

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2023年5月31日
【計算期間】	第62期中(自 2022年9月1日 至 2023年2月28日)
【発行者名】	ブラックロック・グローバル・ファンズ (BLACKROCK GLOBAL FUNDS)
【代表者の役職氏名】	取締役 ジェフ・ラドクリフ (Geoff Radcliffe)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 2453、 ユージン・リュペール通り2 - 4番 (2-4, rue Eugène Ruppert, L-2453 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 中野 春芽 同 十枝 美紀子 同 三宅 章仁
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【事務連絡者氏名】	弁護士 中野 春芽 同 十枝 美紀子 同 三宅 章仁
【連絡場所】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【電話番号】	03(6775)1000
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1) アメリカ合衆国ドル(以下「米ドル」という。)、スターリング・ポンド(以下「英ポンド」という。)、スイス・フラン、ユーロ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ、人民元、シンガポール・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、株式会社三菱UFJ銀行の2023年3月31日現在における対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=133.53円、1英ポンド=165.56円、1スイス・フラン=146.16円、1ユーロ=145.72円、1デンマーク・クローネ=19.56円、1ノルウェー・クローネ=12.84円、1人民元=19.42円、1シンガポール・ドル=100.60円および1ニュージーランド・ドル=83.71円)による。

(注2) ブラックロック・グローバル・ファンズ(以下「ファンド」という。)は、ルクセンブルグ大公国(以下「ルクセンブルグ」という。)の法律に基づいて設立されているが、サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(以下「サブ・ファンド」ということがある。)のクラスA無分配投資証券(以下「ファンド証券」という。)は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。

(注3) サステナブル・ワールド・ボンド・ファンドの名称は、2022年12月15日付でワールド・ボンド・ファンドから変更された。

(注4) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入して記載してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。したがって、本書の中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。以下、別段の記載がない限り同じ。

(注5) ファンドの会計年度(以下「計算期間」ということがある。)は、9月1日に始まり、翌年の8月31日に終わる1年である。

(注6) サブ・ファンドは、アンブレラ・ファンドであるファンドのサブ・ファンドであり、本書において、サブ・ファンドのみが開示される。2023年3月末日現在、ファンドは、サブ・ファンドを含む103個のサブ・ファンドにより構成されている。

1【外国投資法人の概況】

(1)【主要な経営指標等の推移】

	第60会計年度中間 (2021年2月末日)	第60会計年度 (2021年8月末日)	第61会計年度中間 (2022年2月末日)	第61会計年度 (2022年8月末日)	第62会計年度中間 (2023年2月末日)
(a) 営業収益(注1)	17,332,454米ドル (2,314,403千円)	35,658,653米ドル (4,761,500千円)	17,887,070米ドル (2,388,460千円)	36,759,641米ドル (4,908,515千円)	18,449,535米ドル (2,463,566千円)
(b) 経常利益(損失)金額	12,432,020米ドル (1,660,048千円)	26,530,592米ドル (3,542,630千円)	14,249,592米ドル (1,902,748千円)	28,166,571米ドル (3,761,082千円)	15,112,851米ドル (2,018,019千円)
(c) 当期純利益(損失)金額	8,163,957米ドル (1,090,133千円)	19,330,232米ドル (2,581,166千円)	-2,220,389米ドル (-296,489千円)	-79,592,247米ドル (-10,627,953千円)	-68,309,802米ドル (-9,121,408千円)
(d) 出資総額(注2)	1,408,044,234米ドル (188,016,147千円)	1,365,246,053米ドル (182,301,305千円)	1,300,128,123米ドル (173,606,108千円)	1,128,318,997米ドル (150,664,436千円)	1,078,391,072米ドル (143,997,560千円)
(e) 発行済投資証券総数	□	□	□	□	□
クラスA毎日分配型投資証券	129,926	120,012	120,930	100,985	58,110
クラスA毎月分配型投資証券	424,175	357,873	228,735	200,673	237,466
クラスAオフショア中国元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	350	5,585	5,699	5,826	8,289
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	680	19,715	20,757	21,233	22,215
クラスA無分配投資証券	1,464,056	1,433,219	1,272,926	1,088,332	885,697
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	108,144	105,591	98,151	235,080	103,050
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	409,561	472,646	393,087	380,127	378,944
クラスC毎日分配型投資証券	18,002	14,814	14,295	14,197	13,011
クラスD毎月分配型投資証券	126,603	127,436	68,689	69,194	69,819
クラスD無分配投資証券	1,607,685	1,341,941	1,608,138	1,743,877	1,899,925
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	476,900	520,942	526,909	526,909	525,409
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	174,271	85,613	177,570	79,158	84,527
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,846,050	2,779,397	2,503,135	2,267,755	2,482,942
クラスE無分配投資証券	450,243	418,274	436,449	465,044	512,467
クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	1,601,506	2,171,307	2,171,315	2,598,665	4,203,020

クラスI無分配投資証券	500	11,000	421,277	392,265	917,977
クラスX無分配投資証券	4,672,863	4,698,240	4,581,189	4,350,456	3,883,753
クラスXスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8	8	8	8	8
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5	5	5	5	5
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	317,297	242,391	242,391	242,391	236,950
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	16,572,480	16,862,335	17,904,636	17,080,519	17,028,280
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	31,741,827	31,741,827	33,142,500	40,693,062	46,101,771
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795	795	795	795	795
(f) 純資産額	1,408,044,234米ドル (188,016,147千円)	1,365,246,053米ドル (182,301,305千円)	1,300,128,123米ドル (173,606,108千円)	1,128,318,997米ドル (150,664,436千円)	1,078,391,072米ドル (143,997,560千円)
(g) 総資産額	1,583,244,700米ドル (211,410,665千円)	1,605,111,413米ドル (214,330,527千円)	1,491,949,760米ドル (199,220,051千円)	1,198,602,243米ドル (160,049,358千円)	1,235,963,458米ドル (165,038,201千円)
(h) 1口当たり純資産価格					
クラスA毎日分配型投資証券	61.26米ドル (8,180円)	61.89米ドル (8,264円)	57.88米ドル (7,729円)	53.53米ドル (7,148円)	51.47米ドル (6,873円)
クラスA毎月分配型投資証券	61.11米ドル (8,160円)	61.73米ドル (8,243円)	57.73米ドル (7,709円)	53.40米ドル (7,131円)	51.34米ドル (6,855円)
クラスAオフショア中国人民幣元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	107.29人民幣元 (2,084円)	108.18人民幣元 (2,101円)	100.89人民幣元 (1,959円)	92.36人民幣元 (1,794円)	87.05人民幣元 (1,691円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	10.54シンガポール・ ドル (1,060円)	10.60シンガポール・ ドル (1,066円)	9.86シンガポール・ ドル (992円)	9.05シンガポール・ ドル (910円)	8.62シンガポール・ ドル (867円)
クラスA無分配投資証券	85.47米ドル (11,413円)	86.91米ドル (11,605円)	81.85米ドル (10,929円)	76.31米ドル (10,190円)	74.12米ドル (9,897円)
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	198.78ユーロ (28,966円)	201.30ユーロ (29,333円)	188.78ユーロ (27,509円)	174.06ユーロ (25,364円)	166.31ユーロ (24,235円)
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	12.44英ポンド (2,060円)	12.63英ポンド (2,091円)	11.90英ポンド (1,970円)	11.05英ポンド (1,829円)	10.65英ポンド (1,763円)

クラスC 毎日分配型投資証券	61.57米ドル (8,221円)	62.21米ドル (8,307円)	58.18米ドル (7,769円)	53.81米ドル (7,185円)	51.74米ドル (6,909円)
クラスD 毎月分配型投資証券	61.18米ドル (8,169円)	61.80米ドル (8,252円)	57.80米ドル (7,718円)	53.45米ドル (7,137円)	51.39米ドル (6,862円)
クラスD 無分配投資証券	90.32米ドル (12,060円)	92.02米ドル (12,287円)	86.84米ドル (11,596円)	81.12米ドル (10,832円)	78.95米ドル (10,542円)
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10.80スイス・フラン (1,579円)	10.95スイス・フラン (1,600円)	10.27スイス・フラン (1,501円)	9.49スイス・フラン (1,387円)	9.04スイス・フラン (1,321円)
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	205.32ユーロ (29,919円)	208.35ユーロ (30,361円)	195.77ユーロ (28,528円)	180.88ユーロ (26,358円)	173.17ユーロ (25,234円)
クラスD 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	12.54英債券 (2,076円)	12.76英債券 (2,113円)	12.04英債券 (1,993円)	11.21英債券 (1,856円)	10.82英債券 (1,791円)
クラスE 無分配投資証券	78.62米ドル (10,498円)	79.74米ドル (10,648円)	74.91米ドル (10,003円)	69.66米ドル (9,302円)	67.50米ドル (9,013円)
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	10.54ユーロ (1,536円)	10.51ユーロ (1,532円)	9.89ユーロ (1,441円)	8.94ユーロ (1,303円)	8.57ユーロ (1,249円)
クラスI 無分配投資証券	11.73米ドル (1,566円)	11.97米ドル (1,598円)	11.30米ドル (1,509円)	10.57米ドル (1,411円)	10.29米ドル (1,374円)
クラスX 無分配投資証券	97.43米ドル (13,010円)	99.59米ドル (13,298円)	94.26米ドル (12,587円)	88.33米ドル (11,795円)	86.23米ドル (11,514円)
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	15.31スイス・フラン (2,238円)	15.57スイス・フラン (2,276円)	14.67スイス・フラン (2,144円)	13.59スイス・フラン (1,986円)	12.99スイス・フラン (1,899円)
クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	123.10デンマーク・クローネ (2,408円)	125.88デンマーク・クローネ (2,462円)	119.19デンマーク・クローネ (2,331円)	111.26デンマーク・クローネ (2,176円)	107.48デンマーク・クローネ (2,102円)
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	217.77ユーロ (31,733円)	221.67ユーロ (32,302円)	208.92ユーロ (30,444円)	193.62ユーロ (28,214円)	185.93ユーロ (27,094円)
クラスX 英債券・ヘッジ無分配投資証券	13.59英債券 (2,250円)	13.88英債券 (2,298円)	13.13英債券 (2,174円)	12.26英債券 (2,030円)	11.87英債券 (1,965円)
クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	14.64ノルウェー・クローネ (188円)	14.96ノルウェー・クローネ (192円)	14.18ノルウェー・クローネ (182円)	13.25ノルウェー・クローネ (170円)	12.81ノルウェー・クローネ (164円)
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	12.83ニュージーランド・ドル (1,074円)	13.12ニュージーランド・ドル (1,098円)	12.43ニュージーランド・ドル (1,041円)	11.65ニュージーランド・ドル (975円)	11.31ニュージーランド・ドル (947円)

(i) 1口当たり当期純利益金額(注3)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	289,780米ドル (38,694千円)	1,050,555米ドル (140,281千円)	204,307米ドル (27,281千円)	965,028米ドル (128,860千円)	209,901米ドル (28,028千円)
(k) 1口当たり分配金額(注3)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	88.93%	85.06%	87.14%	94.14%	87.25%
(m) 自己資本利益率	0.58%	1.42%	-0.17%	-7.05%	-6.33%

(注1) 営業収益には投資収益を記載している。

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

(注3) (i)および(k)は、ファンドの性格上、算定していない。

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

(2)【外国投資法人の出資総額】

サブ・ファンドの2023年3月末日現在の発行済投資証券総口数、ならびに下記の各会計年度末現在および2023年3月末日現在の純資産総額およびクラスA無分配投資証券の発行済投資証券総口数は、以下のとおりである。

サブ・ファンドにつき、発行可能投資証券総口数の定めはない。

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
クラスA 毎日分配型投資証券	56,657
クラスA 毎月分配型投資証券	229,855
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	8,308
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	22,216
クラスA 無分配投資証券	868,497
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	104,086
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	378,903
クラスC 毎日分配型投資証券	13,018
クラスD 毎月分配型投資証券	69,927
クラスD 無分配投資証券	1,892,467
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	525,409
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	82,667
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,473,886
クラスE 無分配投資証券	508,361
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	4,203,020
クラスI 無分配投資証券	1,169,061
クラスX 無分配投資証券	3,871,714
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8
クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	236,950
クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	17,028,280
クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	46,101,771
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795

会計年度	純資産総額	クラスA無分配投資証券 発行済投資証券総口数
第56会計年度末 (2017年8月末日)	1,501,876,263米ドル (200,545,537千円)	2,589,979口
第57会計年度末 (2018年8月末日)	1,340,682,994米ドル (179,021,400千円)	1,757,513口
第58会計年度末 (2019年8月末日)	1,375,012,111米ドル (183,605,367千円)	1,984,448口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	1,365,243,468米ドル (182,300,960千円)	1,552,663口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	1,365,246,053米ドル (182,301,305千円)	1,433,219口
第61会計年度末 (2022年8月末日)	1,128,318,997米ドル (150,664,436千円)	1,088,332口
2023年3月末日	1,104,811,715米ドル (147,525,508千円)	868,497口

(3) 【主要な投資主の状況】

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

(4)【役員の状況】

(2023年4月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有 投資証券 口数
ポール・フリーマン (Paul Freeman)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 非常勤取締役	0
ベッティナ・マッツォッキ (Bettina Mazzocchi)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターならびにフランス、ベルギー、ルクセ ンブルグおよびモナコにおけるiShares & ウェルス部門のヘッド	0
ジェフ・ラドクリフ (Geoff Radcliffe)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターならびにブラックロック・ルクセンブ ルグ・オフィスおよびインターナシヨナ ル・プロダクト・オーバーサイト・アン ド・ガバナンスのヘッド	0
デニス・ヴォス (Denise Voss)	非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 非常勤取締役	0
キース・サルダナ (Keith Saldanha)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターおよびEMEA・ウェルス・プロダク ト・グループのヘッド	0
ダヴィーナ・セイント (Davina Saint)	独立 非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファンズの 独立非常勤取締役	0
ヴァシリキ・ パチャトゥリディ (Vasiliki Pachatouridi)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディレク ターおよびiSharesフィクスト・インカム・ プロダクト・ストラテジーEMEAのヘッ ド	0

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

(5)【その他】

a. 定款の変更

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

b. 事業譲渡または事業譲受

合併

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

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

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

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

資産の譲渡

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

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出前6か月以内において、訴訟事件その他ファンドに重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

2【外国投資法人の運用状況】

(1)【投資状況】

(資産別および地域別の投資状況)

(2023年3月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率(注1) (%)
国債	ドイツ	98,600,991	7.62
	中国	95,764,382	7.40
	日本	53,481,251	4.13
	イタリア	24,230,731	1.87
	スペイン	18,437,953	1.43
	フランス	17,511,329	1.35
	メキシコ	15,962,005	1.23
	韓国	15,025,397	1.16
	英国	13,541,883	1.05
	インドネシア	12,669,537	0.98
	カナダ	11,433,414	0.88
	南アフリカ	10,250,784	0.79
	米国	9,534,498	0.74
	ベルギー	7,517,479	0.58
	ブラジル	6,920,839	0.54
	チェコ共和国	6,372,182	0.49
	スイス	5,818,798	0.45
	ポーランド	4,641,905	0.36
	オーストリア	4,623,117	0.36
	オランダ	4,587,313	0.35
	マレーシア	3,586,654	0.28
	オーストラリア	2,899,126	0.22
	ルーマニア	2,832,692	0.22
	ポルトガル	2,700,553	0.21
	シンガポール	2,636,003	0.20
	フィンランド	2,494,449	0.19
	タイ	1,942,186	0.15
	ノルウェー	1,846,868	0.14
	スウェーデン	1,727,147	0.13
	ニュージーランド	1,614,008	0.12
	サウジアラビア	1,581,019	0.12
	アイルランド	1,497,322	0.12
デンマーク	1,420,578	0.11	
アラブ首長国連邦	1,313,593	0.10	
カタール	1,157,342	0.09	
ペルー	918,308	0.07	
チリ	871,213	0.07	
コロンビア	865,033	0.07	
パナマ	540,120	0.04	

	スロバキア	529,286	0.04
	フィリピン	415,625	0.03
	ウルグアイ	401,496	0.03
	カザフスタン	384,698	0.03
	ハンガリー	341,368	0.03
	スロベニア	90,867	0.01
	小計	473,533,342	36.61
社債	米国	221,284,575	17.11
	オランダ	21,412,914	1.66
	ドイツ	18,883,981	1.46
	英国	15,623,904	1.21
	フランス	14,889,886	1.15
	ルクセンブルグ	6,569,558	0.51
	スペイン	5,197,638	0.40
	ケイマン諸島	4,452,777	0.34
	日本	3,457,353	0.27
	ベルギー	3,443,791	0.27
	スウェーデン	3,256,021	0.25
	デンマーク	2,686,580	0.21
	カナダ	2,056,103	0.16
	メキシコ	1,877,766	0.15
	インドネシア	1,847,041	0.14
	オーストリア	1,821,516	0.14
	イタリア	1,671,630	0.13
	スイス	1,050,148	0.08
	ニュージーランド	635,437	0.05
	アイルランド	619,650	0.05
	マレーシア	487,075	0.04
	タイ	460,336	0.04
	バミューダ	315,861	0.02
	ノルウェー	261,703	0.02
	シンガポール	242,919	0.02
	ジャージー	231,203	0.02
	オーストラリア	199,206	0.02
	インド	186,518	0.01
	カザフスタン	184,500	0.01
	チリ	167,630	0.01
	コロンビア	163,974	0.01
	パナマ	97,000	0.01
	フィンランド	91,578	0.01
	香港	5,846	0.00
	小計	335,833,618	25.96
政府機関債	米国	259,971,742	20.10
	ケイマン諸島	52,823,733	4.08
	アイルランド	8,042,412	0.62

	英国	6,941,514	0.54
	バミューダ	2,078,050	0.16
	オランダ	1,063,495	0.08
	ルクセンブルグ	462,149	0.04
	スペイン	338,554	0.03
	イタリア	261,753	0.02
	ドイツ	216,288	0.02
	ポルトガル	43,403	0.00
	フランス	37,953	0.00
	小計	332,281,046	25.69
国際機関債	国際機関	11,491,693	0.89
	小計	11,491,693	0.89
投資信託	アイルランド	2,177,631	0.17
	小計	2,177,631	0.17
投資資産合計		1,155,317,330	89.32
現金・その他の資産(負債控除後)		138,173,344	10.68
資産総額		1,293,490,674	100.00
負債総額		188,678,959	14.59(注2)
純資産総額		1,104,811,715 (約147,526百万円)	85.41(注3)

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

(注2) 資産総額に対する負債総額の比率である。

(注3) 資産総額に対する純資産総額の比率である。

(2) 【運用実績】

【純資産等の推移】

2023年3月末日および同日前1年以内における各月末のサブ・ファンドの総資産額および純資産総額ならびにクラスA無分配投資証券の1口当たり純資産価格の推移は、以下のとおりである。

	総資産額		純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年4月末日	1,339,287	178,835	1,198,205	159,996	78.55	10,489
5月末日	1,308,520	174,727	1,195,571	159,645	78.12	10,431
6月末日	1,256,735	167,812	1,147,265	153,194	76.31	10,190
7月末日	1,263,755	168,749	1,153,682	154,051	78.16	10,437
8月末日	1,198,602	160,049	1,128,319	150,664	76.31	10,190
9月末日	1,201,635	160,454	1,078,107	143,960	73.60	9,828
10月末日	1,173,318	156,673	1,069,625	142,827	73.28	9,785
11月末日	1,454,906	194,274	1,115,318	148,928	74.35	9,928
12月末日	1,277,625	170,601	1,085,421	144,936	73.85	9,861
2023年1月末日	1,308,420	174,713	1,110,032	148,223	75.90	10,135
2月末日	1,235,963	165,038	1,078,391	143,998	74.12	9,897
3月末日	1,293,491	172,720	1,104,812	147,526	75.47	10,078

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

【分配の推移】

2023年3月末日前1年間におけるサブ・ファンドの分配金の額は、以下のとおりである。

総額 387,941.14米ドル(約51,802千円)

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

【自己資本利益率(収益率)の推移】

下記の期間におけるサブ・ファンドの自己資本利益率は、以下のとおりである。

期間	自己資本利益率(収益率)
(2022年4月1日～ 2023年3月31日)	-2.28%

(3)【投資リスク】

第62会計年度中間期において、2023年2月28日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載されたリスク要因について、重要な変更はない。

ファンドが将来にわたって営業活動を継続するとの前提に重要な疑義を生じさせるような事象または状況その他ファンドの経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

名称

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

資本金(株主資本)の額

2023年4月30日現在、6,309,670ユーロ(約9億1,945万円)

(2)【大株主の状況】

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

(3)【役員状況】

(2023年4月末日現在)

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

(4)【事業の内容及び営業の概況】

ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーは、2010年法第15章に基づき運用会社として行為することを認可されている。運用会社契約に基づきファンドの投資運用、管理およびサブ・ファンドのマーケティングに関するあらゆる運営機能を、直接または委託により遂行する責任とともに、ファンドの日々の運用を行っている。2023年3月末日現在、運用会社は、以下の3本の投資法人(合計純資産総額は、133,671,497,904.69米ドル、792,952,771.95英ポンド、663,872,896.39スイス・フラン、39,571,893,604.39ユーロ、30,231,154,373.33人民元および43,099,177,511.68円)を運用、助言および/または管理している。

名称(設立国)	基本的性格	設立年月日	純資産総額(通貨別)
ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	1962年6月14日	120,995,874,551.53 米ドル 238,247,661.39 英ポンド 663,872,896.39 スイス・フラン 29,973,087,570.96 ユーロ 30,231,154,373.33 人民元 43,099,177,511.68 円
ブラックロック・ストラテジック・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	2007年5月2日	7,907,185,736.30 米ドル 9,102,500,901.02 ユーロ 554,705,110.56 英ポンド
ブラックロック・グローバル・インデックス・ファンズ(ルクセンブルグ)	変動資本を有する会社型投資信託(アンブレラ型)	2012年8月30日	4,768,437,616.86 米ドル 496,305,132.41 ユーロ

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

4【外国投資法人の経理状況】

- (a) サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成されたファンドの原文(英文)の中間財務書類を翻訳したものである(ただし、円換算部分を除く。)。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」(平成5年大蔵省令第22号。その後の改正を含む。)に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号。その後の改正を含む。)第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである(但し、円換算額を除く。)。
- (b) ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等(公認会計士法(昭和23年法律第103号。その後の改正を含む。)第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。)の監査を受けていない。
- (c) ファンドの原文の中間財務書類は、外貨で表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円への換算には、2023年3月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=133.53円、1英ポンド=165.56円、1スイス・フラン=146.16円、1ユーロ=145.72円、1デンマーク・クローネ=19.56円、1ノルウェー・クローネ=12.84円、1人民元=19.42円、1シンガポール・ドル=100.60円および1ニュージーランド・ドル=83.71円)が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため、合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。
- (注) ファンドの原文の中間財務書類には、現在ファンドを構成するすべてのサブ・ファンドの情報が掲載されているが、日本語の中間財務書類には、サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド(旧名称 ワールド・ボンド・ファンド)の情報のみが掲載されている(ただし、「財務書類に対する注記」を除く。)。

(1) 【資産及び負債の状況】

純資産計算書 2023年2月28日現在(未監査)

	注記	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽²⁾	
		米ドル	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		1,125,229,933	150,251,953
未実現評価損		(109,885,616)	(14,673,026)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,015,344,317	135,578,927
銀行預金	2 (a)	53,041,517	7,082,634
ブローカーに対する債権	14	17,419,467	2,326,021
未収利息および未収配当金	2 (a)	8,190,004	1,093,611
売却投資有価証券未収金	2 (a)	9,232,107*	1,232,763*
販売投資証券未収金	2 (a)	297,306	39,699
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	11,328,575	1,512,705
事後通告証券契約の時価	2 (c)	114,858,851	15,337,102
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	4,468,092	596,624
その他の資産	2 (a, c)	1,783,222	238,114
資産合計		1,235,963,458	165,038,201
負債			
ブローカーに対する債務	14	590,489	78,848
未払収益分配金	2 (a)	34,875	4,657
購入投資有価証券未払金	2 (a)	137,227,740*	18,324,020*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	314,873	42,045
以下に係る未実現評価損：			
未決済上場先物取引	2 (c)	39,988	5,340
スワップの時価	2 (c)	11,852,013	1,582,599
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (c)	6,565,814	876,733
その他の負債	4, 5, 6, 7, 8	946,594	126,399
負債合計		157,572,386	21,040,641
純資産合計		1,078,391,072	143,997,560

* 事後通告証券を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)

サステイナブル・ワールド・
ボンド・ファンド⁽³⁾

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2023年2月28日現在			
純資産合計	米ドル	1,078,391,072	143,997,560 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	51.47	6,873 円
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	51.34	6,855 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	87.05	1,691 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	8.62	867 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	74.12	9,897 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	166.31	24,235 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	10.65	1,763 円
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	51.74	6,909 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	51.39	6,862 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	78.95	10,542 円
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	9.04	1,321 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	173.17	25,234 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	10.82	1,791 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	67.50	9,013 円
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.57	1,249 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.29	1,374 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	86.23	11,514 円
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	12.99	1,899 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2023年2月28日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	107.48	2,102 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	185.93	27,094 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	11.87	1,965 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	12.81	164 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	11.31	947 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

サステイナブル・ワールド・
ボンド・ファンド⁽³⁾

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2022年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,128,318,997	150,664,436 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	53.53	7,148 円
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	53.40	7,131 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	92.36	1,794 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	9.05	910 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	76.31	10,190 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	174.06	25,364 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.05	1,829 円
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	53.81	7,185 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	53.45	7,137 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	81.12	10,832 円
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	9.49	1,387 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	180.88	26,358 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.21	1,856 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	69.66	9,302 円
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.94	1,303 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	10.57	1,411 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	88.33	11,795 円
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	13.59	1,986 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

サステイナブル・ワールド・
ボンド・ファンド⁽³⁾

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2022年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	111.26	2,176 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	193.62	28,214 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	12.26	2,030 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	13.25	170 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	11.65	975 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,365,246,053	182,301,305 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	61.89	8,264 円
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	61.73	8,243 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	108.18	2,101 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	10.60	1,066 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	86.91	11,605 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	201.30	29,333 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.63	2,091 円
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	62.21	8,307 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	61.80	8,252 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	92.02	12,287 円
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.95	1,600 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	208.35	30,361 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.76	2,113 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	79.74	10,648 円
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.51	1,532 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	11.97	1,598 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	99.59	13,298 円
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.57	2,276 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	125.88	2,462 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	221.67	32,302 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.88	2,298 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.96	192 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	13.12	1,098 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,365,243,468	182,300,960 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎日分配型投資証券	米ドル	61.34	8,191 円
クラスA 毎月分配型投資証券	米ドル	61.19	8,171 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	107.70	2,092 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	10.63	1,069 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	85.13	11,367 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	198.89	28,982 円
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.41	2,055 円
クラスC 毎日分配型投資証券	米ドル	61.70	8,239 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	61.26	8,180 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	89.78	11,988 円
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.80	1,579 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	205.03	29,877 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.48	2,066 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	78.50	10,482 円
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.51	1,532 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	11.65	1,556 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	96.57	12,895 円
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.26	2,230 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2023年2月28日現在(未監査)(続き)

