

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年 7 月31日

【発行者名】 フォーカス・シキャブ
(Focused SICAV)

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

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL - 1855、
J.F.ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg,
Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
フォーカス・シキャブ
- グローバル・ボンド
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル
(Focused SICAV
- Global Bond
- High Grade Bond USD
- High Grade Long Term Bond USD)
- US Corporate Bond Sustainable USD
- World Bank Long Term Bond USD)

本書は、EDINETコード「G11464」（フォーカス・シキャブ）と「G14176」（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF - a c c 投資証券 / ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF - a c c 投資証券）および「G14249」（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF - a c c 投資証券）を統合したものである。

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券

グローバル・ボンド

クラス米ドルF - acc投資証券

クラス円ヘッジF - acc投資証券

ハイ・グレード・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券

クラス円ヘッジF - acc投資証券

ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券

クラス円ヘッジF - acc投資証券

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

クラスF - acc投資証券

クラス円ヘッジF - acc投資証券

ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券

上限見込額は以下のとおりである。

グローバル・ボンド

クラス米ドルF - acc投資証券：14億6,480万米ドル（約1,997億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：961億3,000万円を上限とする。

ハイ・グレード・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：14億8,220万米ドル（約2,021億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：941億1,000万円を上限とする。

ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：17億8,040万米ドル（約2,427億円）を上限とする。

クラス円ヘッジF - acc投資証券：904億9,000万円を上限とする。

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

クラスF - acc投資証券：11億270万米ドル（約1,503億円）

クラス円ヘッジF - acc投資証券：870億8,000万円

ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

クラスF - acc投資証券：10億1,770万米ドル（約1,387億円）

（注1）上限見込額は、便宜上、ファンドの投資証券の2023年2月末日現在の1口当たりの純資産価格に基づいて算出されている（グローバル・ボンド・クラス米ドルF - acc投資証券については146.48米ドル（約19,970円）に1,000万口を、グローバル・ボンド・クラス円ヘッジF - acc投資証券については9,613円に1,000万口を、ハイ・グレード・ボンド・米ドル・クラスF - acc投資証券については148.22米ドル（約20,207円）に1,000万口を、ハイ・グレード・ボンド・米ドル・クラス円ヘッジF - acc投資証券については9,411円に1,000万口を、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル・クラスF - acc投資証券については178.04米ドル（約24,272円）に1,000万口を、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル・クラス円ヘッジF - acc投資証券については9,049円に1,000万口を、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル・クラスF - acc投資証券については110.27米ドル（約15,033円）に1,000万口を、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル・クラス円ヘッジF - acc投資証券については8,708円に1,000万口を、ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル・クラスF - acc投資証券については101.77米ドル（約13,874円）に1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。）。

（注2）米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2023年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝136.33円）による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年4月28日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）の関係情報を新たな情報により更新および追加するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正の内容】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

半期報告書の記載内容は以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

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

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

（１）主要な経営指標等の推移

（フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2021年４月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年４月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年４月末日 に終了する 中間会計年度末
（a）営業収益 ^{（１）}	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23	- 131,252,349.23	52,655,555.95
（b）経常利益金額または 経常損失金額	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23	- 131,252,349.23	52,655,555.95
（c）当期純利益金額または 当期純損失金額	- 1,599,508.40	- 10,874,184.59	- 75,031,015.23	- 131,252,349.23	52,655,555.95
（d）出資総額 ^{（２）}	633,524,759.66	639,116,719.43	561,673,497.74	489,370,994.22	563,494,469.14
（e）発行済投資口総数 （クラス米ドルF-acc投資証券）	1,566,856.504口	1,612,030.485口	1,525,890.076口	1,422,679.471口	1,461,804.292口
（クラス円ヘッジF-acc投資証券）	434,674.208口	488,147.208口	543,409.208口	610,933.208口	889,515.500口
（f）純資産額	633,524,759.66	639,116,719.43	561,673,497.74	489,370,994.22	563,494,469.14
（g）資産総額	634,942,088.11	642,599,292.21	565,873,989.24	496,344,088.45	566,270,894.00
（h）１口当たり純資産価格 （クラス米ドルF-acc投資証券）	162.68	163.28	151.80	142.75	150.12
（クラス円ヘッジF-acc投資証券）	11,018円	11,044円	10,244円	9,521円	9,771円
（i）１口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 （クラス米ドルF-acc投資証券）	- 1.62	- 1.01	- 11.71	- 22.08	7.18
（クラス円ヘッジF-acc投資証券）	- 5.42円	- 8.78円	- 17.18円	- 29.64円	4.44円
（j）分配総額	583,121.30	583,121.30	553,230.65	553,230.65	502,657.08
（k）１口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
（l）自己資本比率	99.78%	99.46%	99.26%	98.60%	99.51%
（m）自己資本利益率 ^{（３）} （クラス米ドルF-acc投資証券）	1.83%	- 0.60%	- 6.69%	- 12.57%	- 1.11%
（クラス円ヘッジF-acc投資証券）	1.42%	- 0.94%	- 7.02%	- 13.79%	- 4.62%

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

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

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

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

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

（フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89	- 308,641,886.92	166,076,473.45
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89	- 308,641,886.92	166,076,473.45
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	14,593,949.72	- 14,458,046.57	- 176,409,579.89	- 308,641,886.92	166,076,473.45
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,175,651,219.97	1,349,798,222.03	1,757,025,004.99	2,769,676,669.98	1,974,834,530.78
(e) 発行済投資口総数					
（クラスF - acc投資証券）	2,969,192.534口	3,518,934.573口	4,228,885.081口	7,512,225.343口	4,943,631.818口
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	90,231.000口	100,247.000口	160,397.000口	156,900.000口	136,064.000口
(f) 純資産額	1,175,651,219.97	1,349,798,222.03	1,757,025,004.99	2,769,676,669.98	1,974,834,530.78
(g) 資産総額	1,186,420,663.99	1,362,943,018.11	1,814,445,503.63	2,778,839,418.74	1,994,227,084.33
(h) 1口当たり純資産価格					
（クラスF - acc投資証券）	158.14	157.33	150.23	146.46	151.82
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	10,359円	10,295円	9,810円	9,450円	9,552円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額					
（クラスF - acc投資証券）	- 0.21	- 1.05	- 10.19	- 8.83	5.36
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	- 4.83円	- 9.07円	- 11.38円	- 24.05円	7.86円
(j) 分配総額	1,799,162.13	- 1,799,162.13	1,495,530.58	- 1,495,530.58	3,967,559.85
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.09%	99.04%	96.84%	99.67%	99.03%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾					
（クラスF - acc投資証券）	0.45%	- 0.64%	- 5.00%	- 6.91%	1.06%
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	0.01%	- 0.92%	- 5.30%	- 8.21%	- 2.63%

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

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

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46	- 930,113,142.70	473,858,628.42
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46	- 930,113,142.70	473,858,628.42
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 15,553,964.25	- 52,020,297.55	- 499,403,795.46	- 930,113,142.70	473,858,628.42
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,883,195,339.07	2,294,398,605.83	3,718,475,442.60	4,251,345,080.56	3,516,023,390.26
(e) 発行済投資口総数					
（クラスF - acc投資証券）	3,170,000.782口	4,375,187.469口	7,631,786.057口	9,898,397.723口	6,957,467.703口
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	202,609.000口	235,162.000口	346,604.000口	336,555.000口	296,384.000口
(f) 純資産額	1,883,195,339.07	2,294,398,605.83	3,718,475,442.60	4,251,345,080.56	3,516,023,390.26
(g) 資産総額	1,914,220,515.82	2,324,504,005.61	3,826,394,458.84	4,300,368,637.20	3,563,455,601.76
(h) 1口当たり純資産価格					
（クラスF - acc投資証券）	202.75	203.60	184.96	173.57	185.60
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	10,681円	10,708円	9,700円	8,978円	9,344円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額					
（クラスF - acc投資証券）	- 5.22	- 4.08	- 18.63	- 26.19	16.23
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	- 8.05円	- 11.08円	- 15.81円	- 31.05円	9.37円
(j) 分配総額	6,927,412.32	6,927,412.32	5,681,392.75	5,681,392.75	8,552,600.33
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.38%	98.38%	97.18%	98.86%	98.67%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾					
（クラスF - acc投資証券）	- 1.83%	- 2.35%	- 8.77%	- 14.75%	0.35%
（クラス円ヘッジF - acc投資証券）	- 2.30%	- 2.75%	- 9.18%	- 16.16%	- 3.67%

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

（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	29,741,342.69	21,827,342.63	- 245,867,590.97	- 392,253,088.84	201,960,611.04
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	29,741,342.69	21,827,342.63	- 245,867,590.97	- 392,253,088.84	201,960,611.04
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	29,741,342.69	21,827,342.63	- 245,867,590.97	- 392,253,088.84	201,960,611.04
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,470,399,321.49	1,785,038,748.14	1,653,392,525.45	1,530,016,585.03	1,718,223,339.61
(e) 発行済投資口総数					
(クラスF - acc投資証券)	10,359,913.296口	4,697,522.917口	4,858,129.171口	4,430,677.383口	4,444,732.866口
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	-	115,407.000口	307,960.000口	315,140.000口	301,372.000口
(f) 純資産額	3,470,399,321.49	1,785,038,748.14	1,653,392,525.45	1,530,016,585.03	1,718,223,339.61
(g) 資産総額	3,472,122,208.94	1,786,426,299.31	1,698,018,554.47	1,558,427,225.54	1,805,470,467.57
(h) 1口当たり純資産価格					
(クラスF - acc投資証券)	120.71	121.27	111.83	106.61	113.35
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	-	9,895円	9,090円	8,565円	8,868円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額					
(クラスF - acc投資証券)	- 0.27	2.56	- 9.87	- 15.91	6.88
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	-	- 3.63円	- 11.24円	- 23.24円	7.85円
(j) 分配総額	5,045,190.18	5,045,190.18	8,069,998.16	8,069,998.16	10,354,537.78
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.95%	99.92%	97.37%	98.18%	95.17%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾					
(クラスF - acc投資証券)	4.76%	0.56%	- 7.36%	- 12.09%	1.36%
(クラス円ヘッジF - acc投資証券)	-	- 1.05%	- 9.10%	- 13.44%	- 2.44%

（注）フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルは2016年11月8日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2016年11月8日に運用が開始され、クラス円ヘッジF - acc投資証券は2021年9月13日に運用が開始された。

（フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2021年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2021年10月末日 に終了する 会計年度末	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 21,845,117.03	- 55,141,259.91	- 361,752,016.82	- 573,331,727.97	238,090,901.60
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	- 21,845,117.03	- 55,141,259.91	- 361,752,016.82	- 573,331,727.97	238,090,901.60
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 21,845,117.03	- 55,141,259.91	- 361,752,016.82	- 573,331,727.97	238,090,901.60
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,326,293,487.91	2,069,125,942.00	2,452,508,305.33	2,039,391,807.27	2,254,159,589.48
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - acc投資証券)	3,560,728.837口	6,204,441.665口	7,153,999.415口	6,291,999.182口	6,305,616.293口
(f) 純資産額	1,326,293,487.91	2,069,125,942.00	2,452,508,305.33	2,039,391,807.27	2,254,159,589.48
(g) 資産総額	1,345,921,581.01	2,152,480,783.80	2,520,103,661.41	2,047,264,759.38	2,266,933,036.13
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	116.56	117.17	106.35	99.73	106.18
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF - acc投資証券)	- 2.65	- 1.96	- 10.50	- 18.49	6.50
(j) 分配総額	325,890.18	325,890.18	435,081.97	435,081.97	448,615.55
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.54%	96.13%	97.32%	99.62%	99.44%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - acc投資証券)	- 3.68%	- 3.02%	- 8.76%	- 14.88%	- 0.16%

（注）フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドルは2018年2月14日に運用を開始し、クラスF - acc投資証券は2018年2月14日に運用が開始された。

(2) 外国投資法人の出資総額

2023年5月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数（口）	
	千米ドル	百万円		
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	550,910.38	77,001	クラス米ドル F-acc投資証券	1,455,115.267
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	909,590.500
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド ・米ドル	1,879,385.72	262,682	クラス F-acc投資証券	4,934,298.578
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	134,634.000
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド ・米ドル	3,779,128.91	528,209	クラス F-acc投資証券	7,655,642.988
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	293,434.000
フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	1,672,599.29	233,779	クラス F-acc投資証券	4,401,152.526
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	301,372.000
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	2,326,392.53	325,160	クラス F-acc投資証券	6,724,177.409

(3) 主要な投資主の状況

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

(4) 役員 の 状 況

(2023年 5 月 末 日 現 在)

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

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

(5) そ の 他

a . 定 款 の 変 更

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

b . 事 業 譲 渡 ま た は 事 業 譲 受

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

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

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

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

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

「本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散」の項に記載される状況の下で、本投資法人の取締役会は、サブ・ファンドまたは投資証券クラスの資産を本投資法人の別の既存のサブ・ファンドもしくは投資証券クラス、または2010年法パート 一もしくは海外UCITSに関する2010年法の規則に基づきルクセンブルグの別のUCIもしくは海外のUCITSに配分することおよび、（必要な場合、分裂または統合により、および投資主の比例的権限に相当する金額の支払を通じ）当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの投資証券を別のサブ・ファンドまたは別の投資証券クラスの投資証券として指定変更することを決定することができる。

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

合併の決定は有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第3 管理及び運営、3 投資主・外国投資法人債権者の権利等（1）投資主・外国投資法人債権者の権利（f） 報告書を受領する権利」の項に記載されている方法で投資主に通知する。決定が公告されてから30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、有価証券報告書「第二部 外国投資法人の詳細情報 第2 手

続等 2 買戻し手続等」と題する項に記載する所定の手続きに従って、買戻手数料またはその他の管理料金を支払わずに、その時点の純資産価額で買い戻す権限を有する。買戻しのために提出されなかった投資証券は、交換比率が計算される日に計算した関係するサブ・ファンドの純資産価額に基づいて交換される。集合的投資ファンド（契約型オープン投資信託）の受益証券を割り当てる場合、上記の決定は割当てに賛成票を投じた投資主だけを拘束する。

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出日前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼ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。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド)

(2023年 5 月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
-------	-------	-----------	---------

債券	アメリカ合衆国	122,010,185.75	21.91
	中国	48,551,325.16	8.72
	日本	33,148,587.46	5.95
	フランス	26,289,161.78	4.72
	イギリス	19,112,316.92	3.43
	カナダ	17,696,328.23	3.18
	オーストラリア	16,926,463.94	3.04
	ニュージーランド	15,958,237.95	2.87
	韓国	14,388,531.38	2.58
	スペイン	13,657,021.90	2.45
	ドイツ	11,784,569.73	2.12
	イタリア	9,313,483.94	1.67
	アイルランド	9,072,264.33	1.63
	オランダ	8,641,956.69	1.55
	ルクセンブルグ	6,185,546.26	1.11
	ベルギー	4,708,834.90	0.85
	インド	3,226,301.87	0.58
	スイス	3,122,860.96	0.56
	ケイマン諸島	2,650,100.82	0.48
	スロベニア	2,604,585.10	0.47
	ベネズエラ	2,486,221.55	0.45
	ノルウェー	2,088,028.17	0.38
	シンガポール	1,815,270.38	0.33
	ポーランド	1,781,851.89	0.32
	国際機関	1,699,402.16	0.31
	スウェーデン	1,697,284.78	0.30
	サウジアラビア	1,609,224.37	0.29
	トルコ	1,569,600.00	0.28
	ルーマニア	1,232,873.40	0.22
	メキシコ	1,168,779.42	0.21
	チリ	1,090,915.63	0.20
	フィンランド	850,278.88	0.15
	タイ	546,675.01	0.10
	バミューダ	546,657.43	0.10
	オーストリア	528,172.60	0.09
	香港	446,817.25	0.08
	チェコ共和国	402,505.10	0.07
	デンマーク	295,048.28	0.05
	ペルー	255,243.75	0.05
	エジプト	189,498.75	0.03
	エクアドル	139,335.16	0.03
	小計	411,488,349.03	73.91

不動産担保証券、 アセットバック証券 およびその他の ディスカウント債券	アメリカ合衆国	58,419,773.76	10.49
投資信託	ルクセンブルグ	3,609,189.10	0.65
ポートフォリオ合計		473,517,311.89	85.05
現金・その他資産		83,249,660.49	14.95
資産総額		556,766,972.38	100.00
負債総額		5,856,590.93	1.05
合計（純資産総額）		550,910,381.45 （約77,001百万円）	98.95

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

（フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル）

（2023年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
債券	アメリカ合衆国	1,122,520,745.08	58.04
	国際機関	214,924,525.91	11.11
	カナダ	107,821,700.45	5.57
	ドイツ	73,140,541.37	3.78
	フランス	53,219,411.23	2.75
	スウェーデン	46,047,625.31	2.38
	オーストラリア	41,519,282.68	2.15
	オランダ	30,596,237.75	1.58
	韓国	29,772,322.00	1.54
	ノルウェー	29,249,193.71	1.51
	アラブ首長国連邦	25,005,558.75	1.29
	シンガポール	22,426,073.31	1.16
	日本	12,886,805.76	0.67
	フィンランド	11,853,682.69	0.61
	カタール	9,569,062.50	0.49
	香港	7,152,787.90	0.37
	オーストリア	6,925,394.61	0.36
	イギリス領 ヴァージン諸島	6,290,830.00	0.33
	ベルギー	6,281,146.06	0.32
	イギリス	5,797,931.40	0.30
	ケイマン諸島	4,691,248.00	0.24
	サウジアラビア	730,304.00	0.04
ポートフォリオ合計		1,868,422,410.47	96.61
現金・その他資産		65,628,316.75	3.39
資産総額		1,934,050,727.22	100.00
負債総額		54,665,006.48	2.83
合計（純資産総額）		1,879,385,720.74 （約262,682百万円）	97.17

