORP SER L (REG) 3.95% 21/04/2025	213,000	98.55395	211,556	アメリカ合衆国	0.17
BEACON CONTAINER FINANCE II LLC SER 1A CL A 22/10/2046	254,000	83.889018	213,244	アメリカ合衆国	0.17
COSTAR GROUP INC (SER 144A) 2.8% 15 /07/2030	250,000	84.08215	213,433	アメリカ合衆国	0.17
EBAY INC (REG) 2.7% 11/03/2030	247,000	85.20315	212,490	アメリカ合衆国	0.17
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	388,000	54.106428	210,491	アメリカ合衆国	0.17
JPMORGAN CHASE & CO VAR 13/05/2031	251,000	86.5509	218,232	アメリカ合衆国	0.17
MARVELL TECHNOLOGY INC (REG) 2.45% 15/04/2028	244,000	87.3764	214,460	アメリカ合衆国	0.17
MVW OWNER TRUST 2018-1 SER 1A CL A FRN 21/01/2036	988,000	21.875459	216,368	アメリカ合衆国	0.17
STATE OF QATAR SER REGS (REG) 5.103% 23/04/2048	200,000	105.1955	212,319	カタール	0.17
VISTRA CORP (SER 144A) (REG) 4.3% 1 5/07/2029	232,000	90.125	213,690	アメリカ合衆国	0.17

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
ANGLO AMERICAN CAPITAL SER 144A (REG) 4.75% 01/04/2027	200,000	99.189946	200,517	イギリス	0.16
ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR (REG) 4.6% 15/04/2048	221,000	89.9952	201,036	アメリカ合衆国	0.16
AT&T INC (REG) 3.5% 01/06/2041	248,000	80.1767	199,562	アメリカ合衆国	0.16
BPCE SA (REG) SER 144A 4.5% 15/03/2025	200,000	98.5367	199,723	フランス	0.16
COLT 2020-RPL1 TRUST SER RPL1 CL A1 FRN 25/01/2065	313,000	66.310703	207,817	アメリカ合衆国	0.16
DEUTSCHE BANK NY (REG) VAR 07/01/2028	229,000	86.86895	201,755	ドイツ	0.16
ENTERPRISE PRODUCTS OPER (SER E) VAR 16/08/2077	233,000	84.745	202,043	アメリカ合衆国	0.16
FN BMI277 FRN 01/05/2047	700,000	28.297824	198,758	アメリカ合衆国	0.16
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY CREDIT RISK DEBT NOTES SER DNA5 CL	203,000	100.5709	204,338	アメリカ合衆国	0.16
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 22/04/2031	243,000	85.1716	208,142	アメリカ合衆国	0.16
MACQUARIE BANK LTD (REG) SER 144A 4.875% 10/06/2025	200,000	100.23145	201,032	オーストラリア	0.16
PNC FINANCIAL SERVICES (SER T) VAR PERP 31/12/2049	261,000	76.375	199,733	アメリカ合衆国	0.16
SAUDI INTERNATIONAL BOND (SER REGS) (REG S) (REG) 4.375% 16/04/2029	200,000	101.7268	205,277	サウジアラビア	0.16
SESAC FINANCE LLC SER 1 CL A2 FRN 25/07/2049	221,000	92.935066	207,447	アメリカ合衆国	0.16
UNITED AIR 2014-2 A PTT SER A 03/09/2026	319,000	60.960363	197,171	アメリカ合衆国	0.16
UNIV OF CALIFORNIA CA RGTS MED 3.006% 15/05/2050	270,000	75.703	205,435	アメリカ合衆国	0.16
VR FUNDING LLC FRN 15/11/2050	291,000	69.680379	203,636	アメリカ合衆国	0.16
ARES CAPITAL CORP 2.15% 15/07/2026	217,000	84.4099	185,321	アメリカ合衆国	0.15
BANCO SANTANDER SA (REG) 4.379% 12/04/2028	200,000	96.02545	193,973	スペイン	0.15
BANK OF AMERICA CORP VAR 29/04/2031	224,000	85.2965	192,064	アメリカ合衆国	0.15
BARINGS CLO LTD 2013-I SER IA CL AR FRN 20/01/2028	255,000	74.488858	190,357	ケイマン諸島	0.15
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2050	250,000	75.016134	187,897	アメリカ合衆国	0.15
GMF FLOORPLAN OWNER REVOLVING TRUST SER 1 CL A FRN 15/08/2025	200,000	96.65088	193,362	アメリカ合衆国	0.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.3% 1 5/11/2030	239,000	78.4237	188,135	アメリカ合衆国	0.15
N/A SER INVI CL A1 FRN 25/06/2026	269,000	72.104659	194,187	アメリカ合衆国	0.15
ROYAL BK SCOTLND GRP PLC (REG) VAR 01/11/2029	200,000	95.95405	193,159	イギリス	0.15
SCF EQUIPMENT LEASING 2019-2 LLC SE R 2A CL C FRN 21/06/2027	203,000	95.86897	194,807	アメリカ合衆国	0.15
VANTAGE DATA CENTERS LLC FRN 15/07/ 2044	198,000	94.662387	187,704	アメリカ合衆国	0.15
WILLIAMS PARTNERS LP (REG) 3.75% 15/06/2027	198,000	95.66005	189,737	アメリカ合衆国	0.15
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 2.87 5% 14/08/2024	185,000	95.63415	178,947	アイルランド	0.14
AES PANAMA GENERATION HL (SER 144A) (REG) 4.375% 31/05/2030	200,000	87.625	176,003	パナマ	0.14
AKER BP ASA (SER 144A) (REG) 4% 15/01/2031	198,000	89.62775	181,115	ノルウェー	0.14
ASHTAD CAPITAL INC (SER 144A) (REG) 1.5% 12/08/2026	200,000	87.25	175,658	アメリカ合衆国	0.14
BANK OF AMERICA CORP (SER MTN) (REG) 3.248% 21/10/2027	184,000	94.45345	174,956	アメリカ合衆国	0.14
BENCHMARK 2018-B1 MORTGAGE TRUST SER B12 CL A2 FRN 15/08/2052	185,000	96.082408	178,208	アメリカ合衆国	0.14
BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030	170,000	99.57585	170,982	アメリカ合衆国	0.13
BROADCOM INC (SER 144A) (REG) 3.419 % 15/04/2033	218,000	82.74125	181,949	アメリカ合衆国	0.14
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2020-V KNG SER VKNG CL A FRN 15/10/2037	236,000	72.980995	172,356	アメリカ合衆国	0.14
CF HIPPOLYTA LLC SER 1A CL A1 FRN 15/03/2061	204,000	85.220114	173,983	アメリカ合衆国	0.14