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽³⁾	
		(円換算額)	
2020年8月31日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き):			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	121.99	2,386 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	216.82	31,595 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.49	2,233 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.53	187 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジラン ド・ドル	12.73	1,066 円

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

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)

	注記	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽²⁾	
		米ドル	千円
期首純資産		1,128,318,997	150,664,436
収益			
銀行利息	2 (b)	494,266	65,999
債券利息(源泉徴収税控除後)	2 (b)	16,207,709	2,164,215
スワップ利息	2 (c)	1,593,093	212,726
集団投資スキームによる収益(源泉徴収税控除後)	2 (b)	42,077	5,619
有価証券貸付収益	2 (b)	108,808	14,529
投資運用報酬割戻金	4	636	85
その他の払戻し	10	2,946	393
収益合計	2 (b)	18,449,535	2,463,566
費用			
スワップ利息	2 (c)	1,364,687	182,227
年次サービス料	6	383,473	51,205
ローン・コミットメント・フィー	16	3,489	466
保管および預託報酬	2 (h), 7	149,329	19,940
販売報酬	5	87,572	11,693
税金	8	124,096	16,571
投資運用報酬	4	1,224,038	163,446
費用合計		3,336,684	445,547
純利益		15,112,851	2,018,019
以下に係る実現純評価益/(損):			
投資有価証券	2 (a)	(61,362,253)	(8,193,702)
事後通告証券契約	2 (c)	1,096,844	146,462
上場先物取引	2 (c)	3,038,464	405,726
オプション/スワップション契約	2 (c)	688,133	91,886
スワップ取引	2 (c)	401,865	53,661
先渡為替予約	2 (c)	(13,991,691)	(1,868,310)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	1,818,836	242,869
当期実現純評価損		(68,309,802)	(9,121,408)

損益および純資産変動計算書 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)(続き)

	注記	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽²⁾	
		米ドル	千円
以下に係る未実現評価益/(損)の純変動額:			
投資有価証券	2 (a)	38,343,081	5,119,952
事後通告証券契約	2 (c)	(2,762,141)	(368,829)
上場先物取引	2 (c)	(1,744,624)	(232,960)
オプション/スワップション契約	2 (c)	154,429	20,621
スワップ取引	2 (c)	(5,013,275)	(669,423)
先渡為替予約	2 (c)	9,165,460	1,223,864
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(85,274)	(11,387)
当期末実現評価益/(損)の純変動		38,057,656	5,081,839
運用成績による純資産の減少		(15,139,295)	(2,021,550)
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		110,989,365	14,820,410
投資証券買戻しによる正味支払額		(145,568,094)	(19,437,708)
資本の変動による純資産の減少		(34,578,729)	(4,617,298)
配当金宣言額	15	(209,901)	(28,028)
期末純資産		1,078,391,072	143,997,560

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)

	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド(2)			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	100,985	2,356	45,231	58,110
クラスA 毎月分配型投資証券	200,673	51,406	14,613	237,466
クラスA オフショア中国人民元・ ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	5,826	2,463	-	8,289
クラスA シンガポール・ドル・ ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券	21,233	1,198	216	22,215
クラスA 無分配投資証券	1,088,332	52,143	254,778	885,697
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	235,080	35,367	167,397	103,050
クラスA 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	380,127	13,257	14,440	378,944
クラスC 毎日分配型投資証券	14,197	29	1,215	13,011
クラスD 毎月分配型投資証券	69,194	627	2	69,819
クラスD 無分配投資証券	1,743,877	594,711	438,663	1,899,925
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	526,909	-	1,500	525,409
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	79,158	8,885	3,516	84,527
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	2,267,755	552,298	337,111	2,482,942
クラスE 無分配投資証券	465,044	103,392	55,969	512,467
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配 型投資証券	2,598,665	1,604,355	-	4,203,020
クラスI 無分配投資証券	392,265	682,165	156,453	917,977
クラスX 無分配投資証券	4,350,456	68,643	535,346	3,883,753
クラスX スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	8	-	-	8
クラスX デンマーク・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	5	-	-	5

発行済投資証券口数変動表 2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)(続き)

	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド ⁽²⁾			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスXユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	242,391	-	5,441	236,950
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配 投資証券	17,080,519	-	52,239	17,028,280
クラスXノルウェー・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	40,693,062	5,408,709	-	46,101,771
クラスXニュージーランド・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	795	-	-	795

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

（２）【投資有価証券明細表等】

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品 ファンド							
21,140	アイルランド iShares USD Corp Bond UCITS ETF*、-	2,118,651	0.19	GBP 100,000	ベルギー Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	119,505	0.01
ファンド合計				2,118,651 0.19			
債券							
EUR 200,000	オーストラリア AusNet Services Pty 1.5% 26/2/2027	191,477	0.02	EUR 2,690,000	Kingdom of Belgium Government Bond 0.1% 22/6/2030	2,308,407	0.21
AUD 3,270,000	Australia Government Bond 2.75% 21/4/2024	2,179,180	0.20	EUR 2,660,000	Kingdom of Belgium Government Bond 0.8% 22/6/2025	2,683,140	0.25
AUD 1,220,000	Australia Government Bond 3% 21/3/2047	674,507	0.06	EUR 640,000	Kingdom of Belgium Government Bond 1.4% 22/6/2053	411,560	0.04
				8,587,053 0.79			
				バミューダ			
EUR 400,000	オーストリア BAWAG PSK Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse 0.375% 3/9/2027*	359,185	0.03	USD 145,430	Digicel 8% 1/4/2025	36,631	0.00
EUR 600,000	Erste Bank 0.25% 26/6/2024	609,975	0.06	USD 900,000	OHA Credit Funding 12 8.089% 20/7/2033	898,923	0.08
EUR 600,000	Erste Bank 1% 10/6/2030	572,478	0.05	USD 1,186,000	Shelter Growth CRE 2022-FL4 Issuer 6.86% 17/6/2037	1,186,732	0.11
EUR 100,000	Erste Bank 1.625% 8/9/2031	93,665	0.01	USD 300,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	259,179	0.02
EUR 300,000	Republic of Austria Government Bond 0% 20/10/2040	177,362	0.02	2,381,465 0.21			
EUR 1,460,000	Republic of Austria Government Bond 0.5% 20/2/2029	1,328,910	0.12	ブラジル			
EUR 1,460,000	Republic of Austria Government Bond 0.75% 20/10/2026	1,427,722	0.13	BRL 112,590	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	2,073,578	0.19
EUR 690,000	Republic of Austria Government Bond 1.5% 2/11/2086	408,855	0.04	カナダ			
EUR 350,000	Republic of Austria Government Bond 1.85% 23/5/2049	279,911	0.02	CAD 872,000	Canadian Government Bond 1.75% 1/12/2053	455,018	0.04
EUR 990,000	Republic of Austria Government Bond 2.1% 20/9/2117	714,665	0.07	CAD 2,390,000	Canadian Government Bond 2% 1/12/2051	1,341,424	0.12
USD 280,000	Suzano Austria 2.5% 15/9/2028	235,259	0.02	CAD 420,000	Canadian Government Bond 2.75% 1/12/2048	279,579	0.03
USD 900,000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	830,088	0.08	CAD 850,000	Canadian Government Bond 2.75% 1/12/2064	553,510	0.05
				CAD 2,130,000	Canadian Government Bond 3.5% 1/3/2028	1,566,139	0.14
7,038,075 0.65							

～ 関連会社ファンドに対する有価証券。詳細については注記10を参照のこと。

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
CAD 833,000	Canadian Government Bond 3.5% 1/12/2045	627,729	0.06	USD 2,750,000	Apidos CLO XXXVII 5.945% 22/10/2034	2,707,269	0.25
CAD 510,000	Canadian Government Bond 4% 1/6/2041	407,146	0.04	USD 3,670,000	Baidu 1.625% 23/2/2027*	3,175,009	0.29
GBP 3,500,000	CPPIB Capital 1.125% 14/12/2029*	3,413,918	0.32	USD 1,000,000	Bain Capital Credit CLO 2018-1 5.775% 23/4/2031	991,365	0.09
USD 190,000	Open Text 6.9% 1/12/2027	192,546	0.02	USD 1,166,000	Bain Capital Credit CLO 2021-5 6.465% 23/10/2034	1,129,605	0.10
CAD 4,000	Province of New Brunswick Canada 3.05% 14/8/2050	2,337	0.00	USD 500,000	Ballyrock CLO 2020-2 5.818% 20/10/2031	495,562	0.05
CAD 3,345,000	Province of Ontario Canada 2.4% 2/6/2026	2,340,344	0.22	USD 500,000	CIFC Funding 2012-II-R 6.058% 20/1/2028	491,375	0.05
CAD 900,000	Province of Quebec Canada 3.9% 22/11/2032	653,431	0.06	USD 710,000	CIFC Funding 2014-III 6.015% 22/10/2031	704,471	0.07
CAD 308,000	Province of Saskatchewan Canada 2.95% 2/6/2058	173,218	0.02	USD 1,134,334	CIFC Funding 2015-III 5.668% 19/4/2029	1,123,821	0.10
USD 1,590,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	1,381,851	0.13	USD 589,070	CIFC Funding 2017-II 5.758% 20/4/2030	584,210	0.05
EUR 1,170,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	1,197,311	0.11	USD 950,000	CIFC Funding 2017-IV 6.366% 24/10/2030	918,904	0.08
GBP 100,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027	110,896	0.01	USD 2,335,000	CIFC Funding 2018-II 5.848% 20/4/2031	2,316,598	0.21
USD 510,000	Toronto-Dominion Bank/The 4.456% 8/6/2032	478,702	0.04	USD 340,000	Country Garden 3.3% 12/1/2031*	181,416	0.02
		15,175,099	1.41	USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 6.458% 20/10/2030	494,675	0.05
	ケイマン諸島			USD 1,000,000	Eaton Vance Clo 2015-1 6.058% 20/1/2030	972,375	0.09
USD 350,000	ACAS CLO 2015-1 6.395% 18/10/2028	342,103	0.03	USD 250,000	Eaton Vance Clo 2015-1 6.258% 20/1/2030	245,083	0.02
USD 2,500,000	AGL CLO 3 6.092% 15/1/2033	2,471,534	0.23	USD 200,000	Fantasia 0% 9/1/2023***	28,500	0.00
USD 500,000	AGL CLO 3 6.492% 15/1/2033	492,372	0.05	USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	28,500	0.00
USD 1,413,000	AGL CLO 3 8.092% 15/1/2033	1,347,717	0.12	USD 1,250,000	Galaxy XXII CLO 5.992% 16/4/2034	1,234,062	0.11
USD 500,000	AGL Core CLO 2 6.198% 20/4/2032	496,436	0.05	USD 600,000	Goldentree Loan Management US Clo 10 5.908% 20/7/2034	589,288	0.05
USD 585,000	AGL Core CLO 2 6.708% 20/4/2032	574,797	0.05	USD 320,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 6.358% 20/10/2032	313,315	0.03
USD 500,000	AGL Core CLO 4 5.878% 20/4/2033	494,089	0.05	USD 700,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 5.938% 20/10/2034	687,876	0.06
USD 650,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 5.805% 13/4/2031	643,198	0.06	USD 1,000,000	KKR Clo 17 5.872% 15/4/2034	981,346	0.09
USD 400,000	Apidos CLO XX 6.342% 16/7/2031	392,940	0.04	USD 400,000	KSA Sukuk 3.628% 20/4/2027	383,000	0.04
USD 600,000	Apidos CLO XXX 5.935% 18/10/2031	596,170	0.05	USD 1,000,000	Madison Park Funding XIII 6.298% 19/4/2030	994,524	0.09
USD 2,267,000	Apidos CLO XXXII 6.128% 20/1/2033	2,247,597	0.21	USD 1,237,585	Madison Park Funding XLI 5.645% 22/4/2027	1,226,582	0.11
USD 250,000	Apidos CLO XXXIII 7.208% 20/1/2033	247,178	0.02	USD 747,067	Madison Park Funding XXVI 6.002% 29/7/2030	742,593	0.07
USD 750,000	Apidos CLO XXXIX 5.953% 21/4/2035	739,657	0.07				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

*** 当該有価証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 1,000,000	Madison Park Funding XXVII 6.158% 20/4/2030	981,162	0.09	GBP 200,000	Trafford Centre Finance 4.832% 28/7/2035	186,941	0.02
USD 400,000	MAF Sukuk 4.5% 3/11/2025*	393,482	0.03	USD 1,750,000	Trinitas CLO XIV 6.818% 25/1/2034	1,720,062	0.16
USD 225,454	Modern Land China 9% 30/12/2026	19,104	0.00	USD 2,000,000	Trinitas CLO XIV 7.818% 25/1/2034	1,939,902	0.18
USD 830,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.498% 19/10/2031	819,194	0.08	USD 956,341	Voya CLO 2013-1 6.002% 15/10/2030	950,706	0.09
USD 1,050,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 6.392% 16/10/2033	1,029,482	0.10	USD 835,000	Voya CLO 2014-4 6.392% 14/7/2031	822,065	0.08
USD 3,000,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 6.138% 19/1/2033	2,993,347	0.28	USD 300,000	Voya CLO 2018-1 5.748% 19/4/2031	297,291	0.03
USD 500,000	OCP CLO 2020-18 5.898% 20/7/2032	494,394	0.05	USD 1,000,000	Voya CLO 2018-2 6.042% 15/7/2031	968,096	0.09
USD 750,000	Octagon Investment Partners 18-R 5.752% 16/4/2031	743,412	0.07	USD 500,000	York CLO 1 7.825% 22/10/2029	488,649	0.04
USD 1,000,000	Octagon Investment Partners XVII 5.818% 25/1/2031	992,661	0.09			60,925,204	5.64
USD 600,000	OZLM VI 6.542% 17/4/2031	580,727	0.05		チリ		
USD 750,000	Palmer Square CLO 2018-2 5.892% 16/7/2031	744,190	0.07	USD 200,000	Chile Government International Bond 2.45% 31/1/2031	166,931	0.02
USD 320,000	Palmer Square CLO 2020-3 6.464% 15/11/2031	315,530	0.03	USD 200,000	Chile Government International Bond 3.125% 21/1/2026	190,917	0.02
USD 800,000	Peace Park CLO 5.938% 20/10/2034	788,225	0.07	USD 676,000	Chile Government International Bond 3.5% 25/1/2050	488,489	0.04
USD 250,000	Pikes Peak Clo 4 5.992% 15/7/2034	246,378	0.02	USD 200,000	Nacional del Cobre de Chile 4.25% 17/7/2042	165,133	0.02
USD 200,000	Redsun Properties 9.7% 16/4/2023	33,987	0.01			1,011,470	0.10
USD 2,278,000	Regata XII Funding 5.892% 15/10/2032	2,249,559	0.21		中国		
USD 300,000	Regatta IX Funding 7.242% 17/4/2030	293,480	0.03	CNY 88,200,000	China Government Bond 1.99% 9/4/2025	12,580,372	1.17
USD 250,000	Regatta XVI Funding 8.692% 15/1/2033	241,494	0.02	CNY 25,000,000	China Government Bond 2.62% 25/9/2029	3,551,168	0.33
USD 585,000	Regatta XXI Funding 6.508% 20/10/2034	580,679	0.05	CNY 78,000,000	China Government Bond 2.68% 21/5/2030	11,100,903	1.03
USD 500,000	Rockford Tower CLO 2018-1 6.015% 20/5/2031	496,436	0.05	CNY 10,000,000	China Government Bond 2.7% 3/11/2026	1,442,826	0.13
USD 309,000	RR 3 5.882% 15/1/2030	307,047	0.03	CNY 27,700,000	China Government Bond 2.8% 24/3/2029	3,985,707	0.37
USD 1,500,000	RR 3 6.192% 15/1/2030	1,469,445	0.14	CNY 26,000,000	China Government Bond 2.85% 4/6/2027	3,766,199	0.35
USD 685,000	RR 5 6.442% 15/10/2031	670,676	0.06	CNY 53,500,000	China Government Bond 2.94% 17/10/2024	7,790,154	0.72
USD 250,000	Symphony CLO XXIV 6.015% 23/1/2032	247,604	0.02	CNY 106,000,000	China Government Bond 3.01% 13/5/2028	15,485,285	1.44
USD 500,000	TIAA CLO IV 6.038% 20/1/2032	494,961	0.05	CNY 27,000,000	China Government Bond 3.02% 27/5/2031	3,940,429	0.37
USD 500,000	TICP CLO IX 5.948% 20/1/2031	497,724	0.05	CNY 40,000,000	China Government Bond 3.03% 11/3/2026	5,843,515	0.54
				CNY 56,300,000	China Government Bond 3.13% 21/11/2029	8,291,395	0.77
				CNY 6,700,000	China Government Bond 3.19% 11/4/2024	976,314	0.09
				CNY 9,400,000	China Government Bond 3.22% 6/12/2025	1,382,806	0.13

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
CNY 16,400,000	China Government Bond 3.25% 6/6/2026	2,415,055	0.22	DKK 4,300,000	Denmark Government Bond 4.5% 15/11/2039	741,949	0.07
CNY 4,500,000	China Government Bond 3.29% 23/5/2029	671,512	0.06			2,469,544	0.23
CNY 28,350,000	China Government Bond 3.39% 16/3/2050	4,134,576	0.38		フィンランド		
CNY 1,900,000	China Government Bond 3.4% 15/7/2072	277,755	0.03	EUR 100,000	Ahlstrom-Munksjo 3 Oy 3.625% 4/2/2028	90,625	0.01
CNY 2,800,000	China Government Bond 3.72% 12/4/2051	432,600	0.04	EUR 630,000	Finland Government Bond 0.125% 15/9/2031	519,263	0.05
CNY 2,950,000	China Government Bond 3.73% 25/5/2070	463,893	0.04	EUR 1,670,000	Finland Government Bond 0.5% 15/4/2026*	1,642,787	0.15
CNY 2,000,000	China Government Bond 3.74% 22/9/2035	311,794	0.03	EUR 80,000	Finland Government Bond 1.375% 15/4/2047	59,431	0.01
CNY 1,500,000	China Government Bond 3.81% 14/9/2050	235,061	0.02	EUR 170,000	Finland Government Bond 2.625% 4/7/2042	163,442	0.01
CNY 6,200,000	China Government Bond 3.86% 22/7/2049	979,145	0.09	EUR 610,000	OP Corporate Bank 0.6% 18/1/2027	565,170	0.05
CNY 8,800,000	China Government Bond 3.97% 23/7/2048	1,410,053	0.13			3,040,718	0.28
CNY 3,000,000	China Government Bond 4% 24/6/2069	499,068	0.05		フランス		
CNY 4,800,000	China Government Bond 4.03% 21/6/2040	778,703	0.07	EUR 200,000	Air France-KLM 7.25% 31/5/2026	215,633	0.02
CNY 2,300,000	China Government Bond 4.05% 24/7/2047	373,153	0.03	GBP 400,000	Banque Federative du Credit Mutuel 1.25% 5/12/2025	438,526	0.04
CNY 6,000,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	977,777	0.09	EUR 900,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.75% 1/2/2033	920,999	0.08
CNY 3,000,000	China Government Bond 4.5% 23/6/2041	514,824	0.05	EUR 400,000	BNP Paribas 0.5% 19/2/2028	362,553	0.03
		94,612,042	8.77	EUR 200,000	BNP Paribas 1.125% 15/1/2032	179,928	0.02
	コロンビア			GBP 100,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027	103,184	0.01
USD 800,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	710,938	0.07	EUR 1,100,000	BNP Paribas 2.375% 20/11/2030	1,085,911	0.10
USD 200,000	Colombia Government International Bond 5% 15/6/2045	131,002	0.01	USD 482,000	BNP Paribas 3.132% 20/1/2033	388,356	0.03
USD 100,000	Ecopetrol 5.375% 26/6/2026	95,200	0.01	GBP 100,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	114,981	0.01
USD 100,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	66,625	0.00	EUR 300,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	296,946	0.03
		1,003,765	0.09	EUR 600,000	BPCE 2.25% 2/3/2032	563,650	0.05
	チェコ共和国			EUR 400,000	BPCE SFH 0.75% 2/9/2025	395,483	0.04
CZK 20,500,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	814,667	0.08	EUR 650,000	Caisse de Refinancement de l'Habitat 3.6% 8/3/2024	691,324	0.06
CZK 50,950,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	2,303,783	0.21	EUR 300,000	Caisse Francaise de Financement Local 1% 25/4/2028	281,144	0.03
		3,118,450	0.29	EUR 400,000	Caisse Francaise de Financement Local 1.125% 19/1/2033	338,484	0.03
	デンマーク			EUR 500,000	Cie de Financement Foncier 0.325% 12/9/2023*	523,622	0.05
EUR 500,000	Danske Bank 1.375% 17/2/2027	483,743	0.04	EUR 400,000	Cie de Financement Foncier 0.875% 11/9/2028	369,169	0.03
EUR 600,000	Danske Bank 4.125% 10/1/2031	631,203	0.06				
DKK 4,800,000	Denmark Government Bond 0.5% 15/11/2027	612,649	0.06				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 200,000	Cie de Financement Foncier 1.25% 15/11/2032	173,673	0.02	EUR 100,000	iliad 5.625% 15/2/2030	102,898	0.01
EUR 300,000	Credit Agricole Assurances 2.625% 29/1/2048	281,008	0.03	EUR 300,000	Loxam 3.75% 15/7/2026	294,164	0.03
EUR 400,000	Credit Agricole Home Loan SFH 0.375% 30/9/2024	404,133	0.04	EUR 100,000	Orange 2.375% 15/4/2171	100,589	0.01
EUR 500,000	Credit Agricole Home Loan SFH 0.875% 11/8/2028*	462,494	0.04	EUR 200,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026	191,973	0.02
EUR 600,000	Credit Mutuel Home Loan SFH 4.125% 19/1/2024	641,334	0.06	EUR 200,000	PSA Banque France 0% 22/1/2025	197,222	0.02
EUR 400,000	Electricite de France 4.25% 25/1/2032	413,938	0.04	EUR 200,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	196,254	0.02
EUR 300,000	Electricite de France 4.625% 25/1/2043	299,122	0.03	EUR 1,500,000	Societe Du Grand Paris EPIC 1.125% 25/5/2034*	1,227,454	0.11
GBP 200,000	Electricite de France 6% 29/7/2171	224,147	0.02	EUR 100,000	Societe Generale 1% 24/11/2030	94,446	0.01
EUR 100,000	Engie 2.125% 30/3/2032	90,539	0.01	GBP 100,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024	115,080	0.01
EUR 200,000	Faurecia 3.125% 15/6/2026	197,264	0.02	EUR 1,400,000	Societe Generale 2.125% 27/9/2028	1,315,462	0.12
EUR 100,000	Faurecia 3.75% 15/6/2028	93,380	0.01	EUR 700,000	Societe Generale 4.25% 6/12/2030	719,091	0.07
EUR 13,789	FCT E-Carat 10 3.906% 20/12/2028	14,644	0.00	EUR 200,000	Suez 1.625% 12/9/2171	186,255	0.01
EUR 12,304	FCT Noria 2018-1 3.514% 25/6/2038	12,986	0.00	EUR 181,000	TotalEnergies 1.75% 4/4/2171	184,842	0.02
EUR 12,304	FCT Noria 2018-1 4.664% 25/6/2038	12,843	0.00	EUR 895,000	TotalEnergies 2% 17/4/2171	823,799	0.07
EUR 2,025,000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/3/2025	2,016,546	0.19	EUR 111,000	TotalEnergies 2% 4/9/2171	90,848	0.01
EUR 2,449,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/5/2040	1,617,453	0.15	GBP 100,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	109,972	0.01
EUR 2,720,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/6/2044	1,627,374	0.15	EUR 100,000	Veolia Environnement 0.8% 15/1/2032	82,011	0.01
EUR 630,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/5/2072*	236,725	0.02			31,384,877	2.91
EUR 7,410,000	French Republic Government Bond OAT 0.75% 25/2/2028*	7,036,092	0.65		ドイツ		
EUR 2,000,000	French Republic Government Bond OAT 1.5% 25/5/2050	1,410,260	0.13	EUR 100,000	Bayer 4.5% 25/3/2082	99,286	0.01
EUR 240,000	French Republic Government Bond OAT 2% 25/5/2048	193,981	0.02	EUR 25,252,000	Bundesobligation 0% 10/10/2025	24,914,097	2.31
EUR 10,000	French Republic Government Bond OAT 3.25% 25/5/2045	10,275	0.00	EUR 70,280,000	Bundesobligation 1.3% 15/10/2027*	70,180,085	6.51
EUR 519,000	French Republic Government Bond OAT 4% 25/4/2060	612,413	0.06	EUR 34,456,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2031*	29,400,875	2.73
				EUR 1,150,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2052	579,372	0.05
				EUR 200,000	Commerzbank 0.75% 24/3/2026	196,307	0.02
				EUR 500,000	Commerzbank 0.875% 18/4/2028	468,280	0.04
				EUR 1,300,000	Commerzbank 1.375% 29/12/2031	1,154,306	0.11
				EUR 200,000	Commerzbank 6.125% 9/4/2171	201,200	0.02
				EUR 210,000	Covestro 0.875% 3/2/2026	205,216	0.02
				EUR 510,000	Deutsche Bank 0.25% 15/5/2023	539,799	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 4,300,000	Deutsche Bank 0.75% 17/2/2027	4,041,628	0.37		ギリシャ Hellenic Republic		
EUR 400,000	Deutsche Bank 1.125% 17/3/2025	402,167	0.04	EUR 354,000	Government Bond 0% 12/2/2026	337,319	0.03
EUR 900,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	845,326	0.07	EUR 60,000	Hellenic Republic Government Bond 1.75% 18/6/2032	51,150	0.00
GBP 100,000	Deutsche Bank 2.625% 16/12/2024	114,292	0.01	EUR 161,000	Hellenic Republic Government Bond 4.25% 15/6/2033	169,373	0.02
EUR 500,000	Deutsche Bank 3.25% 24/5/2028	493,759	0.04			557,842	0.05
GBP 100,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2026	115,401	0.01		香港 Yango Justice		
EUR 100,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	95,888	0.01	USD 200,000	International 10.25% 15/9/2022***	6,145	0.00
EUR 1,100,000	Deutsche Bank 5.375% 11/1/2029*	1,167,688	0.11		ハンガリー Hungary Government		
EUR 300,000	Deutsche Pfandbriefbank 0.625% 30/8/2027	281,151	0.03	HUF 168,640,000	Bond 3% 21/8/2030	335,006	0.03
EUR 400,000	DZ HYP 0.25% 30/6/2023	421,814	0.04		インド REC 3.875% 7/7/2027	183,652	0.02
EUR 250,000	DZ HYP 0.875% 22/3/2028	234,548	0.02		インドネシア Indonesia Government		
EUR 170,000	E.ON 0.875% 18/10/2034*	127,945	0.01	USD 800,000	International Bond 4.35% 8/1/2027*	781,500	0.07
EUR 200,000	FCT Autonoria DE 2023 0% 26/1/2043	213,007	0.02	USD 400,000	Indonesia Government International Bond 5.125% 15/1/2045	390,500	0.04
	Fraport Frankfurt Airport Services			IDR 7,535,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	485,689	0.05
EUR 770,000	Worldwide 1.875% 31/3/2028	716,340	0.07	IDR 17,001,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15/4/2032	1,083,276	0.10
EUR 700,000	Fresenius 5% 28/11/2029	743,350	0.07	IDR 15,522,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	1,026,722	0.10
EUR 200,000	Gruenthal 3.625% 15/11/2026	194,690	0.01	IDR 13,716,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	900,206	0.08
EUR 2,500,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 15/9/2028	2,227,340	0.21	IDR 19,728,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	1,347,952	0.12
EUR 2,514,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.875% 4/7/2039	1,845,710	0.17	IDR 17,000,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.125% 15/5/2024	1,139,513	0.11
	Landesbank Baden- Wuerttemberg 0.25% 10/1/2025			IDR 25,876,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	1,838,197	0.17
EUR 400,000		399,574	0.04	IDR 12,598,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	911,883	0.08
EUR 300,000	Merck 1.625% 25/6/2079	302,775	0.03	USD 350,000	Pertamina Persero 4.175% 21/1/2050	270,693	0.02
EUR 100,000	ProGroup 3% 31/3/2026	97,210	0.01	USD 200,000	Pertamina Persero 5.625% 20/5/2043	186,355	0.02
EUR 100,000	Renk 5.75% 15/7/2025	104,849	0.01	USD 500,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.55% 29/3/2026*	496,875	0.05
EUR 124,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2% 15/7/2025	121,963	0.01	USD 880,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.7% 6/6/2032*	866,800	0.08
EUR 800,000	Vantage Towers 0.75% 31/3/2030	784,088	0.07			11,726,161	1.09
EUR 200,000	Vonovia 0.375% 16/6/2027	178,469	0.02		国際機関 Asian Development Bank		
EUR 100,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	107,134	0.01	EUR 660,000	1.95% 22/7/2032	623,930	0.06
		144,316,929	13.38				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