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

（2023年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（％）
債券	アメリカ合衆国	2,551,252,042.55	66.96
	国際機関	499,818,333.42	13.12
	カナダ	134,746,013.62	3.54
	アラブ首長国連邦	109,063,196.00	2.86
	カタール	58,675,937.50	1.54
	香港	54,083,911.68	1.42
	ノルウェー	50,671,575.37	1.33
	オランダ	46,224,458.62	1.21
	フランス	44,797,204.86	1.18
	ドイツ	43,738,415.79	1.15
	韓国	37,512,347.35	0.98
	オーストラリア	33,485,068.42	0.88
	シンガポール	19,133,065.24	0.50
	フィンランド	16,286,520.00	0.43
	イギリス領 ヴァージン諸島	16,163,743.75	0.42
	ベルギー	7,870,257.52	0.21
	小計	3,723,522,091.69	97.72
投資信託	アイルランド	25,000,000.00	0.66
ポートフォリオ合計		3,748,522,091.69	98.38
現金・その他資産		61,824,370.37	1.62
資産総額		3,810,346,462.06	100.00
負債総額		31,217,549.65	0.82
合計（純資産総額）		3,779,128,912.41 （約528,209百万円）	99.18

（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

（2023年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率 （％）
債券	アメリカ合衆国	1,202,005,718.88	71.34
	イギリス	126,903,688.26	7.53
	カナダ	70,293,663.49	4.17
	オーストラリア	56,404,480.45	3.35
	日本	41,595,274.53	2.47
	オランダ	38,933,588.93	2.31
	シンガポール	20,525,272.00	1.22
	アイルランド	19,561,084.34	1.16
	ケイマン諸島	12,922,118.94	0.77
	フランス	11,669,343.13	0.69
	ノルウェー	11,337,201.88	0.67
	多国籍	8,353,852.81	0.50
	バミューダ	8,295,650.00	0.49
	ドイツ	6,023,978.64	0.36
	スウェーデン	5,753,974.26	0.34
	デンマーク	5,506,826.98	0.33
	ルクセンブルグ	4,641,069.20	0.28
	スペイン	4,249,107.63	0.25
	小計	1,654,975,894.35	98.22
投資信託	ルクセンブルグ	3,737,768.40	0.22
従来型オプション	アメリカ合衆国	86,362.50	0.01
ポートフォリオ合計		1,658,800,025.25	98.45
現金・その他資産		26,161,550.05	1.55
資産総額		1,684,961,575.30	100.00
負債総額		12,362,285.66	0.73
合計 （純資産総額）		1,672,599,289.64 （約233,779百万円）	99.27

(フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(2023年5月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率 （％）
債券	国際機関	2,342,210,310.88	100.60
ポートフォリオ合計		2,342,210,310.88	100.60
現金・その他資産		- 13,996,062.35	- 0.60
資産総額		2,328,214,248.53	100.00
負債総額		1,821,715.79	0.08
合計 (純資産総額)		2,326,392,532.74 (約325,160百万円)	99.92

(2) 運用実績

純資産等の推移

2023年5月末日までの1年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

(フォーカス・シキャブ・グローバル・ボンド)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラス米ドル F - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2022年6月末日	544,799.95	76,147	542,652.07	75,846	148.12	20,703	9,973
7月末日	554,645.59	77,523	551,085.67	77,025	151.99	21,244	10,213
8月末日	533,012.15	74,499	531,369.24	74,269	148.23	20,718	9,937
9月末日	507,265.18	70,900	503,499.44	70,374	143.35	20,036	9,588
10月末日	496,344.09	69,374	489,370.99	68,399	142.75	19,952	9,521
11月末日	517,108.85	72,276	514,091.57	71,855	146.54	20,482	9,734
12月末日	521,286.45	72,860	520,287.75	72,721	145.19	20,293	9,604
2023年1月末日	534,418.44	74,696	531,794.77	74,329	149.15	20,847	9,817
2月末日	543,197.53	75,923	534,820.53	74,752	146.48	20,474	9,613
3月末日	560,868.72	78,393	557,646.80	77,942	149.42	20,884	9,763
4月末日	566,270.89	79,148	563,494.47	78,760	150.12	20,982	9,771
5月末日	556,766.97	77,819	550,910.38	77,001	149.56	20,904	9,682

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

(フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル)

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2022年6月末日	3,144,935.03	439,568	3,130,449.76	437,543	150.09	20,978	9,782
7月末日	3,103,569.92	433,786	3,096,298.83	432,770	151.34	21,153	9,844
8月末日	2,005,888.99	280,363	2,001,186.79	279,706	149.32	20,870	9,688
9月末日	2,888,804.48	403,768	2,864,920.92	400,430	146.81	20,520	9,501
10月末日	2,778,839.42	388,398	2,769,676.67	387,118	146.46	20,471	9,450
11月末日	1,857,648.13	259,643	1,854,286.24	259,174	148.18	20,711	9,529
12月末日	1,842,026.41	257,460	1,839,120.06	257,054	148.26	20,722	9,488
2023年1月末日	1,621,876.59	226,690	1,619,800.95	226,400	149.95	20,959	9,553
2月末日	1,563,116.57	218,477	1,556,298.23	217,524	148.22	20,717	9,411
3月末日	1,692,727.73	236,593	1,687,473.87	235,858	151.11	21,121	9,546
4月末日	1,994,227.08	278,733	1,974,834.53	276,023	151.82	21,220	9,552
5月末日	1,934,050.73	270,322	1,879,385.72	262,682	151.12	21,122	9,458

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

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2022年6月末日	4,070,742.35	568,968	4,060,211.06	567,496	184.16	25,740	9,630
7月末日	4,107,027.94	574,039	4,098,335.27	572,824	189.31	26,460	9,876
8月末日	4,504,792.30	629,635	4,495,684.60	628,362	183.05	25,585	9,520
9月末日	4,376,174.25	611,658	4,352,904.37	608,405	175.41	24,517	9,101
10月末日	4,300,368.64	601,063	4,251,345.08	594,211	173.57	24,260	8,978
11月末日	4,283,170.12	598,659	4,266,426.80	596,318	179.19	25,045	9,230
12月末日	4,289,835.51	599,590	4,281,417.52	598,414	177.73	24,841	9,108
2023年1月末日	3,415,241.87	477,348	3,410,684.01	476,711	183.15	25,599	9,342
2月末日	3,291,852.89	460,102	3,285,895.42	459,270	178.04	24,885	9,049
3月末日	4,036,877.83	564,234	4,024,089.00	562,447	184.04	25,723	9,304
4月末日	3,563,455.60	498,064	3,516,023.39	491,435	185.60	25,941	9,344
5月末日	3,810,346.46	532,572	3,779,128.91	528,209	183.48	25,645	9,187

（フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF - acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F - acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	米ドル	円	米ドル	円	円
2022年6月末日	1,597,833.53	223,329	1,592,726.65	222,615	110.57	15,454	8,970
7月末日	1,613,508.41	225,520	1,601,631.95	223,860	113.17	15,818	9,162
8月末日	1,540,208.22	215,275	1,536,821.87	214,802	110.87	15,496	8,955
9月末日	1,452,550.05	203,023	1,442,604.25	201,633	107.06	14,964	8,622
10月末日	1,558,427.23	217,821	1,530,016.59	213,850	106.61	14,901	8,565
11月末日	1,642,208.57	229,531	1,629,728.60	227,787	109.71	15,334	8,776
12月末日	1,648,211.18	230,370	1,646,752.18	230,167	109.54	15,310	8,721
2023年1月末日	1,707,431.09	238,648	1,692,995.54	236,630	112.50	15,724	8,915
2月末日	1,673,211.27	233,865	1,640,148.16	229,244	110.27	15,412	8,708
3月末日	1,810,509.93	253,055	1,807,505.91	252,635	112.62	15,741	8,851
4月末日	1,805,470.47	252,351	1,718,223.34	240,156	113.35	15,843	8,868
5月末日	1,684,961.58	235,507	1,672,599.29	233,779	112.55	15,731	8,762

（フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスF - acc投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2022年6月末日	2,322,279.23	324,585	2,313,981.56	323,425	106.05	14,823
7月末日	2,319,242.95	324,161	2,317,775.59	323,955	108.73	15,197
8月末日	2,211,334.94	309,078	2,208,558.77	308,690	104.99	14,674
9月末日	2,111,464.13	295,119	2,100,110.66	293,532	100.74	14,080
10月末日	2,047,264.76	286,146	2,039,391.81	285,046	99.73	13,939
11月末日	2,214,146.19	309,471	2,192,420.89	306,435	102.74	14,360
12月末日	2,194,576.04	306,736	2,193,112.77	306,531	101.66	14,209
2023年1月末日	2,253,062.27	314,911	2,249,485.80	314,411	104.71	14,635
2月末日	2,162,037.80	302,188	2,156,101.33	301,358	101.77	14,224
3月末日	2,230,277.78	311,726	2,227,486.86	311,336	105.39	14,730
4月末日	2,266,933.04	316,849	2,254,159.59	315,064	106.18	14,841
5月末日	2,328,214.25	325,415	2,326,392.53	325,160	104.94	14,667

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

分配の推移

グローバル・ボンド - クラス米ドルF - acc投資証券	該当事項なし。
グローバル・ボンド - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。
USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル - クラス円ヘッジF - acc投資証券	該当事項なし。
ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル - クラスF - acc投資証券	該当事項なし。

自己資本利益率（収益率）の推移

2022年6月1日から2023年5月末日までの1年間の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

	収益率（％）（注）	
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	クラス米ドルF-acc投資証券	- 1.00
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	- 4.91
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 0.07
	クラス円ヘッジF - acc投資証券	- 4.12
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 1.61
	クラス円ヘッジF - acc投資証券	- 5.95
フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 0.10
	クラス円ヘッジF - acc投資証券	- 4.22
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	クラスF - acc投資証券	- 2.08

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 2023年5月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計金額を加えた額）

b = 2022年5月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（３）投資リスク

当中間計算期間において、2023年4月28日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

U B S ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ（「管理会社」）

資本金（株主資本）の額

2023年4月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ（約20億円）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝150.04円）による。

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

資本金（株主資本）の額

2023年4月末日現在の株主資本総額は、500,000スイスフラン（約7,716万円）

（注）スイスフランの円貨換算は、便宜上、2023年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1スイスフラン＝154.31円）による。

U B S アセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）（「投資運用会社」）

資本金（株主資本）の額

2023年4月末日現在の資本金額は、10,167,024米ドル（約14億円）

(2) 大株主の状況

U B S ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2023年4月末日現在）

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

U B S アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

（2023年4月末日現在）

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

U B S アセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）

（2023年4月末日現在）

名称	住所	所有株式数 （株）	比率 （％）
U B S アメリカス・インク （UBS Americas Inc.）	コーポレーション・サービス・ カンパニー、251 リトル・フォール ズ・ドライブ、ウィルミントン、 デラウェア州、アメリカ合衆国	50	100

(3) 役員の状況

U B S ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（ 2023年 4 月末日現在 ）

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年 1 月 1 日	U B S アセット・マネジ メント・スイス・エイ・ ジー、チューリッヒ、ス イス ヘッド・オブ・プロダク ト	該当なし
フランチェスカ・ ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクターノ ボード・メンバー	2019年12月 5 日	U B S ファンド・マネジ メント（ルクセンブル グ）エス・エイ、ルク センブルグ、チーフ・エ グゼクティブ・オフィ サー	該当なし
ウジェーヌ・ デル・シオッポ (Eugène del Cioppo)	ディレクターノ ボード・メンバー	2022年 9 月 2 日	U B S ファンド・マネジ メント（スイス）エイ ・ジー、バーゼル、ス イス チーフ・エグゼクティ ブ・ オフィサー	該当なし
アン - シャルロット・ ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	インディペンデ ント・ディレク ターノボード・メ ンバー	2022年 1 月 1 日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデ ント・ディレク ターノボード・メ ンバー	2022年 3 月 8 日	U B S アセット・マネジ メント（ドイツランダ ン） ゲーエムベーハー、 フランクフルト、ドイ ツ インスティテューショ ナル・クライアント・カ バ レッジ	該当なし

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

（2023年4月末日現在）

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

UBSアセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）

（2023年4月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有株式
ジョン・クリーグ (John Krieg)	ディレクター	2021年6月14日就任	非公開
ジェームス・ポーチャー (James Poucher)	チェア・オブ・ザ・ボ ード/ディレクター	2022年1月1日就任	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

U B S ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

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

2023年5月末日現在、管理会社は以下のとおり、404本のサブファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託 / 投資法人	404	479,702,090.62オーストラリア・ドル
			1,867,479,434.69カナダ・ドル
			15,154,793,483.70スイス・フラン
			4,388,558,439.29中国元
			483,955,359.27デンマーク・クローネ
			51,586,084,384.31ユーロ
			2,233,969,443.96英ポンド
			274,717,848.66香港ドル
			618,129,235,892.92日本円
			30,411,701.23シンガポール・ドル
			115,807,478,280.37米ドル

UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

2023年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）は117本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS(Lux)Bond Sicav - Convert Global(EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	3,934,596,047
2	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月26日	3,184,803,795
3	UBS(Lux)Money Market Fund - USD Sustainable	契約型投資信託	1988年11月25日	2,643,582,010
4	UBS(Lux)Institutional Fund - Equities Europe(ex UK ex Switzerland)Passive II	契約型投資信託	2020年5月13日	2,489,763,055
5	UBS(Lux)Money Market Fund - EUR Sustainable	契約型投資信託	1989年10月9日	2,240,848,231
6	UBS(Lux)Fund Solutions - Sustainable Development Bank Bonds UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2018年11月8日	2,117,511,012
7	Focused Sicav - World Bank Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2018年2月13日	2,041,811,222
8	Focused Sicav - High Grade Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2005年8月30日	1,788,799,394
9	Global Opportunities Access - Global Equities II	変動資本を有する 投資法人	2014年11月3日	1,237,015,606
10	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable(CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,186,727,395

（注1）－単位当たり純資産価格は開示していない。

（注2）上記は管理会社から提供された情報に基づく。

UBSアセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）

2023年4月末日現在、UBSアセット・マネジメント（アメリカス）インク（シカゴ）は51本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する投資法人	2008年6月30日	7,689,072,847.74
2	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する投資法人	2016年1月28日	4,459,787,842.12
3	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月9日	2,178,614,248.30
4	UBS (Lux) Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates Sustainable (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年1月30日	1,879,573,645.12
5	Focused Sicav - US Corporate Bond Sustainable USD	変動資本を有する投資法人	2016年11月7日	1,556,361,720.58
6	UBS (Lux) Equity Sicav - USA Growth (USD)	変動資本を有する投資法人	2004年10月8日	1,516,894,557.52
7	UBS (Lux) Equity Fund - Global Sustainable (USD)	契約型投資信託	1997年6月13日	783,905,233.86
8	UBS (Lux) Equity Sicav - US Total Yield Sustainable (USD)	変動資本を有する投資法人	2013年2月15日	776,438,035.33
9	UBS (Lux) Fund Solutions - J.P. Morgan USD EM IG ESG Diversified Bond UCITS ETF	変動資本を有する投資法人	2019年8月2日	768,182,738.39
10	UBS (Lux) Equity Sicav - Engage for Impact (USD)	変動資本を有する投資法人	2017年10月13日	671,839,822.37

（注1）一単位当たり純資産価格は開示していない。

（注2）上記は管理会社から提供された情報に基づく。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

b . ファンドの原文の中間財務書類は、フォーカス・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド（フォーカス・シキャブ・グローバル・ボンド、フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル、フォーカス・シキャブ・USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびフォーカス・シキャブ・ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）に関連する部分のみを翻訳している。なお、グローバル・ボンド、ハイ・グレード・ボンド・米ドル、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびワールドバンク・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。

グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc投資証券

グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc投資証券

ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券

ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券

ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券

ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc投資証券

USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券

ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券

c . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。

d . ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2023年5月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝139.77円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）資産及び負債の状況

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

純資産計算書

2023年4月30日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	541,635,686.40	75,704,420
投資有価証券、未実現評価（損）益	(64,467,854.50)	(9,010,672)
投資有価証券合計（注１）	477,167,831.90	66,693,748
現金預金、要求払預金および預託金勘定	78,156,802.64	10,923,976
その他の流動資産（マージン）	2,448,190.67	342,184
有価証券売却未収金（注１）	14,433.89	2,017
発行未収金	460,016.36	64,296
有価証券に係る未収利息	3,825,196.06	534,648
流動資産に係る未収利息	1,166.75	163
前払費用	40,245.99	64,296
金融先物に係る未実現利益（注１）	758,635.06	534,648
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	3,398,374.68	474,991
資産合計	566,270,894.00	79,147,683
負 債		
TBAモーゲージ担保証券に係る未実現損失（注１）	(11,598.08)	(1,621)
有価証券購入未払金（注１）	(1,275,596.43)	(178,290)
買戻未払金	(1,384,899.82)	(193,567)
報酬引当金（注２）	(88,913.80)	(12,427)
年次税引当金（注３）	(4,305.62)	(602)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(11,111.11)	(1,553)
引当金合計	(104,330.53)	(14,582)
負債合計	(2,776,424.86)	(388,061)
期末現在純資産	563,494,469.14	78,759,622