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
CLI FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 18/02/2046	235,000	76.94731	180,949	アメリカ合衆国	0.14
CNO FINANCIAL GROUP INC (REG) 5.25% 30/05/2029	184,000	97.375	180,002	アメリカ合衆国	0.14
CSMC 2021-AFC1 TRUST SER AFC1 CL A1 FRN 25/03/2056	333,000	54.61744	182,027	アメリカ合衆国	0.14
CSMC 2021-RPL2TRUST SER RPL2 CL A1A FRN 25/01/2060	278,000	64.572605	179,702	アメリカ合衆国	0.14
DAE FUNDING LLC (SER 144A) 3.375% 2 0/03/2028	200,000	87.25	176,394	アラブ 首長国連邦	0.14
DIAMOND INFRASTRUCTURE FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 15/04/2049	211,000	86.20583	182,008	アメリカ合衆国	0.14
EXPEDIA GROUP INC (REG) 4.625% 01/0 8/2027	181,000	96.3166	177,821	アメリカ合衆国	0.14
EXPEDIA GROUP INC (SER WI) (REG) 3.25% 15/02/2030	207,000	83.43245	175,247	アメリカ合衆国	0.14
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/10 /2046	475,000	37.132778	176,854	アメリカ合衆国	0.14
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY CREDIT RISK DEBT NOTES SER DNA1 CL	176,000	97.3029	171,284	アメリカ合衆国	0.14
FREEPORT-MCMORAN INC (REG) 5.45% 15 /03/2043	187,000	93.25	177,378	アメリカ合衆国	0.14
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 4.35% 17/01/2027	184,000	96.1712	180,601	アメリカ合衆国	0.14
JBS USA/FOOD/FINANCE (SER 144A) (REG) 5.75% 01/04/2033	183,000	95.479	175,019	ルクセンブルグ	0.14
JPMORGAN CHASE & CO (SER HH) (REG) VAR PERP 31/12/2049	199,000	85	172,964	アメリカ合衆国	0.14
MACQUARIE BANK LTD (SER 144A) (REG) 3.624% 03/06/2030	200,000	87.78525	176,134	オーストラリア	0.14
MIDWEST CONNECTOR CAPIT (SER 144A) (REG) 3.9% 01/04/2024	180,000	98.2063	178,526	アメリカ合衆国	0.14
NEW JERSEY ST TRANSPRTN TRUST 4.081% 15/06/2039	199,000	91.065	181,580	アメリカ合衆国	0.14
NIPPON LIFE INSURANCE (SER 144A) VA R 21/01/2051	207,000	81.13685	170,483	日本	0.13
SONIC CAPITAL LLC SER 1A CL A2I FRN 20/01/2050	183,000	93.297343	170,945	アメリカ合衆国	0.13
TEACHERS INSUR & ANNUITY (REG) SER 144A 4.27% 15/05/2047	193,000	89.793197	174,354	アメリカ合衆国	0.14
ADANI PORTS AND SPECIAL (SER 144A) 3.1% 02/02/2031	200,000	77.84415	158,254	インド	0.12
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 1.75% 30/0 1/2026	190,000	87.3257	167,313	アイルランド	0.13
AT&T INC 3.65% 01/06/2051	210,000	78.00615	164,452	アメリカ合衆国	0.13
BANK OF AMERICA CORP VAR 08/03/2037	181,000	86.6284	158,982	アメリカ合衆国	0.13
CDW LLC/CDW FINANCE 3.569% 01/12/20 31	202,000	83.2095	168,684	アメリカ合衆国	0.13
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/10/2051	196,000	83.390611	164,522	アメリカ合衆国	0.13
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.5% 01/06/2027	158,000	101.2692	160,730	アメリカ合衆国	0.13
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2050	470,000	34.874378	164,457	アメリカ合衆国	0.13
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2045	616,000	26.486599	163,659	アメリカ合衆国	0.13
FLAGSTAR MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 1 CL A2 FRN 01/02/2051	258,000	63.420694	164,033	アメリカ合衆国	0.13
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	580,000	29.040461	168,888	アメリカ合衆国	0.13
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 5.375% 15/04/2026	163,000	98.4136	162,264	アメリカ合衆国	0.13
GM FINANCIAL CONSUMER AUTOMOBILE RECEIVABLES TRUST SER 2 CL A4 FRN	171,000	93.90357	160,634	アメリカ合衆国	0.13
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER H) (REG) 3.375% 15/12/2029	195,000	84.70665	165,470	アメリカ合衆国	0.13
HYUNDAI CAPITAL AMERICA (SER 144A) 1.0% 17/09/2024	175,000	93.32415	163,823	アメリカ合衆国	0.13
JEFFERIES GRP LLC / CAP (REG) 4.15% 23/01/2030	176,000	91.0125	163,388	アメリカ合衆国	0.13
KRAFT HEINZ FOODS CO (REG) 4.375% 0 1/06/2046	194,000	83.7078	163,100	アメリカ合衆国	0.13
LUNDIN ENERGY FI (SER 144A) (REG) 3.1% 15/07/2031	200,000	83.5	169,859	オランダ	0.13

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 4.975% 06/02/2026	158,000	101.125	162,944	アメリカ合衆国	0.13
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.75% 24/05/2031	203,000	81.29405	165,601	アメリカ合衆国	0.13
VANTAGE DATA CENTERS LLC SER 1A CL A2 FRN 15/09/2045	181,000	91.00467	164,851	アメリカ合衆国	0.13
VERIZON OWNER TRUST 2020-C SER C CL C FRN 21/04/2025	171,000	95.52761	163,392	アメリカ合衆国	0.13
WENDY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 15/06/2051	189,000	83.778908	158,540	アメリカ合衆国	0.13
WESTERN DIGITAL CORP (REG) 4.75% 15/02/2026	167,000	96	163,317	アメリカ合衆国	0.13
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 15/05/2 030	173,000	87.8641	152,624	アメリカ合衆国	0.12
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST FRN 25/07/2066	246,000	61.809376	152,190	アメリカ合衆国	0.12
ARES CAPITAL CORP 3.875% 15/01/2026	166,000	92.28485	156,159	アメリカ合衆国	0.12
BARCLAYS PLC SER (REG) 4.375% 12/01/2026	151,000	98.74615	152,208	イギリス	0.12
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2021-VOLT SER VOLT CL C FRN	158,000	93.2025	147,399	アメリカ合衆国	0.12
CGI INC (SER 144A) 1.45% 14/09/2026	171,000	88.41635	151,929	カナダ	0.12
COLT 2021-3 MORTGAGE LOAN TRUST SER 3 CL A1 FRN 27/09/2066	216,000	71.317054	154,189	アメリカ合衆国	0.12
CVS HEALTH CORP 3.75% 01/04/2030	160,000	93.65875	151,354	アメリカ合衆国	0.12
DBJPM 20-C9 MORTGAGE TRUST SER C9 CL A2 FRN 15/09/2053	166,000	93.247	155,053	アメリカ合衆国	0.12
ENBRIDGE INC (SER 20-A) (REG) VAR 15/07/2079	162,000	91.125	151,918	カナダ	0.12
FANNIE MAE - CAS FRN 25/03/2042	161,000	90.384365	145,581	アメリカ合衆国	0.11
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2050	180,000	82.915892	149,753	アメリカ合衆国	0.12
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2047	400,000	38.662375	155,063	アメリカ合衆国	0.12
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022-DNA3 SER DNA3 CL MIA FRN	164,000	93.692985	153,727	アメリカ合衆国	0.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 21/10/2032	177,000	82.5691	147,059	アメリカ合衆国	0.12
JACK IN THE BOX FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 26/02/2052	170,000	90.575462	154,564	アメリカ合衆国	0.12
KLA-TENCOR CORP (REG) 4.1% 15/03/20 29	153,000	99.0594	153,408	アメリカ合衆国	0.12
LIFE 2021-BMR MORTGAGE TRUST SER BMR CL A FRN 15/03/2038	162,000	94.358253	152,949	アメリカ合衆国	0.12
MARRIOTT INTERNATIONAL (SER HH) (REG) 2.85% 15/04/2031	174,000	83.4666	146,279	アメリカ合衆国	0.12
MERIT 2020 SER MHIL CL A FRN 15/01/2027	158,000	95.355	150,739	アメリカ合衆国	0.12
MORGAN STANLEY SER GMTN (REG) 3.875% 27/01/2026	145,000	98.51	145,243	アメリカ合衆国	0.11
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2021-A SER A CL A FRN	329,000	46.995447	154,680	アメリカ合衆国	0.12
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 5% 15/03/2027	149,000	100.1875	151,473	アメリカ合衆国	0.12
STARWOOD MORTGAGE RESIDENTIAL TRUST 2022-1 SER 1 CL A1 FRN 25/12/2066	172,000	88.710473	152,909	アメリカ合衆国	0.12
T-MOBILE USA INC (REG) 4.5% 15/04/2 050	170,000	88.68355	152,377	アメリカ合衆国	0.12
TARGA RESOURCES CORP (REG) 4.95% 15/04/2052	175,000	86.5112	153,440	アメリカ合衆国	0.12
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 2.7% 22/ 06/2030 WI	192,000	81.12515	155,890	アメリカ合衆国	0.12
ZAXBY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 30/07/2051	168,000	87.583529	148,057	アメリカ合衆国	0.12
AMAZON.COM INC (REG) 4.05% 22/08/2047	152,000	93.92045	144,965	アメリカ合衆国	0.11
AMSR 2019-SFR1 TRUST 2.153% 17/06/2038	156,000	86.482321	135,192	アメリカ合衆国	0.11
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER 144A) (REG) 4% 15/01/2029	167,000	81.9991	139,963	アメリカ合衆国	0.11