*** 当該有価証券はデフォルトが生じている。詳細については注記2(b)を参照のこと。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 550,000	European Investment Bank 0.25% 15/6/2040	343,297	0.03	EUR 999,000	RRE 5 Loan Management 4.038% 15/1/2037	1,004,632	0.09
EUR 2,622,000	European Investment Bank 2.75% 28/7/2028	2,725,082	0.25	EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 4.588% 15/4/2033	248,585	0.02
EUR 2,500,000	European Union 0.4% 4/2/2037	1,763,383	0.17	GBP 556,250	Taurus 2019-2 UK 5.865% 17/11/2029	665,159	0.06
EUR 1,370,000	European Union 1% 6/7/2032	1,188,006	0.11	GBP 408,868	Taurus 2019-2 UK 6.165% 17/11/2029	485,324	0.05
EUR 780,800	European Union 3% 4/3/2053	745,880	0.07	GBP 110,191	Taurus 2021-1 UK 5.245% 17/5/2031	127,276	0.01
EUR 975,000	European Union 3.375% 4/11/2042	1,005,560	0.09	GBP 99,271	Taurus 2021-1 UK 5.595% 17/5/2031	112,644	0.01
USD 2,920,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 26/8/2030	2,267,063	0.21	GBP 145,928	Taurus 2021-1 UK 6.545% 17/5/2031	165,013	0.02
		10,662,201	0.99	EUR 158,000	Voya Euro CLO III 3.938% 15/4/2033	160,968	0.02
	アイルランド			EUR 1,186,000	Voya Euro CLO IV 4.038% 15/10/2034	1,202,723	0.11
EUR 200,000	AIB 5.25% 9/4/2171	197,690	0.02			10,491,211	0.98
EUR 500,000	Ares European CLO VII 3.788% 15/10/2030	513,656	0.05		イタリア		
EUR 255,000	Avoca CLO XXII 3.588% 15/4/2035	255,044	0.02	EUR 600,000	ASTM 1.5% 25/1/2030	503,501	0.05
EUR 318,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 3.967% 22/2/2034	319,113	0.03	EUR 149,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	153,638	0.01
EUR 250,000	CVC Cordatus Loan Fund V 3.893% 21/7/2030	258,305	0.02	EUR 100,000	Azzurra Aeroporti 2.625% 30/5/2027	93,066	0.01
EUR 530,000	Fresenius Finance Ireland 0.875% 1/10/2031	405,509	0.04	EUR 100,000	Castor 7.296% 15/2/2029	104,011	0.01
EUR 150,000	Henley CLO IV 3.799% 25/4/2034	151,051	0.02	EUR 100,000	doValue 3.375% 31/7/2026	97,283	0.01
EUR 172,000	Invesco Euro CLO III 4.038% 15/7/2032	173,818	0.02	EUR 560,000	Eni 2.75% 11/5/2171	468,051	0.04
EUR 250,000	Invesco Euro CLO IV 3.988% 15/4/2033	253,441	0.02	EUR 360,000	Intesa Sanpaolo 0.75% 4/12/2024	362,284	0.03
EUR 500,000	Invesco Euro CLO V 6.088% 15/1/2034	491,816	0.05	EUR 390,000	Intesa Sanpaolo 1.35% 24/2/2031	307,776	0.03
EUR 990,000	Ireland Government Bond 1.7% 15/5/2037	854,354	0.08	EUR 7,510,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0% 1/8/2026	7,024,705	0.65
EUR 551,000	Ireland Government Bond 3% 18/10/2043	551,697	0.05	EUR 850,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.1% 1/4/2027	810,814	0.08
EUR 151,968	Last Mile PE 2021 3.882% 17/8/2031	152,728	0.01	EUR 2,256,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 1/3/2036	1,681,218	0.16
EUR 136,971	Last Mile PE 2021 4.282% 17/8/2031	135,435	0.01	EUR 1,886,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.5% 30/4/2045	1,158,851	0.11
EUR 200,000	LT Autorahoitus III 5.156% 17/12/2032	217,973	0.02	EUR 1,206,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 1/9/2050*	865,558	0.08
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 4.398% 25/11/2033	254,545	0.02	EUR 3,000,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.5% 1/12/2032*	2,711,205	0.25
EUR 269,055	Pearl Finance 2020 4.582% 17/11/2032	275,631	0.03	EUR 2,300,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.65% 1/12/2027	2,317,546	0.21
EUR 212,412	Pearl Finance 2020 5.182% 17/11/2032	218,262	0.02	EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.7% 1/3/2047	3,888	0.00
EUR 97,000	River Green Finance 2020 3.443% 22/1/2032	98,108	0.01				
EUR 527,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 3.942% 20/1/2033	540,711	0.05				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 1,970,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 1/9/2038	1,719,672	0.16	JPY 99,050,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.8% 20/3/2048	644,789	0.06
EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 1/3/2048	4,422	0.00	JPY 230,200,000	Japan Government Thirty Year Bond 1.3% 20/6/2052	1,654,047	0.15
EUR 270,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 1/9/2049	251,946	0.02	JPY 151,850,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.3% 20/9/2039	983,562	0.09
EUR 240,000	Koromo Italy 0% 26/2/2035	255,608	0.02	JPY 603,650,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/6/2040	3,932,321	0.37
EUR 100,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029	80,807	0.01	JPY 278,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/3/2038	1,907,849	0.18
EUR 200,000	Telecom Italia 2.75% 15/4/2025	202,602	0.02	JPY 366,200,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.5% 20/12/2038	2,482,353	0.23
EUR 150,000	UniCredit 4.45% 16/2/2029	153,408	0.01	JPY 122,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/6/2037	858,551	0.08
USD 200,000	UniCredit 7.296% 2/4/2034	189,746	0.02	JPY 3,500,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/12/2037	24,475	0.00
		21,521,606	1.99	JPY 33,200,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.7% 20/3/2037	237,552	0.02
EUR 350,000	日本 Asahi 0.01% 19/4/2024	355,895	0.03	JPY 14,100,000	Japanese Government CPI Linked Bond 0.1% 10/9/2023	114,775	0.01
EUR 330,000	Asahi 0.155% 23/10/2024	329,379	0.03	EUR 818,000	Nissan Motor 3.201% 17/9/2028	775,225	0.07
EUR 400,000	East Japan Railway 2.614% 8/9/2025	412,592	0.04	EUR 200,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	200,535	0.02
JPY 100,000,000	Japan Expressway and Debt Repayment Agency 0.306% 31/3/2050	549,456	0.05	EUR 100,000	SoftBank 3.125% 19/9/2025	97,634	0.01
JPY 1,180,500,000	Japan Government Five Year Bond 0.005% 20/6/2026	8,635,264	0.80	USD 1,207,000	Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028	1,189,627	0.11
JPY 607,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.5% 20/3/2059	3,324,863	0.31			45,409,324	4.21
JPY 57,900,000	Japan Government Forty Year Bond 0.7% 20/3/2061	338,941	0.03	USD 500,000	ジャージー AGL CLO 20 7.589% 20/7/2035	497,532	0.05
JPY 560,000,000	Japan Government Forty Year Bond 0.8% 20/3/2058	3,426,233	0.32	EUR 100,000	Avis Budget Finance 4.5% 15/5/2025	104,712	0.01
JPY 121,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.9% 20/3/2057	768,532	0.07	GBP 110,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	122,513	0.01
JPY 382,100,000	Japan Government Forty Year Bond 1% 20/3/2062	2,441,381	0.23	GBP 134,000	Heathrow Funding 2.625% 16/3/2028	135,281	0.01
JPY 430,400,000	Japan Government Ten Year Bond 0.2% 20/9/2032	3,159,307	0.29	GBP 10,000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5.844% 10/5/2031	12,412	0.00
JPY 125,600,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/9/2050	755,338	0.07			872,450	0.08
JPY 73,800,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/6/2048	467,765	0.04	USD 200,000	カザフスタン Kazakhstan Government International Bond 4.875% 14/10/2044	181,141	0.02
JPY 110,150,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/12/2048	694,141	0.07	USD 200,000	Kazakhstan Government International Bond 5.125% 21/7/2025	207,119	0.02
JPY 753,500,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/9/2051	4,646,942	0.43				