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産計算書

2023年4月30日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,982,677,145.56	277,118,785
投資有価証券、未実現評価（損）益	(29,706,263.56)	(4,152,044)
投資有価証券合計（注１）	1,952,970,882.00	272,966,740
現金預金、要求払預金および預託金勘定	9,646,630.68	1,348,310
その他の流動資産（マージン）	1,016,236.25	142,039
有価証券売却未収金（注１）	4,985,492.39	696,822
発行未収金	5,080,873.38	710,154
有価証券に係る未収利息	6,306,825.72	881,505
前払費用	168.49	24
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	14,219,975.42	1,987,526
資産合計	1,994,227,084.33	278,733,120
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注１）	(411,992.28)	(57,584)
有価証券購入未払金（注１）	(12,642,958.33)	(1,767,106)
買戻未払金	(5,753,998.17)	(804,236)
その他の負債	(267,182.79)	(37,344)
報酬引当金（注２）	(165,396.99)	(23,118)
年次税引当金（注３）	(15,191.04)	(2,123)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(135,833.95)	(18,986)
引当金合計	(316,421.98)	(44,226)
負債合計	(19,392,553.55)	(2,710,497)
期末現在純資産	1,974,834,530.78	276,022,622

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

	2023年 4 月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	3,729,051,400.77	521,209,514
投資有価証券、未実現評価（損）益	(249,924,316.41)	(34,931,922)
投資有価証券合計（注１）	3,479,127,084.36	486,277,593
現金預金、要求払預金および預託金勘定	22,459,752.11	3,139,200
その他の流動資産（マージン）	120,644.13	16,862
有価証券売却未収金（注１）	1,340.25	187
発行未収金	9,096,415.89	1,271,406
有価証券に係る未収利息	21,613,782.54	3,020,958
金融先物に係る未実現利益（注１）	48,070.39	6,719
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	30,988,512.09	4,331,264
資産合計	3,563,455,601.76	498,064,189
負 債		
当座借越	(23,452.21)	(3,278)
有価証券購入未払金（注１）	(29,209,452.29)	(4,082,605)
買戻未払金	(17,201,087.07)	(2,404,196)
その他の負債	(394,532.24)	(55,144)
報酬引当金（注２）	(390,203.57)	(54,539)
年次税引当金（注３）	(27,046.33)	(3,780)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(186,437.79)	(26,058)
引当金合計	(603,687.69)	(84,377)
負債合計	(47,432,211.50)	(6,629,600)
期末現在純資産	3,516,023,390.26	491,434,589

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産計算書

2023年4月30日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,787,855,164.40	249,888,516
投資有価証券、未実現評価（損）益	(106,601,204.14)	(14,899,650)
投資有価証券合計（注１）	1,681,253,960.26	234,988,866
現金預金、要求払預金および預託金勘定	71,969,458.05	10,059,171
その他の流動資産（マージン）	275,054.17	38,444
有価証券売却未収金（注１）	20,218,353.56	2,825,919
発行未収金	2,360,549.26	329,934
有価証券に係る未収利息	15,994,978.80	2,235,618
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	13,398,113.47	1,872,654
資産合計	1,805,470,467.57	252,350,607
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注１）	(128,382.90)	(17,944)
買戻未払金	(86,778,522.26)	(12,129,034)
報酬引当金（注２）	(282,113.14)	(39,431)
年次税引当金（注３）	(13,188.24)	(1,843)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(44,921.42)	(6,279)
引当金合計	(340,222.80)	(47,553)
負債合計	(87,247,127.96)	(12,194,531)
期末現在純資産	1,718,223,339.61	240,156,076

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

2023年4月30日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,462,778,533.92	344,222,556
投資有価証券、未実現評価（損）益	(253,200,652.80)	(35,389,855)
投資有価証券合計（注１）	2,209,577,881.12	308,832,700
現金預金、要求払預金および預託金勘定	17,002,592.51	2,376,452
有価証券売却未収金（注１）	341.12	48
発行未収金	2,138,988.46	298,966
有価証券に係る未収利息	8,103,377.57	1,132,609
前払費用	35,240.00	4,925
金融先物に係る未実現利益（注１）	380,468.70	53,178
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	29,694,146.65	4,150,351
資産合計	2,266,933,036.13	316,849,230
負 債		
その他の短期負債（マージン）	(38,525.73)	(5,385)
買戻未払金	(5,246,654.60)	(733,325)
その他の負債	(7,264,132.83)	(1,015,308)
報酬引当金（注２）	(161,180.05)	(22,528)
年次税引当金（注３）	(17,339.70)	(2,424)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(45,613.74)	(6,375)
引当金合計	(224,133.49)	(31,327)
負債合計	(12,773,446.65)	(1,785,345)
期末現在純資産	2,254,159,589.48	315,063,886

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

運用計算書

自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	622,108.84	86,952
有価証券に係る利息	6,449,001.38	901,377
貸付証券に係る純収益（注10）	70,972.64	9,920
その他の収益（注 4）	61,687.79	8,622
収益合計	7,203,770.65	1,006,871
費 用		
報酬（注 2）	(540,368.79)	(75,527)
年次税（注 3）	(27,362.77)	(3,824)
その他の手数料および報酬（注 2）	(10,557.45)	(1,476)
現金資産および当座借越に係る利息	(16,328.05)	(2,282)
費用合計	(594,617.06)	(83,110)
投資純（損）益	6,609,153.59	923,761
実現（損）益（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(13,246,556.38)	(1,851,471)
利回り評価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	(2,792.06)	(390)
金融先物に係る実現（損）益	(1,296,828.88)	(181,258)
先渡為替契約に係る実現（損）益	752,428.41	105,167
為替差（損）益	4,669,210.41	652,616
実現（損）益合計	(9,124,538.50)	(1,275,337)
当期実現純（損）益	(2,515,384.91)	(351,575)
未実現評価（損）益の変動（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	49,125,059.95	6,866,210
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	4034.36	564
TBAモーゲージ担保证券に係る未実現評価（損）益	18,937.31	2,647
金融先物に係る未実現評価（損）益	1,995,730.98	278,943
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	4,027,178.26	562,879
未実現評価（損）益の変動合計	55,170,940.86	7,711,242
運用の結果による純資産の純増（減）	52,655,555.95	7,359,667

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

運用計算書

自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	160,282.54	22,403
有価証券に係る利息	11,392,065.73	1,592,269
貸付証券に係る純収益（注10）	397,196.20	55,516
その他の収益（注 4 ）	763,865.86	106,766
収益合計	12,713,410.33	1,776,953
費 用		
報酬（注 2 ）	(1,034,749.14)	(144,627)
年次税（注 3 ）	(81,499.39)	(11,391)
その他の手数料および報酬（注 2 ）	(36,552.74)	(5,109)
現金資産および当座借越に係る利息	(6.54)	(1)
費用合計	(1,152,807.81)	(161,128)
投資純（損）益	11,560,602.52	1,615,825
実現（損）益（注 1 ）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(32,750,781.16)	(4,577,577)
金融先物に係る実現（損）益	834,012.70	116,570
先渡為替契約に係る実現（損）益	116,296,979.78	16,254,829
為替差（損）益	(12,232,143.23)	(1,709,687)
実現（損）益合計	72,148,068.09	10,084,135
当期実現純（損）益	83,708,670.61	11,699,961
未実現評価（損）益の変動（注 1 ）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	90,261,108.76	12,615,795
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	77,719.50	10,863
金融先物に係る未実現評価（損）益	(385,039.23)	(53,817)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(7,585,986.19)	(1,060,293)
未実現評価（損）益の変動合計	82,367,802.84	11,512,548
運用の結果による純資産の純増（減）	166,076,473.45	23,212,509

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	277,920.04	38,845
有価証券に係る利息	41,129,455.97	5,748,664
分配金	127,182.22	17,776
貸付証券に係る純収益（注10）	974,360.93	136,186
その他の収益（注 4 ）	1,771,652.50	247,624
収益合計	44,280,571.66	6,189,096
費 用		
報酬（注 2 ）	(2,556,044.95)	(357,258)
年次税（注 3 ）	(202,039.59)	(28,239)
その他の手数料および報酬（注 2 ）	(76,501.71)	(10,693)
現金資産および当座借越に係る利息	(201.16)	(28)
費用合計	(2,834,787.41)	(396,218)
投資純（損）益	41,445,784.25	5,792,877
実現（損）益（注 1 ）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(148,217,613.79)	(20,716,376)
金融先物に係る実現（損）益	2,184,473.48	305,324
先渡為替契約に係る実現（損）益	197,673,460.54	27,628,820
為替差（損）益	(9,514,174.51)	(1,329,796)
実現（損）益合計	42,126,145.72	5,887,971
当期実現純（損）益	83,571,929.97	11,680,849
未実現評価（損）益の変動（注 1 ）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	388,787,802.43	54,340,871
金融先物に係る未実現評価（損）益	(319,679.41)	(44,682)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	1,818,575.43	254,182
未実現評価（損）益の変動合計	390,286,698.45	54,550,372
運用の結果による純資産の純増（減）	473,858,628.42	66,231,220

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

運用計算書

自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	629,132.34	87,934
有価証券に係る利息	27,600,204.14	3,857,681
貸付証券に係る純収益（注10）	21,000.92	2,935
その他の収益（注 4）	1,146,725.59	160,278
収益合計	29,397,062.99	4,108,827
費 用		
報酬（注 2）	(1,667,814.17)	(233,110)
年次税（注 3）	(87,748.80)	(12,265)
その他の手数料および報酬（注 2）	(32,920.43)	(4,601)
現金資産および当座借越に係る利息	(46.28)	(6)
費用合計	(1,788,529.68)	(249,983)
投資純（損）益	27,608,533.31	3,858,845
実現（損）益（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(33,765,814.49)	(4,719,448)
金融先物に係る実現（損）益	(3,960,169.40)	(553,513)
先渡為替契約に係る実現（損）益	97,124,380.39	13,575,075
為替差（損）益	(1,162,463.94)	(162,478)
実現（損）益合計	58,235,932.56	8,139,636
当期実現純（損）益	85,844,465.87	11,998,481
未実現評価（損）益の変動（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	109,420,438.63	15,293,695
金融先物に係る未実現評価（損）益	1,657,398.51	231,655
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	5,038,308.03	704,204
未実現評価（損）益の変動合計	116,116,145.17	16,229,554
運用の結果による純資産の純増（減）	201,960,611.04	28,228,035

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	176,252.28	24,635
有価証券に係る利息	17,603,246.95	2,460,406
貸付証券に係る純収益（注10）	152,560.18	21,323
その他の収益（注 4）	66,815.25	9,339
収益合計	17,998,874.66	2,515,703
費 用		
報酬（注 2）	(1,005,021.70)	(140,472)
年次税（注 3）	(112,320.01)	(15,699)
その他の手数料および報酬（注 2）	(43,418.58)	(6,069)
費用合計	(1,160,760.29)	(162,239)
投資純（損）益	16,838,114.37	2,353,463
実現（損）益（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(33,135,151.70)	(4,631,300)
利回り評価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	121,056.39	16,920
金融先物に係る実現（損）益	(782,971.88)	(109,436)
先渡為替契約に係る実現（損）益	94,921,017.68	13,267,111
為替差（損）益	(27,818,865.29)	(3,888,243)
実現（損）益合計	33,305,085.20	4,655,052
当期実現純（損）益	50,143,199.57	7,008,515
未実現評価（損）益の変動（注 1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	151,938,098.71	21,236,388
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	(53,355.16)	(7,457)
金融先物に係る未実現評価（損）益	380,468.70	53,178
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	35,682,489.78	4,987,342
未実現評価（損）益の変動合計	187,947,702.03	26,269,450
運用の結果による純資産の純増（減）	238,090,901.60	33,277,965

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

純資産変動計算書

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	489,370,994.22	68,399,384
発行額	65,993,437.81	9,223,903
買戻額	(44,022,861.76)	(6,153,075)
純発行（買戻）合計	21,970,576.05	3,070,827
支払分配金	(502,657.08)	(70,256)
投資純（損）益	6,609,153.59	923,761
実現（損）益合計	(9,124,538.50)	(1,275,337)
未実現評価（損）益の変動合計	55,170,940.86	7,711,242
運用の結果による純資産の純増（減）	52,655,555.95	7,359,667
期末現在純資産	563,494,469.14	78,759,622

発行済投資証券数の変動表

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日
クラス米ドルF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	1,422,679.4710
期中発行投資証券数	141,951.0190
期中買戻投資証券数	(102,826.1980)
期末現在発行済投資証券数	1,461,804.2920
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	610,933.2080
期中発行投資証券数	331,320.0000
期中買戻投資証券数	(52,737.7080)
期末現在発行済投資証券数	889,515.5000

年次分配金¹

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

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

最重要数値

日付	ISIN	2023年 4 月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産額（米ドル）		563,494,469.14	489,370,994.22	639,116,719.43
クラス米ドルF-acc	LU0326808440			
発行済受益証券口数（口）		1,461,804.2920	1,422,679.4710	1,612,030.4850
1口当たり純資産価格（米ドル）		150.12	142.75	163.28
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		150.12	142.75	163.28
クラス円ヘッジF-acc	LU1490620330			
発行済投資証券数（口）		889,515.5000	610,933.2080	488,147.2080
1口当たり純資産価格（円）		9,771	9,521	11,044
1口当たり発行・買戻価格（円） ¹		9,771	9,521	11,044

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	31.05
中国	8.58
日本	6.38
フランス	4.69
イギリス	3.38
カナダ	3.20
オーストラリア	3.09
ニュージーランド	2.95
韓国	2.62
スペイン	2.51
ドイツ	2.35
ルクセンブルグ	1.97
オランダ	1.93
イタリア	1.79
アイルランド	1.66
ベルギー	0.82
インド	0.57
スイス	0.57
ケイマン諸島	0.49
スロベニア	0.48
ベネズエラ	0.45
ノルウェー	0.38
ポーランド	0.33
スウェーデン	0.31
トルコ	0.29
サウジアラビア	0.29
ルーマニア	0.23
メキシコ	0.21
チリ	0.20
フィンランド	0.15
国際	0.15
バミューダ	0.10
タイ	0.10
オーストリア	0.10
香港	0.08
チェコ共和国	0.07
デンマーク	0.05
ベルー	0.05
エジプト	0.03
エクアドル	0.03
合計	84.68

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	36.69
銀行および金融機関	16.24
モーゲージおよび貸付機関	9.68
金融および持株会社	5.24
エネルギー・水道	2.85
石油	1.25
保険	1.22
通信	1.22
国際機関	1.16
交通・運輸	0.97
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.89
公共、非営利機関	0.80
化学	0.73
投資信託	0.69
不動産	0.62
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	0.58
医薬品・化粧品・医療品	0.55
たばこ・アルコール	0.39
小売り・百貨店	0.36
機械工学・産業機器	0.34
鉱業・石炭・鋼鉄	0.32
電気装置・部品	0.30
建築業・資材	0.28
その他の非分類会社	0.26
その他のサービス業	0.26
電子機器・半導体	0.19
ヘルスケア・社会福祉	0.10
繊維・衣服・革製品	0.10
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.08
自動車	0.08
都市・地方自治体	0.08
バイオテクノロジー	0.06
梱包業	0.05
写真・光学	0.05
合計	84.68

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,769,676,669.98	387,117,708
発行額	657,233,711.29	91,861,556
買戻額	(1,614,184,764.09)	(225,614,604)
純発行（買戻）合計	(956,951,052.80)	(133,753,049)
支払分配金	(3,967,559.85)	(554,546)
投資純（損）益	11,560,602.52	1,615,825
実現（損）益合計	72,148,068.09	10,084,135
未実現評価（損）益の変動合計	82,367,802.84	11,512,548
運用の結果による純資産の純増（減）	166,076,473.45	23,212,509
期末現在純資産	1,974,834,530.78	276,022,622

発行済投資証券数の変動表

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	7,512,225.3430
期中発行投資証券数	1,807,148.3730
期中買戻投資証券数	(4,375,741.8980)
期末現在発行済投資証券数	4,943,631.8180
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	156,900.0000
期中発行投資証券数	10,700.0000
期中買戻投資証券数	(31,536.0000)
期末現在発行済投資証券数	136,064.0000

年次分配金¹

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

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2023年4月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産額（米ドル）		1,974,834,530.78	2,769,676,669.98	1,349,798,222.03
クラスF-acc	LU0224580786			
発行済受益証券口数（口）		4,943,631.8180	7,512,225.3430	3,518,934.5730
1口当たり純資産価格（米ドル）		151.82	146.46	157.33
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		151.82	146.42	157.33
クラス円ヘッジF-acc	LU1786948718			
発行済受益証券口数（口）		136,064.0000	156,900.0000	100,247.0000
1口当たり純資産価格（米ドル）		9,552	9,450	10,295
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		9,552	9,447	10,295