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER 144A) (REG) 2.35% 22/11/2024	154,000	92.1396	142,287	アメリカ合衆国	0.11
CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2019-PRM SER PRM CL A FRN	140,000	98.638	138,483	アメリカ合衆国	0.11
CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST SER GC46 CL A2 FRN 15/01/2053	150,000	95.91	144,204	アメリカ合衆国	0.11
COLT 2021-HX1 MORTGAGE LOAN TRUST SER HX1 CL A1 FRN 25/10/2066	187,000	72.622223	135,952	アメリカ合衆国	0.11
CSMC 2020-NET SER NET CL A FRN 15/08/2037	150,000	90.819141	136,505	アメリカ合衆国	0.11
CVS HEALTH CORP (REG) 5.05% 25/03/2048	141,000	95.755	136,913	アメリカ合衆国	0.11
ENBRIDGE INC (REG) VAR 01/03/2078	153,000	89.125	139,549	カナダ	0.11
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2050	400,000	33.300568	133,647	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY CREDIT RISK DEBT NOTES SER DNA2 CL	150,000	92.4765	138,776	アメリカ合衆国	0.11
FREEPORT-MCMORAN INC (REG) 4.25% 01 /03/2030	155,000	91.75	144,408	アメリカ合衆国	0.11
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 137 CL IO FRN	2,604,000	5.136159	135,153	アメリカ合衆国	0.11
LIBERTY MUTUAL GROUP INC (SER 144A) 5.5% 15/06/2052	140,000	95.09095	133,470	アメリカ合衆国	0.11
MPLX LP (REG) 4% 15/03/2028	139,000	94.9163	133,571	アメリカ合衆国	0.11
ONSLow BAY MORTGAGE LOAN TRUST SER NQM3 CL A1 FRN 25/07/2061	214,000	66.054354	141,507	アメリカ合衆国	0.11
OWENS CORNING (REG) 3.95% 15/08/202 9	148,000	92.79825	139,550	アメリカ合衆国	0.11
SBL HOLDINGS INC (SER 144A) 5% 18/02/2031	159,000	85.01755	138,115	アメリカ合衆国	0.11
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2019-4 SE R 4 CL A1 FRN 25/10/2059	285,000	48.828853	139,517	アメリカ合衆国	0.11
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/03/2046	177,000	78.084193	138,302	アメリカ合衆国	0.11
UNITED AIR 2016-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 07/01/2030	208,000	66.273347	140,585	アメリカ合衆国	0.11
UNIVERSAL HEALTH SVCS (SER 144A) 1. 65% 01/09/2026	153,000	86.7934	133,635	アメリカ合衆国	0.11
US AIRWAYS 2012-1A PTT (REG) FRN 01/04/2026	323,000	41.728822	137,102	アメリカ合衆国	0.11
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 4% 22/06 /2050 WI	205,000	66.93055	137,413	アメリカ合衆国	0.11
WELLS FARGO & COMPANY VAR 30/04/2041	175,000	78.1173	137,615	アメリカ合衆国	0.11
ABPCI DIRECT LENDING FUND ABS I LTD SER 1A CL A FRN 20/12/2030	130,000	95.14844	124,513	アメリカ合衆国	0.10
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 1.65 % 29/10/2024	136,000	92.38895	126,035	アイルランド	0.10
ALASKA AIR 2020-1 CL B (SER 144A) (REG) 8% 15/08/2025	169,000	75.38701	131,091	アメリカ合衆国	0.10
AMER AIRLINE 17-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/08/2030	175,000	69.697612	123,913	アメリカ合衆国	0.10
CHOICE HOTELS INTL INC (REG) 3.7% 0 1/12/2029	143,000	89.38805	128,266	アメリカ合衆国	0.10
CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2019-SMRT SER SMRT CL A FRN	123,000	99.4375	122,733	アメリカ合衆国	0.10
CLI FUNDING VIII LLC SER 1A CL A1 FRN 18/01/2047	140,000	85.606501	119,982	アメリカ合衆国	0.09
CSMC 2021-NQM6 SER NQM6 CL A1 FRN 25/07/2066	191,000	68.333973	130,671	アメリカ合衆国	0.10
DATABANK ISSUER SER 2A CL A2 FRN 25/10/2051	141,000	88.69114	125,111	アメリカ合衆国	0.10
DEEPHAVEN RESIDENTIAL MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 2 CL A1 FRN	214,000	58.566106	125,439	アメリカ合衆国	0.10
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 5.3% 01/10/2029	122,000	98.6162	121,928	アメリカ合衆国	0.10
DELTA AIR LINES/SKYMILES (SER 144A) (REG) 4.75% 20/10/2028	134,102	94.62825	128,155	アメリカ合衆国	0.10

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
DEUTSCHE BANK NY VAR 16/11/2027	150,000	86.2784	129,851	ドイツ	0.10
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2I FRN 25/04/2051	150,000	85.829643	129,477	アメリカ合衆国	0.10
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 2A CL A2 FRN 20/01/2051	140,000	89.356645	125,986	アメリカ合衆国	0.10
EQUINIX INC (REG) 1.55% 15/03/2028	146,000	84.13855	123,509	アメリカ合衆国	0.10
FIRSTKEY HOMES 2020-SFRI TRUST SER SFR1 CL A FRN 17/08/2028	137,000	89.503383	122,795	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC FRN 01/12/2046	385,000	34.187722	131,975	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC FRN 01/12/2049	270,000	48.680349	131,798	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	320,000	37.436938	120,119	アメリカ合衆国	0.09
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2019-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	137,000	94.7778	130,595	ケイマン諸島	0.10
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 40 CL IO FRN	1,975,000	6.435722	128,410	アメリカ合衆国	0.10
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER I) (REG) 3.5% 15/09/2030	145,000	85.42095	125,355	アメリカ合衆国	0.10
J.P. MORGAN CHASE COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES TRUST 2021-OP0	135,000	92.506	125,223	アメリカ合衆国	0.10
LEVEL 3 FINANCING INC (SER 144A) (REG) 3.4% 01/03/2027	140,000	87.375	123,912	アメリカ合衆国	0.10
METLIFE INC (REG) 6.4% 15/12/2036	129,000	99.7017	128,982	アメリカ合衆国	0.10
N/A SER 1A CL A2 FRN 01/02/2062	125,000	95.8412	120,622	カナダ	0.10
NEW RESIDENTIAL MORTGAGE LOAN TRUST SER 1A CL A1B FRN 25/10/2059	250,000	49.785135	124,839	アメリカ合衆国	0.10
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 2.4 5% 02/12/2027	142,000	86.074427	122,506	アメリカ合衆国	0.10
OCEAN TRAILS CLO FRN 15/10/2034	125,000	96.3416	121,032	ケイマン諸島	0.10
ONSLow BAY MORTGAGE LOAN TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2061	202,000	61.575813	124,515	アメリカ合衆国	0.10
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) VAR 06/01/2028	146,000	88.64095	131,183	アメリカ合衆国	0.10
SERVPRO MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 25/04/2051	150,000	85.17666	128,420	アメリカ合衆国	0.10
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST 2020-PT-A SER PTA CL A2A FRN	183,000	69.484451	127,193	アメリカ合衆国	0.10
SONIC CAPITAL LLC SER 1A CL A2I FRN 20/08/2051	144,000	85.1273	122,679	アメリカ合衆国	0.10
T-MOBILE USA INC (REG) 3.75% 15/04/ 2027	131,000	96.293	127,181	アメリカ合衆国	0.10
TARGA RESOURCES PARTNERS (REG) 4% 15/01/2032	146,000	85.5	127,523	アメリカ合衆国	0.10
UNIVERSAL HEALTH SVCS (SER 144A) (REG) 2.65% 15/10/2030	160,000	80.625	129,895	アメリカ合衆国	0.10
VERUS SECURITIZATION TRUST SER 3 CL A1 FRN 25/06/2066	207,000	58.85309	121,942	アメリカ合衆国	0.10
VISIO 2020-1R TRUST SER 1R CL A1 FRN 25/11/2055	360,000	33.624348	121,196	アメリカ合衆国	0.10
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST FRN 20/01/2065	211,000	56.172984	118,643	アメリカ合衆国	0.09
ARES CAPITAL CORP (REG) 2.875% 15/0 6/2028	140,000	79.31345	111,218	アメリカ合衆国	0.09
ARES CAPITAL CORP (REG) 4.2% 10/06/2024	120,000	97.8393	117,701	アメリカ合衆国	0.09
AVIS BUDGET RENTAL CAR FUNDING AESO P LLC SER 1A CL A FRN 20/08/2026	125,000	95.20291	119,093	アメリカ合衆国	0.09
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER 144A) (REG) 2.7% 15/01/2025	119,000	91.3446	110,155	アメリカ合衆国	0.09
COLT FUNDING LLC SER 2 CL A1 FRN 25/08/2066	162,000	73.092697	118,515	アメリカ合衆国	0.09
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES 2019- ICE4 SER ICE4 CL	122,000	97.368	118,923	アメリカ合衆国	0.09