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	KazMunayGas National 4.75% 19/4/2027	183,550	0.02		マレーシア		
		571,810	0.06	MYR 44,200	Malaysia Government Bond 4.893% 8/6/2038	1,067,207	0.10
	ルクセンブルグ			MYR 56,000	Malaysia Government Investment Issue 4.07% 30/9/2026	1,270,380	0.12
EUR 100,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance	86,642	0.01	MYR 52,000	Malaysia Government Investment Issue 4.245% 30/9/2030	1,188,329	0.11
EUR 300,000	/Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028			USD 500,000	Malaysia Sukuk Global 3.179% 27/4/2026	477,435	0.04
EUR 740,000	Altice Financing 2.25% 15/1/2025	298,283	0.03			4,003,351	0.37
EUR 170,000	Becton Dickinson Euro Finance 0.632% 4/6/2023	781,974	0.07		メキシコ		
EUR 147,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.213% 12/2/2036	124,937	0.01	USD 200,000	America Movil 4.375% 16/7/2042	173,548	0.02
EUR 191,000	BL Consumer Credit 2021 4.053% 25/9/2038	151,632	0.01	USD 730,000	America Movil 4.7% 21/7/2032	698,062	0.06
EUR 100,000	BL Consumer Credit 2021 5.253% 25/9/2038	193,955	0.02	USD 950,000	GCC 3.614% 20/4/2032	799,273	0.07
EUR 2,390,000	Cullinan Holdco 7.078% 15/10/2026	102,497	0.01	USD 200,000	Grupo Televisa SAB 5.25% 24/5/2049	180,719	0.02
EUR 640,000	European Financial Stability Facility 1.75% 17/7/2053*	1,715,844	0.16	MXN 1,030,064	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	5,126,589	0.48
EUR 51,145	European Financial Stability Facility 2.375% 21/6/2032	628,411	0.06	MXN 180,000	Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034	878,514	0.08
EUR 51,145	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.125% 14/11/2034	53,640	0.01	MXN 340,000	Mexican Bonos 8% 7/12/2023	1,802,804	0.17
EUR 560,000	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.875% 14/11/2034	53,410	0.00	MXN 289,420	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	1,510,256	0.14
EUR 800,000	Highland 0.318% 15/12/2026	513,576	0.05	USD 280,000	Mexico Government International Bond 4.28% 14/8/2041	223,376	0.02
EUR 110,000	Holcim Finance Luxembourg 0.125% 19/7/2027*	726,719	0.07	USD 600,000	Mexico Government International Bond 4.6% 23/1/2046	480,945	0.04
EUR 1,100,000	Medtronic Global 0.25% 2/7/2025	107,945	0.01			11,874,086	1.10
EUR 460,000	Medtronic Global 0.375% 7/3/2023	1,169,625	0.11		オランダ		
EUR 125,000	Medtronic Global 1.125% 7/3/2027	440,241	0.04	EUR 200,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/2/2172	191,520	0.02
EUR 630,000	Prologis International Funding II 1.625% 17/6/2032	101,145	0.01	EUR 235,000	ABN AMRO Bank 0.5% 17/7/2023	247,626	0.02
EUR 100,000	SES 2% 2/7/2028	581,821	0.05	EUR 300,000	ABN AMRO Bank 0.875% 14/1/2026	295,596	0.03
EUR 800,000	Stena International 7.25% 15/2/2028	107,405	0.01	EUR 200,000	ABN AMRO Bank 1.45% 12/4/2038	162,964	0.02
EUR 600,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024*	806,348	0.07	EUR 450,000	ABN AMRO Bank 2.5% 5/9/2023	476,927	0.04
	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024	596,039	0.06	EUR 400,000	Allianz Finance II 0.25% 6/6/2023	422,578	0.04
		9,342,089	0.87	USD 200,000	Braskem Netherlands Finance 4.5% 10/1/2028	180,380	0.02
				EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank 1.5% 26/4/2038*	162,475	0.01
				GBP 100,000	Cooperatieve Rabobank UA 1.875% 12/7/2028	104,819	0.01
				EUR 400,000	Digital Dutch Finco 0.625% 15/7/2025	384,642	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 144,000	Domi 2023-1 0% 15/2/2055	152,952	0.01	EUR 120,000	RELX Finance 0.5% 10/3/2028*	108,816	0.01
EUR 125,000	Dutch Property Finance 2020-2 3.818% 28/1/2058	130,798	0.01	USD 446,000	Shell International Finance 2.75% 6/4/2030	390,260	0.03
EUR 178,000	Dutch Property Finance 2021-1 3.568% 28/7/2058	185,476	0.02	EUR 100,000	Financieringsmaatschappij 0% 20/2/2026	95,679	0.01
EUR 2,191,000	EnBW International Finance 4.049% 22/11/2029	2,336,777	0.21	EUR 100,000	Financieringsmaatschappij 0.3% 28/2/2024	103,059	0.01
EUR 300,000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	303,521	0.03	EUR 30,000	Financieringsmaatschappij 0.5% 5/9/2034	22,699	0.00
EUR 810,000	Heimstaden Bostad Treasury 0.25% 13/10/2024	780,731	0.07	EUR 112,937	Summer BidCo 9% 15/11/2025	93,617	0.01
EUR 500,000	ING Bank 0.875% 11/4/2028	468,309	0.04	EUR 1,500,000	Telefonica Europe 4.375% 14/3/2171	1,555,030	0.14
EUR 100,000	ING Groep 0.1% 3/9/2025	99,693	0.01	EUR 200,000	Telefonica Europe 6.135% 2/3/2030	204,564	0.02
EUR 400,000	ING Groep 1.25% 16/2/2027	387,189	0.04	EUR 200,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	177,809	0.02
GBP 100,000	ING Groep 3% 18/2/2026	113,780	0.01	EUR 800,000	Universal Music 3% 30/6/2027	815,422	0.07
EUR 100,000	IPD 3 5.5% 1/12/2025	103,628	0.01	EUR 570,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	540,870	0.05
EUR 400,000	JDE Peet's 0% 16/1/2026	376,426	0.04	EUR 800,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028*	685,562	0.06
EUR 540,000	JDE Peet's 0.625% 9/2/2028	479,699	0.04	EUR 400,000	Wintershall Dea Finance 0.84% 25/9/2025	391,082	0.04
EUR 100,000	Koninklijke KPN 2% 8/2/2172	100,313	0.01	EUR 3,200,000	Wintershall Dea Finance 1.332% 25/9/2028	2,830,814	0.26
EUR 400,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025	402,234	0.04	EUR 380,000	Wolters Kluwer 3% 23/9/2026	393,897	0.04
EUR 160,000	Mondelez International Netherlands 1.25% 9/9/2041	107,251	0.01	EUR 200,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	194,153	0.02
EUR 100,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2171	103,046	0.01			28,247,699	2.61
EUR 1,110,000	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2030	955,019	0.09	ニュージーランド			
EUR 1,620,000	Netherlands Government Bond 0.25% 15/7/2029*	1,456,989	0.13	EUR 599,000	Chorus 3.625% 7/9/2029	615,340	0.06
EUR 693,000	Netherlands Government Bond 2.75% 15/1/2047	715,903	0.07	NZD 1,000,000	New Zealand Government Bond 4.25% 15/5/2034	599,519	0.06
EUR 1,040,000	Netherlands Government Bond 4% 15/1/2037	1,222,662	0.11	NZD 555,000	New Zealand Government Bond 4.5% 15/4/2027	341,427	0.03
USD 210,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.25% 30/11/2051	132,287	0.01			1,556,286	0.15
USD 1,993,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,719,396	0.16	ノルウェー			
USD 1,738,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	1,602,180	0.15	EUR 290,000	Aker BP 1.125% 12/5/2029	252,059	0.02
USD 2,178,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	2,040,116	0.19	NOK 6,650,000	Norway Government Bond 1.75% 17/2/2027	602,213	0.06
USD 460,000	Prosus 4.987% 19/1/2052*	332,350	0.03			854,272	0.08
EUR 200,000	Q-Park I 4.716% 1/3/2026*	206,114	0.02	パナマ			
				EUR 100,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	94,705	0.01
				USD 400,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	375,129	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 200,000	Panama Government International Bond 4.5% 15/5/2047	154,345	0.01	EUR 44,194	TAGUS -Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII 0.7% 12/2/2024	46,111	0.01
		624,179	0.06			2,803,973	0.27
	ペルー				カタール		
USD 460,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	379,240	0.03	USD 500,000	Qatar Government International Bond 3.25% 2/6/2026	477,836	0.04
USD 600,000	Peruvian Government International Bond 2.844% 20/6/2030*	507,170	0.05	USD 280,000	Qatar Government International Bond 3.75% 16/4/2030	266,576	0.02
		886,410	0.08	USD 200,000	Qatar Government International Bond 4.625% 2/6/2046	187,049	0.02
	フィリピン			USD 200,000	Qatar Government International Bond 5.103% 23/4/2048	197,750	0.02
USD 500,000	Philippine Government International Bond 3.7% 1/3/2041	404,375	0.04			1,129,211	0.10
	ポーランド				ルーマニア		
PLN 5,930,000	Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2026	1,188,433	0.11	RON 1,870,000	Romania Government Bond 4.15% 26/1/2028	351,482	0.03
PLN 3,300,000	Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2027	638,344	0.06	EUR 2,530,000	Romanian Government International Bond 2.375% 19/4/2027*	2,393,153	0.22
PLN 460,000	Republic of Poland Government Bond 2.75% 25/10/2029	83,527	0.01			2,744,635	0.25
PLN 4,945,000	Republic of Poland Government Bond 4% 25/10/2023	1,104,444	0.10		サウジアラビア		
EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.375% 22/10/2027*	472,629	0.04	USD 270,000	Saudi Government International Bond 3.25% 22/10/2030	243,331	0.02
EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.5% 9/9/2025	503,436	0.05	USD 770,000	Saudi Government International Bond 3.45% 2/2/2061	533,154	0.05
USD 500,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026	474,668	0.04	USD 400,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028	378,500	0.03
		4,465,481	0.41	USD 400,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	391,852	0.04
	ポルトガル					1,546,837	0.14
EUR 200,000	EDP -Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	192,424	0.02	SGD 1,920,000	Singapore Government Bond 2% 1/2/2024	1,401,249	0.13
EUR 610,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 15/6/2029	599,386	0.05	SGD 530,000	Singapore Government Bond 2.75% 1/4/2042	374,792	0.04
EUR 1,570,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.125% 17/10/2028	1,573,740	0.15	SGD 1,050,000	Singapore Government Bond 3.5% 1/3/2027	778,973	0.07
EUR 357,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.1% 15/4/2037	392,312	0.04	USD 250,000	Temasek Financial I 3.625% 1/8/2028	237,517	0.02
						2,792,531	0.26
				EUR 580,000	スロバキア Slovakia Government Bond 0.75% 9/4/2030	505,099	0.05
				EUR 110,000	スロベニア Slovenia Government Bond 1.75% 3/11/2040	82,619	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	南アフリカ						
ZAR 145,163,050	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030*	7,101,127	0.66	EUR 800,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	786,699	0.07
ZAR 14,679,692	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	651,384	0.06	EUR 100,000	Cellnex Telecom 1% 20/4/2027	91,260	0.01
		7,752,511	0.72	EUR 100,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027	99,444	0.01
	韓国			EUR 47,788	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.997% 21/3/2033	49,180	0.00
USD 200,000	Korea Gas 2.25% 18/7/2026*	180,672	0.02	EUR 100,000	Consolidated Airlines 2.75% 25/3/2025	100,515	0.01
USD 600,000	Korea International Bond 2.75% 19/1/2027*	560,823	0.05	EUR 100,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	96,296	0.01
KRW 743,530,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2025	526,074	0.05	EUR 3,788,000	Spain Government Bond 0.1% 30/4/2031	3,070,680	0.28
KRW 2,190,680,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2039	1,168,949	0.11	EUR 1,030,000	Spain Government Bond 0.5% 31/10/2031	850,729	0.08
KRW 2,686,940,000	Korea Treasury Bond 1.25% 10/3/2026	1,887,335	0.17	EUR 730,000	Spain Government Bond 0.7% 30/4/2032	607,044	0.06
KRW 3,290,120,000	Korea Treasury Bond 1.5% 10/3/2025	2,373,899	0.22	EUR 2,750,000	Spain Government Bond 0.85% 30/7/2037	1,948,059	0.18
KRW 4,904,750,000	Korea Treasury Bond 1.875% 10/6/2029	3,317,957	0.31	EUR 1,013,000	Spain Government Bond 1% 31/10/2050*	548,712	0.05
KRW 1,200,000,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2046	685,982	0.06	EUR 212,000	Spain Government Bond 2.35% 30/7/2033	199,942	0.02
KRW 2,822,720,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2049	1,578,231	0.15	EUR 18,500,000	Spain Government Bond 2.55% 31/10/2032	17,987,858	1.67
KRW 420,000,000	Korea Treasury Bond 2.125% 10/3/2047	246,187	0.02	EUR 2,100,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	1,937,449	0.18
KRW 2,169,270,000	Korea Treasury Bond 2.25% 10/12/2025	1,574,031	0.15	EUR 28,000	Spain Government Bond 5.15% 31/10/2044	34,789	0.00
KRW 530,000,000	Korea Treasury Bond 2.375% 10/9/2038	345,850	0.03	GBP 200,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	243,034	0.02
		14,445,990	1.34			33,831,902	3.14
	スペイン				スウェーデン		
EUR 80,426	Autonoria Spain 2021 FT 6.303% 31/1/2039	80,929	0.01	SEK 7,400,000	Nordea Hypotek 1.25% 20/9/2023	700,633	0.06
EUR 100,000	Autonoria Spain 2022 FT 5.203% 27/1/2040	106,317	0.01	EUR 350,000	Stadshypotek 0.5% 11/7/2025	345,482	0.03
EUR 100,000	Autonoria Spain 2022 FT 9.403% 29/1/2040	107,313	0.01	SEK 11,000,000	Stadshypotek 1.5% 1/3/2024	1,031,109	0.10
EUR 700,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025	701,768	0.07	GBP 100,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	104,930	0.01
EUR 400,000	Banco de Sabadell 1.125% 11/3/2027*	385,274	0.04	SEK 11,000,000	Swedbank Hypotek 1% 20/12/2023	1,031,916	0.10
EUR 100,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	97,034	0.01	SEK 4,110,000	Sweden Government Bond 0.75% 12/5/2028*	355,413	0.03
EUR 100,000	Banco de Sabadell 5.25% 7/2/2029	103,758	0.01	SEK 2,300,000	Sweden Government Bond 3.5% 30/3/2039	242,693	0.02
EUR 1,900,000	Banco Santander 0.2% 11/2/2028	1,657,703	0.15			3,812,176	0.35
GBP 300,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	339,396	0.03		スイス		
EUR 200,000	CaixaBank 1.125% 17/5/2024	205,740	0.02	CHF 1,420,000	Swiss Confederation Government Bond 0% 26/6/2034	1,282,063	0.12
EUR 1,200,000	CaixaBank 4.125% 24/3/2036*	1,306,062	0.12	CHF 460,000	Swiss Confederation Government Bond 0.25% 23/6/2035	422,791	0.04
EUR 100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	88,918	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
CHF 200,000	Swiss Confederation Government Bond 2% 25/6/2064	253,471	0.02	EUR 1,162,000	Chanel Ceres 0.5% 31/7/2026	1,089,742	0.10
EUR 1,000,000	UBS 1.25% 17/4/2025*	1,029,411	0.10	EUR 350,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	331,417	0.03
		2,987,736	0.28	GBP 110,000	CMF 2020-1 4.933% 16/1/2057	132,548	0.01
USD 200,000	タイ Bangkok Bank Hong Kong 3.733% 25/9/2034	169,756	0.02	GBP 100,000	Dowson 2022-2 9.183% 20/8/2029	120,024	0.01
USD 200,000	GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031	161,961	0.02	EUR 200,000	EC Finance 3% 15/10/2026	194,519	0.02
THB 12,800,000	Thailand Government Bond 1.585% 17/12/2035	313,628	0.03	GBP 99,982	Finsbury Square 2020-1 4.954% 16/3/2070	120,828	0.01
THB 25,320,000	Thailand Government Bond 2.875% 17/6/2046	671,665	0.06	GBP 100,000	Funding V 5.633% 15/10/2025	118,962	0.01
THB 10,510,000	Thailand Government Bond 3.3% 17/6/2038	308,631	0.03	GBP 100,000	Funding VI 7.033% 15/7/2026	123,023	0.01
THB 17,060,000	Thailand Government Bond 3.775% 25/6/2032	532,503	0.05	GBP 100,000	Gengarto 2021-1 4.904% 16/12/2067	117,677	0.01
USD 200,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050	126,550	0.01	GBP 193,003	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	199,008	0.02
		2,284,694	0.22	GBP 181,000	Harben Finance 4.855% 28/9/2055	207,434	0.02
USD 670,000	アラブ首長国連邦 Abu Dhabi Government International Bond 3.125% 16/4/2030	616,400	0.06	GBP 179,000	Harben Finance 5.205% 28/9/2055	194,560	0.02
USD 760,000	Abu Dhabi Government International Bond 4.125% 11/10/2047	665,000	0.06	GBP 200,000	Heathrow Finance 3.875% 1/3/2027	215,810	0.02
		1,281,400	0.12	GBP 99,996	Hops Hill No 1 5.783% 27/5/2054	119,558	0.01
EUR 141,000	英国 Anglo American Capital 1.625% 11/3/2026	139,540	0.01	GBP 99,997	Hops Hill No 1 6.283% 27/5/2054	118,492	0.01
USD 771,000	Anglo American Capital 4.5% 15/3/2028	728,355	0.07	GBP 100,000	Hops Hill No2 6.183% 27/11/2054	121,541	0.01
EUR 1,799,000	Anglo American Capital 4.75% 21/9/2032	1,889,647	0.17	GBP 100,000	Hops Hill No2 6.783% 27/11/2054	120,025	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 5.562% 25/7/2058	120,454	0.01	GBP 100,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	106,441	0.01
GBP 165,000	Azure Finance NO 2 6.933% 20/7/2030	201,365	0.02	USD 405,000	HSBC 7.39% 3/11/2028	428,009	0.04
USD 259,000	Barclays 2.894% 24/11/2032	200,286	0.02	EUR 453,000	Informa 2.125% 6/10/2025	457,438	0.04
GBP 100,000	Barclays 3% 8/5/2026	112,070	0.01	GBP 100,000	Informa 3.125% 5/7/2026	111,741	0.01
GBP 100,000	Barclays 3.25% 12/2/2027	110,523	0.01	EUR 524,000	ITV 1.375% 26/9/2026	505,667	0.05
EUR 1,024,000	Barclays 5.262% 29/1/2034	1,092,665	0.10	GBP 100,000	Jerrold Finco 4.875% 15/1/2026	107,149	0.01
USD 253,000	Barclays 5.746% 9/8/2033	242,319	0.02	GBP 140,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 5.814% 12/6/2057	168,001	0.02
USD 252,000	Barclays 7.437% 2/11/2033	270,339	0.03	GBP 200,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	231,034	0.02
GBP 200,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	208,210	0.02	EUR 1,492,000	Lloyds Banking 4.5% 18/3/2030	1,560,488	0.15
GBP 200,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	245,064	0.02	GBP 100,000	Marks & Spencer 6% 12/6/2025	119,726	0.01
GBP 115,000	Canada Square Funding 6 5.267% 17/1/2059	132,270	0.01	GBP 50,000	Mitchells & Butlers Finance 5.956% 15/6/2036	49,070	0.01
GBP 130,000	Canada Square Funding 6 5.667% 17/1/2059	145,325	0.01	GBP 100,000	Mortimer BTL 2021-1 5.11% 23/6/2053	116,461	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 889,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	881,941	0.08	GBP 124,000	Tower Bridge Funding 2021-1 5.698% 21/7/2064	149,370	0.02
EUR 500,000	Nationwide Building Society 1.125% 31/5/2028	469,307	0.04	GBP 106,000	Tower Bridge Funding 2021-1 5.998% 21/7/2064	126,663	0.01
GBP 100,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	113,208	0.01	GBP 305,000	Turbo Finance 9 5.583% 20/8/2028	370,350	0.04
GBP 100,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	112,172	0.01	GBP 100,000	Twin Bridges 2018-1 5.733% 12/9/2050	121,610	0.01
EUR 2,527,000	NatWest 4.067% 6/9/2028	2,630,137	0.24	GBP 115,000	Twin Bridges 2020-1 5.814% 12/12/2054	138,921	0.01
GBP 128,000	Newday Funding Master Issuer -Series 2021-1 5.483% 15/3/2029	153,432	0.01	GBP 125,000	Twin Bridges 2020-1 6.564% 12/12/2054	150,888	0.02
GBP 136,000	Newday Funding Master Issuer -Series 2021-3 5.283% 15/11/2029	161,684	0.02	GBP 138,000	Twin Bridges 2021-1 5.164% 12/3/2055	161,578	0.02
GBP 100,000	Newday Funding Master Issuer -Series 2022-2 8.933% 15/7/2030	122,466	0.01	GBP 100,000	Twin Bridges 2021-1 5.664% 12/3/2055	115,367	0.01
EUR 47,545	Paragon Mortgages No 12 3.134% 15/11/2038	45,975	0.01	GBP 100,000	Twin Bridges 2022-2 5.564% 12/6/2055	119,272	0.01
GBP 120,000	Paragon Mortgages No 25 5.015% 15/5/2050	145,726	0.01	GBP 527,869	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	638,186	0.06
GBP 100,000	Paragon Mortgages No 25 5.365% 15/5/2050	121,004	0.01	GBP 1,210,000	United Kingdom Gilt 0.125% 31/1/2024*	1,416,617	0.13
GBP 445,770	Parkmore Point RMBS 2022-1 5.362% 25/7/2045	533,605	0.05	GBP 5,860,000	United Kingdom Gilt 0.375% 22/10/2026*	6,282,887	0.59
GBP 100,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025	112,106	0.01	GBP 2,250,000	United Kingdom Gilt 1.5% 31/7/2053	1,492,888	0.14
GBP 100,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	108,949	0.01	GBP 718,000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/1/2049	537,482	0.05
GBP 100,000	Residential Mortgage 32 5.849% 20/6/2070	120,425	0.01	GBP 100,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	113,280	0.01
GBP 150,000	Sage AR Funding No 1 6.095% 17/11/2030	169,888	0.02			34,331,794	3.20
EUR 380,000	Santander UK 0.5% 10/1/2025*	379,859	0.04		米国		
GBP 100,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026	114,725	0.01	USD 881,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 3.901% 10/8/2035	828,760	0.08
EUR 1,500,000	Standard Chartered 0.8% 17/11/2029	1,301,671	0.12	USD 750,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 4.142% 10/8/2035	668,477	0.06
EUR 200,000	Thames Water Utilities Finance 0.875% 31/1/2028	180,103	0.02	USD 840,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 4.142% 10/8/2035	760,980	0.07
EUR 700,000	Thames Water Utilities Finance 4.375% 18/1/2031	729,255	0.07	USD 245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	456,643	0.04	
GBP 100,000	Tower Bridge Funding 2020-1 6.099% 20/9/2063	121,359	0.01	USD 870,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	735,921	0.07
GBP 100,000	Tower Bridge Funding 2020-1 7.099% 20/9/2063	122,613	0.01	USD 820,000	280 Park Avenue 2017- 280P Mortgage Trust 6.117% 15/9/2034	770,790	0.07
				USD 2,597,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	2,293,026	0.21
				USD 385,000	Amazon.com 4.1% 13/4/2062	314,954	0.03
				USD 239,000	Amazon.com 4.7% 1/12/2032	235,174	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 6,921	American Airlines 2015-2 Class AA Pass Through Trust 3.6% 22/3/2029	6,286	0.00	EUR 200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	184,085	0.01
USD 181,260	American Airlines 2016-3 Class AA Pass Through Trust 3% 15/4/2030	160,779	0.01	USD 1,104,000	AREIT 2022-CRE7 6.806% 17/6/2039	1,091,823	0.10
USD 46,150	American Airlines 2017-1 Class AA Pass Through Trust 3.65% 15/8/2030	41,757	0.00	USD 297,000	Astrazeneca Finance 2.25% 28/5/2031	246,128	0.02
USD 419,248	American Airlines 2019-1 Class AA Pass Through Trust 3.15% 15/8/2033	365,723	0.03	USD 1,164,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	1,045,674	0.10
USD 372,000	American Express 4.42% 3/8/2033	346,216	0.03	USD 2,481,000	AT&T 2.55% 1/12/2033	1,892,775	0.18
USD 1,223,767	American Homes 4 Rent 2015-SFR2 Trust 3.732% 17/10/2052	1,176,053	0.11	GBP 200,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	224,420	0.02
EUR 400,000	American International 1.875% 21/6/2027	385,806	0.04	USD 365,000	AT&T 3.5% 15/9/2053	247,674	0.02
EUR 640,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	581,137	0.05	USD 1,944,000	AT&T 4.3% 15/2/2030	1,819,606	0.17
EUR 400,000	American Tower 1.95% 22/5/2026*	394,048	0.04	GBP 300,000	AT&T 4.375% 14/9/2029*	341,919	0.03
USD 317,000	American Tower 2.1% 15/6/2030	250,032	0.02	GBP 100,000	AT&T 5.5% 15/3/2027	121,988	0.01
USD 1,210,000	American Tower 2.3% 15/9/2031*	934,637	0.09	USD 730,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015- 200P 3.596% 14/4/2033	607,726	0.06
USD 125,000	American Tower 4.05% 15/3/2032	110,848	0.01	USD 922,024	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018- DSNY 6.288% 15/9/2034	895,436	0.08
USD 2,092,000	Amgen 2.45% 21/2/2030	1,750,347	0.16	EUR 100,000	Bank of America 0.654% 26/10/2031	80,712	0.01
USD 220,000	Amgen 4.05% 18/8/2029	204,721	0.02	EUR 375,000	Bank of America 0.694% 22/3/2031	309,915	0.03
GBP 100,000	Amgen 5.5% 7/12/2026	123,039	0.01	USD 99,000	Bank of America 0.981% 25/9/2025	91,896	0.01
USD 2,123,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.5% 1/6/2030*	1,930,212	0.18	EUR 400,000	Bank of America 1.776% 4/5/2027	393,339	0.04
USD 726,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.75% 23/1/2029	712,624	0.07	USD 1,382,000	Bank of America 1.898% 23/7/2031	1,073,154	0.10
USD 784,000	Aon / Aon Global 2.6% 2/12/2031	637,318	0.06	USD 143,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	110,353	0.01
USD 258,000	Aon / Aon Global 5% 12/9/2032	251,333	0.02	USD 886,000	Bank of America 2.299% 21/7/2032	690,514	0.06
USD 1,520,000	Apple 1.65% 8/2/2031	1,211,405	0.11	USD 2,604,000	Bank of America 2.572% 20/10/2032	2,064,228	0.19
USD 1,296,000	Apple 1.7% 5/8/2031*	1,026,789	0.09	USD 338,000	Bank of America 2.651% 11/3/2032	273,556	0.03
USD 272,000	Apple 3.35% 8/8/2032	243,547	0.02	USD 822,000	Bank of America 2.687% 22/4/2032	665,199	0.06
EUR 200,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	173,928	0.02	EUR 842,000	Bank of America 2.824% 27/4/2033	784,044	0.07
USD 333,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	280,054	0.03	USD 1,080,000	Bank of America 2.972% 4/2/2033	879,319	0.08
				EUR 400,000	Bank of America 3.081% 22/9/2026	425,958	0.04
				USD 3,524,000	Bank of America 3.194% 23/7/2030	3,050,380	0.28
				USD 3,018,000	Bank of America 4.571% 27/4/2033	2,795,667	0.26
				USD 2,534,000	Bank of America 5.015% 22/7/2033	2,427,084	0.22
				USD 1,457,146	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.022% 25/4/2036	1,323,365	0.12
				USD 480,989	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 5.067% 25/9/2037	443,014	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 730,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 5.743% 15/8/2036	724,486	0.07	USD 300,000	Capital One Financial 5.268% 10/5/2033	282,561	0.03
USD 2,035,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 5.31% 15/3/2037	1,899,284	0.18	USD 15,000	Capital One Financial 5.817% 1/2/2034	14,496	0.00
USD 424,000	BBCMS Mortgage Trust 2018-C2 4.744% 15/12/2051	390,696	0.04	USD 505,000	CCUBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 4.159% 15/11/2050	455,075	0.04
USD 550,000	BDS 2022-FL12 6.7% 19/8/2038	546,297	0.05	USD 37,000	CenterPoint Energy Houston Electric 3.95% 1/3/2048	30,218	0.00
USD 1,348,476	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 4.937% 25/1/2047	1,067,662	0.10	USD 33,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	26,414	0.00
EUR 400,000	Becton Dickinson 1.401% 24/5/2023	423,835	0.04	USD 944,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	550,712	0.05
EUR 200,000	Belden 3.875% 15/3/2028	199,379	0.02	USD 198,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	118,198	0.01
USD 704,000	Benchmark 2018-B2 Mortgage Trust 4.271% 15/2/2051	608,826	0.06	USD 23,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	19,555	0.00
USD 416,000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 4.295% 10/4/2051	376,971	0.03	USD 164,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	119,240	0.01
USD 655,682	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 4.57% 15/7/2051	598,840	0.06	USD 374,000	Charter Communications Operating / Charter Communications	296,095	0.03
USD 200,000	Bimbo Bakeries USA 4% 17/5/2051*	153,200	0.01	EUR 200,000	Chemours 4% 15/5/2026	195,113	0.02
EUR 200,000	Booking 4% 15/11/2026	213,797	0.02	USD 5,237	CHL Mortgage Pass- Through Trust 2004-29 4.887% 25/2/2035	4,627	0.00
EUR 200,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	212,635	0.02	EUR 820,000	Chubb INA 1.55% 15/3/2028	775,899	0.07
USD 3,170,000	Broadcom 3.419% 15/4/2033	2,549,994	0.24	USD 307,000	Cigna 2.4% 15/3/2030	255,757	0.02
USD 2,954,000	Broadcom 3.469% 15/4/2034	2,327,928	0.22	USD 708,000	Citigroup 0.776% 30/10/2024	684,455	0.06
USD 217,000	Broadcom 4% 15/4/2029	196,050	0.02	GBP 200,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	215,254	0.02
USD 540,000	Broadcom 4.11% 15/9/2028	502,740	0.05	USD 2,930,000	Citigroup 2.52% 3/11/2032	2,299,703	0.22
USD 3,283,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	2,949,063	0.27	USD 1,055,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	863,018	0.08
USD 125,000	Broadcom 4.15% 15/4/2032	109,661	0.01	USD 210,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	174,206	0.02
USD 127,000	Burlington Northern Santa Fe 4.45% 15/1/2053	111,981	0.01	USD 2,098,000	Citigroup 2.976% 5/11/2030	1,777,393	0.17
USD 440,000	BXP Trust 2017-GM 3.379% 13/6/2039	398,234	0.04				
USD 1,220,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	1,025,660	0.09				
USD 730,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	595,084	0.06				
USD 1,436,000	Cameron LNG 2.902% 15/7/2031	1,243,705	0.12				
USD 1,968,000	Cameron LNG 3.302% 15/1/2035	1,630,531	0.15				
USD 280,000	Cameron LNG 3.402% 15/1/2038	233,593	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 386,000	Citigroup 3.057% 25/1/2033	315,319	0.03	USD 802,000	Crown Castle 4.3% 15/2/2029	752,337	0.07
USD 995,000	Citigroup 3.785% 17/3/2033	860,822	0.08	USD 351,000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 3.558% 15/11/2048	292,355	0.03
USD 2,594,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	2,361,103	0.22	USD 220,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 3.458% 15/11/2050	199,655	0.02
USD 169,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	156,760	0.01	USD 885,000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 4.916% 15/11/2051	822,706	0.08
USD 514,000	Citigroup 4.91% 24/5/2033	485,247	0.05	USD 727,000	CSX 4.1% 15/11/2032	667,978	0.06
USD 429,000	Citigroup 6.27% 17/11/2033	447,777	0.04	USD 146,000	CVS Health 5.125% 20/7/2045	131,076	0.01
USD 387,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014- GC19 4.023% 11/3/2047	379,933	0.04	USD 319,706	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-25 4.757% 25/6/2037	294,848	0.03
USD 204,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3.176% 10/8/2049	181,512	0.02	USD 700,000	DBUBS 2017-BRKB Mortgage Trust 3.53% 10/10/2034	632,630	0.06
USD 807,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-B2 4.28% 10/3/2051	728,733	0.07	EUR 247,000	Discovery Communications 1.9% 19/3/2027	237,835	0.02
USD 915,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5 4.408% 10/6/2051	860,584	0.08	USD 84,000	Duke Energy Progress 3.45% 15/3/2029	76,464	0.01
USD 231,530	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-FX1 5.775% 25/10/2036	152,879	0.01	USD 491,000	DuPont de Nemours 4.725% 15/11/2028	481,254	0.04
USD 498,127	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 6% 25/5/2037	452,000	0.04	USD 161,000	Ecolab 2.7% 15/12/2051	101,228	0.01
USD 712,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	619,513	0.06	USD 453,000	Edison International 6.95% 15/11/2029	474,852	0.04
USD 1,335,000	Comcast 1.5% 15/2/2031	1,027,601	0.10	USD 252,000	Elevance Health 3.6% 15/3/2051	186,388	0.02
USD 1,256,000	Comcast 1.95% 15/1/2031	1,003,465	0.09	EUR 310,000	Eli Lilly 1.375% 14/9/2061	162,357	0.02
USD 1,277,000	Comcast 2.65% 1/2/2030	1,096,833	0.10	EUR 200,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025	198,822	0.02
USD 276,000	Comcast 3.4% 15/7/2046	202,013	0.02	USD 864,000	Entergy Louisiana 2.35% 15/6/2032	682,216	0.06
USD 189,000	Comcast 3.969% 1/11/2047	151,187	0.01	USD 1,150,000	Entergy Louisiana 4% 15/3/2033	1,031,940	0.10
USD 2,072,000	Comcast 4.15% 15/10/2028	1,977,384	0.19	USD 817,000	Equinix 3.2% 18/11/2029	710,962	0.07
USD 606,000	Comcast 4.25% 15/10/2030	573,569	0.05	USD 2,024,000	Equinix 3.9% 15/4/2032	1,780,458	0.17
USD 1,536,000	Comcast 4.25% 15/1/2033	1,430,096	0.13	USD 1,100,000	Exelon 4.7% 15/4/2050	949,971	0.09
USD 261,000	Comcast 5.5% 15/11/2032	267,588	0.02	USD 659,439	Fannie Mae Pool 1.5% 1/11/2041	531,299	0.05
USD 1,837,717	COMM 2015-CCRE27 Mortgage Trust 4.338% 10/10/2048	1,685,889	0.16	USD 1,496,115	Fannie Mae Pool 1.5% 1/12/2041	1,205,390	0.11
USD 635,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3.829% 10/2/2048	596,201	0.06	USD 207,394	Fannie Mae Pool 1.5% 1/11/2050	160,241	0.01
EUR 200,000	Coty 3.875% 15/4/2026	202,071	0.02	USD 277,247	Fannie Mae Pool 1.5% 1/3/2051	214,063	0.02
USD 170,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	143,793	0.01	USD 262,465	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	238,174	0.02
USD 148,000	Crown Castle 3.1% 15/11/2029	128,180	0.01	USD 144,222	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	128,327	0.01
USD 1,311,000	Crown Castle 3.3% 1/7/2030	1,139,949	0.11				

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 923,454	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2042	780,484	0.07	USD 69,862	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	56,875	0.01
USD 118,046	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2042	99,261	0.01	USD 136,644	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	112,377	0.01
USD 177,966	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	145,325	0.01	USD 312,984	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	257,149	0.02
USD 320,424	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	262,148	0.02	USD 698,487	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	572,752	0.05
USD 96,447	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	79,459	0.01	USD 163,541	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	134,365	0.01
USD 307,644	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	252,125	0.02	USD 296,676	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	243,271	0.02
USD 256,101	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2051	208,716	0.02	USD 543,192	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	443,881	0.04
USD 200,569	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	164,351	0.02	USD 206,575	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	169,722	0.02
USD 113,132	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	93,194	0.01	USD 593,980	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2031	549,465	0.05
USD 102,909	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	85,027	0.01	USD 246,303	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	212,306	0.02
USD 151,964	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	124,523	0.01	USD 376,261	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	322,620	0.03
USD 179,479	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	147,850	0.01	USD 370,687	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	317,841	0.03
USD 59,710	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	49,197	0.00	USD 378,144	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	324,234	0.03
USD 766,777	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	624,183	0.06	USD 495,131	Fannie Mae Pool 2.5% 1/8/2050	424,542	0.04
USD 361,122	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	296,265	0.03	USD 404,116	Fannie Mae Pool 2.5% 1/8/2050	346,503	0.03
USD 115,934	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	95,414	0.01	USD 126,051	Fannie Mae Pool 2.5% 1/8/2050	108,080	0.01
USD 93,776	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	77,129	0.01	USD 284,195	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2050	245,014	0.02
USD 208,391	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	171,255	0.02	USD 69,984	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2051	60,005	0.01
USD 326,074	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	265,627	0.02	USD 716,934	Fannie Mae Pool 2.5% 1/10/2051	617,759	0.06
USD 69,607	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	56,650	0.01	USD 187,815	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2051	161,551	0.01
USD 129,879	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	106,516	0.01	USD 677,030	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2051	582,910	0.05
USD 57,832	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	48,079	0.00	USD 621,205	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	534,120	0.05
USD 416,213	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	338,781	0.03	USD 2,953,386	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	2,510,134	0.23
USD 192,674	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	158,274	0.01	USD 157,183	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	134,619	0.01
USD 290,779	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	237,332	0.02	USD 111,031	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	94,990	0.01
USD 290,086	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	237,006	0.02	USD 398,141	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	339,939	0.03
USD 265,467	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	218,159	0.02	USD 471,265	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	402,084	0.04
USD 270,287	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	222,026	0.02	USD 77,899	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	66,971	0.01
USD 230,023	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	188,991	0.02	USD 38,227	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	35,906	0.00
USD 363,316	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	299,530	0.03	USD 222,344	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	209,932	0.02

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 208,286	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2029	196,683	0.02	USD 255,931	Fannie Mae-Aces 3.547% 25/9/2028	244,146	0.02
USD 100,784	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2030	95,032	0.01	USD 847,893	FBR Securitization Trust 5.322% 25/11/2035	825,745	0.08
USD 50,090	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2030	47,294	0.00	USD 2,423,000	Federal Home Loan Mortgage 6.25% 15/7/2032	2,787,249	0.26
USD 2,285,210	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2047	2,086,668	0.19	EUR 520,000	FedEx 0.45% 4/5/2029	438,311	0.04
USD 418,947	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2050	372,732	0.03	USD 8,000	FedEx 4.1% 15/4/2043	6,283	0.00
USD 409,609	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	361,869	0.03	EUR 510,000	Fidelity National Information Services 0.75% 21/5/2023	539,728	0.05
USD 182,967	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2051	162,180	0.01	EUR 360,000	Fidelity National Information Services 2.95% 21/5/2039	304,830	0.03
USD 699,291	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	619,741	0.06	USD 492,000	FirstEnergy Transmission 4.55% 1/4/2049	406,473	0.04
USD 61,209	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2052	54,393	0.00	USD 2,000	FirstEnergy Transmission 5.45% 15/7/2044	1,871	0.00
USD 95,965	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2052	84,963	0.01	EUR 500,000	Fiserv 1.625% 1/7/2030	443,703	0.04
USD 266,430	Fannie Mae Pool 3.5% 1/10/2030	255,655	0.02	USD 955,000	Florida Power & Light 3.15% 1/10/2049	669,168	0.06
USD 6,489	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2032	6,227	0.00	USD 155,000	Florida Power & Light 3.99% 1/3/2049	127,539	0.01
USD 298,689	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2047	275,852	0.03	USD 456,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	427,939	0.04
USD 300,354	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2047	277,795	0.03	GBP 100,000	Ford Motor Credit 4.535% 6/3/2025	116,850	0.01
USD 180,496	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	166,763	0.02	USD 532,310	Freddie Mac Gold Pool 2.5% 1/12/2027	506,537	0.05
USD 138,022	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2048	127,410	0.01	USD 569,209	Freddie Mac Gold Pool 3.5% 1/12/2044	531,340	0.05
USD 14,082	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	13,792	0.00	USD 406,322	Freddie Mac Gold Pool 3.5% 1/1/2045	379,878	0.04
USD 41,676	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2033	40,847	0.00	USD 365,461	Freddie Mac Gold Pool 3.5% 1/6/2045	341,176	0.03
USD 126,878	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2045	121,766	0.01	USD 1,048,603	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/8/2044	1,013,830	0.09
USD 150,904	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	144,572	0.01	USD 524,707	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2045	509,685	0.05
USD 38,262	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	36,273	0.00	USD 307,534	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2045	297,555	0.03
USD 94,840	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2042	93,864	0.01	USD 204,602	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/9/2039	202,411	0.02
USD 33,700	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2043	33,353	0.00	USD 77,286	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/2/2040	76,149	0.01
USD 83,487	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2045	82,117	0.01	USD 44,552	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/10/2036	44,470	0.00
USD 74,775	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2052	71,851	0.01	USD 556	Freddie Mac Gold Pool 6.5% 1/8/2032	575	0.00
USD 1,176,224	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2035	1,182,492	0.11	USD 91,464	Freddie Mac Pool 1.5% 1/8/2050	70,670	0.01
USD 5,749	Fannie Mae Pool 5.5% 1/2/2035	5,896	0.00	USD 228,596	Freddie Mac Pool 1.5% 1/10/2050	176,622	0.02
USD 414,988	Fannie Mae Pool 5.5% 1/8/2037	423,235	0.04	USD 109,185	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2036	97,156	0.01
USD 287,959	Fannie Mae Pool 5.5% 1/8/2037	294,029	0.03				
USD 381,951	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2041	395,586	0.04				