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	61.60
国際	5.60
カナダ	5.00
ドイツ	3.96
フランス	2.76
スウェーデン	2.35
オーストラリア	2.19
オランダ	1.56
韓国	1.52
ノルウェー	1.49
シンガポール	1.33
アラブ首長国連邦	1.31
イギリス	1.11
ルクセンブルグ	0.94
フィリピン	0.90
中国	0.88
日本	0.65
フィンランド	0.60
ベルギー	0.52
カタール	0.49
スイス	0.38
香港	0.37
オーストリア	0.35
英領ヴァージン諸島	0.32
ケイマン諸島	0.24
コートジボワール	0.24
ジャージー	0.19
サウジアラビア	0.04
合計	98.89

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	47.78
銀行および金融機関	18.42
国際機関	11.80
金融および持株会社	5.04
モーゲージおよび貸付機関	4.48
郡、連邦州	2.31
石油	1.47
公共、非営利機関	1.34
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.28
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.13
食品・清涼飲料	0.80
バイオテクノロジー	0.80
小売り・百貨店	0.65
その他の消費財	0.42
建築業・資材	0.32
交通・運輸	0.24
投資信託	0.23
その他のサービス業	0.23
都市・地方自治体	0.15
合計	98.89

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,251,345,080.56	594,210,502
発行額	1,049,269,851.41	146,656,447
買戻額	(2,249,897,569.80)	(314,468,183)
純発行（買戻）合計	(1,200,627,718.39)	(167,811,736)
支払分配金	(8,552,600.33)	(1,195,397)
投資純（損）益	41,445,784.25	5,792,877
実現（損）益合計	42,126,145.72	5,887,971
未実現評価（損）益の変動合計	390,286,698.45	54,550,372
運用の結果による純資産の純増（減）	473,858,628.42	66,231,220
期末現在純資産	3,516,023,390.26	491,434,589

発行済投資証券数の変動表

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	9,898,397.7230
期中発行投資証券数	2,468,270.8970
期中買戻投資証券数	(5,409,200.9170)
期末現在発行済投資証券数	6,957,467.7030
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	336,555.0000
期中発行投資証券数	19,400.0000
期中買戻投資証券数	(59,571.0000)
期末現在発行済投資証券数	296,384.0000

年次分配金¹

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

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2023年4月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産額（米ドル）		3,516,023,390.26	4,251,345,080.56	2,294,398,605.83
クラスF-acc	LU0270450066			
発行済受益証券口数（口）		6,957,467.7030	9,898,397.7230	4,375,187.4690
1口当たり純資産価格（米ドル）		185.60	173.57	203.60
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		185.60	173.57	203.60
クラス円ヘッジF-acc	LU1786951779			
発行済受益証券口数（口）		296,384.0000	336,555.0000	235,162.0000
1口当たり純資産価格（米ドル）		9,344	8,978	10,708
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		9,344	8,978	10,708

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	67.48
国際	7.21
カナダ	4.00
ルクセンブルグ	3.10
アラブ首長国連邦	3.08
カタール	1.79
香港	1.55
ノルウェー	1.47
オランダ	1.34
フランス	1.29
ドイツ	1.26
韓国	1.08
オーストラリア	0.96
フィリピン	0.92
アイルランド	0.71
シンガポール	0.55
フィンランド	0.47
英領ヴァージン諸島	0.46
ベルギー	0.23
合計	98.95

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	48.05
国際機関	13.59
金融および持株会社	7.35
モーゲージおよび貸付機関	5.74
銀行および金融機関	4.66
郡、連邦州	3.82
小売り・百貨店	3.14
石油	2.35
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	2.11
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.12
その他の消費財	1.12
公共、非営利機関	1.10
バイオテクノロジー	0.84
投資信託	0.80
都市・地方自治体	0.70
エネルギー・水道	0.58
食品・清涼飲料	0.57
その他のサービス業	0.47
医薬品・化粧品・医療品	0.33
交通・運輸	0.30
その他の非分類会社	0.13
保険	0.07
航空宇宙産業	0.01
合計	98.95

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産変動計算書

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,530,016,585.03	213,850,418
発行額	355,524,954.49	49,691,723
買戻額	(358,924,273.17)	(50,166,846)
純発行（買戻）合計	(3,399,318.68)	(475,123)
支払分配金	(10,354,537.78)	(1,447,254)
投資純（損）益	27,608,533.31	3,858,845
実現（損）益合計	58,235,932.56	8,139,636
未実現評価（損）益の変動合計	116,116,145.17	16,229,554
運用の結果による純資産の純増（減）	201,960,611.04	28,228,035
期末現在純資産	1,718,223,339.61	240,156,076

発行済投資証券数の変動表

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	4,430,677.3830
期中発行投資証券数	1,032,346.8460
期中買戻投資証券数	(1,018,291.3630)
期末現在発行済投資証券数	4,444,732.8660
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	315,140.0000
期中発行投資証券数	2,930.0000
期中買戻投資証券数	(16,698.0000)
期末現在発行済投資証券数	301,372.0000

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ	分配落ち日	支払日	通貨	1 口当たり 分配金額
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル				
該当なし				

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2023年4月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産額（米ドル）		1,718,223,339.61	1,530,016,585.03	1,785,038,748.14
クラスF-acc	LU1484152423			
発行済受益証券口数（口）		4,444,732.8660	4,430,677.3830	4,697,522.9170
1口当たり純資産価格（米ドル）		113.35	106.61	121.27
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		113.35	106.61	121.27
クラス円ヘッジF-acc	LU2288920767			
発行済受益証券口数（口）		301,372.0000	315,140.0000	115,407.0000
1口当たり純資産価格（日本円）		8,868	8,565	9,895
1口当たり発行・買戻価格（日本円） ¹		8,868	8,565	9,895

¹ 注記1を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	70.16
イギリス	7.79
カナダ	4.57
オーストラリア	3.73
日本	2.98
オランダ	2.28
アイルランド	1.14
フランス	0.96
ケイマン諸島	0.76
ノルウェー	0.66
ルクセンブルグ	0.49
多国籍	0.49
バミューダ	0.48
ドイツ	0.36
スペイン	0.34
スウェーデン	0.34
デンマーク	0.32
合計	97.85

注記は当財務書類の一部である。

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
銀行および金融機関	29.93
金融および持株会社	22.10
エネルギー・水道	8.59
医薬品・化粧品・医療品	3.63
小売り・百貨店	3.56
通信	2.83
ヘルスケア・社会福祉	2.76
交通・運輸	2.41
不動産	2.25
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	2.05
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.94
電子機器・半導体	1.94
保険	1.71
食品・清涼飲料	1.33
機械工学・産業機器	1.27
電気装置・部品	1.13
バイオテクノロジー	1.09
石油	1.06
鉱業・石炭・鋼鉄	1.04
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.88
その他の商社	0.87
たばこ・アルコール	0.76
自動車	0.60
化学	0.55
その他のサービス業	0.50
非鉄金属	0.30
梱包業	0.24
投資信託	0.22
農業・漁業	0.17
環境サービスおよびリサイクル	0.14
合計	97.85

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,039,391,807.27	285,045,793
発行額	168,072,978.14	23,491,560
買戻額	(190,947,481.98)	(26,688,730)
純発行（買戻）合計	(22,874,503.84)	(3,197,169)
支払分配金	(448,615.55)	(62,703)
投資純（損）益	16,838,114.37	2,353,463
実現（損）益合計	33,305,085.20	4,655,052
未実現評価（損）益の変動合計	187,947,702.03	26,269,450
運用の結果による純資産の純増（減）	238,090,901.60	33,277,965
期末現在純資産	2,254,159,589.48	315,063,886

発行済投資証券数の変動表

	自2022年11月 1 日 至2023年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	6,291,999.1820
期中発行投資証券数	431,397.8750
期中買戻投資証券数	(417,780.7640)
期末現在発行済投資証券数	6,305,616.2930

年次分配金¹

フォーカス・シキャブ				1 口当たり
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル	分配落ち日	支払日	通貨	分配金額
該当なし				

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2023年4月30日	2022年10月31日	2021年10月31日
純資産額（米ドル）		2,254,159,589.48	2,039,391,807.27	2,069,125,942.00
クラスF-acc	LU1739535000			
発行済受益証券口数（口）		6,305,616.2930	6,291,999.1820	6,204,441.6650
1口当たり純資産価格（米ドル）		106.18	99.73	117.17
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		106.18	99.73	117.17

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表	（純資産に対する百分率 %）
アメリカ合衆国	51.61
国際	46.41
合計	98.02
業種別分布表	（純資産に対する百分率 %）
国際機関	98.02
合計	98.02

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ
財務書類に対する注記
2023年4月30日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

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

a) 純資産額の計算

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

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

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

b) 評価原則

- 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形および売掛金、前払費用、現金配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、評価額が決定される。
- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。これらの証券、派生商品もしくはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の価格が適用される。
証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の資産で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、定期的に運営され、認知され、公開されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。
- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場されていない派生商品（OTC派生商品）は、独立の値付機関に基づき評価される。派生商品に利用可能である独立の値付機関が1社のみの場合、得られた評価の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の市場価格に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算方法によって検証される。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

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

e) 証券売買実現純（損）益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2023年4月30日現在の連結純資産計算書および連結運用計算書および連結純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目をユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2023年4月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1 ユーロ	=	0.982615	スイスフラン
1 ユーロ	=	0.878351	英ポンド
1 ユーロ	=	1.104000	米ドル

i) 「モーゲージ担保证券」

本投資法人はその投資方針に従い、「モーゲージ担保证券」に投資することができる。「モーゲージ担保证券」は、証券の形態に統合されたモーゲージ・プールへの参加を意味するものである。対象モーゲージに係る元本および利息の支払いは、「モーゲージ担保证券」の保有者にパススルーされ、そのうちの元本部分により証券のコスト・ベースが減少する。元本および利息の支払いは、米国の準政府機関により保証されることがある。利益または損失は、各元本に対する支払いがある都度計算される。

この利益または損失は、運用計算書の「有価証券の売却に係る実現純利益または損失」に計上されている。さらに、対象モーゲージの期限前返済により証券の残存期間が短縮することがあり、それにより本投資法人の予想利回りが影響を受けることがある。

j) モーゲージ関連証券 - TBA証券

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

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

これらのTBAポジションは、「TBAモーゲージ担保证券に係る未実現（損）益」に含まれる。2023年4月30日現在、TBAポジションの価格は、サブ・ファンドのフォーカス・シキャブ - グローバル・ボンドにおける13,220,907.81米ドルである。

k) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外貨取引による未収金および未払金は、相殺される。

l) 収益の認識

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

m) スワップ

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

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

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

注 2 - 報酬

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

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

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

フォーカス・シキャブ	実効定率報酬	
	2022年10月31日	2023年4月30日
- グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc	0.20%	0.20%
- グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc	0.21%	0.21%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.12%	0.12%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.13%	0.13%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.14%	0.14%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.15%	0.15%
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc	0.20%	0.20%
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.21%	0.21%
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.11%	0.11%

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

上限定率報酬は、下記のように使用される。

1. 本投資法人の運用、管理事務、ポートフォリオ管理および販売に関して（該当する場合）、また保管受託銀行のすべての職務（本投資法人の資産の保管および監督、支払取引の取扱いならびに販売目論見書の「保管受託銀行および主たる支払代理人」の項に記載されているその他一切の職務等）に関して、次の規定に従い本投資法人の資産から、本投資法人の純資産価額に基づく上限定率報酬が支払われる。当該報酬は、純資産の計算毎に比例按分ベースで本投資法人の資産に対し請求され、毎月支払われる（上限定率料率）。名称に「ヘッジ」を含むクラス投資証券の上限定率報酬には、為替リスクをヘッジするための費用が含まれる。対応する各クラス投資証券が設定されるまでは、関連する上限定率報酬は対応する投資証券クラスが発行されるまで請求されない。上限定率報酬の概要は、販売目論見書の「サブ・ファンドおよびその特別投資方針」の項にて参照することができる。

実際に適用される上限定率報酬については、年次報告書および半期報告書で参照することができる。

当該報酬は、運用計算書において「報酬」として開示される。

2. 上限定率報酬は、以下の報酬および本投資法人にも請求される追加費用を含まない。

- a) 資産の売買のための本投資法人の資産の管理に関する一切の追加の費用（市場、手数料、報酬等に合致する買呼値および売呼値スプレッド、仲介手数料）。かかる費用は、通常、各資産の売買時点で計算される。本書の記載にかかわらず、受益証券の発行および買戻しの決済に関する資産の売買によって生じるかかる追加の費用は、販売目論見書の「純資産価額、発行、買戻しおよび転換価格」の項に基づくシングル・スイング・プライシングの原理の適用によりカバーされる。
- b) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する監督官庁への費用ならびに監督官庁およびサブ・ファンドが上場されている証券取引所に関する一切の手数料。
- c) 本投資法人の設立、変更、清算および合併に関する年次監査および認可に関する監査報酬ならびにファンドの管理事務に関して監査人が提供するサービスに関して監査法人に支払われ、かつ法律によって許可される一切のその他の報酬。
- d) 本投資法人の設立、販売国における登録、変更、清算および合併に関する法律顧問、税務顧問および公証人に対する報酬ならびに法律で明白に禁止されない限り、本投資法人およびその投資者の利益の全般的な保護に関する手数料。
- e) 本投資法人の純資産価額の公表に関するコストおよび投資者に対する通知に関する一切のコスト（翻訳コストを含む）。
- f) 本投資法人の法的文書に関するコスト（目論見書、KIID、年次報告書および半期報告書ならびに居住国および販売が行われる国で法的に要求されるその他の一切の文書）。
- g) 外国の監督官庁への本投資法人の登録に関するコスト（該当する場合、手数料、翻訳コストおよび外国の代表者または支払代理人に対する報酬を含む）。
- h) 本投資法人による議決権または債権者の権利により生じた費用（外部顧問報酬を含む）。
- i) 本投資法人の名義で登録された知的財産または本投資法人の利用者の権利に関するコストおよび手数料。
- j) 管理会社、ポートフォリオ・マネジャーまたは保管受託銀行が投資者の利益の保護のために講じた特別措置に関して生じた一切の費用。
- k) 管理会社が投資者の利益につき集団訴訟に関与する場合、管理会社は、第三者に関して生じる費用（例えば、法律コストおよび保管受託銀行に関するコスト）を本投資法人の資産に対して請求できる。さらに、管理会社は、すべての管理事務コストを請求することができる。ただし、当該コストは、証明可能かつ開示されており、本投資法人の総費用比率（TER）の開示において考慮される。
- l) 本投資法人の取締役役に支払われる手数料、コストおよび費用（合理的な立替費用、保険料および取締役会に関連する合理的な交通費ならびに取締役の報酬を含む。）。

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

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

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

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

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

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

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

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

その投資方針の条項に従ってその他の投資信託（UCIsまたはUCITS）（以下「対象ファンド」という。）に投資するサブ・ファンドの場合、当該対象ファンドおよびサブ・ファンドの両段階で支払いが生じる。サブ・ファンドの資産が投資される対象ファンドの管理報酬（パフォーマンス報酬を除く）は、あらゆる付随的な報酬を考慮の上、最大3%とする。

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

本投資法人の現行の手数料の詳細は、KIDsに記載されている。

注3 - 年次税

ルクセンブルグ大公国の現行法に従い、本投資法人は、ルクセンブルグの源泉徴収税、所得税、キャピタル・ゲイン税または富裕税の対象とならない。ただし、各サブ・ファンドは、純資産総額について年率0.01%のルクセンブルグの年次税を課せられ、各四半期末に支払わなければならない。かかる税金は、各四半期末に各サブ・ファンドの純資産総額について計算される。

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

注4 - その他の収益

その他の収益は、主にスイング・プライシングから生じた収益で構成される。

注 5 - 収益の分配

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

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

収入調整金は、分配金と実際に収入を受け取る権利が一致するように計算される。

注 6 - ソフト・コミッション協定

2022年11月１日から2023年４月30日までの期間において、フォーカス・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション協定」はなく、「ソフト・コミッション協定」の金額はゼロである。

注 7 - 金融先物契約

2023年４月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物契約および関連する通貨は、以下のように要約される。

金融先物

フォーカス・シキャブ	債券に係る金融先物 （購入）	債券に係る金融先物 （売却）
- グローバル・ボンド	81,856,860.34米ドル	69,122,349.63米ドル
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	79,706,171.72米ドル	- 米ドル
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	8,669,632.85米ドル	- 米ドル
- USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	30,924,609.30米ドル	41,835,937.63米ドル
- ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	12,145,312.50米ドル	5,487,109.40米ドル

フォーカス・シキャブ	指数に係る金融先物 （購入）	指数に係る金融先物 （売却）
- グローバル・ボンド	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	該当なし	該当なし
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし
- USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	該当なし	該当なし
- ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

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

注 8 - 総費用比率（TER）

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

過去12ヶ月のTERは、以下のとおりである。

フォーカス・シキャブ	総費用比率（TER）
- グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc	0.21%
- グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc	0.22%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.13%
- ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.14%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.15%
- ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.16%
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc	0.21%
- USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.22%
- ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.12%