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
DOMINION ENERGY INC (SER C) 3.375% 01/04/2030	121,000	91.46065	111,688	アメリカ合衆国	0.09
ELARA HGV TIMESHARE ISSUER 2019-A L LC SER A CL A FRN 25/01/2034	300,000	38.720595	116,215	アメリカ合衆国	0.09
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2050	305,000	35.093181	107,356	アメリカ合衆国	0.08
FOOTHILL ESTRN TRANSPRTN CORRI 4.094% 15/01/2049	139,000	84.125	119,558	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/09 /2047	415,000	28.052761	116,814	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/11/2046	315,000	34.146605	107,895	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022- DNA4 SER DNA4 CL MIB FRN 25/05/2042	117,000	94.559394	110,668	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022- DNA4 SER DNA4 CL MIB FRN 25/05/2042	126,000	95.1191	119,902	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY CREDIT RISK DEBT NOTES SER DNA2 CL	138,000	85.4766	118,003	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A FRN 16/06/2062	2,131,000	5.154478	112,001	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 3 CL IO FRN	1,880,000	5.716871	108,613	アメリカ合衆国	0.09
GSMS 2019-GC40 A2 SER GC40 CL A2 FRN 10/07/2052	115,000	98.367	113,407	アメリカ合衆国	0.09
IRVINE CORE OFFICE TRUST 2013-IRV SER IRV CL A2 FRN 15/05/2048	120,000	99.0785	119,124	アメリカ合衆国	0.09
JEFFERIES GRP LLC / CAP (REG) 4.85% 15/01/2027	112,000	100.402	114,955	アメリカ合衆国	0.09
KRAFT HEINZ FOODS CO (REG) 5.5% 01/ 06/2050	118,000	96.4153	114,311	アメリカ合衆国	0.09
LIFE 2021-BMR MORTGAGE TRUST SER BMR CL D FRN 15/03/2038	126,000	93.087764	117,398	アメリカ合衆国	0.09
PNC FINANCIAL SERVICES (REG) VAR PERP	116,000	97	113,292	アメリカ合衆国	0.09
PROVIDENT FUNDING MORTGAGE TRUST 2020-F1 SER F1 CL A2 FRN 25/01/2036	207,000	53.035436	109,990	アメリカ合衆国	0.09
QORVO INC (SER 144A) 1.75% 15/12/20 24	122,000	93.5	114,165	アメリカ合衆国	0.09
SCF EQUIPMENT LEASING 2021-1 LLC SER 1A CL B FRN 20/08/2029	122,000	91.804552	112,053	アメリカ合衆国	0.09
SIERRA TIMESHARE 2021-1 RECEIVABLES FUNDING LLC SER 1A CL A FRN	232,000	46.729751	108,449	アメリカ合衆国	0.09
SUNOCO LOGISTICS PARTNER (REG) 5.4% 01/10/2047	125,000	88.2854	112,044	アメリカ合衆国	0.09
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2018-1 SER 1 CL A1 FRN 25/01/2058	459,000	25.594084	117,784	アメリカ合衆国	0.09
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2020-4 SER 4 CL A1 FRN 25/10/2060	184,000	59.397935	109,465	アメリカ合衆国	0.09
TRANSCANADA PIPELINES (REG) 4.25% 1 5/05/2028	114,000	97.4407	111,701	カナダ	0.09
VANTAGE DATA CENTERS LLC SER 2A CL A2 FRN 15/09/2045	130,000	87.58864	113,980	アメリカ合衆国	0.09
VERIZON COMMUNICATIONS	121,000	96.372	117,497	アメリカ合衆国	0.09
VERUS SECURITIZATION TRUST 2021-5 SER 5 CL A1 FRN 25/09/2066	161,000	71.757203	115,643	アメリカ合衆国	0.09
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (REG) VAR 02/03/2033	131,000	88.6694	117,608	アメリカ合衆国	0.09
ARROYO MORTGAGE TRUST 2021-1R SER 1R CL A1 FRN 25/10/2048	171,000	57.528266	98,479	アメリカ合衆国	0.08
BOCA COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2022-BOCA SER BOCA CL A FRN	107,000	98.53162	105,537	アメリカ合衆国	0.08
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2021-ACNT SER ACNT CL A FRN	106,000	96.395	102,260	アメリカ合衆国	0.08
CARS-DB4 LP SER 1A CL A1 FRN 15/02/2050	125,000	84.808519	106,145	アメリカ合衆国	0.08
CITIGROUP INC VAR 01/05/2032	119,000	82.37895	98,539	アメリカ合衆国	0.08

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
CSMC 2021-NQM2 SER NQM2 CL A1 FRN 25/02/2066	205,000	50.083973	102,783	アメリカ合衆国	0.08
DELL INT LLC / EMC CORP (SER 144A) 3.45% 15/12/2051	144,000	68.05185	98,215	アメリカ合衆国	0.08
DIAMONDBACK ENERGY INC (REG) 3.125% 24/03/2031	120,000	86.71605	105,070	アメリカ合衆国	0.08
DISCOVER FINANCIAL SVS (REG) 4.1% 09/02/2027	102,000	96.0504	99,621	アメリカ合衆国	0.08
EMERA US FINANCE LP (REG) SER WI 3.55% W/I 15/06/2026	110,000	96.00175	105,775	アメリカ合衆国	0.08
ENERGY TRANSFER LP (REG) 4.2% 15/04/2027	103,000	95.76775	99,554	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2049	100,000	96.355423	96,683	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2051	128,000	82.416103	105,736	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2047	395,000	24.850237	98,531	アメリカ合衆国	0.08
GCAT SER NQM3 CL A1 FRN 25/05/2066	194,000	54.593613	106,029	アメリカ合衆国	0.08
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2020-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	100,000	96.209	96,842	アメリカ合衆国	0.08
HUNTINGTON INGALLS INDUS (SER WI) (REG) 4.2% 01/05/2030 (WHEN ISSUED)	102,000	94.5766	97,518	アメリカ合衆国	0.08
JOHN DEERE OWNER TRUST 2020-B SER B CL A4 FRN 15/06/2027	111,000	95.27594	105,792	アメリカ合衆国	0.08
KINDER MORGAN ENER PART (REG) 7.75% 15/03/2032	83,000	115.8529	98,052	アメリカ合衆国	0.08
KNDL 2019-KNSQ MORTGAGE TRUST SER K NSQ CL C FRN 15/05/2036	100,000	97.123	97,194	アメリカ合衆国	0.08
LAZARD GROUP LLC (REG) 4.375% 11/03 /2029	99,000	95.5707	95,938	アメリカ合衆国	0.08
MARRIOTT INTERNATIONAL (SER FF) (REG) 4.625% 15/06/2030	106,000	96.1718	102,160	アメリカ合衆国	0.08
MFRA TRUST SER INV1 CL A1 FRN 25/01/2056	243,000	42.567272	103,522	アメリカ合衆国	0.08
MPLX LP (SER WI) (REG) 4.25% 01/12/ 2027	101,000	96.625	97,949	アメリカ合衆国	0.08
NEW YORK LIFE INSURANCE (SER 144A) (REG) 3.75% 15/05/2050	115,000	82.86485	95,846	アメリカ合衆国	0.08
NISOURCE INC (REG) 3.6% 01/05/2030	103,000	91.86285	95,237	アメリカ合衆国	0.08
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 4.4 5% 15/06/2029	107,000	90.375	96,913	アメリカ合衆国	0.08
ONE MARKET PLAZA TRUST SER 1MKT CLS D FRN 10/02/2032	100,000	94.3725	94,718	アメリカ合衆国	0.07
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP SER R VAR PERP	106,000	90.75	96,623	アメリカ合衆国	0.08
PROGRESS RESIDENTIAL 2020-SFR1 TRUST SER SFR1 CL A FRN 17/04/2037	100,000	94.936	95,080	アメリカ合衆国	0.07
TIF FUNDING II LLC SER 1A CL A FRN 20/02/2046	126,000	77.161272	97,281	アメリカ合衆国	0.08
VERUS SECURITIZATION TRUST SER 1 CL A1 FRN 25/01/2066	248,000	42.781552	106,179	アメリカ合衆国	0.08
WORKDAY INC(REG) 3.8% 01/04/2032	107,000	91.30135	98,709	アメリカ合衆国	0.08
AMERICAN HOMES 4 RENT (REG) 4.25% 15/02/2028	93,000	95.58425	90,387	アメリカ合衆国	0.07
BARCLAYS COMMERCIAL MORTGAGE S SER SRCH CL D VAR 10/08/2035	100,000	93.9595	94,315	アメリカ合衆国	0.07
BRITISH AIR 13-1 A PTT (REG) SER 144A 4.625% 20/06/2024	200,000	42.781048	85,845	イギリス	0.07
CVS HEALTH CORP (REG) 4.3% 25/03/2028	87,000	99.42855	87,500	アメリカ合衆国	0.07
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 5.85% 15/07/2025	80,000	103.2657	84,771	アメリカ合衆国	0.07
ELLINGTON FINANCIAL MORTGAGE TRUST 2017-1 SER 2 CL A1 FRN 25/06/2066	153,000	60.090281	92,021	アメリカ合衆国	0.07
ENERGY TRANSFER PARTNERS (REG) 5.15% 15/03/2045	95,000	85.8932	83,039	アメリカ合衆国	0.07
EXETER AUTOMOBILE RECEIVABLES TRUST 2020-1 SER 1A CL C FRN 15/01/2025	185,000	46.879716	86,842	アメリカ合衆国	0.07
EXPEDIA GROUP INC (REG) 2.95% 15/03 /2031	105,000	80.355	85,285	アメリカ合衆国	0.07