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 130,743	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2042	109,939	0.01	USD 93,781	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	83,775	0.01
USD 61,358	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	50,285	0.00	USD 120,053	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	106,442	0.01
USD 94,922	Freddie Mac Pool 2% 1/11/2050	78,202	0.01	USD 69,232	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	61,799	0.01
USD 568,910	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2051	463,592	0.04	USD 677,423	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2052	600,416	0.06
USD 291,827	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2051	241,122	0.02	USD 82,910	Freddie Mac Pool 3.5% 1/1/2034	79,114	0.01
USD 170,103	Freddie Mac Pool 2% 1/5/2051	140,126	0.01	USD 2,257,889	Freddie Mac Pool 3.5% 1/9/2046	2,109,528	0.20
USD 785,392	Freddie Mac Pool 2% 1/7/2051	650,870	0.06	USD 180,914	Freddie Mac Pool 3.5% 1/1/2048	166,544	0.02
USD 48,903	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	40,009	0.00	USD 577,552	Freddie Mac Pool 4% 1/1/2045	553,997	0.05
USD 227,751	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	186,057	0.02	USD 10,314	Freddie Mac Pool 4% 1/7/2048	9,824	0.00
USD 46,605	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	37,934	0.00	USD 70,364	Freddie Mac Pool 4.5% 1/7/2052	67,623	0.01
USD 617,862	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	502,769	0.05	USD 444,489	Freddie Mac Pool 4.5% 1/7/2052	427,664	0.04
USD 76,194	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	62,467	0.01	USD 136,842	Freddie Mac Pool 4.5% 1/8/2052	131,482	0.01
USD 164,372	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	134,805	0.01	USD 40,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	38,058	0.00
USD 202,642	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	166,531	0.02	USD 1,265,000	FREMF 2018-K72 Mortgage Trust 3.994% 25/12/2050	1,176,143	0.11
USD 31,433	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	25,897	0.00	USD 875,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.144% 17/8/2037	875,466	0.08
USD 481,593	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	395,850	0.04	USD 288,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	282,573	0.03
USD 354,891	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	292,585	0.03	EUR 2,707,000	General Electric 1.875% 28/5/2027	2,634,811	0.25
USD 1,493,135	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	1,231,510	0.11	EUR 130,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	125,522	0.01
USD 263,851	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	216,780	0.02	USD 839,000	General Motors 5% 1/10/2028*	811,385	0.08
USD 87,507	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2052	71,183	0.01	USD 431,000	General Motors 5.4% 15/10/2029	413,466	0.04
USD 69,720	Freddie Mac Pool 2.5% 1/7/2050	59,666	0.01	EUR 131,000	General Motors Financial 0.6% 20/5/2027	117,880	0.01
USD 585,033	Freddie Mac Pool 2.5% 1/2/2051	504,349	0.05	EUR 100,000	General Motors Financial 0.85% 26/2/2026	95,896	0.01
USD 338,737	Freddie Mac Pool 2.5% 1/5/2051	294,434	0.03	USD 375,000	Gilead Sciences 4.75% 1/3/2046	337,026	0.03
USD 502,690	Freddie Mac Pool 2.5% 1/5/2051	431,626	0.04	USD 908	Ginnie Mae I Pool 6.5% 15/4/2031	930	0.00
USD 328,506	Freddie Mac Pool 2.5% 1/11/2051	281,321	0.03	USD 3,487	Ginnie Mae I Pool 6.5% 15/7/2031	3,580	0.00
USD 242,574	Freddie Mac Pool 2.5% 1/12/2051	207,359	0.02	USD 1,073,050	Ginnie Mae II Pool 2% 20/8/2050	904,439	0.08
USD 701,466	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	624,913	0.06	USD 135,841	Ginnie Mae II Pool 2% 20/11/2050	114,246	0.01
USD 143,707	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	127,348	0.01				
USD 372,431	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2050	335,638	0.03				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 616,170	Ginnie Mae II Pool 2% 20/1/2051	517,966	0.05	GBP 100,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028*	130,646	0.01
USD 283,131	Ginnie Mae II Pool 2% 20/2/2051	237,239	0.02		GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	346,406	0.03
USD 404,375	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/4/2051	350,879	0.03	USD 437,093	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-3 4.95% 20/7/2049	1,535,316	0.14
USD 1,092,658	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/10/2051	944,695	0.09	USD 1,260,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.515% 3/5/2032	1,221,176	0.11
USD 2,071,699	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/12/2051	1,790,550	0.17	USD 1,564,363	GS Mortgage Trust 2015-GC34 4.466% 10/10/2048	1,430,509	0.13
USD 310,640	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/7/2052	268,414	0.02	USD 1,162,000	GS Mortgage Trust 2016-GS2 3.759% 10/5/2049	1,032,411	0.10
USD 699,187	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2044	640,051	0.06	USD 788,429	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP1 3.672% 25/1/2035	687,344	0.06
USD 99,695	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2050	89,611	0.01	USD 562,005	GSMPS Mortgage Loan Trust 2005-RP3 3.704% 25/9/2035	513,657	0.05
USD 125,103	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2050	112,471	0.01	USD 327,000	Hasbro 3.9% 19/11/2029	287,066	0.03
USD 577,604	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	515,053	0.05	USD 123,000	HCA 2.375% 15/7/2031	95,517	0.01
USD 182,373	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2051	163,180	0.02	USD 405,000	HCA 3.5% 1/9/2030	346,682	0.03
USD 112,665	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2052	100,667	0.01	USD 1,616,000	HCA 3.625% 15/3/2032	1,361,536	0.13
USD 1,044,777	Ginnie Mae II Pool 3.5% 20/11/2046	972,502	0.09	USD 173,000	Hewlett Packard Enterprise 6.35% 15/10/2045	169,209	0.02
USD 755,785	Ginnie Mae II Pool 4% 20/6/2047	724,712	0.07	USD 206,000	Home Depot 2.7% 15/4/2030	177,799	0.02
USD 635,456	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/5/2041	632,674	0.06	USD 700,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982% 5/3/2037	618,136	0.06
USD 47,574	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/9/2048	46,591	0.00	USD 254,000	HP 4% 15/4/2029	230,448	0.02
USD 18,692	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/4/2050	18,292	0.00	USD 281,000	HP 4.2% 15/4/2032	240,915	0.02
USD 259,258	Ginnie Mae II Pool 5% 20/7/2040	259,822	0.02	USD 2,044,582	HSI Asset Securitization Trust 2007-NC1 4.757% 25/4/2037	1,430,181	0.13
USD 140,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	122,739	0.01	USD 1,534,500	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.763% 10/7/2035	1,440,998	0.13
USD 392,000	Global Payments 4.95% 15/8/2027	379,056	0.04	USD 610,526	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 4.857% 25/7/2036	556,094	0.05
USD 528,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	404,537	0.04	USD 945,000	Intel 4.875% 10/2/2028	930,831	0.09
USD 1,396,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032	1,091,516	0.10	USD 900,000	Intel 5.2% 10/2/2033	879,336	0.08
USD 3,233,000	Goldman Sachs 2.6% 7/2/2030	2,715,527	0.25	USD 172,000	International Business Machines 2.95% 15/5/2050	110,728	0.01
USD 1,721,000	Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	1,376,828	0.13	USD 4,975,079	IXIS Real Estate Capital Trust 2006-HE2 5.137% 25/8/2036	1,411,510	0.13
USD 160,000	Goldman Sachs 2.65% 21/10/2032	126,884	0.01				
USD 1,936,000	Goldman Sachs 3.102% 24/2/2033	1,588,865	0.15				
USD 2,443,000	Goldman Sachs 3.8% 15/3/2030	2,214,553	0.21				
EUR 4,620,000	Goldman Sachs 4% 21/9/2029*	4,766,952	0.44				
USD 1,689,000	Goldman Sachs 4.223% 1/5/2029	1,577,654	0.15				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 690,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.725% 15/1/2049	632,091	0.06	USD 1,016,619	Mastr Asset Backed Trust 2004-OPT2 5.317% 25/9/2034	864,046	0.08
USD 552,486	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 3.655% 25/5/2047	461,035	0.04	USD 312,324	Mastr Asset Backed Trust 2005-WF1 6.342% 25/6/2035	307,552	0.03
USD 982,787	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4 3.713% 25/10/2048	804,699	0.07	USD 883,235	Mastr Asset Backed Trust 2005-WF1 6.477% 25/6/2035	864,414	0.08
USD 845,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4.236% 17/3/2049	707,573	0.07	USD 398,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	400,360	0.04
USD 1,000,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3.144% 15/6/2049	929,477	0.09	USD 85,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	70,419	0.01
EUR 1,980,000	JPMorgan Chase 0.625% 25/1/2024	2,052,682	0.19	EUR 100,000	Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 9/4/2024	102,364	0.01
GBP 200,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	221,126	0.02	USD 853,000	MF1 2022-FL10 7.199% 17/9/2037	853,000	0.08
EUR 400,000	JPMorgan Chase 1.638% 18/5/2028	381,032	0.04	USD 332,000	Moody's 3.1% 29/11/2061	204,718	0.02
USD 480,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	368,400	0.03	USD 491,000	Moody's 3.75% 25/2/2052	372,869	0.04
USD 1,420,000	JPMorgan Chase 1.953% 4/2/2032	1,097,889	0.10	USD 2,356,000	Morgan Stanley 2.239% 21/7/2032	1,826,797	0.17
USD 435,000	JPMorgan Chase 2.522% 22/4/2031	358,320	0.03	USD 946,000	Morgan Stanley 2.511% 20/10/2032	746,338	0.06
USD 139,000	JPMorgan Chase 2.545% 8/11/2032	110,633	0.01	USD 833,000	Morgan Stanley 2.943% 21/1/2033	678,130	0.06
USD 2,641,000	JPMorgan Chase 2.963% 25/1/2033	2,172,578	0.20	USD 167,000	Morgan Stanley 3.622% 1/4/2031	147,404	0.01
USD 580,000	JPMorgan Chase 3.702% 6/5/2030	521,732	0.05	USD 1,100,000	Morgan Stanley 4.431% 23/1/2030	1,032,327	0.10
USD 2,559,000	JPMorgan Chase 4.565% 14/6/2030*	2,421,532	0.22	USD 3,307,000	Morgan Stanley 4.889% 20/7/2033	3,125,556	0.29
USD 2,774,000	JPMorgan Chase 4.586% 26/4/2033	2,577,680	0.24	USD 915,000	Morgan Stanley 6.342% 18/10/2033	962,415	0.09
USD 897,000	JPMorgan Chase 4.912% 25/7/2033	854,072	0.08	USD 555,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3.994% 15/12/2049	514,624	0.05
USD 96,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	88,317	0.01	USD 1,000,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 3.89% 15/12/2050	915,344	0.08
USD 651,000	KLA 5.25% 15/7/2062*	617,245	0.06	USD 852,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 3.912% 9/9/2032	751,513	0.07
GBP 100,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	116,236	0.01	USD 1,449,748	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 4.62% 15/7/2051	1,324,541	0.12
USD 97,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	66,892	0.01	USD 289,971	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 4.719% 15/10/2051	264,412	0.02
USD 147,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	109,754	0.01	USD 634,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.276% 11/7/2040	557,144	0.05
EUR 100,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	99,573	0.01				
USD 124,000	Lowe's 5.125% 15/4/2050	112,185	0.01				
EUR 100,000	Marsh & McLennan 1.979% 21/3/2030	91,184	0.01				
USD 216,000	Marsh & McLennan 6.25% 1/11/2052	237,833	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 129,755	Mosaic Solar Loan Trust 2020-1 3.1% 20/4/2046	110,603	0.01	USD 551,000	Oncor Electric Delivery 4.55% 15/9/2032	531,674	0.05
USD 344,684	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 1.44% 20/8/2046	286,310	0.03	USD 1,162,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	1,061,325	0.10
USD 209,071	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 2.21% 20/8/2046	170,054	0.02	USD 721,755	OneMain Financial Issuance Trust 2020-A 3.84% 14/5/2032	717,538	0.07
USD 231,883	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	216,087	0.02	USD 150,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	122,994	0.01
USD 1,039,000	MPLX 4% 15/3/2028 Navient Private	971,168	0.09	USD 170,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.47% 16/6/2036	132,363	0.01
USD 714,562	Education Refi Loan Trust 2020-C 6.188% 15/11/2068	716,638	0.07	USD 132,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	117,850	0.01
USD 626,909	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 5.337% 25/10/2035	609,079	0.06	USD 2,149,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	1,775,376	0.16
USD 140,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	101,065	0.01	USD 4,429,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	3,772,328	0.35
GBP 150,000	New York Life Global Funding 4.35% 16/9/2025	179,403	0.02	EUR 400,000	Oracle 3.125% 10/7/2025*	419,641	0.04
USD 936,112	Newcastle Mortgage Trust 2007-1 4.847% 25/4/2037	918,368	0.08	USD 2,042,000	Oracle 4.3% 8/7/2034	1,789,726	0.17
USD 2,611,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	2,206,370	0.21	USD 169,000	Oracle 6.15% 9/11/2029	174,579	0.02
USD 3,678,000	NextEra Energy Capital 2.25% 1/6/2030	2,966,674	0.28	USD 2,538,000	Oracle 6.25% 9/11/2032	2,629,623	0.24
USD 352,000	NextEra Energy Capital 2.75% 1/11/2029	299,583	0.03	EUR 100,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2.875% 30/4/2028	91,332	0.01
USD 700,000	NextEra Energy Capital 5.05% 28/2/2033	673,407	0.06	USD 500,000	Otis Worldwide 2.565% 15/2/2030	420,541	0.04
USD 656,000	Norfolk Southern 3% 15/3/2032	551,168	0.05	USD 412,000	Paramount Global 4.2% 19/5/2032	339,029	0.03
USD 542,000	NVIDIA 2% 15/6/2031*	435,536	0.04	USD 204,000	PECO Energy 2.85% 15/9/2051	133,497	0.01
USD 1,010,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3.566% 10/5/2039	911,640	0.08	USD 490,000	PECO Energy 4.375% 15/8/2052	427,619	0.04
USD 690,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3.945% 10/5/2039	530,654	0.05	USD 132,000	PECO Energy 4.6% 15/5/2052	119,165	0.01
EUR 100,000	Olympus Water US 3.875% 1/10/2028	91,443	0.01	USD 31,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	29,659	0.00
USD 684,000	Oncor Electric Delivery 3.1% 15/9/2049	476,026	0.04	USD 200,000	Periana 5.95% 19/4/2026	188,698	0.02
USD 37,000	Oncor Electric Delivery 3.8% 30/9/2047	29,939	0.00	EUR 915,000	PPG Industries 1.4% 13/3/2027	880,212	0.08
USD 949,000	Oncor Electric Delivery 4.15% 1/6/2032	889,727	0.08	EUR 400,000	Prologis Euro Finance 0.25% 10/9/2027	356,232	0.03
				EUR 280,000	Prologis Euro Finance 0.625% 10/9/2031	218,747	0.02
				EUR 300,000	Prologis Euro Finance 1.5% 8/2/2034	238,558	0.02
				USD 9,000	Public Service Electric and Gas 3.6% 1/12/2047	6,931	0.00
				USD 490,000	Public Service Electric and Gas 4.9% 15/12/2032	486,066	0.05
				USD 1,373,000	QUALCOMM 2.15% 20/5/2030	1,148,015	0.11

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 640,000	QUALCOMM 4.5% 20/5/2052	563,102	0.05	USD 2,005,804	SMB Private Education Loan Trust 2021-A	1,963,462	0.18
USD 148,000	QUALCOMM 6% 20/5/2053	158,309	0.01		5.318% 15/1/2053		
USD 554,815	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9	556,563	0.05	USD 2,065,425	SMB Private Education Loan Trust 2022-B	2,062,146	0.19
	7.072% 25/6/2037				5.851% 16/2/2055		
USD 232,413	Renaissance Home Equity Loan Trust	228,019	0.02	USD 1,627,766	SMB Private Education Loan Trust 2022-C	1,567,092	0.15
	2005-3 5.14%				4.48% 16/5/2050		
	25/11/2035			USD 525,321	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84%	505,425	0.05
USD 313,000	Republic Services	246,547	0.02		25/1/2041		
	2.375% 15/3/2033			USD 314,000	Southern California Edison 2.5% 1/6/2031	256,952	0.02
USD 19,000	RPM International	16,395	0.00		Southern California Edison 2.75% 1/2/2032	979,417	0.09
USD 1,250,000	RR 1 6.392% 15/7/2035	1,230,974	0.11	USD 1,188,000	Southern California Edison 5.95% 1/11/2032	2,228,656	0.21
USD 173,000	S&P Global 3.9%	134,619	0.01		State Street 2.623%	289,030	0.03
	1/3/2062			USD 355,000	7/2/2033		
USD 617,000	Salesforce 1.95%	492,519	0.05	USD 235,000	Tenet Healthcare	222,996	0.02
	15/7/2031				6.125% 15/6/2030		
USD 2,425,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2,651,061	0.24	USD 475,000	Thermo Fisher	410,309	0.04
	Sesac Finance 5.216%				Scientific 2.6%		
USD 501,800	25/7/2049	467,333	0.04	USD 136,000	1/10/2029	129,458	0.01
USD 168,000	Sherwin-Williams 2.9%	102,564	0.01	USD 185,000	Time Warner Cable	122,845	0.01
EUR 100,000	Silgan 2.25% 1/6/2028	90,553	0.01		6.55% 1/5/2037		
	SLM Private Credit			USD 973,000	T-Mobile USA 3.3%	880,071	0.08
USD 491,680	Student Loan Trust	478,504	0.04		15/2/2051		
	2004-A 5.169%			USD 675,000	T-Mobile USA 3.875%	646,773	0.06
	15/6/2033				15/4/2030		
USD 1,684,694	SLM Private Credit	1,611,005	0.15	USD 83,000	T-Mobile USA 5.05%	77,918	0.01
	Student Loan Trust				15/7/2033		
	2005-B 5.099%			USD 1,390,100	Transcontinental Gas Pipe Line 4% 15/3/2028	1,280,297	0.12
	15/6/2039				2019-SFR1 Trust 2.75%		
USD 2,062,559	SLM Private Credit	1,944,292	0.18	USD 276,000	17/3/2038	171,521	0.02
	Student Loan Trust			USD 186,000	Union Pacific 2.973%	134,333	0.01
	2006-A 5.059%				16/9/2062		
	15/6/2039			USD 305,000	Union Pacific 3.799%	230,671	0.02
USD 424,977	SLM Private Credit	397,786	0.04		6/4/2071		
	Student Loan Trust			USD 260,000	Union Pacific 3.839%	247,241	0.02
	2006-B 4.969%				20/3/2060		
	15/12/2039			USD 99,370	Union Pacific 5.15%	88,407	0.01
USD 1,128,226	SLM Private Education	1,211,084	0.11		20/1/2063		
	Loan Trust 2010-C			USD 606,835	United Airlines 2016-1	544,104	0.05
	9.338% 15/10/2041				Class AA Pass Through		
USD 680,000	SMB Private Education	641,415	0.06	USD 914,039	Trust 3.1% 7/1/2030	777,751	0.07
	Loan Trust 2015-C 3.5%				United Airlines 2018-1		
	15/9/2043			USD 4,800	Class AA Pass Through	5,130	0.00
USD 885,000	SMB Private Education	745,307	0.07		Trust 3.5% 1/9/2031		
	Loan Trust 2020-A 3%				United Airlines 2019-2		
	15/8/2045				Class A Pass Through		
USD 1,595,000	SMB Private Education	1,258,893	0.12		Trust 2.9% 1/11/2029		
	Loan Trust 2020-PT-A				United States Treasury		
	2.5% 15/9/2054				Inflation Indexed		
USD 1,090,000	SMB Private Education	861,556	0.08		Bonds 0.125% 15/4/2026		
	Loan Trust 2020-PTB						
	2.5% 15/9/2054						