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

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

定率報酬は、当会計年度中に変更される場合がある（注 2 を参照のこと。）。

注 9 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

注10 - 貸付証券

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

U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店は、証券の貸付機関として行為する。

2023年4月30日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー*		2023年4月30日現在の 担保の内訳（％）			
フォーカス・シキャブ	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・スイス・ エイ・ジー)	株式	債券	現金
- グローバル・ボンド	105,311,851.23 米ドル	111,643,552.17 米ドル	54.04	45.96	0.00
- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	750,059,179.35 米ドル	792,428,036.91 米ドル	54.04	45.96	0.00
- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	1,181,286,168.20 米ドル	1,244,289,060.85 米ドル	54.04	45.96	0.00
- USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	48,915,034.15 米ドル	52,204,021.53 米ドル	54.04	45.96	0.00
- ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	96,698,830.87 米ドル	101,795,220.86 米ドル	54.04	45.96	0.00

*取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2023年4月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2023年4月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

フォーカス・シキャブ			
	- グローバル・ボンド	- ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	- ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル
貸付証券収益	118,287.73 米ドル	661,993.67 米ドル	1,623,934.88 米ドル
貸付証券コスト**			
U B S スイス・エイ・ジー	35,486.32 米ドル	198,598.10 米ドル	487,180.46 米ドル
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	11,828.77 米ドル	66,199.37 米ドル	162,393.49 米ドル
純貸付証券収益	70,972.64 米ドル	397,196.20 米ドル	974,360.93 米ドル
	- USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	- ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	
貸付証券収益	35,001.53 米ドル	254,266.97 米ドル	
貸付証券コスト**			
U B S スイス・エイ・ジー	10,500.46 米ドル	76,280.09 米ドル	
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	3,500.15 米ドル	25,426.70 米ドル	
純貸付証券収益	21,000.92 米ドル	152,560.18 米ドル	

**2022年6月1日より、総収入の30%を証券貸付サービス・プロバイダーであるU B S スイス・エイ・ジーが、10%を有価証券貸付代理人であるU B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店がコスト/手数料として留保している。

（２）投資有価証券明細表等

フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド

2023年４月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	280 000.00	220 302.41	0.04
EUR BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23	150 000.00	165 288.67	0.03
EUR BP CAPITAL MARKETS BV-REG-S 0.93300% 20-04.12.40	380 000.00	252 240.59	0.04
EUR CELANESE US HOLDINGS LLC 4.77700% 22-19.07.26	250 000.00	273 976.92	0.05
EUR CHINA, PEOPLE'S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	1 160 000.00	874 677.12	0.15
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 340 000.00	1 330 773.08	0.23
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	565 000.00	490 353.32	0.09
EUR HEIDELBERGCEMENT AG-REG-S 3.75000% 23-31.05.32	1 505 000.00	1 576 300.64	0.28
EUR LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON-REG-S 0.37500% 20-11.02.31	300 000.00	271 294.53	0.05
EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	300 000.00	284 499.48	0.05
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	340 000.00	316 417.22	0.06
EUR VONOVIA SE-REG-S 2.37500% 22-25.03.32	300 000.00	269 420.60	0.05
ユーロ合計		6 325 544.58	1.12
米ドル			
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	200 000.00	198 475.48	0.03
USD ABBVIE INC 4.40000% 13-06.11.42	310 000.00	282 384.25	0.05
USD ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48	170 000.00	163 155.22	0.03
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.50000% 20-15.09.23	150 000.00	149 080.07	0.03
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	160 000.00	161 560.85	0.03
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	1 625 000.00	1 457 046.74	0.26
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30	210 000.00	183 203.81	0.03
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.87500% 23-12.01.33	415 000.00	427 950.90	0.08
USD ALBEMARLE CORPORATION 5.45000% 14-01.12.44	200 000.00	190 331.64	0.03
USD ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26	102 000.00	101 253.06	0.02
USD ALTRIA GROUP INC 4.80000% 19-14.02.29	14 000.00	13 901.69	0.00
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.30	195 000.00	200 273.87	0.04
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33	565 000.00	581 327.47	0.10
USD AMGEN INC 5.75000% 23-02.03.63	350 000.00	362 513.05	0.06
USD ANHEUSER-BUSCH COS 3.65000% 19-01.02.26	150 000.00	147 446.23	0.03
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	380 000.00	388 605.22	0.07
USD APPLE INC 3.85000% 16-04.08.46	420 000.00	375 858.30	0.07
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	1 220 000.00	1 197 262.73	0.21
USD ARCELORMITTAL SA 6.80000% 22-29.11.32	1 050 000.00	1 098 947.89	0.19
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	510 000.00	501 280.28	0.09
USD AT&T INC 4.75000% 15-15.05.46	550 000.00	492 797.25	0.09
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05000% 22-15.03.25	755 000.00	757 849.32	0.13
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27	605 000.00	612 411.10	0.11
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 5.90000% 22-05.07.24	585 000.00	585 645.07	0.10
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.86000% 17-21.06.47	630 000.00	524 199.37	0.09
USD CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	370 000.00	367 480.79	0.06
USD CITIGROUP INC 4.65000% 18-23.07.48	425 000.00	392 016.32	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.62500% 17-01.08.27	620 000.00	590 666.25	0.10
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	120 000.00	102 070.46	0.02
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 7.95000% 23-09.01.25	1 065 000.00	1 083 914.40	0.19
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	115 000.00	107 355.43	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.12500% 15-20.07.45	635 000.00	600 768.22	0.11
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 5.30000% 19-15.05.49	290 000.00	237 108.06	0.04
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	198 120.00	72 350.95	0.01
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	75 600.00	39 727.80	0.01
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	90 800.00	29 527.03	0.01
USD ENBRIDGE INC 5.70000% 23-08.03.33	140 000.00	145 388.66	0.03
USD ENERGY TRANSFER LP 6.05000% 11-01.06.41	550 000.00	552 583.20	0.10

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENERGY TRANSFER LP 6.00000% 18-15.06.48	210 000.00	200 546.38	0.04
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	590 000.00	558 169.50	0.10
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	910 000.00	856 891.13	0.15
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.00000% 23-11.01.28	715 000.00	736 478.60	0.13
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	415 000.00	395 699.99	0.07
USD FLOWSERVE CORP 3.50000% 20-01.10.30	450 000.00	397 131.45	0.07
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	425 000.00	432 572.01	0.08
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	420 000.00	411 175.93	0.07
USD GEORGIA POWER CO 2.10000% 20-30.07.23	340 000.00	337 177.32	0.06
USD GILEAD SCIENCES INC 4.80000% 14-01.04.44	350 000.00	338 582.51	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	955 000.00	927 784.96	0.16
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.40000% 18-15.03.48	220 000.00	187 775.50	0.03
USD HOME DEPOT INC/THE 4.50000% 22-15.09.32	260 000.00	263 692.71	0.05
USD ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26	410 000.00	391 811.29	0.07
USD INTEL CORP 5.20000% 23-10.02.33	285 000.00	291 020.91	0.05
USD INTEL CORP 5.70000% 23-10.02.53	325 000.00	332 417.61	0.06
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	460 000.00	445 982.40	0.08
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 4.75000% 23-03.04.26	670 000.00	667 715.30	0.12
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	235 000.00	230 800.63	0.04
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	350 000.00	300 878.20	0.05
USD MAGALLANES INC-144A 4.27900% 22-15.03.32	960 000.00	852 633.53	0.15
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.45000% 23-15.03.53	390 000.00	406 131.88	0.07
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	1 600 000.00	1 264 300.00	0.22
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	215 000.00	176 004.38	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	890 000.00	741 926.25	0.13
USD MICROSOFT CORP 2.92100% 21-17.03.52	650 000.00	498 107.23	0.09
USD MPLX LP 5.20000% 17-01.03.47	200 000.00	180 412.83	0.03
USD NATWEST GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	500 000.00	496 048.08	0.09
USD NIKE INC 2.40000% 20-27.03.25	325 000.00	314 897.95	0.06
USD NISOURCE INC 5.25000% 23-30.03.28	70 000.00	71 497.44	0.01
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	235 000.00	224 369.79	0.04
USD ORACLE CORP 5.55000% 23-06.02.53	190 000.00	182 539.82	0.03
USD ORACLE CORP 6.15000% 22-09.11.29	1 720 000.00	1 825 030.77	0.32
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 5.62500% 22-17.11.29	190 000.00	198 453.75	0.04
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	255 000.00	230 740.03	0.04
USD PUBLIC STORAGE 1.95000% 21-09.11.28	320 000.00	281 048.06	0.05
USD QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47	160 000.00	148 651.47	0.03
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 10.25000% 22-30.11.24	1 615 000.00	1 568 972.50	0.28
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 750 000.00	1 235 171.87	0.22
USD REYNOLDS AMERICAN INC 5.70000% 15-15.08.35	680 000.00	651 532.28	0.12
USD ROMANIA-REG-S 5.12500% 18-15.06.48	1 400 000.00	1 178 012.51	0.21
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31	720 000.00	605 335.11	0.11
USD SGSP AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S 3.25000% 16-29.07.26	530 000.00	504 240.43	0.09
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.60000% 20-13.07.30	200 000.00	24 500.00	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	340 000.00	41 650.00	0.01
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	505 000.00	61 862.50	0.01
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.50000% 23-17.01.33	465 000.00	460 146.56	0.08
USD SOUTHERN CO 4.40000% 16-01.07.46	120 000.00	105 359.97	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 20-09.07.25	450 000.00	87 750.00	0.02
USD SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26	250 000.00	254 500.00	0.05
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 0.75000% 20-15.05.25	1 210 000.00	1 128 291.43	0.20
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33	1 635 000.00	1 647 058.13	0.29
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	413 000.00	404 063.54	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	1 440 000.00	1 287 315.22	0.23
USD VIACOMCBS INC 4.75000% 20-15.05.25	417 000.00	412 852.51	0.07
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.00000% 16-15.11.46	195 000.00	161 449.97	0.03
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	100 000.00	97 387.80	0.02
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	330 000.00	306 011.12	0.05
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.12500% 22-13.05.25	735 000.00	718 697.41	0.13
USD VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24	480 000.00	454 439.54	0.08
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	1 260 000.00	1 270 866.30	0.23
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.42100% 19-24.07.39	395 000.00	335 273.20	0.06
USD XL GROUP LTD 5.25000% 13-15.12.43	605 000.00	614 952.25	0.11
米ドル合計		47 890 508.17	8.50
ノート、固定利付債合計		54 216 052.75	9.62

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	25 948.00	7 919.01	0.00
米ドル合計		7 919.01	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計			7 919.01 0.00
ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 4.875%/VAR 23-16.07.28	220 000.00	245 423.44	0.04
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	800 000.00	745 314.82	0.13
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	520 000.00	423 062.51	0.08
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	655 000.00	661 556.46	0.12
EUR CREDIT SUISSE GROUP-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32	405 000.00	377 402.50	0.07
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	185 000.00	170 285.10	0.03
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%VAR 21-PRP	200 000.00	105 024.91	0.02
EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-29.10.28	490 000.00	517 963.79	0.09
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	500 000.00	463 680.00	0.08
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	400 000.00	334 379.52	0.06
ユーロ合計		4 044 093.05	0.72
米ドル			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	400 000.00	326 469.19	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 5.015%/VAR 22-22.07.33	1 000 000.00	985 978.26	0.17
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.222%/VAR 20-18.09.24	180 000.00	176 320.58	0.03
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP	620 000.00	598 415.42	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	610 000.00	528 656.81	0.09
USD MORGAN STANLEY 5.123%/VAR 23-01.02.29	925 000.00	929 530.22	0.16
USD PRUDENTIAL FUNDING PLC-REG-S-SUB 2.950%/VAR 21-03.11.33	945 000.00	804 882.96	0.14
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	550 000.00	552 844.74	0.10
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 9.375%/VAR 22-PRP	690 000.00	655 086.00	0.12
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	550 000.00	496 642.41	0.09
米ドル合計		6 054 826.59	1.07
ノート、変動利付債合計			10 098 919.64 1.79
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	210 000.00	137 808.44	0.02
AUD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.50000% 15-05.06.25	1 890 000.00	1 234 730.36	0.22
AUD QANTAS AIRWAYS LTD 3.15000% 21-27.09.28	440 000.00	258 393.41	0.05
オーストラリア・ドル合計		1 630 932.21	0.29
ユーロ			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	900 000.00	835 460.61	0.15
EUR AEROPORTI DI ROMA SPA-REG-S 1.75000% 21-30.07.31	130 000.00	116 354.80	0.02
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY AB-REG-S 1.75000% 17-07.02.25	260 000.00	268 258.39	0.05
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	455 000.00	421 878.47	0.07
EUR BANQUE FEDER DU CRE MUTUEL SA-REG-S-SUB 5.12500% 23-13.01.33	700 000.00	760 357.92	0.13
EUR BPCE SA-REG-S 3.62500% 23-17.04.26	500 000.00	549 631.92	0.10
EUR BPCE SA-REG-S 4.50000% 23-13.01.33	1 300 000.00	1 439 634.77	0.25
EUR CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMME-REG-S 0.37500% 22-10.03.26	1 230 000.00	1 243 183.91	0.22
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	600 000.00	636 720.08	0.11
EUR CEZ AS-REG-S 2.37500% 22-06.04.27	405 000.00	415 450.49	0.07
EUR CHORUS LTD 3.62500% 22-07.09.29	270 000.00	291 240.68	0.05
EUR CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26	550 000.00	583 482.77	0.10
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 4.00000% 23-10.01.30	1 800 000.00	1 977 756.82	0.35
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	310 000.00	277 840.70	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON 1.25000% 16-14.04.26	200 000.00	206 425.48	0.04
EUR CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25	2 005 000.00	2 175 518.29	0.39
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	1 280 000.00	1 185 480.50	0.21

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	200 000.00	200 434.73	0.04
EUR DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-14.11.23	615 000.00	666 097.78	0.12
EUR E.ON SE-REG-S 0.87500% 22-08.01.25	400 000.00	423 274.48	0.07
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-11.03.30	245 000.00	271 991.98	0.05
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49	200 000.00	130 844.32	0.02
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 4.62500% 23-25.01.43	700 000.00	729 374.83	0.13
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	170 000.00	164 668.87	0.03
EUR ELIA TRANSMISSION BELGIUM SA-REG-S 0.87500% 20-28.04.30	100 000.00	92 658.06	0.02
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.04900% 22-22.11.29	275 000.00	309 962.85	0.05
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25	1 300 000.00	1 357 602.56	0.24
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 110 000.00	910 979.84	0.16
EUR FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA-REG-S 3.75000% 22-14.04.27	970 000.00	1 068 245.64	0.19
EUR GAS NETWORKS IRELAND-REG-S 0.12500% 19-04.12.24	580 000.00	605 777.29	0.11
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	100 000.00	94 033.20	0.02
EUR GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.25000% 21-26.01.28	600 000.00	555 162.73	0.10
EUR KBC GROUP NV-REG-S 1.12500% 19-25.01.24	400 000.00	433 300.57	0.08
EUR LINDE PLC-REG-S 1.37500% 22-31.03.31	1 200 000.00	1 151 343.94	0.20
EUR LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.25000% 21-06.04.28	700 000.00	669 339.08	0.12
EUR NATIONAL GAS TRANSMISSION PLC-REG-S 4.25000% 23-05.04.30	455 000.00	506 010.34	0.09
EUR NATIONAL GRID PLC-REG-S 3.87500% 23-16.01.29	835 000.00	924 459.87	0.16
EUR NBN CO LTD-REG-S 4.12500% 23-15.03.29	995 000.00	1 117 018.83	0.20
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	790 000.00	769 450.95	0.14
EUR ORANO SA-REG-S 5.37500% 22-15.05.27	400 000.00	453 313.79	0.08
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	465 000.00	446 396.94	0.08
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	2 195 000.00	1 636 168.37	0.29
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	350 000.00	366 996.54	0.06
EUR RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-REG-S 4.12500% 22-08.09.25	500 000.00	545 998.65	0.10
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	1 470 000.00	1 498 161.67	0.27
EUR REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25	700 000.00	765 535.68	0.14
EUR ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.62500% 22-23.03.26	1 200 000.00	1 222 660.57	0.22
EUR RTE EDF TRANSPORT SA-REG-S 1.00000% 16-19.10.26	100 000.00	102 370.00	0.02
EUR SELP FINANCE SARL-REG-S 3.75000% 22-10.08.27	290 000.00	297 648.78	0.05
EUR TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON-REG-S 1.12500% 22-08.02.27	425 000.00	413 401.80	0.07
EUR TERNA -RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S 3.62500% 23-21.04.29	1 540 000.00	1 681 190.46	0.30
EUR TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 3.63100% 22-13.12.29	700 000.00	745 017.84	0.13
EUR TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.99400% 20-08.04.32	100 000.00	97 819.92	0.02
EUR UNICAJA BANCO SA-REG-S 4.50000% 22-30.06.25	500 000.00	548 947.44	0.10
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S 5.50000% 23-04.05.29	310 000.00	345 450.21	0.06
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.50000% 19-24.05.39	320 000.00	285 060.93	0.05
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51	400 000.00	214 480.70	0.04
EUR VONOVIA SE-REG-S 5.00000% 22-23.11.30	300 000.00	325 280.13	0.06
EUR WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.94900% 22-20.09.32	235 000.00	256 127.99	0.04
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	2 395 000.00	2 192 371.47	0.39
ユーロ合計		40 977 109.22	7.27
英ポンド			
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.25000% 17-16.10.24	165 000.00	198 144.78	0.03
GBP VICINITY CENTRES TRUST-REG-S 3.37500% 16-07.04.26	480 000.00	569 773.89	0.10
英ポンド合計		767 918.67	0.13
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25	1 180 000.00	1 154 262.18	0.21
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 4.62500% 23-06.03.26	1 250 000.00	1 274 262.50	0.23
USD DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE-REG-S 0.75000% 20-07.05.23	1 940 000.00	1 938 808.72	0.34
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	600 000.00	549 300.00	0.10
USD JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 1.00000% 20-21.05.25	1 940 000.00	1 803 466.87	0.32
USD KOMMUNALBANKEN A/S-REG-S 0.25000% 21-21.07.23	510 000.00	504 425.70	0.09
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	1 400 000.00	1 369 350.70	0.24
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 120 000.00	1 010 660.00	0.18
USD REC LTD-REG-S 5.62500% 23-11.04.28	990 000.00	993 898.12	0.18
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	1 730 000.00	1 631 390.00	0.29
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 4.37500% 23-13.02.26	1 040 000.00	1 048 675.69	0.19
米ドル合計		13 278 500.48	2.37
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		56 654 460.58	10.06