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2051	106,000	88.26855	93,781	アメリカ合衆国	0.07
GOLDEN ST TOBACCO SECURITIZATI 4.214% 01/06/2050	101,000	83.048	84,044	アメリカ合衆国	0.07
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 53 CL IO FRN	1,413,000	6.5392	93,236	アメリカ合衆国	0.07
HOME PARTNERS OF AMERICA 2021-2 TRUST SER 2 CL A FRN 17/12/2026	100,000	85.641199	85,794	アメリカ合衆国	0.07
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER F) (REG) 4.5% 01/02/2026	87,000	98.55735	87,376	アメリカ合衆国	0.07
HOTWIRE FUNDING LLC SER 2021-1 CL A 2 20/11/2051	94,000	89.16353	83,880	アメリカ合衆国	0.07
HYUNDAI CAPITAL AMERICA (SER 144A) (REG) 1.8% 15/10/2025	100,000	91.74135	92,121	アメリカ合衆国	0.07
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2019-F SER FA CL A2 FRN 15/0	200,000	45.063076	90,235	アメリカ合衆国	0.07
NEIGHBORLY ISSUER 2022-1 SER 1A CL A2 FRN 30/01/2052	109,000	86.040911	94,467	アメリカ合衆国	0.07
NEWMONT GOLDCORP CORP (REG) 2.8% 01 /10/2029	102,000	88.50725	90,991	アメリカ合衆国	0.07
NISSAN MOTOR ACC CO (SER 144A) 1.12 5% 16/09/2024	92,000	91.9838	84,927	アメリカ合衆国	0.07
OXFORD FINANCE FUNDING 2019-1 LLC SER 1A CL A2 FRN 15/02/2027	150,000	55.552488	83,520	アメリカ合衆国	0.07
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST FRN 17/09/2038	105,000	87.98716	92,534	アメリカ合衆国	0.07
QORVO INC (SER 144A) (REG) 3.375% 0 1/04/2031	113,000	79.5	90,788	アメリカ合衆国	0.07
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.2% 15/03/2028	85,000	96.25	82,864	アメリカ合衆国	0.07
STARVEST EMERGING MARKETS CBO I SER 2 CL A1 FRN 25/05/2065	209,000	41.917723	87,683	アメリカ合衆国	0.07
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/09/2045	115,000	76.50058	88,041	アメリカ合衆国	0.07
VCP RRL ABS I LTD 2021 SER 1A CL A FRN 20/10/2031	100,000	83.939427	84,324	アメリカ合衆国	0.07
VERISIGN INC (REG) 2.7% 15/06/2031	115,000	80.75	93,001	アメリカ合衆国	0.07
VIATRIS INC (REG) 2.3% 22/06/2027 WI	100,000	86.8785	86,936	アメリカ合衆国	0.07
WORKDAY INC (REG) 3.5% 01/04/2027	94,000	95.83595	90,908	アメリカ合衆国	0.07
AIR LEASE CORP (REG) 2.1% 01/09/202 8	95,000	80.583	77,219	アメリカ合衆国	0.06
AIR LEASE CORP (SER MTN) (REG) 2.87 5% 15/01/2026	87,000	91.86545	81,076	アメリカ合衆国	0.06
AMER AIRLINE 16-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/01/2028	105,000	68.401462	73,140	アメリカ合衆国	0.06
AMER AIRLINE 21-1A EETC (REG) 2.875 % 11/07/2034	87,000	85.0749	75,634	アメリカ合衆国	0.06
AQUA FINANCE TRUST 2017-A SER A CL A FRN 17/07/2046	106,000	70.387173	74,660	アメリカ合衆国	0.06
AUTONATION INC 4.75% 01/06/2030	83,000	94.30675	78,603	アメリカ合衆国	0.06
BBCMS TRUST SER C6 CL A2 FRN 15/02/2053	74,000	97.169	72,071	アメリカ合衆国	0.06
BOEING CO (REG) 3.2% 01/03/2029	86,000	87.19495	75,905	アメリカ合衆国	0.06
BRITISH AIR 20-1 B PTT (SER 144A) (REG) 8.375% 15/11/2028	141,000	54.460286	78,298	アメリカ合衆国	0.06
CHOICE HOTELS INTL INC 3.7% 15/01/2 031	91,000	88.24325	81,854	アメリカ合衆国	0.06
COMM 2020-CX MORTGAGE TRUST SER CX CL D FRN 10/11/2046	100,000	81.6965	81,920	アメリカ合衆国	0.06
CONNECTICUT AVENUE SECURITIES TRUST 2022-R06 SER R06 CL 1M1 FRN	74,000	96.925322	71,752	アメリカ合衆国	0.06
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES SER NQM5 CL A1 FRN	119,000	66.815321	79,583	アメリカ合衆国	0.06
CSMC 2021-NQM3 SER NQM3 CL A1 FRN 25/04/2066	147,000	53.729271	79,061	アメリカ合衆国	0.06
DB MASTER FINANCE LLC SER A1 CL A2II FRN 20/11/2047	78,000	91.317856	71,574	アメリカ合衆国	0.06