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
AUD	1,660,000	USD	1,120,415	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(332)
BRL	8,720,000	USD	1,633,298	Barclays	15/3/2023	35,228
BRL	48,066,893	USD	8,871,550	BNP Paribas	15/3/2023	325,801
BRL	21,159,922	USD	4,041,015	BNY Mellon	15/3/2023	7,826
BRL	14,320,000	USD	2,776,867	Goldman Sachs	15/3/2023	(36,810)
CAD	5,965,000	EUR	4,097,285	State Street	2/3/2023	30,130
CAD	5,965,000	EUR	4,142,128	Nomura	4/4/2023	(25,287)
CHF	615,254	USD	670,000	State Street	15/3/2023	(11,255)
CNH	27,865,887	USD	4,015,605	Barclays	15/3/2023	(2,565)
CNH	1,125,000	USD	162,092	UBS	15/3/2023	(77)
CNH	1,125,000	USD	162,030	JP Morgan	15/3/2023	(16)
CNH	1,125,000	USD	162,264	Morgan Stanley	15/3/2023	(250)
CNH	1,125,000	USD	162,586	Bank of America	15/3/2023	(572)
CNH	7,500,000	USD	1,093,709	Deutsche Bank	15/3/2023	(13,614)
CNH	3,760,000	USD	555,966	Nomura	15/3/2023	(14,479)
CZK	64,485,000	USD	2,917,640	Barclays	15/3/2023	(1,463)
CZK	9,295,643	USD	416,287	Goldman Sachs	2/3/2023	4,434
EUR	10,695,000	USD	11,493,756	Bank of America	15/3/2023	(107,995)
EUR	5,440,000	USD	5,826,319	Goldman Sachs	15/3/2023	(34,966)
EUR	2,070,000	USD	2,222,678	Citigroup	15/3/2023	(18,982)
EUR	5,260,000	USD	5,674,909	Deutsche Bank	15/3/2023	(75,181)
EUR	3,959,689	USD	4,295,120	HSBC Bank	15/3/2023	(79,687)
EUR	19,150,000	JPY	2,788,125,100	State Street	15/3/2023	(65,215)
EUR	9,527,000	USD	10,247,407	State Street	15/3/2023	(105,085)
EUR	3,150,000	USD	3,383,049	JP Morgan	15/3/2023	(29,600)
EUR	861,591	NOK	9,145,000	Bank of America	15/3/2023	30,586
EUR	785,665	NOK	8,340,000	Barclays	15/3/2023	27,805
EUR	886,265	NOK	9,415,000	BNP Paribas	15/3/2023	30,675
EUR	1,300,000	GBP	1,147,736	State Street	15/3/2023	(9,621)
EUR	2,080,311	USD	2,253,724	Barclays	15/3/2023	(39,052)
EUR	12,130,000	USD	13,198,802	BNP Paribas	15/3/2023	(285,358)
EUR	1,020,000	USD	1,107,224	Toronto-Dominion	15/3/2023	(21,346)
EUR	2,530,000	USD	2,769,391	Morgan Stanley	15/3/2023	(75,985)
EUR	720,309	AUD	1,110,000	Standard Chartered Bank	2/3/2023	17,603
EUR	1,730,000	USD	1,881,997	Morgan Stanley	2/3/2023	(41,788)
EUR	128,898	HUF	50,000,000	JP Morgan	16/3/2023	(3,052)
EUR	1,520,000	USD	1,613,696	Standard Chartered Bank	2/3/2023	3,135
EUR	704,200	AUD	1,110,000	Goldman Sachs	4/4/2023	1,079
GBP	13,080,133	EUR	14,970,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(54,940)
GBP	1,154,430	EUR	1,300,000	State Street	15/3/2023	17,748
GBP	4,100,000	EUR	4,653,713	Royal Bank of Canada	2/3/2023	26,813
GBP	1,000,572	USD	1,207,242	Barclays	15/3/2023	7,655
GBP	1,619,428	USD	1,955,149	JP Morgan	15/3/2023	11,164
GBP	1,680,000	USD	2,033,994	Morgan Stanley	15/3/2023	5,866
GBP	1,860,000	USD	2,253,148	Goldman Sachs	15/3/2023	5,268
GBP	4,100,000	EUR	4,649,467	Standard Chartered Bank	4/4/2023	24,179
HUF	50,000,000	EUR	126,369	JP Morgan	16/3/2023	5,744
IDR	12,920,000,000	USD	829,009	JP Morgan	15/3/2023	17,959
IDR	22,180,000,000	USD	1,420,432	BNP Paribas	15/3/2023	33,573
IDR	8,415,000,000	USD	539,838	UBS	15/3/2023	11,805
IDR	8,415,000,000	USD	539,838	Citibank	15/3/2023	11,805
IDR	10,085,000,000	USD	665,457	Citibank	17/4/2023	(4,776)
IDR	33,988,225,000	USD	2,259,915	BNY Mellon	15/3/2023	(31,825)
IDR	4,987,462,737	USD	327,821	Citigroup	15/3/2023	(869)
INR	291,050,000	USD	3,505,696	Barclays	15/3/2023	12,115
INR	53,140,000	USD	651,146	Citibank	17/4/2023	(10,232)
JPY	548,820,000	USD	4,188,250	JP Morgan	15/3/2023	(162,425)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	6,309,030,000	USD	46,564,168	UBS	15/3/2023	(284,804)
JPY	601,077,592	USD	4,674,880	Deutsche Bank	15/3/2023	(265,725)
JPY	194,130,000	USD	1,484,741	HSBC Bank	15/3/2023	(60,717)
JPY	57,345,444	USD	441,158	Standard Chartered Bank	15/3/2023	(20,505)
JPY	112,000,000	USD	855,406	BNP Paribas	15/3/2023	(33,839)
JPY	639,323,561	USD	4,920,652	Morgan Stanley	15/3/2023	(230,947)
JPY	22,780,000	USD	174,535	State Street	15/3/2023	(7,434)
JPY	68,750,000	USD	525,835	Bank of America	15/3/2023	(21,526)
JPY	498,000,000	USD	3,853,784	Goldman Sachs	15/3/2023	(200,747)
JPY	96,120,000	USD	737,593	Citibank	15/3/2023	(32,513)
JPY	193,860,000	USD	1,494,022	Citigroup	15/3/2023	(71,978)
JPY	36,093,684	NZD	430,000	Deutsche Bank	15/3/2023	(984)
KRW	1,425,000,000	USD	1,120,089	BNP Paribas	15/3/2023	(41,170)
KRW	715,000,000	USD	576,195	Barclays	15/3/2023	(34,842)
MXN	275,016,000	USD	13,881,021	JP Morgan	15/3/2023	1,087,572
MXN	157,835,000	USD	7,848,154	Barclays	15/3/2023	742,503
MXN	52,200,000	USD	2,750,459	Morgan Stanley	15/3/2023	90,687
MXN	11,544,785	USD	625,290	BNY Mellon	15/3/2023	3,071
MXN	11,971,830	USD	647,249	UBS	2/3/2023	6,057
MYR	2,400,000	USD	557,491	Goldman Sachs	15/3/2023	(22,221)
NOK	5,800,000	EUR	557,541	RBS	15/3/2023	(31,212)
NOK	19,788,346	USD	2,040,106	Bank of America	15/3/2023	(121,527)
NOK	12,195,000	EUR	1,154,149	Bank of America	15/3/2023	(46,326)
NOK	9,495,000	EUR	905,076	Barclays	15/3/2023	(42,945)
NOK	2,110,000	EUR	200,981	Morgan Stanley	15/3/2023	(9,387)
NOK	25,130,000	USD	2,531,188	JP Morgan	15/3/2023	(94,708)
NOK	31,470,000	USD	3,177,250	Deutsche Bank	15/3/2023	(126,076)
NOK	2,430,000	USD	245,172	Goldman Sachs	15/3/2023	(9,572)
NZD	430,000	JPY	35,897,389	Deutsche Bank	15/3/2023	2,424
SEK	44,971,346	USD	4,340,905	JP Morgan	15/3/2023	(21,431)
SEK	7,010,000	USD	672,678	Deutsche Bank	15/3/2023	630
SEK	5,200,000	USD	500,424	Bank of America	15/3/2023	(967)
SGD	1,870,000	USD	1,380,542	BNP Paribas	15/3/2023	7,950
SGD	1,870,000	USD	1,378,141	Bank of America	15/3/2023	10,351
SGD	4,450,000	USD	3,281,607	HSBC Bank	15/3/2023	22,559
SGD	730,000	USD	550,903	Goldman Sachs	15/3/2023	(8,871)
THB	19,200,000	USD	549,490	Barclays	15/3/2023	(5,480)
THB	18,500,000	USD	553,793	Goldman Sachs	15/3/2023	(29,617)
TRY	164,000	USD	8,594	Barclays	2/3/2023	91
TRY	164,000	USD	8,523	HSBC Bank	4/4/2023	7
TWD	47,700,000	USD	1,571,784	Barclays	15/3/2023	(9,839)
TWD	3,300,000	USD	108,935	JP Morgan	15/3/2023	(875)
TWD	16,900,000	USD	565,937	BNP Paribas	15/3/2023	(12,543)
USD	500,202	TWD	15,100,000	Barclays	15/3/2023	5,750
USD	1,991,570	JPY	262,398,655	UBS	15/3/2023	66,767
USD	624,021	EUR	590,000	UBS	15/3/2023	(4,085)
USD	649,810	CNH	4,500,000	Morgan Stanley	15/3/2023	1,754
USD	15,921,834	EUR	14,776,490	Deutsche Bank	15/3/2023	190,972
USD	2,028,003	SEK	20,581,346	BNP Paribas	15/3/2023	51,175
USD	32,698,236	EUR	30,353,510	Bank of America	15/3/2023	384,280
USD	837,272	EUR	780,000	Citigroup	15/3/2023	6,894
USD	551,357	KRW	715,000,000	Bank of America	15/3/2023	10,005
USD	25,953,395	JPY	3,517,063,095	Morgan Stanley	15/3/2023	154,272
USD	15,683,719	GBP	12,750,000	State Street	15/3/2023	202,637
USD	2,300,000	CNY	15,956,535	BNY Mellon	15/3/2023	(1,120)
USD	687,968	BRL	3,728,593	Goldman Sachs	15/3/2023	(25,479)
USD	1,930,700	ZAR	33,910,000	Deutsche Bank	15/3/2023	85,922
USD	1,765,388	MXN	34,493,563	Goldman Sachs	15/3/2023	(112,031)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	9,910,200	IDR	155,285,000,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	(269,469)
USD	342,065	KRW	450,000,000	Citigroup	15/3/2023	1,353
USD	1,279,200	INR	106,630,000	Citigroup	15/3/2023	(9,597)
USD	13,826,898	KRW	18,183,456,000	BNP Paribas	15/3/2023	59,540
USD	3,663,267	MYR	16,150,000	Barclays	15/3/2023	61,345
USD	276,725	TWD	8,400,000	BNP Paribas	15/3/2023	1,666
USD	10,588,646	EUR	9,815,000	BNP Paribas	15/3/2023	139,723
USD	4,701,958	NOK	47,118,346	JP Morgan	15/3/2023	133,597
USD	1,933,615	SGD	2,600,000	UBS	15/3/2023	3,091
USD	1,384,417	SGD	1,870,000	Barclays	15/3/2023	(4,075)
USD	681,575	NOK	6,770,000	Deutsche Bank	15/3/2023	25,191
USD	3,711,225	JPY	484,524,756	JP Morgan	15/3/2023	157,032
USD	50,840	JPY	6,585,244	Barclays	15/3/2023	2,534
USD	846,663	EUR	790,000	HSBC Bank	15/3/2023	5,639
USD	2,545,672	SEK	26,330,000	JP Morgan	15/3/2023	16,690
USD	3,194,541	SEK	32,810,000	Deutsche Bank	15/3/2023	43,158
USD	1,124,048	AUD	1,660,000	Morgan Stanley	15/3/2023	3,965
USD	2,173,831	GBP	1,820,000	Barclays	15/3/2023	(36,018)
USD	2,850,064	INR	236,400,000	BNP Paribas	15/3/2023	(7,213)
USD	1,067,230	CNH	7,310,000	State Street	15/3/2023	14,498
USD	3,139,854	JPY	404,330,000	HSBC Bank	15/3/2023	173,926
USD	2,009,518	IDR	30,789,976,246	Bank of America	15/3/2023	(8,913)
USD	1,664,029	EUR	1,530,000	Barclays	15/3/2023	35,211
USD	182,427	EUR	170,000	State Street	15/3/2023	1,447
USD	1,596,446	IDR	24,692,566,000	HSBC Bank	15/3/2023	(22,271)
USD	1,879,811	JPY	239,310,000	Bank of America	15/3/2023	124,373
USD	426,072	JPY	54,290,000	Société Générale	15/3/2023	27,832
USD	6,928,983	JPY	894,000,000	Deutsche Bank	15/3/2023	371,121
USD	10,190,602	EUR	9,460,000	JP Morgan	15/3/2023	119,606
USD	935,279	ZAR	16,345,000	Morgan Stanley	17/4/2023	48,602
USD	672,930	INR	54,650,000	Barclays	15/3/2023	12,396
USD	250,683	SEK	2,560,000	Goldman Sachs	15/3/2023	4,796
USD	4,961,579	MXN	93,100,000	UBS	15/3/2023	(105,676)
USD	4,200,345	BRL	21,685,000	BNP Paribas	15/3/2023	51,033
USD	2,272,906	IDR	33,988,225,000	UBS	15/3/2023	44,816
USD	31,968,561	GBP	25,815,495	Citigroup	2/3/2023	631,132
USD	5,215,000	GBP	4,210,426	BNY Mellon	2/3/2023	103,964
USD	2,334,390	CHF	2,146,000	RBS	2/3/2023	40,221
USD	103,736,766	CNH	699,332,072	Barclays	2/3/2023	3,112,194
USD	3,547,905	SEK	36,675,000	Deutsche Bank	2/3/2023	27,831
USD	425,000	ZAR	7,395,807	HSBC Bank	2/3/2023	22,166
USD	5,044,703	CZK	110,705,000	Barclays	2/3/2023	34,196
USD	4,276,597	JPY	554,588,243	UBS	2/3/2023	216,357
USD	13,698,480	CAD	18,274,233	Morgan Stanley	2/3/2023	254,183
USD	20,987,750	MXN	396,308,299	HSBC Bank	2/3/2023	(638,914)
USD	1,114,534	NZD	1,718,000	RBS	2/3/2023	52,815
USD	3,244,661	AUD	4,580,756	State Street	2/3/2023	155,364
USD	292,135,555	EUR	267,895,315	Morgan Stanley	2/3/2023	7,174,003
USD	1,462,876	MXN	27,357,143	Morgan Stanley	2/3/2023	(30,012)
USD	8,937,389	ZAR	155,495,292	State Street	2/3/2023	467,879
USD	400,139	EUR	370,000	Deutsche Bank	2/3/2023	6,568
USD	3,632,970	PLN	15,740,000	HSBC Bank	2/3/2023	77,690
USD	1,929,313	DKK	13,151,000	Morgan Stanley	2/3/2023	49,869
USD	1,881,103	THB	61,371,000	JP Morgan	2/3/2023	144,578
USD	41,335,396	JPY	5,360,095,973	Citigroup	2/3/2023	2,093,167
USD	382,956	RON	1,730,000	JP Morgan	2/3/2023	9,102
USD	479,382	HUF	173,790,000	Goldman Sachs	2/3/2023	(10,736)
USD	678,684	NOK	6,730,000	HSBC Bank	2/3/2023	26,648
USD	1,663,907	EUR	1,530,000	Morgan Stanley	15/3/2023	35,089

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	2,858,447	SGD	3,750,000	HSBC Bank	2/3/2023	74,954
USD	98,464	GBP	80,000	Royal Bank of Canada	2/3/2023	1,352
USD	951,176	KRW	1,171,820,000	JP Morgan	15/3/2023	63,948
USD	1,547,472	MXN	29,240,000	Deutsche Bank	2/3/2023	(48,164)
USD	2,044,859	GBP	1,660,000	Toronto-Dominion	2/3/2023	29,785
USD	4,961,316	EUR	4,560,000	Toronto-Dominion	2/3/2023	110,822
USD	606,903	THB	20,375,000	Goldman Sachs	15/3/2023	29,601
USD	2,501,934	JPY	333,298,764	Citigroup	15/3/2023	57,049
USD	501,051	JPY	64,560,000	Bank of America	2/3/2023	28,395
USD	139,195	JPY	17,900,000	BNP Paribas	15/3/2023	7,891
USD	5,559,749	MXN	104,700,000	State Street	15/3/2023	(138,871)
USD	9,325,384	EUR	8,480,000	HSBC Bank	2/3/2023	305,167
USD	61,565	GBP	50,000	Morgan Stanley	2/3/2023	870
USD	5,530,668	MXN	103,300,000	Deutsche Bank	15/3/2023	(91,753)
USD	3,360,960	BRL	16,996,912	JP Morgan	15/3/2023	108,690
USD	514,684	THB	17,325,000	Citigroup	15/3/2023	23,801
USD	405,022	EUR	370,000	Royal Bank of Canada	2/3/2023	11,451
USD	465,665	GBP	380,000	Barclays	2/3/2023	4,383
USD	640,750	ZAR	11,010,000	Morgan Stanley	2/3/2023	41,058
USD	1,661,478	CNH	11,260,000	Citigroup	15/3/2023	39,896
USD	348,901	GBP	290,000	UBS	2/3/2023	(3,130)
USD	72,933	GBP	60,000	State Street	2/3/2023	99
USD	38,357,387	EUR	35,900,000	State Street	2/3/2023	170,382
USD	2,740,000	JPY	366,576,654	RBS	15/3/2023	51,008
USD	3,843,719	GBP	3,210,000	JP Morgan	15/3/2023	(53,871)
USD	1,370,274	GBP	1,140,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(13,916)
USD	542,664	IDR	8,255,000,000	BNP Paribas	15/3/2023	1,509
USD	2,699,749	GBP	2,260,000	Goldman Sachs	15/3/2023	(44,349)
USD	774,861	ZAR	14,017,904	Barclays	15/3/2023	12,257
USD	159,923	EUR	150,000	UBS	2/3/2023	367
USD	130,441	ZAR	2,400,000	Citigroup	15/3/2023	(124)
USD	2,594,293	BRL	13,468,010	Citigroup	15/3/2023	17,258
USD	415,495	CZK	9,295,643	Deutsche Bank	15/3/2023	(4,878)
USD	589,678	GBP	490,000	Bank of America	15/3/2023	(5,281)
USD	116,784	EUR	110,000	RBS	2/3/2023	(224)
USD	255,134	ZAR	4,663,669	JP Morgan	15/3/2023	1,420
USD	1,120,680	JPY	152,000,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	5,696
USD	12,649,251	CAD	17,133,402	Toronto-Dominion	4/4/2023	40,116
USD	1,758,557	THB	61,371,000	UBS	4/4/2023	16,120
USD	651,417	NOK	6,730,000	HSBC Bank	4/4/2023	(1,803)
USD	40,085,603	JPY	5,424,655,973	JP Morgan	4/4/2023	175,860
USD	3,526,826	SEK	36,675,000	UBS	4/4/2023	311
USD	4,535,886	CZK	101,409,357	HSBC Bank	4/4/2023	(44,431)
USD	4,276,597	JPY	578,847,411	Morgan Stanley	4/4/2023	17,958
USD	855,000	CAD	1,159,390	Royal Bank of Canada	4/4/2023	1,760
USD	1,057,525	NZD	1,718,000	UBS	4/4/2023	(4,255)
USD	9,206,167	ZAR	169,673,968	UBS	4/4/2023	(7,680)
USD	5,215,000	GBP	4,333,835	State Street	4/4/2023	(49,153)
USD	334,126,967	EUR	314,687,167	JP Morgan	4/4/2023	(1,303,199)
USD	2,297,835	CHF	2,146,000	Morgan Stanley	4/4/2023	(5,162)
USD	34,147,643	GBP	28,335,495	HSBC Bank	4/4/2023	(270,454)
USD	481,568	HUF	173,790,000	BNP Paribas	4/4/2023	(2,729)
USD	23,148,073	MXN	428,677,381	UBS	4/4/2023	(91,343)
USD	649,129	MXN	11,971,830	Morgan Stanley	15/3/2023	(2,475)
USD	100,693,733	CNH	699,332,072	Bank of America	4/4/2023	(155,029)
USD	3,097,111	AUD	4,601,392	Goldman Sachs	4/4/2023	(10,029)
USD	2,214,333	MXN	40,700,000	Barclays	15/3/2023	(890)
USD	1,875,088	DKK	13,151,000	Bank of America	4/4/2023	(8,869)
USD	371,987	RON	1,730,000	Goldman Sachs	4/4/2023	(1,331)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
USD	3,528,808	PLN	15,740,000	UBS	4/4/2023	(17,742)
USD	2,784,460	SGD	3,750,000	BNP Paribas	4/4/2023	(1,373)
USD	9,612,596	EUR	9,040,000	Deutsche Bank	4/4/2023	(23,287)
ZAR	37,800,000	USD	2,160,102	Morgan Stanley	15/3/2023	(103,700)
ZAR	48,510,000	USD	2,819,459	JP Morgan	15/3/2023	(180,410)
ZAR	2,400,000	USD	140,065	Bank of America	15/3/2023	(9,500)
ZAR	14,017,904	USD	774,586	Goldman Sachs	15/3/2023	(11,981)
ZAR	4,663,669	USD	255,067	Société Générale	2/3/2023	(1,046)
未実現純評価益						14,446,688
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	4,873,949	USD	5,317,866	BNY Mellon	15/3/2023	(99,233)
USD	111,721	CHF	103,126	BNY Mellon	15/3/2023	1,303
未実現純評価損						(97,930)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	742,208	USD	109,612	BNY Mellon	15/3/2023	(2,722)
USD	2,192	CNY	15,018	BNY Mellon	15/3/2023	29
未実現純評価損						(2,693)
ヘッジを使用したデンマーク・クローネ建投資証券クラス						
DKK	544	USD	79	BNY Mellon	15/3/2023	(1)
USD	1	DKK	10	BNY Mellon	15/3/2023	-
未実現純評価損						(1)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	114,678,558	USD	123,663,490	BNY Mellon	15/3/2023	(1,576,860)
USD	2,449,505	EUR	2,293,057	BNY Mellon	15/3/2023	8,339
未実現純評価損						(1,568,521)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	239,475,704	USD	291,120,048	BNY Mellon	15/3/2023	(347,996)
USD	6,331,474	GBP	5,245,114	BNY Mellon	15/3/2023	(37,145)
未実現純評価損						(385,141)
ヘッジを使用したノルウェー・クローネ建投資証券クラス						
NOK	605,138,325	USD	59,742,807	BNY Mellon	15/3/2023	(1,070,854)
USD	1,137,265	NOK	11,626,846	BNY Mellon	15/3/2023	9,977
未実現純評価損						(1,060,877)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	9,205	USD	5,861	BNY Mellon	15/3/2023	(172)
USD	104	NZD	166	BNY Mellon	15/3/2023	2
未実現純評価損						(170)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	198,868	USD	150,485	BNY Mellon	15/3/2023	(2,823)
USD	4,300	SGD	5,734	BNY Mellon	15/3/2023	43
未実現純評価損						(2,780)
未実現純評価益合計						11,328,575

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

未決済上場先物取引 2023年2月28日現在

取引数	通貨	取引 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(606)	EUR	Euro BOBL	2023年3月	1,394,461
(104)	EUR	Euro Bund	2023年3月	245,791
4	EUR	Euro BUXL	2023年3月	(19,679)
47	EUR	Euro Schatz	2023年3月	(47,553)
(56)	EUR	Euro-BTP	2023年3月	128,910
124	EUR	Euro-OAT	2023年3月	(908,053)
50	EUR	Short-Term Euro-BTP	2023年3月	(70,577)
(49)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年3月	(372,745)
80	AUD	Australian 10 Year Bond	2023年3月	(274,593)
60	AUD	Australian 3 Year Bond	2023年3月	(52,070)
7	KRW	Korean 10 Year Bond	2023年3月	(4,338)
48	KRW	Korean 3 Year Bond	2023年3月	(33,002)
(8)	AUD	90 Day Bank Bill	2023年6月	6,914
(34)	EUR	Euro BOBL	2023年6月	26,891
(2)	EUR	Euro Bund	2023年6月	3,159
(117)	EUR	Euro Schatz	2023年6月	25,933
(14)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年6月	(12,739)
(85)	EUR	3 Month EUR IBOR	2023年6月	20,583
(49)	CAD	Banker's Acceptance	2023年6月	17,574
165	CAD	Canadian 10 Year Bond	2023年6月	(55,839)
48	USD	US Long Bond (CBT)	2023年6月	(76,743)
(666)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年6月	437,499
(997)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年6月	526,950
204	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年6月	(273,457)
71	GBP	Long Gilt	2023年6月	(199,208)
(254)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2023年6月	71,901
586	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年6月	(292,691)
(17)	AUD	90 Day Bank Bill	2023年9月	14,073
(85)	EUR	3 Month EUR IBOR	2023年9月	43,428
79	GBP	3 Month SONIA	2023年9月	(46,128)
17	AUD	90 Day Bank Bill	2024年3月	(16,459)
8	GBP	3 Month SONIA	2024年3月	7,875
8	AUD	90 Day Bank Bill	2024年6月	(9,821)
12	GBP	3 Month SONIA	2024年6月	(32,224)
23	GBP	3 Month SONIA	2024年9月	(66,676)
85	EUR	3 Month EUR IBOR	2024年12月	(87,676)
21	GBP	3 Month SONIA	2024年12月	(62,330)
8	GBP	3 Month SONIA	2025年3月	2,671
合計				(39,988)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (816,276)	ファンドは ITRAXX.XO.34.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2025	(59,888)	45,544
CDS	EUR 1,530,000	ファンドは ITRAXX.EUR.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(157)	(14,668)
CDS	USD 110,000	ファンドは CDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	2,502	(1,664)
CDS	EUR 660,000	ファンドは ITRAXX.XO.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(267)	(23,823)
CDS	USD (7,000)	ファンドは CMBX.NA.9.BBB- に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(509)	(1,271)
CDS	USD (9,000,000)	ファンドは Mexico Government International Bond に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(9,004)	86,479
CDS	USD (329,000)	ファンドは CMBX.NA.9.BBB- に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	4,619	(59,734)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IFS	EUR 1,065,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.72%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/10/2027	24,772	24,772
IFS	EUR 1,110,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.555%の固定金利を支払う	Bank of America	16/10/2027	35,142	35,142
IFS	EUR 970,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/11/2027	3,264	3,264
IFS	EUR 710,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3.0467%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/11/2027	679	679
IFS	EUR 1,900,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.7%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2027	19,508	19,508
IFS	EUR 1,120,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.27375%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2028	22,910	23,880
IFS	EUR 1,520,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.3125%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2028	29,446	29,472
IFS	EUR 1,020,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.539%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2028	8,196	8,196
IFS	EUR 1,530,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.295%の固定金利を支払う	Bank of America	17/1/2028	31,001	31,001
IFS	EUR 1,155,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.415%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/10/2032	(47,820)	(47,820)
IFS	EUR 260,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.545%の固定金利を支払う	Bank of America	16/10/2032	(7,420)	(7,420)
IFS	EUR 1,080,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.5475%の固定金利を支払う	Bank of America	16/10/2032	(30,551)	(30,551)
IFS	EUR 940,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.67625%の固定金利を支払う	Bank of America	16/11/2032	(9,342)	(9,342)
IFS	EUR 710,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.70603%の固定金利を支払う	Bank of America	16/11/2032	(4,930)	(4,930)
IFS	EUR 1,790,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.50481%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/12/2032	(33,445)	(33,445)
IFS	EUR 1,120,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.29%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/1/2033	(30,440)	(32,955)
IFS	EUR 1,020,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.4475%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/1/2033	(14,392)	(14,392)
IFS	EUR 3,050,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.3%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/1/2033	(86,772)	(86,798)
IRS	GBP 31,230,000	ファンドは4.255%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	6/9/2024	(189,595)	(188,418)
IRS	CNY 19,835,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.455%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	6,252	6,252
IRS	CNY 22,190,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.4625%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	6,524	6,524
IRS	CNY 19,835,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.53%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	1,934	1,934
IRS	BRL 1,560,088	ファンドは13.125%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	2,211	2,211
IRS	BRL 32,488,194	ファンドは13.15%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	48,691	48,691
IRS	JPY 530,410,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.2724%の固定金利を支払う	Bank of America	6/1/2025	(7,523)	(7,523)
IRS	JPY 396,100,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.265%の固定金利を支払う	Bank of America	12/1/2025	(5,185)	(5,185)
IRS	MXN 56,811,800	ファンドは9.8%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2025	(52,661)	(52,661)
IRS	MXN 213,445,735	ファンドは9.9%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(177,211)	(177,211)
IRS	MXN 102,845,265	ファンドは9.92%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(83,414)	(83,414)
IRS	MXN 315,940,000	ファンドは9.95%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2025	(246,648)	(246,648)
IRS	AUD 4,180,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.8025%の固定金利を支払う	Bank of America	9/2/2025	21,443	21,443

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	NZD 4,650,000	ファンドは4.94%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2025	(22,304)	(22,304)
IRS	GBP 8,650,000	ファンドは3.9825%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	16/2/2025	(55,477)	(55,477)
IRS	USD 28,412,000	ファンドは2.601%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	(1,235,628)	(1,235,628)
IRS	USD 28,410,000	ファンドは2.701%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	(1,182,740)	(1,182,740)
IRS	GBP 7,220,000	ファンドは4.03%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	19/2/2025	(42,047)	(42,047)
IRS	THB 92,550,000	ファンドはTHB 3ヶ月BKIBORの変動金利を受け取り、1.735%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2025	19,772	19,772
IRS	MYR 12,790,000	ファンドは3.5%の固定金利を受け取り、MYR 3ヶ月KLIB3Mの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2025	(6,383)	(6,383)
IRS	CNY 8,390,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.69%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2025	263	263
IRS	KRW 695,631,583	ファンドは3.2825%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/3/2026	(7,056)	(7,056)
IRS	KRW 1,375,180,000	ファンドは3.303%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/3/2026	(13,348)	(13,348)
IRS	KRW 7,671,377,700	ファンドは3.023%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2026	(115,753)	(115,752)
IRS	KRW 4,505,412,300	ファンドは3.05%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2026	(65,414)	(65,414)
IRS	JPY 3,044,390,542	ファンドは0.035%の固定金利を受け取り、JPY 1日TONARの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2027	(216,558)	(252,352)
IRS	CNY 8,170,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.7975%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	8,648	8,648
IRS	CNY 8,130,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.956%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	(32)	(32)
IRS	CNY 8,100,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.93750%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2028	3,782	3,782
IRS	USD 6,760,000	ファンドは3.04%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/10/2032	(364,300)	(364,300)
IRS	USD 6,770,000	ファンドは2.868%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/11/2032	(458,271)	(458,271)
IRS	USD 6,820,000	ファンドは2.908%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	4/11/2032	(439,925)	(439,925)
IRS	USD 16,474,500	ファンドは2.8905%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/11/2032	(1,087,307)	(1,087,307)
IRS	USD 6,770,000	ファンドは3.191%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/11/2032	(283,648)	(283,648)
IRS	AUD 970,000	ファンドは4.15%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	9/2/2033	(17,799)	(17,799)
IRS	NZD 1,080,000	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、4.2525%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2033	23,042	23,042
IRS	KRW 2,543,732,100	ファンドは KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を受け取り、2.97%固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2033	88,854	88,854
IRS	KRW 1,493,937,900	ファンドは KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を受け取り、2.973%固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2033	51,904	51,904
IRS	USD 3,537,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.23%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2033	110,275	110,275
IRS	EUR 190,000	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.7395%の固定金利を支払う	Bank of America	4/11/2042	10,619	10,619
IRS	GBP 9,370,000	ファンドは0.70116116%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	13/9/2051	(4,660,847)	(5,751,388)
IRS	EUR 130,000	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.2705%の固定金利を支払う	Bank of America	4/3/2053	13,240	13,240
IRS	NZD 5,165,000	ファンドは4.697%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(17,518)	(17,518)
IRS	AUD 4,475,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、4.0425%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	7,949	7,949