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28	2 800 000.00	2 683 279.06	0.48
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	240 000.00	235 761.41	0.04
ユーロ合計		2 919 040.47	0.52
メディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		2 919 040.47	0.52
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	350 000.00	348 571.44	0.06
EUR BARCLAYS PLC-REG-S 3.375%/VAR 20-02.04.25	330 000.00	361 036.75	0.06
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRLIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	290 000.00	305 343.00	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.000%/VAR 20-22.04.26	700 000.00	727 076.52	0.13
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	400 000.00	413 776.55	0.07
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30	300 000.00	262 343.52	0.05
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 22-24.06.32	500 000.00	476 372.69	0.09
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	200 000.00	216 620.26	0.04
EUR KBC GROUP NV-REG-S 4.375%/VAR 22-23.11.27	400 000.00	444 146.27	0.08
EUR ORANGE SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 23-PRP	500 000.00	548 550.00	0.10
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 100 000.00	2 187 990.00	0.39
ユーロ合計		6 291 827.00	1.12
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26	675 000.00	650 898.44	0.11
USD MORGAN STANLEY 2.239%/VAR 21-21.07.32	1 040 000.00	839 482.51	0.15
米ドル合計		1 490 380.95	0.26
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		7 782 207.95	1.38
債券、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.50000% 19-21.06.31	8 090 000.00	4 666 764.76	0.83
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	3 610 000.00	2 292 770.57	0.40
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	270 000.00	154 850.04	0.03
オーストラリア・ドル合計		7 114 385.37	1.26
カナダ・ドル			
CAD CANADA HOUSING TRUST-144A 2.35000% 13-15.09.23	3 990 000.00	2 917 492.24	0.52
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 15-01.06.26	4 000 000.00	2 799 823.05	0.50
CAD CANADA, GOVERNMENT 1.00000% 16-01.06.27	2 260 000.00	1 539 041.17	0.27
CAD CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 11-01.12.45	3 600 000.00	2 857 242.20	0.51
CAD CANADA, GOVERNMENT 4.00000% 08-01.06.41	970 000.00	809 838.07	0.14
カナダ・ドル合計		10 923 436.73	1.94
中国元			
CNY AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.45000% 20-23.09.25	96 000 000.00	14 117 767.03	2.50
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.80000% 16-25.01.36	59 000 000.00	9 184 149.64	1.63
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04000% 17-10.04.27	39 800 000.00	6 013 315.89	1.07
CNY CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.45000% 19-20.09.29	121 500 000.00	18 076 495.44	3.21
中国元合計		47 391 728.00	8.41
ユーロ			
EUR ABBOTT IRELAND FINCING DAC-REG-S 0.87500% 18-27.09.23	375 000.00	409 760.64	0.07
EUR ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	300 000.00	268 613.13	0.05
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA REG-S 2.00000% 21-15.01.30	1 315 000.00	1 213 206.80	0.21
EUR BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON 0.50000% 17-03.07.24	1 900 000.00	2 019 229.47	0.36
EUR BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUND-REG-S 1.70000% 22-15.08.32	4 500 000.00	4 727 985.99	0.84
EUR CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	305 000.00	275 480.74	0.05
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	1 310 000.00	839 727.43	0.15
EUR FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25	720 000.00	707 840.64	0.13

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 17-25.05.28	4 760 000.00	4 786 868.48	0.85
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	1 800 000.00	1 365 981.41	0.24
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40	3 630 000.00	2 593 666.94	0.46
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 18-15.08.28	900 000.00	893 544.48	0.16
EUR INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.00000% 23-06.02.43	350 000.00	375 974.93	0.07
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 15-18.02.45	3 910 000.00	3 495 183.40	0.62
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26	1 990 000.00	2 091 268.65	0.37
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 4.00000% 05-01.02.37	2 310 000.00	2 460 991.80	0.44
EUR ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	3 690 000.00	3 381 204.50	0.60
EUR JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28	960 000.00	1 052 768.01	0.19
EUR MAPFRE SA-REG-S-SUB 2.87500% 22-13.04.30	500 000.00	472 435.83	0.08
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	620 000.00	589 747.97	0.10
EUR RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26	200 000.00	202 636.99	0.04
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	2 630 000.00	2 697 892.72	0.48
EUR SPAIN, KINGDOM OF 4.20000% 05-31.01.37	1 350 000.00	1 585 085.11	0.28
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	920 000.00	875 418.66	0.15
EUR SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25	7 770 000.00	8 355 478.83	1.48
EUR TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	250 000.00	234 479.24	0.04
EUR UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	200 000.00	185 267.54	0.03
EUR VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV-REG-S 1.12500% 17-02.10.23	400 000.00	436 994.99	0.08
ユーロ合計		48 594 735.32	8.62
英ポンド			
GBP BELLIS ACQUISITION CO PLC-REG-S 3.25000% 21-16.02.26	345 000.00	355 577.01	0.06
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	185 000.00	158 857.44	0.03
GBP ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	655 000.00	754 416.18	0.13
GBP SCOTTISH WIDOWS PLC-REG-S-SUB 5.50000% 13-16.06.23	380 000.00	477 074.65	0.09
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.25000% 12-22.01.44	1 190 000.00	1 317 953.96	0.23
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47	3 890 000.00	2 954 183.21	0.53
GBP UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.87500% 19-22.10.29	3 350 000.00	3 558 390.73	0.63
英ポンド合計		9 576 453.18	1.70
日本円			
JPY JAPAN 0.10000% 19-20.12.28	957 000 000.00	7 009 823.78	1.24
JPY JAPAN 0.50000% 19-20.03.59	325 950 000.00	1 849 080.72	0.33
JPY JAPAN 0.80000% 17-20.03.47	344 000 000.00	2 362 311.00	0.42
JPY JAPAN 0.80000% 18-20.03.58	146 000 000.00	926 158.84	0.17
JPY JAPAN 2.00000% 11-20.09.41	209 000 000.00	1 796 311.75	0.32
JPY JAPAN 2.30000% 05-20.06.35	839 600 000.00	7 386 186.19	1.31
日本円合計		21 329 872.28	3.79
韓国ウォン			
KRW KOREA, REPUBLIC OF 1.87500% 16-10.06.26	18 078 000 000.00	12 927 238.27	2.29
韓国ウォン合計		12 927 238.27	2.29
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	1 810 000.00	922 585.35	0.16
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	1 320 000.00	554 231.43	0.10
NZD NEW ZEALAND 3.00000% 18-20.04.29	7 020 000.00	4 095 260.38	0.73
ニュージーランド・ドル合計		5 572 077.16	0.99
米ドル			
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	170 000.00	132 139.39	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELEC 4.95000% 23-01.04.33	405 000.00	415 303.62	0.07
USD CITIGROUP INC 3.87500% 13-25.10.23	840 000.00	833 674.91	0.15
USD CONSUMERS ENERGY COMPANY 3.25000% 16-15.08.46	100 000.00	76 278.30	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	340 000.00	154 551.25	0.03
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.00000% 12-30.09.42	250 000.00	216 076.60	0.04
USD DUKE ENERGY OHIO INC 5.25000% 23-01.04.33	160 000.00	166 118.10	0.03
USD DUKE ENERGY PROGRESS LLC 5.25000% 23-15.03.33	425 000.00	444 848.42	0.08
USD EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 10.87500% 23-28.02.26	210 000.00	172 370.63	0.03
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.87500% 23-15.03.28	880 000.00	889 389.60	0.16
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.15000% 15-22.05.45	420 000.00	396 621.75	0.07
USD JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 0.62500% 20-22.05.23	1 520 000.00	1 517 651.44	0.27

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	363 000.00	278 330.25	0.05
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 2.10000% 20-01.08.27	225 000.00	196 863.81	0.04
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 2.50000% 20-01.02.31	240 000.00	194 479.82	0.03
USD PACIFICORP 6.00000% 09-15.01.39	340 000.00	369 749.59	0.07
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	300 000.00	259 743.75	0.05
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	290 000.00	285 242.60	0.05
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.00000% 17-01.04.47	170 000.00	140 502.25	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	235 000.00	230 026.10	0.04
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 2.85000% 19-01.08.29	155 000.00	140 420.65	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 20-10.01.25	200 000.00	41 552.00	0.01
米ドル合計		7 551 934.83	1.34
債券、固定利付債合計		170 981 861.14	30.34
債券、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.00000% 20-22.10.27	3 490 000.00	3 424 279.67	0.61
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.05.35	3 690 000.00	3 062 400.20	0.54
ユーロ合計		6 486 679.87	1.15
債券、ゼロ・クーポン合計		6 486 679.87	1.15
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL-REG-S 8.000%/VAR 22-22.09.26	700 000.00	779 973.13	0.14
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	250 000.00	254 364.36	0.05
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	200 000.00	190 704.52	0.03
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	400 000.00	421 879.91	0.08
EUR ORSTED A/S-REG-S-SUB 2.250%/VAR 17-24.11.3017	100 000.00	104 742.00	0.02
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	600 000.00	534 061.32	0.09
EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	830 000.00	744 345.06	0.13
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	200 000.00	194 304.00	0.03
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	87 768.00	0.02
ユーロ合計		3 312 142.30	0.59
英ポンド			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	430 000.00	497 417.72	0.09
英ポンド合計		497 417.72	0.09
日本円			
JPY JAPAN 0.100%/CPI LINKED 19-10.03.29	1 065 000 000.00	8 582 063.02	1.52
日本円合計		8 582 063.02	1.52
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35	3 250 000.00	2 563 743.16	0.45
ニュージーランド・ドル合計		2 563 743.16	0.45
米ドル			
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	1 210 000.00	1 202 027.67	0.22
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	400 000.00	300 000.00	0.05
米ドル合計		1 502 027.67	0.27
債券、変動利付債合計		16 457 393.87	2.92
財務省証券（T-note）、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 13-15.05.43	3 270 000.00	2 837 874.60	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46	15 210 000.00	11 509 098.08	2.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.08.47	1 930 000.00	1 606 875.78	0.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 19-15.05.49	2 470 000.00	2 116 384.77	0.38

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 13-15.11.23	3 210 000.00	3 172 006.64	0.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26	8 530 000.00	7 957 890.26	1.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	15 730 000.00	12 909 660.08	2.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31	1 740 000.00	1 525 218.75	0.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-30.09.27	10 990 000.00	11 238 562.92	2.00
米ドル合計		54 873 571.88	9.74
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		54 873 571.88	9.74
財務省証券（T-note）、変動利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 15-15.02.45	2 520 000.00	2 719 346.02	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.500%/CPI LINKED 18-15.01.28	13 800 000.00	16 215 295.30	2.88
米ドル合計		18 934 641.32	3.36
財務省証券（T-note）、変動利付債合計		18 934 641.32	3.36
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		399 412 748.48	70.88
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD COLT MERGER SUB INC-144A 3.60000% 18-25.02.48	1 500 000.00	405 174.84	0.07
USD PSNH FUNDING LLC 3.81400% 18-01.02.35	600 000.00	573 259.86	0.10
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.34000% 18-25.08.47	1 890 000.00	391 669.28	0.07
米ドル合計		1 370 103.98	0.24
アセット・バック証券、固定利付債合計		1 370 103.98	0.24
アセット・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A VAR 17-25.07.40	150 000.00	141 359.76	0.03
米ドル合計		141 359.76	0.03
アセット・バック証券、変動利付債合計		141 359.76	0.03
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK BNK-SUB 4.40700% 18-01.11.61	300 000.00	292 039.26	0.05
USD BBCMS TRUST-144A-SUB 4.49800% 15-06.08.35	407 000.00	372 974.60	0.07
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST 3.94360% 18-01.07.51	200 000.00	190 725.82	0.03
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST-SUB 3.97900% 19-01.03.62	200 000.00	179 351.30	0.03
USD BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33	200 000.00	187 369.42	0.03
USD CD MORTGAGE TRUST 3.45600% 17-01.11.50	400 000.00	371 088.32	0.07
USD CITIGROUP COMERCIAL MORT TRST 2015-SUB 3.77800% 15-01.09.58	280 000.00	267 829.77	0.05
USD CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 4.22800% 18-01.06.51	375 000.00	361 152.33	0.06
USD COMM 2015-PC1 MORTGAGE TRUST 3.62000% 15-01.07.50	250 000.00	102 937.63	0.02
USD FANNIE MAE 1.00000% 22-01.04.51	950 000.00	663 672.82	0.12
USD FANNIE MAE 1.50000% 21-01.02.51	550 000.00	374 923.01	0.07
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.03.51	1 650 000.00	1 131 780.72	0.20
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.07.51	1 900 000.00	1 409 964.64	0.25
USD FANNIE MAE 2.00000% 20-01.09.50	1 750 000.00	1 029 445.59	0.18
USD FANNIE MAE 2.00000% 20-01.01.51	500 000.00	330 780.79	0.06
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.02.51	1 775 000.00	1 189 982.34	0.21
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.02.51	2 200 000.00	1 502 192.06	0.27
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.05.51	600 000.00	429 646.34	0.08
USD FANNIE MAE 2.50000% 21-01.10.51	1 575 000.00	1 231 150.71	0.22