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2048	81,000	94.887811	77,588	アメリカ合衆国	0.06
EQUINIX INC (REG) 3.2% 18/11/2029	87,000	89.0335	77,792	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	143,000	50.526145	72,445	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	175,000	43.28982	75,963	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2047	165,000	42.996554	71,133	アメリカ合衆国	0.06
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022-DNA3 SER DNA3 CL M1B FRN	87,000	93.7253	81,587	アメリカ合衆国	0.06
GCAT 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/01/2066	178,000	40.990816	73,023	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO VAR 01/12/2062	1,090,000	6.434687	70,920	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 11 CL IO FRN	1,123,000	6.856392	77,882	アメリカ合衆国	0.06
JETBLUE 2019-1 CLASS AA (SER AA) (REG) 2.75% 15/05/2032	103,000	76.495246	79,139	アメリカ合衆国	0.06
KRAFT FOODS GROUP INC (REG) 5% 04/06/2042	76,000	91.7407	70,008	アメリカ合衆国	0.06
METLIFE INC (REG) 9.25% 08/04/2038	60,000	117.7416	71,925	アメリカ合衆国	0.06
MORGAN STANLEY (SER GMTN) (REG) VAR 21/07/2032	88,000	80.9988	72,155	アメリカ合衆国	0.06
NAVIENT STUDENT LOAN TRUST 2020-2 SER 2A CL A1A FRN 26/08/2069	100,000	71.837162	71,855	アメリカ合衆国	0.06
OXFORD FINANCE FUNDING 2020-1 LLC SER 1A CL A2 FRN 15/02/2028	100,000	72.75509	72,874	アメリカ合衆国	0.06
PAYPAL HOLDINGS INC (REG) 2.85% 01/ 10/2029	78,000	90.39995	71,068	アメリカ合衆国	0.06
PRUDENTIAL FINANCIAL INC VAR 01/03/ 2052	83,000	92.7183	78,386	アメリカ合衆国	0.06
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 4.4% 13/07/2027	73,000	96.2766	71,781	アメリカ合衆国	0.06
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST SER A CL APT2 FRN 15/01/2053	131,000	62.315041	81,677	アメリカ合衆国	0.06
T-MOBILE USA INC (REG) 2.55% 15/02/ 2031	95,000	84.17475	80,881	アメリカ合衆国	0.06
TAKE-TWO INTERACTIVE SOF (REG) 3.55 % 14/04/2025	80,000	98.5631	79,458	アメリカ合衆国	0.06
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2019-1 SER 1 CL A1 FRN 25/03/2058	183,000	43.346311	79,571	アメリカ合衆国	0.06
VERUS SECURITIZATION TRUST SER R2 CL A1 FRN 25/02/2064	172,000	40.499692	69,718	アメリカ合衆国	0.05
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.625% 01/12/2029	80,000	90.56835	72,763	アメリカ合衆国	0.06
VULCAN MATERIALS CO (REG) 3.5% 01/0 6/2030	88,000	90.61635	79,999	アメリカ合衆国	0.06
WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2019-C51 SER C51 CL A2 FRN	75,000	96.08004	72,245	アメリカ合衆国	0.06
AIR LEASE CORP 3.625% 01/12/2027	64,000	89.3596	57,383	アメリカ合衆国	0.05
AKER BP ASA (SER 144A) (REG) 3% 15/01/2025	70,000	96.5	68,518	ノルウェー	0.05
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2020-R1 SER R1 CL A1 FRN 25/04/2053	209,000	31.005042	64,860	アメリカ合衆国	0.05
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 2 CL A1 FRN 25/04/2066	124,000	46.238607	57,393	アメリカ合衆国	0.05
AUTODESK INC (REG) 2.85% 15/01/2030	74,000	88.3566	66,356	アメリカ合衆国	0.05
BENCHMARK 2019-B13 MORTGAGE TRUST SER B13 CL A2 FRN 15/08/2057	65,000	97.903	63,793	アメリカ合衆国	0.05
BRAVO RESIDENTIAL FUNDING TRUST 2021-NQM1 SER NQM1 CL A1 FRN	136,000	50.107399	68,205	アメリカ合衆国	0.05
BRE GRAND ISLANDER TIMESHARE ISSUER 2019-A LLC SER A CL A FRN 26/09/20	149,000	43.110031	64,281	アメリカ合衆国	0.05
CONTINENTAL RESOURCES (REG) 4.9% 01 /06/2044	84,000	79.125	66,808	アメリカ合衆国	0.05

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
CROWN CASTLE INTL CORP (REG) 3.8% 1 5/02/2028	70,000	94.5078	67,160	アメリカ合衆国	0.05
CROWN CASTLE INTL CORP 3.3% 01/07/2030	75,000	88.438	67,566	アメリカ合衆国	0.05
DELTA AIR LINES INC (REG) 2.9% 28/1 0/2024	74,000	92.72625	68,993	アメリカ合衆国	0.05
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SE R 1A CL A2 FRN 25/10/2049	73,000	88.492987	65,091	アメリカ合衆国	0.05
EQT CORP (REG) 7.5% 01/02/2030	56,000	107.075	61,712	アメリカ合衆国	0.05
EQUINIX INC (REG) 1.8% 15/07/2027	78,000	87.27035	68,718	アメリカ合衆国	0.05
EXETER AUTOMOBILE RECEIVABLES TRUST 2021-1 SER 1A CL C FRN 15/01/2026	68,000	97.47085	66,303	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE CONNECTICUT AVENUE SECURITIES SER R04 CL IM1 FRN	69,000	90.165182	62,245	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2052	63,000	97.893579	61,882	アメリカ合衆国	0.05
GCAT 2021-NQM2 TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2066	117,000	56.426616	66,086	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 169 CL IO FRN	3,835,000	1.785043	69,341	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 163 CL IO FRN	884,994	6.420464	57,357	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 17 CL IO FRN 31/12/	900,000	7.180227	65,221	アメリカ合衆国	0.05
IMPERIAL FUND MORTGAGE TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/06/2056	115,000	57.603822	66,314	アメリカ合衆国	0.05
JBS USA/FOOD/FINANCE (SER 144A) (REG) 5.125% 01/02/2028	67,000	97.375	65,337	ルクセンブルグ	0.05
MFA 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/04/2065	179,000	36.218154	64,902	アメリカ合衆国	0.05
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 4.6% 23/05/2029	68,000	95.91045	65,549	アメリカ合衆国	0.05
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2020-G SER GA CL A FRN	200,000	34.419377	68,877	アメリカ合衆国	0.05
NXP BV/NXP FDG/NXP USA (REG) 3.25% 11/05/2041	81,000	75.5224	61,539	オランダ	0.05
S&P GLOBAL INC (SER 144A) (REG) 4.7 5% 01/08/2028	61,000	101.9621	63,404	アメリカ合衆国	0.05
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2018-6 SER 6 CL A1A FRN 25/03/2058	233,000	27.889902	65,187	アメリカ合衆国	0.05
UNITED AIR 2019-1 A PTT SER A (REG) 4.55% 25/08/2031	90,000	69.803076	64,031	アメリカ合衆国	0.05
UNITED AIR 2020-1 B PTT 4.875% 15/0 1/2026	74,000	78.6425	58,957	アメリカ合衆国	0.05
UNUM GROUP (REG) 4.125% 15/06/2051	77,000	73.7265	56,911	アメリカ合衆国	0.04
VSE VOI MORTGAGE LLC SER A CL A FRN 20/03/2035	320,000	18.477874	59,174	アメリカ合衆国	0.05
AMER AIRLINE 16-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/07/2029	75,000	63.01637	48,343	アメリカ合衆国	0.04
AMER AIRLINE 17-2 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/04/2031	79,000	68.028981	54,230	アメリカ合衆国	0.04
APTIV PLC / APTIV CORP (REG) 3.25% 01/03/2032	64,000	85.04915	55,200	ジャージー	0.04
ASCOT GROUP LTD (SER 144A) (REG) 4.25% 15/12/2030	60,000	89.75	53,963	バミューダ	0.04
AXA SA 8.6% (REG) 15/12/2030	48,000	117.8967	56,774	フランス	0.04
CNA FINANCIAL CORP (REG) 2.05% 15/0 8/2030	64,000	80.71525	52,153	アメリカ合衆国	0.04
COLORADO INT GAS CO/ISS (REG) SER 144A 4.15% 15/08/2026	45,000	98.82645	45,177	アメリカ合衆国	0.04
DELTA AIR LINES INC (REG) 4.375% 19/04/2028	59,000	86	51,256	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2048	175,000	30.847945	54,168	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	195,000	24.178107	47,275	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	82,000	59.849361	49,209	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	78,000	59.311869	46,388	アメリカ合衆国	0.04