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 6,839,826	ファンドは13.78%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2025	25,064	25,064
IRS	JPY 535,900,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.23%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/1/2025	(4,440)	(4,440)
IRS	JPY 872,000,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.235%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/1/2025	(7,734)	(7,734)
IRS	EUR 8,890,000	ファンドは3.27%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/2/2025	(32,689)	(32,429)
IRS	CHF 8,570,000	ファンドはCHF 1日SARONの変動金利を受け取り、1.708%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/2/2025	19,717	20,536
IRS	USD 19,530,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、4.42%の固定金利を支払う	BNP Paribas	28/2/2025	13,688	13,577
IRS	NZD 2,325,000	ファンドは4.97%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2025	(10,563)	(10,563)
IRS	USD 2,750,000	ファンドは3.6%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	BNP Paribas	1/12/2025	(48,367)	(33,501)
IRS	USD 2,750,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.47%の固定金利を支払う	BNP Paribas	1/12/2025	40,917	40,917
IRS	GBP 3,410,000	ファンドは3.09%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/2/2027	(22,833)	(22,541)
IRS	GBP 10,530,000	ファンドは3.514%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	17/2/2027	(78,237)	(78,237)
IRS	USD 5,110,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.1055%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/2/2027	31,058	31,058
IRS	USD 7,830,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.193%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/2/2027	35,614	35,614
IRS	GBP 2,360,000	ファンドは3.165%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/1/2028	(8,717)	(8,634)
IRS	GBP 5,250,000	ファンドは3.175%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/1/2028	(18,835)	(18,683)
IRS	GBP 1,880,000	ファンドは3.2%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/1/2028	(6,860)	(6,222)
IRS	GBP 21,420,000	ファンドは2.92%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/2/2028	(129,769)	(129,769)
IRS	GBP 12,390,000	ファンドは2.81702%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	3/2/2028	(79,256)	(87,694)
IRS	USD 37,850,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.231%の固定金利を支払う	BNP Paribas	26/2/2028	(5,984)	(5,984)
IRS	USD 5,120,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.24%の固定金利を支払う	BNP Paribas	26/2/2028	(1,128)	(1,195)
IRS	EUR 1,080,000	ファンドは2.41%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	27/1/2033	(22,721)	(22,721)
IRS	EUR 2,510,000	ファンドは2.618%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	9/2/2033	(31,533)	(30,836)
IRS	USD 2,840,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.01946%の固定金利を支払う	BNP Paribas	9/2/2033	29,505	31,828
IRS	USD 1,190,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.2565%の固定金利を支払う	BNP Paribas	28/2/2033	2,739	2,739
IRS	NZD 548,000	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、4.23%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2033	12,326	12,326
IRS	EUR 749,800	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.72691%の固定金利を支払う	BNP Paribas	4/11/2042	40,939	43,370
IRS	EUR 279,300	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.263%の固定金利を支払う	BNP Paribas	4/3/2053	28,886	28,886
IRS	BRL 8,917,509	ファンドは13.22%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	15,385	15,385
IRS	BRL 32,492,143	ファンドは13.225%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	56,655	56,655
IRS	BRL 33,920,361	ファンドは13.15%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	50,748	50,748
IRS	BRL 16,951,636	ファンドは13.18%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	27,026	27,026

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

スワップ 2023年2月28日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 8,936,520	ファンドは12.755%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	1,995	1,995
IRS	BRL 83,860,239	ファンドは12.7825%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	26,668	26,668
合計					(10,832,824)	(11,852,013)

CDS：クレジット・デフォルト・スワップ

IFS：インフレ・スワップ

IRS：金利スワップ

買建オプション 2023年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
420,000	コール	OTC AUD/NZD	Bank of America	AUD 1.09	13/3/2023	(2,524)	1,683
250,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(15,000)	-
250,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(15,000)	-
180,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/4/2023	(12,939)	237
10,290,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.13	21/4/2023	(42,210)	4,035
22,370,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 123.25	6/6/2023	(261,529)	75,117
14,660,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 126.7	16/6/2023	(78,139)	103,513
420,000	コール	OTC AUD/NZD	Citibank	AUD 1.06	13/3/2023	4,274	8,235
2,270,000	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 19.5	7/3/2023	117,933	142,810
10,400,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.1	14/3/2023	(67,689)	1,862
12,920,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.11	5/5/2023	(38,576)	28,613
7,460,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	7/3/2023	(24,049)	86
10,290,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	7/3/2023	(34,691)	119
62	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119.5	26/5/2023	(22,520)	4,844
1,500	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.5	15/3/2024	1,871,805	2,643,750
合計						1,379,146	3,014,904

売建オプション 2023年2月28日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(10,290,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1	7/3/2023	74,855	(119)
(420,000)	コール	OTC AUD/NZD	Bank of America	AUD 1.06	13/3/2023	3,003	(8,235)
(22,370,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 121.31	6/6/2023	211,436	(45,953)
(14,660,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 124.7	16/6/2023	62,196	(74,435)
(420,000)	コール	OTC AUD/NZD	Citibank	AUD 1.09	13/3/2023	(507)	(1,683)
(2,270,000)	コール	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 21	7/3/2023	24,330	-
(2,270,000)	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.75	7/3/2023	(46,312)	(52,958)
(2,000)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	15/3/2024	(1,666,760)	(2,112,500)
合計						(1,337,759)	(2,295,883)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3)(続き)

買建スワップション 2023年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 40,900,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を2023年11月4日から半期ごとに受け取り、1%の固定金利を2024年5月4日から毎年支払う	Goldman Sachs	2/5/2023	1,023,496	1,240,583
USD 5,714,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年4月5日から毎年受け取り、3.8%の固定金利を2023年10月5日から半期ごとに支払う	Citibank	3/4/2023	(2,492)	51,545
USD 2,068,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは2.85%の固定金利を2024年5月16日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年11月9日から毎年支払う	Citibank	14/11/2023	(33,979)	56,954
USD 5,784,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドは2.85%の固定金利を2024年2月9日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年8月9日から毎年支払う	Goldman Sachs	7/8/2023	(37,566)	23,538
USD 2,740,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを買う。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年11月9日から毎年受け取り、2.82%の固定金利を2024年5月9日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	7/11/2023	(12,429)	20,877
USD 2,740,000	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを買う。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年11月9日から毎年受け取り、4.82%の固定金利を2024年5月9日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	7/11/2023	(30,278)	14,294
EUR 10,960,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはEURIBORの変動金利を2025年2月19日から毎年受け取り、2.2%の固定金利を2026年2月19日から半期ごとに支払う	Morgan Stanley	17/2/2025	(10,855)	45,397
合計				895,897	1,453,188

売建スワップション 2023年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (6,900,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.4%の固定金利を2023年10月10日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年4月10日から毎年支払う	Bank of America	6/4/2023	(114,134)	(196,934)
USD (6,820,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年4月20日から毎年受け取り、3.45%の固定金利を2023年10月20日から半期ごとに支払う	Bank of America	18/4/2023	(77,144)	(181,149)
GBP (1,200,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは4.2%の固定金利を2024年7月17日から半期ごとに受け取り、GBP SONIAの変動金利を2024年7月14日から毎年支払う	Barclays	17/7/2023	(8,303)	(15,112)
USD (2,850,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.45%の固定金利を2024年8月6日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年2月6日から毎年支払う	Barclays	2/2/2024	(28,444)	(47,026)
USD (27,900,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月1日から毎年受け取り、3.3%の固定金利を2023年12月1日から半期ごとに支払う	Citibank	30/5/2023	69,598	(4,337)
GBP (1,273,554)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは4.7%の固定金利を2024年6月14日から半期ごとに受け取り、GBP SONIAの変動金利を2024年6月14日から毎年支払う	Citibank	14/6/2023	243	(7,616)
GBP (1,011,240)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは4.7%の固定金利を2024年6月14日から半期ごとに受け取り、GBP SONIAの変動金利を2024年6月14日から毎年支払う	Citibank	14/6/2023	193	(6,047)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド(3) (続き)

売建スワップション 2023年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (5,714,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.85%の固定金利を2024年1月6日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年7月6日から毎年支払う	Citibank	3/7/2023	(3,863)	(86,079)
USD (20,680,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年11月16日から毎年受け取り、2.75%の固定金利を2024年5月16日から半期ごとに支払う	Citibank	14/11/2023	46,334	(22,111)
USD (20,680,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは4.75%の固定金利を2024年5月16日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年11月16日から毎年支払う	Citibank	14/11/2023	(31,257)	(97,746)
USD (62,000,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.9%の固定金利を2024年6月5日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年12月5日から毎年支払う	Citibank	1/12/2023	(368,431)	(759,031)
USD (62,000,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2025年1月19日から毎年受け取り、2.75%の固定金利を2024年7月19日から半期ごとに支払う	Citibank	17/1/2024	242,828	(110,571)
USD (11,160,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月1日から毎年受け取り、2.8%の固定金利を2023年12月1日から半期ごとに支払う	Deutsche Bank	30/5/2023	58,256	(5,913)
USD (10,970,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.27%の固定金利を2023年9月27日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年3月27日から毎年支払う	Goldman Sachs	23/3/2023	(315,104)	(404,236)
EUR (81,800,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは1.75%の固定金利を2024年5月4日から毎年受け取り、6ヶ月EURIBORの変動金利を2023年11月4日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	2/5/2023	(1,641,232)	(1,852,475)
USD (11,213,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月1日から毎年受け取り、2.8%の固定金利を2023年12月1日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	30/5/2023	92,039	(5,942)
USD (28,032,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月1日から毎年受け取り、3.3%の固定金利を2023年12月1日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	30/5/2023	90,421	(4,358)
USD (5,730,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月12日から毎年受け取り、2.5%の固定金利を2023年12月12日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	8/6/2023	32,604	(1,619)
USD (11,450,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは4%の固定金利を2023年12月12日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年6月12日から毎年支払う	Goldman Sachs	8/6/2023	(47,972)	(121,306)
USD (13,110,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.9%の固定金利を2023年12月16日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年6月16日から毎年支払う	Goldman Sachs	14/6/2023	(95,764)	(169,242)
USD (13,110,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年6月16日から毎年受け取り、2.5%の固定金利を2023年12月16日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	14/6/2023	68,935	(4,420)
USD (7,230,000)	ファンドは金利スワップを締結するためプット・オプションを売る。行使されれば、ファンドは3.75%の固定金利を2024年2月9日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2024年8月9日から毎年支払う	Goldman Sachs	7/8/2023	(76,238)	(144,198)
USD (10,970,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2024年11月9日から毎年受け取り、3.26%の固定金利を2024年5月9日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	7/11/2023	21,614	(22,463)
合計				(2,084,821)	(4,269,931)

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド⁽³⁾(続き)

事後通告証券契約 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
TBA	米国		
USD 2,772,000	Fannie Mae or Freddie Mac 1.5% TBA	2,392,433	0.22
USD 2,013,500	Fannie Mae or Freddie Mac 1.5% TBA	1,548,822	0.14
USD 5,120,000	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	4,543,901	0.42
USD 13,025,008	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	10,568,573	0.98
USD 1,851,000	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	1,682,782	0.16
USD 9,991,900	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	8,438,472	0.78
USD 1,124,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	1,045,847	0.10
USD 5,711,537	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	5,013,659	0.46
USD 317,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	301,590	0.03
USD 21,621,120	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	19,639,747	1.82
USD 160,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	155,532	0.01
USD 4,111,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	3,847,960	0.36
USD 114,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	112,196	0.01
USD 36,268,700	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	34,809,452	3.23
USD 3,299,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	3,232,930	0.30
USD 600,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	587,984	0.05
USD 555,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5.5% TBA	552,781	0.05
USD 370,000	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	373,816	0.03
USD 4,624,700	Ginnie Mae 2% TBA	3,863,070	0.36
USD 3,029,400	Ginnie Mae 2.5% TBA	2,613,331	0.24
USD 3,333,600	Ginnie Mae 3% TBA	2,970,029	0.28
USD 2,769,000	Ginnie Mae 3.5% TBA	2,542,072	0.24
USD 1,709,000	Ginnie Mae 4% TBA	1,613,002	0.15
USD 1,103,000	Ginnie Mae 4.5% TBA	1,066,463	0.10
USD 100,000	Ginnie Mae 5% TBA	98,628	0.01
USD 622,000	Ginnie Mae 5% TBA	613,493	0.06
USD 407,000	Ginnie Mae 5.5% TBA	407,407	0.04
USD 220,000	Ginnie Mae 6% TBA	222,879	0.02
TBA合計		114,858,851	10.65

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

財務書類に対する注記

1. 組織

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

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

2023年2月28日現在、当社は103のサブファンド(以下それぞれを「ファンド」という。)における投資証券を発行しており、以下総称して「当ファンド」という。各ファンドは、それぞれ個別の資産プールである。各ファンドは、アペンディクスに詳述のとおり投資証券クラスに分類されており、それぞれ個別の投資証券により表象されている。

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

当期に生じた重要な事象

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

2022年9月6日付で、オフショア人民元建てのチャイナ・オンショア・ボンド・ファンドが設定された。

2022年9月13日付で、英文目論見書の補遺が発行された。

2022年9月22日付で、米ドル建のシステムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンドが設定された。

2022年10月4日付で、米ドル建のサステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンドが設定された。

2022年10月6日付で、ユーロ建のインパクト・ボンド・ファンドが設定された。

2022年10月6日付で、ベッティーナ・マツオッキが当社の取締役会に任命された。

2022年12月2日付で、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドを2023年3月2日付で終了するとした取締役会決議を通知する投資主通知が発行された。

2022年12月15日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2022年12月15日付で、システムティック・グローバル・スモールキャップ・ファンドはシステムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンドに、システムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンドはESGシステムティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンドに、またワールド・ボンド・ファンドはサステイナブル・ワールド・ボンド・ファンドに名称を変更した。

2022年12月29日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

取締役会および投資顧問会社は、ロシアのウクライナへの侵攻に起因する地政学的緊張を考慮して、ファンドの投資目的に沿った投資パフォーマンスを引き続き監視している。当ファンドの運用および純資産価額の公表は、BGFエマージング・ヨーロッパ・ファンド(本パラグラフの残りの部分では「ファンド」という。)を除いて継続されている。ロシアに対するファンドの重大な投資エクスポージャーにより、ファンドの取引条件は重大な影響を受けた。したがって、取締役会は、ファンドのすべての投資証券クラスの販売、買戻し、転換、およ

び純資産価額の決定については、英文目論見書に基づくファンドの裁量に基づき、2022年3月1日からそれ以降の通知までの期間、一時的に停止されることが、ファンドおよびその投資家の利益になると考えた。2022年3月3日、取締役会は、ファンドが保有するロシアの有価証券の価値をさらに大幅に評価減することを決定した。2022年3月9日、運用会社の取締役会は、ファンドの評価、販売および買戻しについて、ブラックロックのウェブサイトを通じてさらなる通知がなされるまで停止する一方で、ファンドに関連する投資運用報酬および年次サービス料を放棄する(2022年3月1日発効)という追加の例外的な決定を下した。2023年1月以降、月末の想定純資産価額はブラックロックのウェブサイトで公表されている。半期報告書に開示されている純資産価額は2023年2月28日現在のファンドの想定純資産価額である。2023年2月28日現在、取締役会はファンドを終了する計画はないため、これらの財務書類は継続企業の前提に基づき作成されている。

2. 重要な会計方針の要約

当社の財務書類は、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドを除き継続企業の前提に基づいて作成されている。アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドは、期末後にファンドを終了するという取締役の決定に伴い、非継続企業の前提に基づいて作成されている。詳細については注記1を参照のこと。この財務書類は、ルクセンブルグの投資法人のためにルクセンブルグの関係官庁が規定した財務書類の作成に関連する法律および規制上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針を含む。

(a) 投資有価証券およびその他の資産の評価

当社の投資有価証券およびその他の資産は以下のとおり評価されている。

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

- ・ ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドで保有されている短期金融商品は、時価基準で評価される。これが不可能な場合、資産は評価モデルによる評価基準を用いて保守的に評価される。
- ・ 定期預金は、償却原価で評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ 現金、預金、要求払手形およびその他の債務ならびに前払費用は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未収利息および未収配当金、売却投資有価証券未収金ならびに販売投資証券未収金を含む資産は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未払費用、未払収益分配金、購入投資有価証券未払金および買戻し投資証券未払金を含む負債は、これらの額面金額で評価される。

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

(b) 投資有価証券からの収益 / 費用

当社は以下の方法で投資有価証券からの収益を会計処理している。

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

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

(c) デリバティブ商品

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

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

ドが決済取引を行った場合)、当ファンドはオプションに係る損益を、受取または支払プレミアムの分だけ(もしくは決済取引のコストが受取または支払プレミアムを超過する分だけ)実現する。

2023年2月28日現在、当ファンドは差金決済取引契約(以下「CFD」という。)を締結している。CFDにより、投資家は変動証拠金でシンセティック・ロングポジションまたはシンセティック・ショートポジションを取ることができる。株式と違い、CFDにおいては、購入者は証拠金として支払った金額を大幅に上回る金額について責任を負う可能性がある。そのため、当ファンドは取引相手から受け取った現金を様々な金融機関に預け入れており、これは英文目論見書にも記載されている。締結されたCFDポジションには、該当するベンチマーク以上またはそれ以下の事前に合意されたレートを適用する金融費用が日々、課される。関連する受取配当金または支払配当金は、損益および純資産変動計算書に源泉徴収税控除後の金額で開示される。

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、適切と思われる場合は決済前に契約を処分することがある。TBAの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。TBA売却契約が残存している間、当該取引をカバーするために、相応の交付可能有価証券または相殺対象となる(売却契約日以前に交付可能な)TBA購入契約を保有する。二者の取引相手が同一のTBA契約に対して相殺対象となる取引を行っている場合、これらの取引は相殺される。決済日において売り手は、約定日の2日前に指定された有価証券を引渡し、約定日に指定された現金を受け取る。

ただし実務上は、ほとんどのT B A取引において、最終的に不動産担保証券現物の引渡しは行われず。売り手は、現物を決済するのではなく、満期前に残存取引を解消または「ロール」する。

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

2023年2月28日現在、当ファンドは未決済のT B Aを有していた。これは、純資産計算書の「売却投資有価証券未収金」および「購入投資有価証券未払金」に含まれている。

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

(d) 為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、2023年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートで換算されている。

(e) 結合財務書類

各ファンドの財務書類はファンドの基準通貨で表示されている。

当社の結合数値は米ドルで表示されており、各ファンドの財務書類の合計を含んでいる。純資産計算書の換算レートは、2023年2月28日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9401	0.8238	136.5900	0.9354	6.9499

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

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9695	0.8484	138.4699	0.9530	7.0050

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

損益および純資産変動計算書の結合数値は、期中の平均為替レートをを用いて算定されている。その結果生じる為替換算調整額1,949,649,745米ドルは、2022年8月31日と2023年2月28日の間の為替レートの変動を表す。これは想定金額であり、個々のファンドの純資産に対する影響はない。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2023年2月28日現在、当ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産ならびにその他の負債を換算するために使用された。

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
UAEディルハム	0.2243	0.2723	0.2560	37.1889	0.2547	1.8922
アルゼンチン・ペソ (公式レート)	0.0042	0.0051	0.0048	0.6927	0.0047	0.0352
豪ドル	0.5556	0.6744	0.6340	92.1173	0.6309	4.6871
ブラジル・レアル	0.1581	0.1919	0.1804	26.2060	0.1795	1.3334
カナダ・ドル	0.6061	0.7357	0.6916	100.4888	0.6882	5.1130
スイス・フラン	0.8807	1.0690	1.0050	146.0208	1.0000	7.4298
チリ・ペソ	0.0010	0.0012	0.0011	0.1646	0.0011	0.0084
オフショア中国人民元	0.1185	0.1439	0.1353	19.6535	0.1346	1.0000
中国人民元	0.1187	0.1441	0.1355	19.6832	0.1348	1.0015
コロンビア・ペソ	0.0002	0.0002	0.0002	0.0284	0.0002	0.0014
チェコ・コルナ	0.0373	0.0453	0.0425	6.1821	0.0423	0.3146
デンマーク・クローネ	0.1177	0.1429	0.1344	19.5204	0.1337	0.9932
ドミニカ・ペソ	0.0148	0.0180	0.0169	2.4571	0.0168	0.1250
エジプト・ポンド	0.0269	0.0326	0.0307	4.4594	0.0305	0.2269
ユーロ	0.8763	1.0637	1.0000	145.2914	0.9950	7.3927
英ポンド	1.0000	1.2139	1.1412	165.8066	1.1355	8.4365
ガーナ・セディ	0.0646	0.0784	0.0737	10.7129	0.0734	0.5451
香港ドル	0.1050	0.1274	0.1198	17.4022	0.1192	0.8855
ハンガリー・フォリント	0.0023	0.0028	0.0027	0.3852	0.0026	0.0196
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0090	0.0001	0.0005
イスラエル・シェケル	0.2250	0.2731	0.2567	37.2985	0.2554	1.8978
インド・ルピー	0.0100	0.0121	0.0114	1.6523	0.0113	0.0841
アイスランド・クローナ	0.0058	0.0070	0.0066	0.9538	0.0065	0.0485
日本円	0.0060	0.0073	0.0069	1.0000	0.0068	0.0509
ケニア・シリング	0.0065	0.0079	0.0074	1.0759	0.0074	0.0547
韓国ウォン	0.0006	0.0008	0.0007	0.1032	0.0007	0.0053
クウェート・ディナール	2.6842	3.2584	3.0632	445.0586	3.0479	22.6453
カザフスタン・テンゲ	0.0019	0.0022	0.0021	0.3068	0.0021	0.0156
スリランカ・ルピー	0.0023	0.0028	0.0026	0.3773	0.0026	0.0192
メキシコ・ペソ	0.0450	0.0546	0.0513	7.4538	0.0510	0.3793
マレーシア・リンギット	0.1836	0.2228	0.2095	30.4380	0.2084	1.5487
ナイジェリア・ナイラ	0.0018	0.0022	0.0020	0.2965	0.0020	0.0151
ノルウェー・クローネ	0.0798	0.0969	0.0911	13.2335	0.0906	0.6733
ニュージーランド・ドル	0.5091	0.6180	0.5810	84.4122	0.5781	4.2950
ペルー・新ソル	0.2165	0.2628	0.2470	35.8939	0.2458	1.8263
フィリピン・ペソ	0.0149	0.0181	0.0170	2.4677	0.0169	0.1256

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
ポーランド・ズロチ	0.1861	0.2259	0.2123	30.8523	0.2113	1.5698
カタール・リヤル	0.2262	0.2746	0.2581	37.5064	0.2569	1.9084
ルーマニア・レイ	0.1780	0.2161	0.2032	29.5171	0.2021	1.5019
ロシア・ルーブル	0.0110	0.0133	0.0125	1.8182	0.0125	0.0925
サウジ・リアル	0.2195	0.2665	0.2505	36.3982	0.2493	1.8520
スウェーデン・クローネ	0.0791	0.0960	0.0902	13.1099	0.0898	0.6671
シンガポール・ドル	0.6115	0.7423	0.6978	101.3860	0.6943	5.1587
タイ・バーツ	0.0233	0.0283	0.0266	3.8649	0.0265	0.1967
新トルコ・リラ	0.0436	0.0530	0.0498	7.2337	0.0495	0.3681
台湾ドル	0.0270	0.0328	0.0309	4.4828	0.0307	0.2281
ウクライナ・フリヴニャ	0.0224	0.0272	0.0256	3.7166	0.0255	0.1891
米ドル	0.8238	1.0000	0.9401	136.5900	0.9354	6.9499
ウルグアイ・ペソ	0.0212	0.0257	0.0242	3.5149	0.0241	0.1788
ベトナム・ドン	0.0000	0.0000	0.0000	0.0057	0.0000	0.0003
南アフリカ・ランド	0.0449	0.0545	0.0512	7.4398	0.0510	0.3785
ザンビア・クワチャ	0.0416	0.0505	0.0474	6.8933	0.0472	0.3507

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

(g) 希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引および仲介手数料、税金および関税、市場の動き、原資産の購入価格と売却価格間のスプレッド等の要因により、当該ファンドにおける原資産の帳簿価額を逸脱している場合に生じる。希薄化は、ファンドの価値に悪影響を及ぼし、その結果投資主に影響を与える可能性がある。投資証券1口当たり純資産価額を調整することにより、この影響を軽減または回避して、投資主を希薄化による影響から保護することができる。いずれかの取引日において、当該ファンドの全投資証券クラスの総取引の価値によって、当該ファンドに対して取締役が設定する1つ以上の基準値を超える投資証券の純増減が生じた場合、取締役は当該ファンドの純資産価額を調整することがある。ある取引日にファンドの純資産価額を調整できる金額は、当該ファンドの市場取引の予想コストに関連している。このような状況において、関連するファンドの純資産価額は、純資産価額の1.50%（債券ファンドの場合は3%）を超えない金額で調整されることがある。例外的な状況において取締役は、投資主の利益のため、上記の最大変動要因を一時的に引き上げ、その旨を投資家に通知する場合がある。純変動により当ファンドの全投資証券の価値が増加した場合は加算調整となり、価値が減少した場合には減算調整となる。特定の株式市場および管轄区域においては、特に関税および税金に関して、買い手側と売り手側で課金構造が異なる場合があるため、結果として生じる調整は、販売純額（流入）と買戻し純額（流出）で異なることがある。さらに、取締役は、調整額に特別な財務上の費用を含めることに同意することもある。これらの特別な財務上の費用は市場ごとに異なり、現時点ではその純資産価額の2.5%を超えないものと予想されている。ファンドが主に国債や短期金融証券などの特定の資産タイプに投資する場合、取締役はそのような調整を行うことが適切でないと判断する可能性がある。

英文目論見書のアペンディクスBの17.3(訳注:原文の参照番号)に従い、2023年2月28日現在、かかる希薄化調整はユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、ニュートリション・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンドおよびワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンドに適用されていた。2023年2月28日に終了した期間において、かかる希薄化調整は、チャイナ・イノベーション・ファンド、チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、ユーロ・リザーブ・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、インパクト・ボンド・ファンド、サステイナブル・エネルギー・ファンドおよびUSダラー・リザーブ・ファンドを除くすべてのファンドに適用された。

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

(h) 取引費用

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

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

(i) その他の取引に係る外国通貨

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

(j) 公正価値評価

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

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

2023年2月28日現在、以下のとおり公正価値調整が行われた。

ファンド	通貨	公正価値評価された証券の時価	純資産比率(%)
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	-	0.00
アジア・ドラゴン・ファンド	米ドル	10,130,605	1.23
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	13,771	0.02
アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	68,220	0.84
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00

チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	131,785,900	0.43
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド(1)	オフショア 中国人民元	9,941,320	1.89
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	ユーロ	32,759	0.07
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	931,954	0.03
エマージング・ヨーロッパ・ファンド(2)	ユーロ	26,579	0.01
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	573	0.00
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	33,846,077	1.40
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	68	0.00
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド	ユーロ	612,519	0.13
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	207,633	0.13
ESGマルチアセット・ファンド	ユーロ	17,665,857	0.27
ユーロ・リザーブ・ファンド	ユーロ	1,000,000	0.82
ユーロ・マーケット・ファンド	ユーロ	1,612,388	0.12
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	-	0.00
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	ユーロ	8,617	0.16
フィンテック・ファンド	米ドル	3,433	0.00
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	64,684,107	0.83
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	386,605,004	2.63
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	1,580	0.00