注記は当財務書類の一部である。

銘柄				数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD	FANNIE MAE	2.50000%	22-01.03.52	450 000.00	371 552.80	0.07
USD	FANNIE MAE	2.50000%	21-01.08.51	1 100 000.00	882 054.38	0.16
USD	FANNIE MAE	2.50000%	21-01.08.51	1 346 000.00	986 131.68	0.17
USD	FANNIE MAE	3.00000%	13-01.08.43	136 385.00	29 918.30	0.01
USD	FANNIE MAE	3.00000%	16-01.07.46	1 500 000.00	452 066.81	0.08
USD	FANNIE MAE	3.00000%	21-01.10.51	375 000.00	301 473.27	0.05
USD	FANNIE MAE	3.00000%	22-01.12.48	1 975 000.00	1 620 972.68	0.29
USD	FANNIE MAE	3.00000%	20-01.06.50	2 250 000.00	751 882.88	0.13
USD	FANNIE MAE	3.00000%	20-01.08.50	600 000.00	221 828.88	0.04
USD	FANNIE MAE	3.50000%	16-01.08.46	450 000.00	116 779.26	0.02
USD	FANNIE MAE	3.50000%	15-01.04.45	200 000.00	66 574.85	0.01
USD	FANNIE MAE	3.50000%	16-01.01.46	175 000.00	54 320.50	0.01
USD	FANNIE MAE	3.50000%	16-01.12.46	600 000.00	271 460.66	0.05
USD	FANNIE MAE	3.50000%	18-01.03.48	250 000.00	44 112.66	0.01
USD	FANNIE MAE	3.50000%	18-01.07.48	350 000.00	73 464.07	0.01
USD	FANNIE MAE	3.50000%	17-01.08.47	650 000.00	93 203.29	0.02
USD	FANNIE MAE	4.00000%	10-01.01.41	1 357 002.00	86 488.56	0.02
USD	FANNIE MAE	4.00000%	11-01.01.41	1 584 763.00	105 094.18	0.02
USD	FANNIE MAE	4.00000%	15-01.11.45	1 250 000.00	346 116.44	0.06
USD	FANNIE MAE	4.00000%	16-01.02.46	1 025 000.00	107 282.32	0.02
USD	FANNIE MAE	4.00000%	15-01.08.45	1 575 000.00	471 440.95	0.08
USD	FANNIE MAE	4.00000%	14-01.11.44	400 000.00	94 690.02	0.02
USD	FANNIE MAE	4.00000%	11-01.02.41	938 348.00	62 162.50	0.01
USD	FANNIE MAE	4.00000%	11-01.02.41	2 969 225.00	198 044.99	0.04
USD	FANNIE MAE	4.50000%	15-01.06.44	465 000.00	80 675.03	0.01
USD	FANNIE MAE	4.50000%	16-01.07.44	350 000.00	59 033.11	0.01
USD	FANNIE MAE	4.50000%	11-01.04.41	1 629 000.00	72 941.32	0.01
USD	FANNIE MAE	5.00000%	11-01.01.41	589 000.00	40 171.90	0.01
USD	FANNIE MAE	5.00000%	10-01.08.40	50 000.00	2 494.01	0.00
USD	FANNIE MAE	5.50000%	15-01.01.39	425 000.00	76 935.85	0.01
USD	FANNIE MAE	5.50000%	07-01.04.37	1 242 395.00	47 580.57	0.01
USD	FANNIE MAE POOL	2.00000%	22-01.11.51	1 600 000.00	1 240 446.75	0.22
USD	FANNIE MAE POOL	2.50000%	21-01.11.51	1 050 000.00	812 407.25	0.14
USD	FREDDIE MAC	1.50000%	21-01.09.51	2 496 884.00	1 837 124.70	0.33
USD	FREDDIE MAC	2.00000%	21-01.02.51	3 550 000.00	2 387 051.57	0.42
USD	FREDDIE MAC	2.50000%	20-01.10.50	625 000.00	395 006.55	0.07
USD	FREDDIE MAC	2.50000%	21-01.05.51	2 675 000.00	1 884 691.10	0.33
USD	FREDDIE MAC	3.00000%	16-01.09.46	975 000.00	192 284.38	0.03
USD	FREDDIE MAC	3.00000%	20-01.09.50	923 000.00	361 222.50	0.06
USD	FREDDIE MAC	3.00000%	16-01.10.46	1 200 000.00	391 077.53	0.07
USD	FREDDIE MAC	3.00000%	18-01.04.47	2 125 000.00	537 477.96	0.10
USD	FREDDIE MAC	3.50000%	16-01.08.46	600 000.00	90 050.41	0.02
USD	FREDDIE MAC	3.50000%	22-01.05.51	2 650 000.00	2 282 169.68	0.41
USD	FREDDIE MAC	3.50000%	15-01.06.45	350 000.00	116 426.22	0.02
USD	FREDDIE MAC	4.00000%	17-01.11.47	325 000.00	49 077.33	0.01
USD	FREDDIE MAC	4.00000%	17-01.08.47	450 000.00	72 474.32	0.01
USD	FREDDIE MAC	4.00000%	17-01.11.47	475 000.00	81 534.39	0.01
USD	FREDDIE MAC	4.50000%	11-01.03.41	2 647 244.00	107 480.76	0.02
USD	FREDDIE MAC	4.50000%	11-01.09.41	1 120 431.00	43 482.65	0.01
USD	FREDDIE MAC	5.00000%	05-01.05.35	11 775 000.00	118 727.52	0.02
USD	FREDDIE MAC	5.00000%	23-01.03.53	1 500 000.00	1 502 838.15	0.27
USD	FREDDIE MAC	5.50000%	14-01.06.41	575 000.00	63 240.43	0.01
USD	FREDDIE MAC POOL	2.50000%	21-01.10.51	3 000 000.00	2 331 861.22	0.41
USD	GINNIE MAE	2.00000%	20-01.02.51	1 350 000.00	877 192.18	0.16
USD	GINNIE MAE	2.00000%	21-01.11.51	2 425 000.00	1 870 466.38	0.33
USD	GINNIE MAE	3.00000%	16-01.08.46	1 925 000.00	308 914.89	0.05
USD	GINNIE MAE	3.00000%	19-01.10.49	5 425 000.00	1 112 869.49	0.20
USD	GINNIE MAE	3.50000%	12-01.08.42	1 300 000.00	238 551.03	0.04
USD	GINNIE MAE	3.50000%	18-01.01.48	525 000.00	81 857.72	0.01
USD	GINNIE MAE	4.50000%	11-01.05.41	1 141 511.00	45 499.35	0.01
USD	GINNIE MAE	5.50000%	11-01.06.41	1 219 909.00	10 099.99	0.00
USD	GINNIE MAE	5.50000%	08-01.12.38	1 706 205.00	26 429.74	0.00
USD	GINNIE MAE	5.50000%	10-01.03.40	1 357 167.00	30 241.03	0.01
USD	GINNIE MAE	5.50000%	08-01.01.38	1 053 419.00	109 957.47	0.02

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GINNIE MAE 6.50000% 07-01.06.37	8 288 862.00	327 911.88	0.06
USD GINNIE MAE 6.50000% 08-01.10.38	8 474 348.00	22 281.23	0.00
USD GINNIE MAE II 2.50000% 21-01.12.51	3 550 000.00	2 829 508.68	0.50
USD HILTON USA TRUST-144-SUB 3.32284% 16-01.11.35	400 000.00	377 431.24	0.07
USD MORGAN STANLEY BOA MERR LYH TRT 15-C24 3.73200% 15-01.05.48	170 000.00	163 591.68	0.03
USD WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 4.21200% 18-01.05.51	200 000.00	191 774.58	0.03
USD WF-RBS COMMERCIAL MORTGAGE TRUST-SUB 4.10100% 14-01.03.47	260 320.00	255 455.11	0.05
米ドル合計		45 586 143.23	8.09
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		45 586 143.23	8.09
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
米ドル			
USD BAML COMMERCIAL MORTGAGE-144A VAR 15-01.04.33	800 000.00	710 671.12	0.13
USD BX TRUST-144A 1M LIBOR+80BP 18-15.05.35	350 000.00	344 748.78	0.06
USD CD MORTGAGE TRUST FLR 17-01.11.50	230 000.00	210 157.72	0.04
USD FREMF MORTGAGE TRUST-144A-SUB VAR 17-01.05.50	200 000.00	190 963.80	0.03
USD GS MORTGAGE SECURITIES TRUST 4.047%/VAR 17-01.03.50	325 000.00	289 216.88	0.05
USD JPMDB COMRCIAL MOTGE SECURTIES TRST 3.985%/VAR 17-01.10.50	650 000.00	580 904.94	0.10
USD MAD MORTGAGE TRUST-144A 3.141%/VAR 17-01.08.34	370 000.00	342 708.21	0.06
USD MORGAN STANLEY BOA ML TRT 2015-C24-SUB VAR 15-01.05.48	500 000.00	475 077.60	0.09
USD MSCG TRUST 2018-SELF-144A-SUB 1M LIBOR+90BP 18-15.10.37	495 000.00	444 127.09	0.08
米ドル合計		3 588 576.14	0.64
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		3 588 576.14	0.64
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 2.00000% 21-15.07.26	200 000.00	182 309.10	0.03
USD AKER BP ASA-144A 3.10000% 21-15.07.31	200 000.00	170 394.87	0.03
USD AKER BP ASA-144A 3.75000% 20-15.01.30	490 000.00	445 330.30	0.08
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.12500% 21-21.02.26	340 000.00	303 361.60	0.05
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	400 000.00	351 106.36	0.06
USD BROADCOM INC-144A 2.60000% 21-15.02.33	1 630 000.00	1 286 366.08	0.23
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	506 000.00	425 870.23	0.08
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.14400% 23-28.04.25	735 000.00	735 369.87	0.13
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25	285 000.00	287 253.13	0.05
USD COLONIAL ENTERPRISES INC-144A 3.25000% 20-15.05.30	290 000.00	262 781.05	0.05
USD COMCAST CORP 2.93700% 22-01.11.56	332 000.00	220 716.67	0.04
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.85000% 21-15.07.25	200 000.00	204 255.60	0.04
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	600 000.00	606 477.29	0.11
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	180 000.00	164 836.21	0.03
USD KENVUE INC-144A 5.35000% 23-22.03.26	195 000.00	200 193.37	0.04
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	105 000.00	102 661.40	0.02
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	80 000.00	78 196.34	0.01
USD PHILLIPS 66 CO-144A 4.68000% 22-15.02.45	400 000.00	355 032.80	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-SUB-144A 7.36700% 23-10.01.53	1 250 000.00	1 225 827.79	0.22
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 6.20000% 10-15.03.40	320 000.00	340 847.72	0.06
USD TEACHERS INSURANCE&ANNUITY ASS-144A-SUB 4.90000% 14-15.09.44	1 090 000.00	1 015 167.78	0.18
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	115 000.00	107 120.87	0.02
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 2.05000% 21-15.04.26	285 000.00	253 302.30	0.04
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	145 000.00	136 753.13	0.02
USD XCEL ENERGY INC 4.80000% 11-15.09.41	290 000.00	268 332.03	0.05
米ドル合計		9 729 863.89	1.73
ノート、固定利付債合計		9 729 863.89	1.73

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.332%/VAR 23-09.03.44	325 000.00	342 315.16	0.06
USD STATE STREET CORP 2.901%/VAR 20-30.03.26	375 000.00	360 918.20	0.06
米ドル合計		703 233.36	0.12
ノート、変動利付債合計		703 233.36	0.12
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD AURIZON FINANCE PTY LTD 3.00000% 21-09.03.28	1 020 000.00	589 208.70	0.10
オーストラリア・ドル合計		589 208.70	0.10
英ポンド			
GBP NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION 4.00000% 12-08.06.27	330 000.00	395 578.92	0.07
英ポンド合計		395 578.92	0.07
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		984 787.62	0.17
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
オーストラリア・ドル			
AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK-SUB 6.322%/VAR 22-03.08.32	750 000.00	509 460.84	0.09
オーストラリア・ドル合計		509 460.84	0.09
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		509 460.84	0.09
債券、固定利付債			
米ドル			
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	340 000.00	337 695.76	0.06
米ドル合計		337 695.76	0.06
債券、固定利付債合計		337 695.76	0.06
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR BANKINTER SA-REG-S 4.375%/VAR 23-03.05.30	800 000.00	888 903.71	0.16
ユーロ合計		888 903.71	0.16
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40	1 890 000.00	1 462 244.93	0.26
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	5 620 000.00	4 713 289.99	0.84
ニュージーランド・ドル合計		6 175 534.92	1.10
米ドル			
USD SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80	315 000.00	285 758.20	0.05
米ドル合計		285 758.20	0.05
債券、変動利付債合計		7 350 196.83	1.31
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		70 301 421.41	12.48

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD DBGS 2018-BIOD MORTGAGE TRUST-SUB 4.61044% 18-01.10.51	200 000.00	187 898.92	0.03
米ドル合計		187 898.92	0.03
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		187 898.92	0.03
ノート、固定利付債			
カナダ・ドル			
CAD PSP CAPITAL INC 0.90000% 20-15.06.26	4 300 000.00	2 914 390.54	0.52
カナダ・ドル合計		2 914 390.54	0.52
ノート、固定利付債合計		2 914 390.54	0.52
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		3 102 289.46	0.55

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	565 000.00	585 332.41	0.10
米ドル合計		585 332.41	0.10
ノート、固定利付債合計		585 332.41	0.10
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		585 332.41	0.10

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

投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	250.00	37 969.32	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	2.00	41 730.82	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	67 000.00	3 686 340.00	0.65
ルクセンブルグ合計		3 766 040.14	0.67
投資信託、オープン・エンド型合計		3 766 040.14	0.67
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		3 766 040.14	0.67
投資有価証券合計		477 167 831.90	84.68

To Be Announced（"TBA"）モーゲージ担保証券（注１）

TBAモーゲージ担保証券			
USD FANNIE MAE 2.00000% MAY 23 11.05.23	2 650 000.00	3 211.46	0.00
USD FANNIE MAE 3.50000% MAY 23 11.05.23	2 275 000.00	-1 189.12	0.00
USD FANNIE MAE 4.00000% MAY 23 11.05.23	3 375 000.00	-4 407.35	0.00
USD GINNIE MAE 5.00000% MAY 23 11.05.23	4 200 000.00	-5 701.75	0.00
USD GINNIE MAE 3.00000% MAY 23 11.05.23	1 675 000.00	-3 511.32	0.00
TBAモーゲージ担保証券合計		-11 598.08	0.00
To Be Announced（"TBA"）モーゲージ担保証券（注１）合計		-11 598.08	0.00

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 08.06.23	77.00	408 888.48	0.08
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.06.23	-52.00	-164 186.88	-0.03
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.06.23	-25.00	-221 352.00	-0.04
GBP LONG GILT FUTURE 28.06.23	74.00	48 365.51	0.01
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.23	194.00	511 203.13	0.09
AUD AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.06.23	-272.00	-36 741.40	-0.01
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.06.23	-32.00	-50 834.70	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 21.06.23	-5.00	-29 960.94	-0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	205.00	698 281.25	0.13
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.23	-16.00	-367 789.08	-0.07
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	125.00	292 968.87	0.05
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 21.06.23	-196.00	-330 207.18	-0.06
債券関連金融先物合計		758 635.06	0.13
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		758 635.06	0.13
金融派生商品合計		758 635.06	0.13
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日			
USD 47 564 263.23 CNY 326 405 000.00 4.5.2023		398 636.96	0.07
USD 12 760 243.85 KRW 16 536 000 000.00 4.5.2023		401 270.50	0.07
CHF 105 238 600.00 USD 115 720 251.04 4.5.2023		2 566 036.13	0.46
JPY 8 617 107 100.00 USD 65 130 726.56 8.5.2023		-1 790 445.85	-0.32
USD 39 095 334.34 JPY 5 172 500 000.00 8.5.2023		1 074 732.05	0.19
USD 14 971 206.98 CAD 20 085 000.00 4.5.2023		161 646.42	0.03
USD 13 645 897.24 NZD 21 675 000.00 4.5.2023		258 550.24	0.05
USD 12 139 982.52 GBP 9 715 000.00 4.5.2023		-71 888.96	-0.01
GBP 13 829 600.00 USD 17 281 636.88 4.5.2023		102 336.13	0.02
USD 125 443 889.56 EUR 114 860 000.00 4.5.2023		-1 389 455.24	-0.25
EUR 122 959 600.00 USD 134 289 835.30 4.5.2023		1 487 435.67	0.26
USD 10 333 164.41 AUD 15 285 000.00 4.5.2023		230 635.58	0.04
CHF 568 500.00 USD 630 053.87 4.5.2023		8 929.87	0.00
USD 688 855.03 EUR 629 700.00 4.5.2023		-6 486.75	0.00
USD 484 454.16 JPY 63 700 000.00 8.5.2023		16 225.57	0.00
USD 1 452 662.71 EUR 1 330 000.00 4.5.2023		-15 980.41	0.00
GBP 178 100.00 USD 221 334.51 4.5.2023		2 539.33	0.00
EUR 1 467 800.00 USD 1 603 171.67 4.5.2023		17 636.13	0.00
EUR 1 475 000.00 USD 1 618 753.35 4.5.2023		10 005.00	0.00
USD 182 476.62 GBP 146 500.00 4.5.2023		-1 675.64	0.00
USD 1 481 023.17 EUR 1 350 000.00 4.5.2023		-9 704.81	0.00
USD 47 463 973.59 CNY 326 405 000.00 6.6.2023		158 181.82	0.03
CNY 326 405 000.00 USD 47 373 730.04 4.5.2023		-208 103.77	-0.04
KRW 16 536 000 000.00 USD 12 369 838.42 4.5.2023		-10 865.07	0.00
USD 12 393 386.60 KRW 16 536 000 000.00 7.6.2023		4 959.30	0.00
USD 47 163 581.72 CNY 326 405 000.00 4.5.2023		-2 044.55	0.00
JPY 8 553 407 100.00 USD 63 324 465.02 6.6.2023		-166 637.27	-0.03
JPY 5 172 500 000.00 USD 38 128 414.88 8.5.2023		-107 812.59	-0.02
USD 63 050 334.37 JPY 8 553 407 100.00 8.5.2023		178 282.25	0.03
USD 38 294 189.85 JPY 5 172 500 000.00 6.6.2023		100 770.53	0.02
USD 959 766.26 GBP 763 000.00 4.5.2023		666.11	0.00
先渡為替契約合計		3 398 374.68	0.60
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		80 604 993.31	14.30
その他の資産および負債		1 576 232.27	0.29
純資産総額		563 494 469.14	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル