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	94,000	47.437346	44,711	アメリカ合衆国	0.04
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 3.25% 15/01/2032	68,000	80.77235	56,141	アメリカ合衆国	0.04
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 4% 15 /01/2030	63,000	88.15595	56,700	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 10 CL IO FRN	735,000	6.508862	48,638	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 110 CL IO FRN	712,000	7.398237	53,188	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 118 CL IO FRN	1,140,000	4.058757	46,816	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 170 CL IO FRN	940,000	5.777872	55,117	アメリカ合衆国	0.04
HERCULES CAPITAL INC 2.625% 16/09/2 026	64,000	86.70925	55,984	アメリカ合衆国	0.04
HYUNDAI CAPITAL AMERICA (SER 144A) (REG) 2.375% 15/10/2027	50,000	88.12505	44,313	アメリカ合衆国	0.03
M&T BANK CORPORATION SER F (REG) VAR PERP	60,000	90.5	54,813	アメリカ合衆国	0.04
SERVICEMASTER FUNDING LLC SER 1 CL A2II FRN 30/01/2051	65,000	82.998672	54,313	アメリカ合衆国	0.04
UNITED AIR 2016-1 B PTT (REG) 07/01/2026	72,000	60.843614	44,642	アメリカ合衆国	0.04
VERUS SECURITIZATION TRUST 2021-R1 SER R1 CL A1 FRN 25/10/2063	187,000	29.642452	55,476	アメリカ合衆国	0.04
VICI PROPERTIES LP 4.375% 15/05/202 5	52,000	98.005	51,354	アメリカ合衆国	0.04
AMERICREDIT AUTOMOBILE RECEIVA FRN 20/10/2025	42,000	96.81739	40,687	アメリカ合衆国	0.03
BANK OF AMERICA CORP (REG) VAR 22/0 7/2027	49,000	89.09005	44,029	アメリカ合衆国	0.03
BOJANGLES ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 20/10/2050	45,000	93.660187	42,487	アメリカ合衆国	0.03
BRITISH AIR 20-1 A PPT (SER 144A) (REG) 4.25% 15/11/2032	60,000	53.698414	32,406	アメリカ合衆国	0.03
COX COMMUNICATIONS INC (SER 144A) (REG) 2.95% 01/10/2050	50,000	66.3386	33,538	アメリカ合衆国	0.03
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 8.35% 15/07/2046	25,000	124.65495	32,126	アメリカ合衆国	0.03
DELTA AIR LINES/SKYMILES (SER 144A) (REG) 4.5% 20/10/2025	40,000	97.1654	39,221	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	85,000	44.427841	37,866	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2045	115,000	31.429049	36,240	アメリカ合衆国	0.03
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 183 CL IO FRN	597,000	7.010403	42,282	アメリカ合衆国	0.03
GS MORTGAGE-BACKED SECURITIES TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/07/2061	100,000	41.760591	41,802	アメリカ合衆国	0.03
HILTON GRAND VACATIONS TRUST 2018-A SER AA CL A FRN 25/02/2032	100,000	34.716964	34,738	アメリカ合衆国	0.03
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 25/01/2033	47,000	85.76855	40,915	アメリカ合衆国	0.03
MISSISSIPPI ST HOSP EQUIPMENT 3.72% 01/09/2026	36,000	96.851	35,313	アメリカ合衆国	0.03
MPLX LP (REG) 4.125% 01/03/2027	45,000	96.39075	43,995	アメリカ合衆国	0.03
NAVIENT PRIVATE EDUCATION LOAN TRUS T 2016-A SER AA CL A2A FRN 15/12/20	100,000	32.944044	33,002	アメリカ合衆国	0.03
ROYALTY PHARMA PLC (SER WI) (REG) 1 .75% 02/09/2027	50,000	85.50055	43,040	イギリス	0.03
VERUS SECURITIZATION TRUST 2020-5 SER 5 CL A1 FRN (STP) 25/05/2065	100,000	37.748128	37,792	アメリカ合衆国	0.03
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.125% 15/08/2030	40,000	87.125	35,473	アメリカ合衆国	0.03
AMER AIRLINE 19-1AA PTT (SER AA) (REG) 3.15% 15/08/2033	37,000	79.700538	29,894	アメリカ合衆国	0.02
ANTHEM INC (REG) 2.875% 15/09/2029	32,000	90.167	29,124	アメリカ合衆国	0.02

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
ANTHEM INC 2.25% 15/05/2030	27,000	85.4711	23,155	アメリカ合衆国	0.02
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER 144A) (REG) 3.25% 15/03/2027	34,000	84.8608	29,178	アメリカ合衆国	0.02
BX 2021-MFM1 SER MFM1 CL D FRN 15/01/2034	30,000	93.631	28,117	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	155,000	19.124692	29,735	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	91,000	23.333143	21,292	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2048	90,970	31.447983	28,684	アメリカ合衆国	0.02
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	75,000	41.662045	31,332	アメリカ合衆国	0.02
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 21 CL IO FRN	405,000	6.791315	27,761	アメリカ合衆国	0.02
MERCEDES-BENZ AUTO RECEIVABLES TRUST SER 1 CL A4 FRN 15/10/2024	50,000	38.119777	19,092	アメリカ合衆国	0.02
OHIO ST TURNPIKE COMMISSION 3.216% 15/02/2048	35,000	78.67	27,960	アメリカ合衆国	0.02
OVINTIV INC (REG) 7.2% 01/11/2031	23,000	109.5632	25,476	アメリカ合衆国	0.02
PNC FINANCIAL SERVICES (REG) 3.15% 19/05/2027	20,000	95.36575	19,147	アメリカ合衆国	0.02
VICI PROPERTIES LP 5.125% 15/05/203 2	31,000	94.1782	29,469	アメリカ合衆国	0.02
AMER AIRLINE 19-1A PTT (SER A) (REG) 3.5% 15/08/2033	25,000	73.554744	18,692	アメリカ合衆国	0.01
COMM MORTGAGE TRUST SER COR3 CL XA FRN 10/05/2051	579,000	2.21788	13,117	アメリカ合衆国	0.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2048	70,000	25.673739	18,033	アメリカ合衆国	0.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2048	53,000	33.400919	17,750	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A FRN 16/02/2062	185,000	5.557346	10,394	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO FRN 16/03/2060	435,000	2.175216	9,565	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 43 CL IO FRN 16/05/2060	670,000	1.882755	13,073	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 69 CL IO FRN 16/04/2060	565,000	1.62304	9,261	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 9 CL IO FRN 16/01/2060	630,000	1.916852	12,210	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 99 CL IO FRN 16/06/2060	755,000	1.114305	8,493	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 20 CL IO VAR	860,000	1.368596	11,971	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 100 CL IO FRN	166,967	5.10181	8,648	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 119 CL IO FRN	175,000	4.234592	7,484	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 131 CL IO FRN	241,000	3.290595	8,019	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 158 CL IO VAR	409,000	2.848173	11,916	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 41 CL IO VAR	505,000	1.228197	6,319	アメリカ合衆国	0.00
NEW JERSEY ST TRANSPRTN TRUST 4.131% 15/06/2042	10,000	91.494	9,168	アメリカ合衆国	0.01
UNITED AIR 2018-1 B PTT SER B (REG) 4.6% 01/03/2026	17,000	64.627065	11,176	アメリカ合衆国	0.01
FREDDIE MAC MULTIFAMILY STRUCTURED PASS THROUGH CERTIFICATES SER K022	820,000	0.001627	445	アメリカ合衆国	0.00
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 114 CL IO VAR 16/04/2060	520,000	0.952434	5,016	アメリカ合衆国	0.00
純資産総額			126,804,320		