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	10,479,961	2.65
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,197,990	0.14
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	21,295,650	0.41
ラテン・アメリカン・ファンド	米ドル	-	0.00
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	米ドル	305	0.00
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	米ドル	2,012	0.01
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	70,899,751	2.87
ニュートリション・ファンド	米ドル	1	0.00
サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	-	0.00
サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	768,306	0.15
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	米ドル	210,800	0.19
システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	60,849	0.00
システムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド ⁽³⁾	米ドル	2,758	0.00
ユナイテッド・キングダム・ファンド	英ポンド	-	0.00
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	5,579,637	0.27
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	902	0.00
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	2,281	0.00
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	42,418,505	1.11
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	738,840	0.01
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	12,796,119	0.21
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	米ドル	78,459	0.05
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	164,981,737	2.02

当該ファンドは時価がゼロで公正価値評価された証券を保有している。

- (1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記 1 を参照のこと。
- (2) 一時的に停止されたファンド。詳細については注記 1 を参照のこと。
- (3) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記 1 を参照のこと。

(k) 特別買収目的会社に関するコミットメント

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

SPACに対する未履行のPIPEコミットメントは時価評価され、当該コミットメントから生じる利益/損失は、純資産計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)」、ならびに損益および純資産変動計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)の純変動」に計上される。2023年2月28日現在において、そのようなコミットメントはなかった。

3. 運用会社

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

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

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

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

4. 投資運用報酬

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

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

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

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

2022年3月9日付で、運用会社の取締役会は、エマージング・ヨーロッパ・ファンドの停止により、その投資運用報酬を放棄した。

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

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

2023年2月28日現在の未払投資運用報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

5. 販売報酬

英文目論見書のアペンディクスEに記載されているとおり、当社は年間販売報酬を支払っている。販売報酬の水準は、0.00%から1.25%の間である。クラスA、D、I、J、S、XおよびZ投資証券では、販売報酬を支払わない。ユーロ・リザーブ・ファンドおよびUSドル・リザーブ・ファンドのクラスC投資証券では、販売報酬を支払わない。当該報酬は、該当ファンドの純資産価額に基づき（該当する場合、英文目論見書のアペンディクスBの17.3項（訳注：原文の参照番号）に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している）、毎日発生し、毎月支払われる。

当社は、損益および純資産変動計算書において詳述されているとおり、販売報酬を支払う。2023年2月28日現在の未払販売報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

6. 年次サービス料

当社は年次サービス料を運用会社に支払っている。

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

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

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

アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド、チャイナ・イノベーション・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデルート・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、ESGシステムティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ファンド、ヨーロッパ・フォーカス・ファンド、ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド、フィンテック・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド、ニュートリション・ファンド、サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド、システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド、システムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド、USドル・ボンド・ファンドおよびUSサステイナブル・エクイティ・ファンドの継続的

経費(ongoing charge)は、損益および純資産変動計算書の年次サービス料と相殺される差額に上限が定められている。

年次サービス料は、預託報酬、販売報酬、有価証券貸付手数料、借入金から生じるすべての手数料(疑義を避けるために明記すると、貸し手に支払う可能性のあるコミットメント報酬を含む。)、欧州連合(以下「EU」という。)および非EUの源泉徴収税還付請求に関連する費用とその税金またはその利息、ならびに投資レベルまたは会社のレベルで課される税金を除き、当社が負担したすべての固定および変動の営業費用および管理費に充てる目的で運用会社が使用する。

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

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

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

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

ブラックロック・グループの従業員でない取締役は、遂行した役務の対価として報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員でない当社の取締役は、税込みで年間55,000ユーロから60,000ユーロの範囲の報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員である取締役は、取締役報酬を受ける権利を有していない。

特定の管轄地域に適用される税金も、ファンドに直接請求される(注記8参照)。

年次サービス料は、損益および純資産変動計算書において開示されている。

2023年2月28日現在の未払年次サービス料は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

7. 預託報酬

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

預託報酬はファンドに直接請求される。2023年2月28日現在の未払保管および預託報酬は純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

8. 税金

ルクセンブルグ

現在のルクセンブルグの法律および慣習に基づき、当社はルクセンブルグにおける所得税もしくはキャピタル・ゲイン税が課されず、また、当社が支払う配当金はルクセンブルグの源泉徴収税の対象となっていない。しかし、当社は、純資産価額に対して年率0.05%のルクセンブルグにおける税金、またはリザーブ・ファンド、クラスI、クラスJおよびクラスXの投資証券の場合には純資産価額に対して年率0.01%の税金が課される。当該税金は、各ファンドの該当四半期末(暦年)の純資産価額に基づき、四半期毎に支払われる。ルクセンブルグにおいて、投資証券の発行に伴う印紙税またはその他の税金は支払われない。2023年2月28日に終了した期間において、ルクセンブルグの税金に関連して29,588,003米ドルが費用計上された。

ベルギー

当社は金融市場に関する2012年8月3日法第154条に基づき、ベルギーの金融サービス市場機構に登録されている。ベルギーにおいて一般向け販売のために登録されたファンドには、前年の12月31日現在、ベルギーの仲介業者を通じてベルギーで販売された口数の純資産価額に対して年率0.0925%の税金が課される。この税金は、毎年3月に支払われる。

英国

報告型ファンド(Reporting Funds)

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

<http://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>より入手可能である。

その他の取引税

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

源泉徴収税

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

9. 投資顧問会社

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

すべての投資顧問会社は、ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーにより直接任命されている。すべての副投資顧問会社は関連する投資顧問会社により任命されている。これらのうちの数社は、投資顧問会社として

以下の会社に業務の一部を再委託している。ブラックロック・ジャパン株式会社(以下「BLK J a p」という。)、ブラックロック・アセット・マネジメント・ノースアジア・リミテッド(以下「BAMNA」という。)およびブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(以下「BLK Aus」という。)

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ドラゴン・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・グロース・リーダーズ・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BSL	-
アジア・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BSL、 BIMLLC	BAMNA、 BLKAus
アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
チャイナ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA
チャイナ・ファンド	BIMUK	BAMNA
チャイナ・インパクト・ファンド*	BIMUK	BAMNA
チャイナ・イノベーション・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド(1)	BSL	-
サーキュラー・エコノミー・ファンド	BIMUK	-
クライメイト・アクション・エクイティ・ファン*	BIMUK	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド*	BIMUK	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	BIMUK	-
ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ ファンド*	BIMUK	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、 BSL	BAMNA、 BIMAL
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・ファンド(2)	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFMLLC	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	BAMNA
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド*	BFM、BIMUK	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド*	BIMUK、BIMLLC、 BSL、BFM	BAMNA
ESGマルチアセット・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BFM、BSL	BIMAL
ESGシステマティック・マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド(2)	BIMLLC、BIMUK、 BFM	-
ユーロ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・マーケット・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	BIMUK	-
フィンテック・ファンド	BIMUK	-
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BLKAus
フューチャー・コンシューマー・ファンド*	BIMUK	-
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC、BSL	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	BIMAL
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	-
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、 BSL	BAMNA、 BIMAL
インバクト・ボンド・ファンド(1)*	BIMUK、BFM	-
インド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA、 BLKJap
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・ オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	BLKJap
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
マルチテーマ・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-
ニュートリション・ファンド	BIMUK	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド*	BSL	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド*	BIMUK、BSL、BFM	BLKAus
サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド(1)*	BIMUK、BIMLLC、 BSL	-
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・グローバル・インフラストラクチャー・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BLKAus
サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド(2)	BIMUK、BFM、BSL	BIMAL
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド(3)	BIMUK	-
システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド	BIMLLC	-
システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	BIMUK	-
システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド(1)*	BIMUK、BFM	-
システムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド(2)	BIMLLC	-
ユナイテッド・キングダム・ファンド	BIMUK	-
USベシック・バリュウ・ファンド	BIMLLC	-
USDル・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
USDル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BFM	-
USDル・リザーブ・ファンド	BFM	-
USDル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BFM	-
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
USガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	BFM	-
USグロース・ファンド	BIMLLC	-
USミッドキャップ・バリュウ・ファンド	BIMLLC	-
USサステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMLLC	-
ワールド・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ゴールド・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	BIMLLC	-
ワールド・マイニング・ファンド	BIMUK	-
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BIMAL
ワールド・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-

* 当該ファンドは香港では認可されておらず、2023年2月28日現在、香港では一般に公開されていない。

- (1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (2) 一時的に停止されたたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (2) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。
- (3) 販売中止になったファンド。詳細については注記1を参照のこと。

10. 関連当事者との取引

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

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

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

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

当期末において、当社の取締役であるキース・サルダニャが、以下の投資証券を保有していた。

ファンド	投資証券クラス	投資証券口数	金額
チャイナ・ボンド・ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	493	4,255英ポンド
チャイナ・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	593	8,219ユーロ
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	644	8,894英ポンド
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスD無分配投資証券	1,228	17,646米ドル
サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	409	5,697英ポンド
ワールド・マイニング・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	82	3,856英ポンド

他の取締役による当ファンドの投資証券の保有はなかった。

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

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

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

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

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

2023年2月28日現在、以下のファンドは、当ファンドの投資有価証券明細表において「」と示されており、クロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.14%に相当する。

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	通貨	時価	純資産比率 (%)
アジア・マルチアセット・ インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・ボンド・ファンド	米ドル	3,291,093	4.74
アジア・タイガー・ボンド・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・アジア・ボンド・ ファンド	米ドル	5,063,031	0.16
ダイナミック・ハイ・ インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	7,866,567	0.27
エマージング・マーケット・ ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・ コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	49,350,600	5.09
ESGグローバル・ マルチアセット・インカム・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・インパクト・ ボンド・ファンド	米ドル	26,800	0.02
フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニティーズ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	米ドル	19,388,733	0.25
グローバル・アロケーション・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	米ドル	32,662,700	0.22
グローバル・マルチアセット・ インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - USドル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	37,878,157	0.73
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サーキュラー・エコノミー・ファンド	米ドル	18,088,394	9.99
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フィンテック・ファンド	米ドル	7,071,459	3.91
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フューチャー・オブ・トランスポート・ ファンド	米ドル	3,646,744	2.01
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ネクスト・ジェネレーション・ テクノロジー・ファンド	米ドル	1,811,140	1.00
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ニュートリション・ファンド	米ドル	5,410,155	2.99
マルチテーマ・エクイティ・ ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	27,155,597	14.99

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	通貨	時価	純資産比率 (%)
サステイナブル・フィクスト・ インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エマージング・ マーケッツ・ボンド・ファンド	ユーロ	1,870,162	0.36

2023年2月28日に終了した期間において、預託銀行の関連当事者である、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌブイは、外国為替取引および通貨管理/ヘッジ・プログラムにおける当ファンドの保管銀行であった。これらの取引に関連して支払った手数料合計は6,499,770米ドルであり、平均手数料率は0.15bpsであった。預託銀行の関連当事者との総取引価額は4,300億米ドルであり、当ファンドが行ったこれら取引の合計価額の73%を占める。預託銀行の関連当事者との取引はすべて、通常の業務過程において標準的な取引条件に基づいて行われた。

その他の払戻し

当会計期間において当社の一部のファンドは、証券決済の遅延に伴い証券決済機関から当ファンドに課された課徴金について、ブラックロック・グループの関連会社から払戻しを受けた。当会計期間において当ファンドが受取った当該払戻しは、損益および純資産変動計算書の「その他の払戻し」にて開示されている。

11. コミッションの使用

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

12. デリバティブ商品

当ファンドは、英文目論見書に詳述されているとおり、デリバティブ商品を売買することがある。2023年2月28日現在において保有しているデリバティブ商品についてはファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

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

当ファンドが担保として差入れた、または保証として引渡した有価証券は当ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当該有価証券はファンドの投資有価証券明細表において「†」と示されており、2023年2月28日現在、その評価額は587,923,074米ドルである。

システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンドについて、売建コール・オプションの担保は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド、メリルリンチ・インターナショナルおよびバンク・オブ・ニューヨーク・メロン(インターナショナル)リミテッドの三者間契約に基づき差入れられる。担保はファンドの投資有価証券明細表において「^」と示されており、2023年2月28日現在、その評価額は67,508,395米ドルである。

ファンドが保証として受取った有価証券の詳細は、以下の表のとおりである。2023年2月28日現在、これらの有価証券の評価額は3,170,900米ドルである。

ファンド	額面 金額	銘柄	通貨	評価額 (単位:米ドル)
------	----------	----	----	-----------------

アジア・タイガー・ボンド・ファンド	1,503,000	United States Treasury Note/Bond 0.5% 28/2/2026	米ドル	1,299,432
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	1,454,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 31/1/2024	米ドル	1,399,986
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	349,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/3/2028	米ドル	295,677
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	71,000	United States Treasury Note/Bond 2.25% 31/12/2023	米ドル	69,601
サステナブル・エマージング・ マーケッツ・ローカル・カレンシー・ ボンド・ファンド	122,000	United States Treasury Note/Bond 0.25% 30/9/2025	米ドル	106,204

14. 現金担保

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

2023年2月28日現在の保有CFD、スワップ契約および店頭オプション取引に関連するブローカーからの/(に対する)現金担保残高は、以下の表のとおりである。先物取引現金残高は、ブローカーが保有する現金に関連しており、2023年2月28日現在、証拠金要件を満たすために一部使用されている。

ファンド	通貨	ブローカー からのCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
アジアン・グロース・リーダーズ・ ファンド	米ドル	-	-	13	-
アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	17,892,351	(3,058,927)	1,234,000	(380,279)
アジアン・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	299,902	-	141,585	(20)
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	18,562,474	(2,502,577)	278,293	(5)
チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア中 国人民元	14,144,964	(25,575,682)	86,992,067	(2,930,563)
チャイナ・ファンド	米ドル	2,610,000	-	-	-
チャイナ・インパクト・ファンド	米ドル	-	-	7	-
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド(1)	オフショア中 国人民元	-	-	1,263,656	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	ユーロ	-	-	409,903	(38,000)
コンチネンタル・ヨーロッパ・ フレキシブル・ファンド	ユーロ	-	-	1,687,807	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	17,498,737	-
エマージング・ヨーロッパ・ファンド(1)	ユーロ	-	-	-	(4)
エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	米ドル	3,839	(6,740,000)	3,832,000	(1,276,813)
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	-	(5,060,000)	295,000	(11,318)
エマージング・マーケット・エクイティ・ インカム・ファンド	米ドル	-	-	446,840	-
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	7,140,000	(240,000)	1,714,801	-
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	4,057,417	(3,577,428)	1,434,057	-
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイ ティ・ファンド	米ドル	-	-	67,093	-
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファン ド	ユーロ	-	-	3,778,206	-
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファン ド	米ドル	-	-	1,257,414	(338,805)
ESGマルチアセット・ファンド	ユーロ	26,300,000	(6,280,000)	51,807,875	(87,770)
ESGシステムティック・マルチ・アローケーション・ クレジット・ファンド(2)	米ドル	-	-	190,531	(30,128)
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	7,435,608	(1,662,807)	25,429,045	(237,094)
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	65,625,832	(7,933,085)	5,965,631	(2,100,226)
ユーロ・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	ユーロ	11,844,720	(992,330)	20,529,981	(334,673)
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	1,203,000	(36,723)	8,410	-
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	151,069,058	(13,067,634)	89,488,559	(10,169,054)

ファンド	通貨	ブローカー からのCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するCFD、 スワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	39,717,952	(20,690,103)	47,232,874	(2,430,229)
グローバル・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	2,553,405	(3,112,844)	7,646,291	(942,471)
グローバル・ダイナミック・エクイティ・ ファンド	米ドル	-	-	3,213,390	(22,686)
グローバル・ガバメント・ボンド・ ファンド	米ドル	2,296,388	(578,685)	5,578,597	(289,774)
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	5,393,000	(1,093,539)	2,536,695	(306,914)
グローバル・インフレーション・リンクド・ ボンド・ファンド	米ドル	524,563	(42,071)	630,048	(133,431)
グローバル・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	916,158	(14,640)	24,647,567	(691,346)
インバクト・ボンド・ファンド(1)	ユーロ	59,000	(20,641)	171,018	(114,270)
インディア・ファンド	米ドル	-	-	3	-
サステナブル・アジア・ボンド・ ファンド	米ドル	195,511	-	84,609	-
サステナブル・エマージング・マーケット・ブレン デッド・ボンド・ファンド	米ドル	246,565	-	91,569	(12,226)
サステナブル・エマージング・ マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	-	(2,611,076)	1,495,000	(509,266)
サステナブル・エマージング・ マーケット・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	-	(660,000)	21,000	(632)
サステナブル・エマージング・ マーケット・ローカル・カレンシー・ ボンド・ファンド	米ドル	1,687,657	(1,170,698)	380,808	-
サステナブル・フィクスト・インカム・ グローバル・オポチュニティーズ ・ファンド	ユーロ	8,309,430	(900,035)	5,832,009	(983,008)
サステナブル・グローバル・アロケーション・ファ ンド(1)	米ドル	134,683	-	817,507	-
サステナブル・グローバル・ボンド・ インカム・ファンド	米ドル	267,305	(13,185)	950,000	(208,103)
サステナブル・ワールド・ボンド・ ファンド(2)	米ドル	17,419,467	(590,489)	7,991,329	(82,743)
システムティック・チャイナ・A株式・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	-	-	1,164,468	(3)
システムティック・グローバル・ エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	173,800,833	(98,585)
システムティック・グローバル・サステナブル・イ ンカム・アンド・グロース・ファンド(1)	米ドル	-	-	628,074	(426)
システムティック・サステナブル・ グローバル・スモールキャップ・ファンド(2)	米ドル	-	-	329,508	-
USDル・ボンド・ファンド	米ドル	400,570	(475,884)	2,424,857	(226,486)

ファンド	通貨	ブローカーからのCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーに対するCFD、スワップ契約および店頭オプション取引現金担保残高	ブローカーからの先物取引	ブローカーに対する先物取引
USDドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	3,169,000	(682,065)	4,238,474	(186,424)
USDドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	米ドル	1,569,945	(339,911)	6,472,677	(1,224,917)
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	480,000	-	-	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	4,750,000	-	-	-

- (1) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
(2) 一時的に停止されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。
(3) 当期において名称を変更したファンド。詳細については注記1を参照のこと。

15. 配当金

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

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

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

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

16. 信用供与

JPMorgan・チェース銀行・エヌ・イー（以下「JPMorgan」という。）によって設定された21.50億米ドルの信用供与により、当社は約定済み12.25億米ドルのトランシェにこれを利用することができる。信用供与枠の一部である12.25億米ドルが、2022年4月22日付の割当通知に基づき当ファンドに割り当てられる予定である。

当ファンドは、この信用供与枠を一時的な資金調達目的で利用し、その目的には、例えば、投資家からの買戻しの資金を含むがこれに限定されない。かかる信用供与枠からの引出に関連する利息や未使用枠の手数料は、関連するファンドの資産により支払われる。新規設定ファンドには自動的に信用枠が供与されないため、併合プロセスにより合算しなければならない。かかるプロセスにおいては、新規設定ファンドの信用枠の合算を承認する

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

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

2022年9月1日から2023年2月28日までの期間において使用した信用供与枠はなかった。

17. 下引受けに係る収益

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

18. 後発事象

2023年3月2日付で、アジア・パシフィック・エクイティ・インカム・ファンドが終了した。

2023年3月3日付で、ヴァシリキ・パチャトゥリディが当社の取締役会に任命された。

[次へ](#)

アペンディクス - 投資証券クラス

投資証券クラスの設定および再開

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

設定日	ファンド	種類
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスIオフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスXオフショア中国人民元無分配英国報告型投資証券
2022年9月6日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスX米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月7日	エマージング・マーケッツ・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスSR米ドル毎月分配型投資証券
2022年9月7日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスD米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年9月14日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスXユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスSユーロ毎四半期総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスS米ドル毎四半期総収益分配型投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスSユーロ無分配投資証券
2022年9月21日	ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンド	クラスS米ドル無分配投資証券
2022年9月21日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスI英ポンド毎年分配英国報告型投資証券
2022年9月21日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスI英ポンド無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル毎四半期総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスD米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスI米ドル無分配英国報告型投資証券

設定日	ファンド	種類
2022年9月22日	システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスX米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年9月22日	システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスZ米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ毎年分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスA米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスDユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスD米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスEユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスI米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスX米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスZ米ドル無分配英国報告型投資証券
2022年10月4日	サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	クラスZユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスAユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスDユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスIユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスXユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスX米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスZユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月6日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスZユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月12日	エマージング・マーケット・インバクト・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	クラスIユーロ無分配英国報告型投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・アジアン・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・アジアン・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンディッド・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券

設定日	ファンド	種類
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2022年10月12日	サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスZ米ドル・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスZ米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年10月19日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスZオフショア中国人民元無分配投資証券
2022年10月19日	サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月19日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月19日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	USガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2022年10月19日	USガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2022年10月19日	ワールド・エネルギー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月19日	ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月19日	ワールド・ゴールド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	チャイナ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	USベーシック・バリュー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年10月26日	ワールド・テクノロジー・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
2022年11月23日	エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2022年11月23日	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年1月4日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスD米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2023年1月18日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年1月18日	ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	クラスXカナダ・ドル無分配投資証券
2023年2月1日	アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券

設定日	ファンド	種類
2023年2月1日	アジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	デベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	デベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月1日	USサステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZユーロ無分配投資証券
2023年2月1日	USサステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券
2023年2月15日	インバクト・ボンド・ファンド	クラスEユーロ無分配投資証券
2023年2月15日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券

発行済投資証券クラス

2023年2月28日現在、当社は以下の投資証券クラスを発行している。二つ以上の取引通貨があるファンドの場合、追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

クラスA

クラスA毎年総収益分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスAスイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA毎年分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラスA毎年分配英国報告型投資証券	クラスA安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスA豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスAカナダ・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA毎日分配型投資証券	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA毎日分配英国報告型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎日分配英国報告型投資証券	クラスA香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA毎月総収益分配型投資証券	クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスA毎月分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスAトータル・リターン分配型投資証券
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA豪ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスAカナダ・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスA香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスA豪ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA豪ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券
クラスA米ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラスA無分配投資証券
クラスA毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスAスイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスAカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA毎四半期分配型投資証券	クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスA豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA香港ドル無分配投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスAユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA円ヘッジ無分配投資証券
クラスA英ポンド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスAポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ無分配投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券	クラスA無分配英国報告型投資証券
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスA豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	クラスA米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA1

クラスA1毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA1毎四半期分配型投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスA1無分配投資証券

クラスA1ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC

クラスC毎日分配型投資証券

クラスCユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券

クラスC毎月分配型投資証券

クラスC毎四半期総収益分配型投資証券

クラスCシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期
総収益分配型投資証券

クラスC毎四半期分配型投資証券

クラスC安定毎月総収益分配型投資証券

クラスC無分配投資証券

クラスCユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスC無分配英国報告型投資証券

クラスD

クラスD毎年総収益分配型投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型
投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券

クラスD毎年総収益分配英国報告型投資証券

クラスD毎年分配型投資証券

クラスDカナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスD毎年分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD毎月分配型投資証券

クラスD豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD毎月分配英国報告型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD毎四半期総収益分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期
総収益分配型投資証券

クラスD毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配
英国報告型投資証券クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配
英国報告型投資証券クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配
英国報告型投資証券

クラスD毎四半期分配型投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月
総収益分配型投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスD基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスD無分配投資証券

クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスDオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスD香港ドル無分配投資証券

クラスDポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券

クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスD無分配英国報告型投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスDオフショア中国人民元・ヘッジ無分配英国報告型
投資証券

クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスDスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスE

クラスE 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスE 毎四半期分配型投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスE安定毎月総収益分配型投資証券

クラスE基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスE無分配投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスE英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスEポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券

クラスE米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスE無分配英国報告型投資証券

クラスEユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスI*

クラスI 毎年総収益分配型投資証券

クラスI 毎年分配型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスI 毎年分配英国報告型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスI米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスI 毎月総収益分配型投資証券

クラスI 毎月分配型投資証券

クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスI 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスI 毎四半期分配型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスI円ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスI 毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスIスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスI安定毎月総収益分配型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスI米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスI基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスI無分配投資証券

クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券

クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスI円ヘッジ無分配投資証券

クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券

クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスI米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスI無分配英国報告型投資証券

クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスI米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスJ*

クラスJ 毎月分配型投資証券

クラスJ 無分配投資証券

クラスS

クラスS 毎年分配型投資証券

クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスS英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスS英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスSシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスS 毎四半期分配型投資証券
 クラスS 毎四半期総収益分配型投資証券
 クラスS 無分配投資証券
 クラスS スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスS 無分配英国報告型投資証券
 クラスS スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスS ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスS 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスSI

クラスSI 無分配投資証券

クラスSI 米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスSR

クラスSR 毎年総収益分配英国報告型投資証券
 クラスSR 毎年分配英国報告型投資証券
 クラスSR 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスSR 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスSR 毎月分配型投資証券
 クラスSR 毎月分配英国報告型投資証券
 クラスSR 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券
 クラスSR 安定毎月総収益分配型投資証券
 クラスSR 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスSR ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
 クラスSR 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
 クラスSR シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
 クラスSR 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
 クラスSR 無分配投資証券
 クラスSR 無分配英国報告型投資証券
 クラスSR ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスSR 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスX*

クラスX 毎年分配型投資証券
 クラスX ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券
 クラスX 毎年分配英国報告型投資証券
 クラスX 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスX 毎月分配型投資証券
 クラスX 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券
 クラスX ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券
 クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券
 クラスX 毎四半期総収益分配英国報告型投資証券
 クラスX 毎四半期分配型投資証券
 クラスX スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスX ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスX 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券
 クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券
 クラスX ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスX トータル・リターン分配型投資証券
 クラスX 無分配投資証券
 クラスX 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX カナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX 円ヘッジ無分配投資証券
 クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスX 無分配英国報告型投資証券
 クラスX 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスZ

クラスZ 無分配投資証券
 クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
 クラスZ ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスZ 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスZ 無分配英国報告型投資証券
 クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスZ1

クラスZ1米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスZ1安定毎月総収益分配型投資証券

クラスZ1無分配投資証券

クラスZ1ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスZ1米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスZ1無分配英国報告型投資証券

クラスZ1ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

* 機関投資家が購入可能

5【販売及び買戻しの実績】

2023年3月末日前1年間におけるファンド証券の販売および買戻しの実績ならびに2023年3月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

クラスA無分配投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2022年4月1日～ 2023年3月31日	132,715 (132,715)	442,327 (441,047)	864,533 (850,433)

(注1) ()内の数は、本邦外における販売、買戻しおよび発行済口数である。

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