国別比率（2022年6月末時点）

国名	時価 (米ドル)	対純資産総額比率 (%)
アメリカ合衆国	116,438,762	91.83
ケイマン諸島	2,369,944	1.87
イギリス	1,302,193	1.03
アイルランド	960,784	0.76
カナダ	675,719	0.53
サウジアラビア	527,146	0.42
スペイン	499,122	0.39
オランダ	465,929	0.37
オーストラリア	377,166	0.30
ドイツ	331,606	0.26
バミューダ	306,987	0.24
フランス	256,497	0.20
ペルー	253,472	0.20
ノルウェー	249,633	0.20
ルクセンブルグ	240,356	0.19
カタール	212,319	0.17
アラブ首長国連邦	176,394	0.14
パナマ	176,003	0.14
日本	170,483	0.13
インド	158,254	0.12
ジャージー	55,200	0.04
純資産総額	126,804,320	

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額

2022年7月末日現在、管理会社の未監査発行済株式資本の額は2,841百万香港ドル（約48,723百万円）で、全額払込済です。管理会社の授權株式総数は、普通株式2,486,543,936株および優先株式301,000,000株です。

最近5年間で、資本金は1,257百万香港ドル（約21,558百万円）増加しました。

(注) 香港ドルの円貨換算は、2022年7月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1香港ドル＝17.15円）によります。

（２）事業の内容及び営業の状況

管理会社の事業の目的は、各シリーズ・トラストの資産を投資ならびに再投資することおよび基本信託証書に規定される他の一定の機能を果たすことです。

2022年7月末日現在、管理会社は、下記のユニット・トラストの管理および運用を行っています。

国別（設立国）	種類別	本数	純資産総額の合計 (百万米ドル)
ケイマン諸島	ユニット・トラスト (マニユライフ・イン ベストメント・トラ スト)	6	約613
香港	ユニット・トラスト (マニユライフ・香 港・シリーズ)	3	約58
合計		9	約671

（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与えた事実、または与えることが予想される事実は生じていません。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

（注）下線の部分は訂正部分を示します（図表に変更がある場合には、当該図表の右側に線で示します。）。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

3 投資リスク

③ リスクに関する参考情報

<訂正前>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2017年5月～2022年4月の5年間におけるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格（毎月末時点）と、年間騰落率（毎月末時点）の推移を示したものです。クラスA（米ドル建て）は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA（豪ドル建てヘッジあり）は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

【クラスA（米ドル建て）】

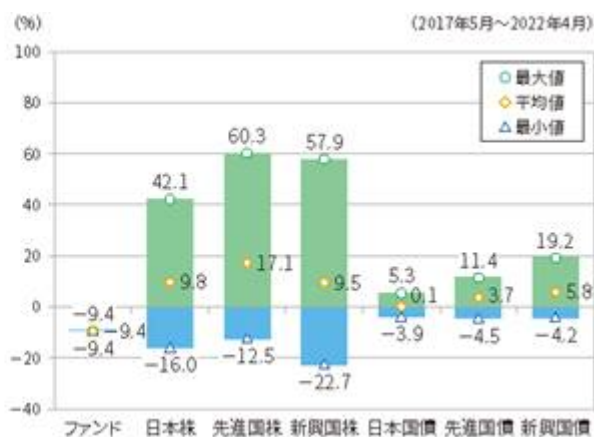


【クラスA（豪ドル建てヘッジあり）】



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

左のグラフと同じ期間（ただし、クラスA（米ドル建て）については2021年9月～2022年4月の期間、クラスA（豪ドル建てヘッジあり）については2022年4月時点）における年間騰落率（毎月末時点）の平均と振れ幅を、ファンドと他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



出所：管理会社、Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

※ 分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

※ ファンドの年間騰落率（各月末時点）は、各月末とその1年前における分配金再投資1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。

※ 代表的な資産クラスの年間騰落率（各月末時点）は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。

※ ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。

※ ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれ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。

※ ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX（配当込み）

先進国株・・・FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数（円ベース）

（注）S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

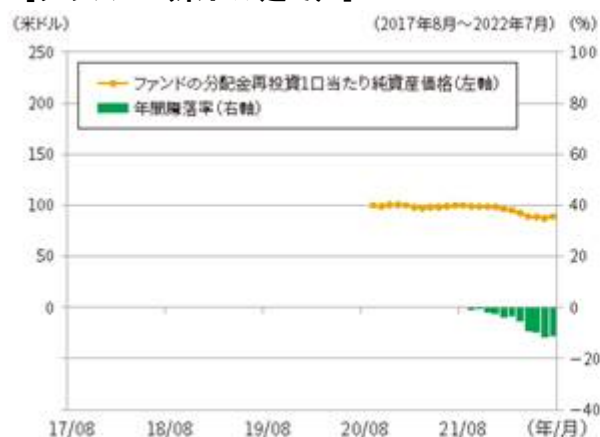
TOPIX（東証株価指数）の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）、FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）およびFTSE新興国市場国債指数（円ベース）に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。

<訂正後>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・
年間騰落率の推移

2017年8月～2022年7月の5年間におけるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格（毎月末時点）と、年間騰落率（毎月末時点）の推移を示したものです。クラスA（米ドル建て）は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA（豪ドル建てヘッジあり）は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

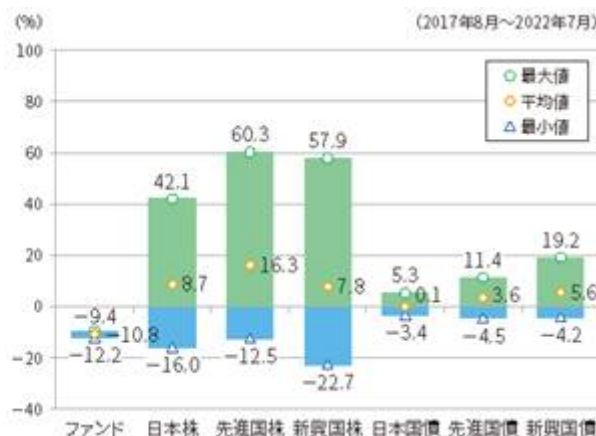
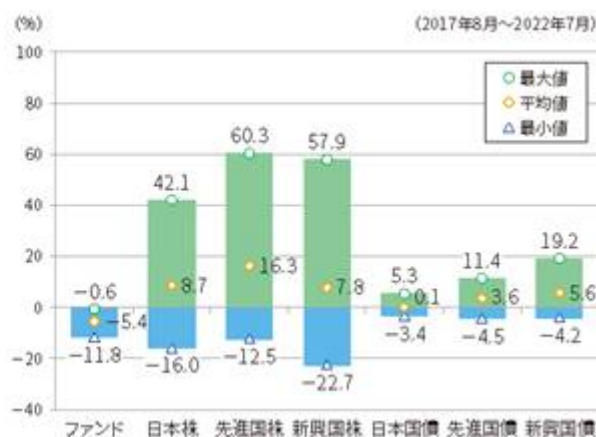
[クラスA（米ドル建て）]



[クラスA（豪ドル建てヘッジあり）]

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

左のグラフと同じ期間（ただし、クラスA（米ドル建て）については2021年9月～2022年7月の期間、クラスA（豪ドル建てヘッジあり）については2022年4月～2022年7月の期間）における年間騰落率（毎月末時点）の平均と振れ幅を、ファンドと他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



出所：管理会社、Bloomberg L.P.および指数提供会社のデータを基に森・濱田松本法律事務所が作成

※ 分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したものです。

※ ファンドの年間騰落率（各月末時点）は、各月末とその1年前における分配金再投資1口当たり純資産価格を対比して、その騰落率を算出したものです。

※ 代表的な資産クラスの年間騰落率（各月末時点）は、各月末とその1年前における下記の指数の値を対比して、その騰落率を算出したものです。

※ ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較は、上記の5年間の各月末時点における年間騰落率を用いて、それらの平均・最大・最小をグラフにして比較したものです。

※ ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれ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。

※ ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX（配当込み）

先進国株・・・FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数（円ベース）

（注）S&P新興国総合指数は、Bloomberg L.P.で円換算しています。

TOPIX（東証株価指数）の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）、FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）およびFTSE新興国市場国債指数（円ベース）に関するすべての権利は、London Stock Exchange Group plcまたはそのいずれかのグループ企業に帰属します。各指数は、FTSE International Limited、FTSE Fixed Income LLCまたはそれらの関連会社等によって計算されています。London Stock Exchange Group plcおよびそのグループ企業は、指数の使用、依存または誤謬から生じるいかなる負債について、何人に対しても一切の責任を負いません。