2023年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	10 000 000.00	9 651 875.00	0.49
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 3.00000% 18-20.09.23	2 000 000.00	1 983 828.02	0.10
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.75000% 23-12.01.28	2 927 000.00	2 987 322.54	0.15
USD AMAZON.COM INC 3.30000% 22-13.04.27	8 000 000.00	7 776 369.28	0.39
USD APPLE INC 0.70000% 21-08.02.26	17 000 000.00	15 526 084.87	0.79
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	5 000 000.00	4 421 347.45	0.22
USD APPLE INC 3.20000% 15-13.05.25	5 500 000.00	5 396 904.15	0.27
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVEST BANK/THE 0.50000% 21-30.10.24	2 500 000.00	2 355 114.69	0.12
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK/THE 0.50000% 20-28.05.25	10 000 000.00	9 259 504.00	0.47
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 2.00000% 22-21.03.25	5 000 000.00	4 797 620.00	0.24
USD BANQUE FEDERATIVE DU CRT MUT SA-REG-S 1.60400% 21-04.10.26	12 000 000.00	10 715 797.08	0.54
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 3.00000% 22-17.05.25	5 000 000.00	4 875 685.00	0.25
USD CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 21-19.05.26	2 000 000.00	1 826 557.70	0.09
USD CHEVRON CORP 2.95400% 16-16.05.26	2 000 000.00	1 940 309.26	0.10
USD CHEVRON USA INC 0.68700% 20-12.08.25	2 000 000.00	1 840 588.20	0.09
USD CHEVRON USA INC 1.01800% 20-12.08.27	5 000 000.00	4 439 095.20	0.23
USD COLGATE-PALMOLIVE CO 3.10000% 22-15.08.27	2 000 000.00	1 944 315.08	0.10
USD COLGATE-PALMOLIVE CO 4.60000% 23-01.03.28	5 000 000.00	5 157 781.50	0.26
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.12500% 21-15.06.26	14 000 000.00	12 599 916.00	0.64
USD CORP ANDINA DE FOMENTO 2.25000% 22-08.02.27	13 000 000.00	11 918 790.00	0.60
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 0.37500% 21-10.06.24	2 000 000.00	1 906 860.00	0.10
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 20-04.03.25	5 500 000.00	5 196 733.74	0.26
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25	1 077 000.00	1 025 817.07	0.05
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 1.19400% 21-15.03.27	3 000 000.00	2 675 026.92	0.14
USD EQUINOR ASA 1.75000% 20-22.01.26	7 000 000.00	6 543 882.59	0.33
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-19.05.25	10 000 000.00	9 285 589.90	0.47
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.62500% 20-25.07.25	2 500 000.00	2 325 525.65	0.12
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.37500% 21-26.03.26	5 000 000.00	4 531 620.00	0.23
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	1 500 000.00	1 448 718.75	0.07
USD EXXON MOBIL CORP 2.01900% 19-16.08.24	3 204 000.00	3 102 970.51	0.16
USD EXXON MOBIL CORP 2.99200% 20-19.03.25	8 200 000.00	7 985 669.14	0.40
USD HONG KONG GOVT GREEN BND PRGM-REG-S 2.50000% 19-28.05.24	600 000.00	588 700.75	0.03
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	5 450 000.00	5 149 173.89	0.26
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-23.09.24	7 500 000.00	7 106 065.58	0.36
USD INTER-AMERICAN INVESTMENT CORP 2.62500% 22-22.04.25	2 000 000.00	1 934 942.06	0.10
USD INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000% 23-12.07.28	5 554 000.00	5 520 781.52	0.28
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.87500% 21-15.07.26	5 000 000.00	4 567 145.40	0.23
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.50000% 20-28.10.25	5 000 000.00	4 598 157.45	0.23
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-24.11.27	7 000 000.00	6 150 032.70	0.31
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.87500% 20-12.03.25	7 000 000.00	6 572 244.00	0.33
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 2.25000% 22-24.02.27	4 450 000.00	4 127 909.00	0.21
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 4.00000% 22-08.09.25	5 000 000.00	4 927 800.00	0.25
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 1.12500% 21-17.05.26	7 000 000.00	6 271 930.00	0.32
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.00000% 15-02.05.25	7 500 000.00	7 185 401.40	0.36
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.50000% 21-20.09.24	10 000 000.00	9 469 932.81	0.48
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.50000% 20-27.05.25	5 000 000.00	4 632 941.06	0.24
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 21-30.03.26	5 000 000.00	4 590 836.65	0.23
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 3.87500% 22-28.09.27	3 000 000.00	3 023 070.45	0.15
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	8 565 000.00	8 414 206.32	0.43
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 22-24.08.27	5 000 000.00	4 884 270.00	0.25
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	5 000 000.00	4 701 051.50	0.24
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.88700% 22-12.01.27	4 000 000.00	3 653 146.28	0.19
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.75000% 20-15.01.25	5 000 000.00	4 782 540.00	0.24

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.15000% 21-14.01.27	4 500 000.00	4 042 008.45	0.21
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.12500% 22-01.10.27	2 000 000.00	2 004 082.10	0.10
USD NORDEA BANK AB-REG-S 0.62500% 21-24.05.24	2 000 000.00	1 900 283.88	0.10
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 4.75000% 22-22.09.25	2 000 000.00	1 987 808.44	0.10
USD NORDIC INVESTMENT BANK 0.37500% 21-20.09.24	3 000 000.00	2 839 140.00	0.14
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.62500% 22-04.04.25	3 000 000.00	2 915 550.00	0.15
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.00000% 15-20.11.25	5 000 000.00	4 846 157.25	0.25
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.00000% 20-14.02.27	4 000 000.00	3 716 095.40	0.19
USD OMERS FINANCE TRUST CP-REG-S 1.10000% 21-26.03.26	1 000 000.00	914 117.46	0.05
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.05000% 20-21.05.27	5 000 000.00	4 476 470.85	0.23
USD ONTARIO, PROVINCE OF 0.62500% 21-21.01.26	2 000 000.00	1 825 705.55	0.09
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.00000% 21-23.04.26	1 300 000.00	1 194 009.63	0.06
USD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA CANADA 0.90000% 21-20.07.26	5 500 000.00	5 006 585.48	0.25
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 1.00000% 21-29.06.26	2 000 000.00	1 817 293.64	0.09
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 0.50000% 21-15.09.24	2 500 000.00	2 363 779.80	0.12
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 1.37500% 21-12.09.26	3 500 000.00	3 165 968.74	0.16
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	2 000 000.00	2 044 125.00	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.40000% 20-16.04.25	4 500 000.00	4 406 625.00	0.22
USD QUEBEC, PROVINCE OF 3.62500% 23-13.04.28	7 000 000.00	6 935 989.20	0.35
USD QUEBEC, PROVINCE OF 2.50000% 16-20.04.26	5 505 000.00	5 278 730.31	0.27
USD SASKATCHEWAN, PROVINCE OF 3.25000% 22-08.06.27	7 000 000.00	6 835 053.69	0.35
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	16 190 000.00	15 625 647.85	0.79
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 3.95000% 22-10.06.27	3 809 000.00	3 700 855.40	0.19
USD SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25	5 777 000.00	5 589 949.41	0.28
USD TSMC ARIZONA CORP 1.75000% 21-25.10.26	2 000 000.00	1 816 000.00	0.09
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.25000% 21-23.04.26	7 000 000.00	6 348 790.00	0.32
USD UBS AG/LONDON-REG-S 0.70000% 21-09.08.24	8 000 000.00	7 508 813.68	0.38
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	500 000.00	485 291.76	0.02
USD WALMART INC 3.70000% 18-26.06.28	5 000 000.00	4 977 253.70	0.25
USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26	6 000 000.00	5 403 777.60	0.27
USD WESTPAC BANKING CORP 1.95300% 21-20.11.28	2 000 000.00	1 753 964.20	0.09
USD WESTPAC BANKING CORP 5.35000% 22-18.10.24	5 000 000.00	5 043 843.85	0.26
米ドル合計		409 065 265.43	20.71
ノート、固定利付債合計		409 065 265.43	20.71
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD DNB BANK ASA-REG-S 0.856%/VAR 21-30.09.25	7 000 000.00	6 555 813.04	0.33
USD DNB BANK ASA-REG-S 2.968%/VAR 22-28.03.25	5 000 000.00	4 884 773.70	0.25
米ドル合計		11 440 586.74	0.58
ノート、変動利付債合計		11 440 586.74	0.58
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25	6 000 000.00	5 558 734.02	0.28
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26	3 000 000.00	2 727 336.00	0.14
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 4.37500% 22-03.11.27	5 625 000.00	5 779 237.50	0.29
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.62500% 21-22.01.26	2 000 000.00	1 821 460.00	0.09
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 3.12500% 22-30.06.24	5 000 000.00	4 903 405.20	0.25
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.46000% 20-30.06.25	500 000.00	464 991.00	0.02
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.26000% 21-10.02.26	800 000.00	730 848.00	0.04
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	10 000 000.00	9 607 401.60	0.49
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26	6 000 000.00	5 476 281.42	0.28
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.25000% 21-09.06.28	5 000 000.00	4 448 435.90	0.23
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 21-08.10.24	8 250 000.00	7 816 627.50	0.40
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.5000% 22-20.01.27	5 000 000.00	4 617 417.85	0.23
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.87500% 22-06.05.25	5 000 000.00	4 876 008.70	0.25
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.12500% 22-27.09.24	7 275 000.00	7 236 488.18	0.37
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BANK 3.37500% 22-29.06.25	4 000 000.00	3 926 120.00	0.20
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GRP/NY 3.70000% 15-16.11.25	8 000 000.00	7 810 841.60	0.40

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 2.87500% 14-18.09.24	4 000 000.00	3 907 543.48	0.20
USD BNG BANK NV-REG-S 0.87500% 21-18.05.26	5 000 000.00	4 555 807.55	0.23
USD CAISSE D'AMORT DE LA DS-REG-S 0.37500% 20-23.09.25	8 000 000.00	7 332 050.88	0.37
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETT-REG-S 1.12500% 21-29.11.24	2 500 000.00	2 371 545.20	0.12
USD CDP FINANCIAL INC-REG-S 1.75000% 22-01.02.27	8 000 000.00	7 358 342.40	0.37
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	3 350 000.00	3 226 485.79	0.16
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.01500% 22-11.01.27	8 000 000.00	7 267 500.00	0.37
USD DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 1.87500% 22-14.02.25	7 000 000.00	6 630 544.69	0.34
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	4 300 000.00	4 221 525.00	0.21
USD ERSTE ABWICKLUNGSANSTALT-REG-S 0.87500% 21-30.10.24	7 400 000.00	7 008 022.00	0.35
USD EUROCLEAR BANK-REG-S 1.26100% 21-03.08.26	7 000 000.00	6 376 906.34	0.32
USD EUROFIMA EUROPAEISCHE GESELLSCHAFT-REG-S 3.12500% 22-16.05.25	5 900 000.00	5 748 134.00	0.29
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 4.37500% 23-09.03.28	10 000 000.00	10 325 838.80	0.52
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 1.75000% 21-19.10.28	5 000 000.00	4 380 625.00	0.22
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 5.12500% 22-13.10.27	3 000 000.00	3 081 187.50	0.16
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 4.37500% 23-24.04.28	2 368 000.00	2 344 024.00	0.12
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONA-REG-S 4.50000% 23-11.01.28	3 556 000.00	3 652 481.39	0.19
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-20.04.26	12 000 000.00	11 007 630.72	0.56
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.37500% 20-16.07.25	3 000 000.00	2 755 388.61	0.14
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 21-08.10.26	4 000 000.00	3 613 351.52	0.18
USD INTL FINANCE FACILITY FOR IMMUN-REG-S 1.00000% 21-21.04.26	7 500 000.00	6 858 720.00	0.35
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 4.00000% 23-19.01.28	4 166 000.00	4 197 919.89	0.21
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.62500% 21-15.09.25	5 000 000.00	4 620 732.50	0.23
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT-REG-S 4.87500% 23-09.03.26	5 000 000.00	5 111 176.60	0.26
USD LANDESKREDITBANK BADEN-REG-S 1.37500% 22-27.01.25	7 500 000.00	7 123 953.30	0.36
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 20-21.05.26	7 000 000.00	6 590 062.50	0.33
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	5 050 000.00	4 744 244.76	0.24
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 21-02.09.26	2 000 000.00	1 807 392.00	0.09
USD NEW DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 1.12500% 21-27.04.26	4 000 000.00	3 571 440.00	0.18
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.70000% 23-02.04.26	5 000 000.00	5 009 074.50	0.25
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	1 800 000.00	1 727 791.09	0.09
USD NRW BANK-REG-S 0.75000% 21-25.10.24	2 000 000.00	1 892 532.00	0.10
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 0.50000% 21-02.02.26	4 000 000.00	3 639 886.79	0.18
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 0.50000% 21-16.09.24	3 500 000.00	3 314 775.52	0.17
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.50000% 16-12.04.26	3 850 000.00	3 640 416.39	0.18
USD SFIL SA-REG-S 0.62500% 21-09.02.26	5 000 000.00	4 538 668.05	0.23
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	4 100 000.00	3 972 915.99	0.20
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	13 305 000.00	12 898 106.09	0.65
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 2.25000% 22-22.03.27	7 500 000.00	7 055 175.00	0.36
USD SWEDISH EXPORT CREDIT CORP 4.00000% 23-15.07.25	5 000 000.00	4 975 957.65	0.25
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 1.25000% 21-14.04.26	900 000.00	821 898.00	0.04
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S 3.05900% 22-07.04.25	5 700 000.00	5 540 731.17	0.28
米ドル合計		288 620 139.13	14.61

メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計	288 620 139.13	14.61
-----------------------	----------------	-------

債券、固定利付債

米ドル

USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK 0.50000% 21-27.01.26	5 000 000.00	4 539 990.60	0.23
USD BANK OF MONTREAL-REG-S 3.750000% 22-25.07.25	6 500 000.00	6 359 149.10	0.32
USD BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 2.17000% 22-09.03.27	4 000 000.00	3 703 150.40	0.19
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 1.18800% 21-13.10.26	2 500 000.00	2 246 001.53	0.11
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	3 540 000.00	3 383 935.56	0.17
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.25000% 16-02.06.26	3 800 000.00	3 616 093.91	0.18
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26	10 000 000.00	9 044 363.10	0.46
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 4.92800% 22-09.12.25	4 500 000.00	4 516 983.00	0.23
USD COOPERATIEVE RABOBANK UA/NY 1.37500% 22-10.01.25	2 601 000.00	2 454 499.03	0.12
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 3.00000% 22-16.06.25	7 500 000.00	7 321 350.00	0.37
USD DBS BANK LTD-REG-S 2.37500% 22-17.03.27	2 850 000.00	2 665 114.23	0.14
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.375% 21-24.07.24	5 000 000.00	4 759 483.50	0.24
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 21-26.10.26	7 500 000.00	6 770 779.27	0.34
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75000% 22-15.08.25	5 000 000.00	4 872 314.30	0.25
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 0.90800% 20-25.06.25	4 100 000.00	3 795 599.60	0.19

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.62500% 20-15.07.25	7 450 000.00	6 928 956.61	0.35
USD INTERNATIONAL BANK RECONSTRUCTION & DLP 3.12500% 22-15.06.27	10 000 000.00	9 782 600.00	0.50
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24	2 100 000.00	2 042 225.89	0.10
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 0.80000% 21-19.07.26	10 000 000.00	8 859 100.00	0.45
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.37500% 20-18.07.25	5 000 000.00	4 620 672.60	0.23
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.12500% 22-10.06.25	5 000 000.00	4 894 615.06	0.25
USD LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 2.00000% 22-24.02.25	5 000 000.00	4 756 137.10	0.24
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	8 000 000.00	7 626 765.68	0.39
USD NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 2.90000% 22-06.04.27	7 500 000.00	7 135 180.35	0.36
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.40000% 14-06.05.24	2 890 000.00	2 846 923.72	0.14
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	350 000.00	335 120.63	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA REG-S 1.05000% 21-14.09.26	12 250 000.00	11 019 958.64	0.56
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 2.00000% 20-16.01.25	6 000 000.00	5 729 469.60	0.29
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.55200% 21-30.09.26	4 000 000.00	3 644 937.20	0.19
米ドル合計		150 271 470.21	7.61
債券、固定利付債合計		150 271 470.21	7.61
財務省証券（T-note）、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 30.04.20-30.04.25	27 000 000.00	25 110 000.00	1.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.04.27	13 000 000.00	11 516 679.71	0.58
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.05.27	29 000 000.00	25 624 218.75	1.30
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25	27 000 000.00	24 982 382.88	1.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.06.25	20 000 000.00	18 483 593.80	0.94
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.07.25	39 000 000.00	35 927 226.66	1.82
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.07.27	19 000 000.00	16 624 257.86	0.84
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.08.25	30 000 000.00	27 568 359.30	1.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27	40 000 000.00	34 829 687.60	1.76
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.09.25	37 000 000.00	33 970 625.00	1.72
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.10.23	23 000 000.00	22 505 859.26	1.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.25000% 20-31.10.25	30 000 000.00	27 442 968.61	1.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.10.27	25 000 000.00	21 846 679.75	1.11
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 20-15.12.23	33 000 000.00	32 046 093.75	1.62
USD AMERICA, UNITED STATE OF TB 0.62500% 20-31.12.27	56 000 000.00	49 037 187.36	2.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.12.25	16 000 000.00	14 641 875.04	0.74
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.01.26	45 000 000.00	41 018 554.81	2.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.12500% 21-15.02.24	27 000 000.00	25 999 101.63	1.32
USD AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26	27 000 000.00	24 648 046.75	1.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.03.28	15 000 000.00	13 468 359.30	0.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-15.04.24	33 000 000.00	31 636 172.04	1.60
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-30.04.26	35 000 000.00	32 063 281.24	1.62
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 21-15.05.24	30 000 000.00	28 627 734.30	1.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.05.26	31 000 000.00	28 334 726.64	1.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 21-15.06.24	60 000 000.00	57 105 468.60	2.89
USD AMERICA, UNITED STATES OF TREASURY NOTE 0.37500% 21-15.07.24	32 000 000.00	30 425 000.00	1.54
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 21-31.07.26	20 000 000.00	18 139 062.40	0.92
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 15.08.21-15.08.24	26 000 000.00	24 650 234.44	1.25
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.37500% 21-15.09.24	29 000 000.00	27 435 586.02	1.39
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 21-30.09.26	21 000 000.00	19 140 351.51	0.97
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.10.23	24 000 000.00	23 463 750.00	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-15.11.24	18 000 000.00	17 043 046.91	0.86
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 21-30.11.23	5 000 000.00	4 873 437.50	0.25
米ドル合計		870 229 609.42	44.07
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		870 229 609.42	44.07
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 729 627 070.93	87.58

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 18.04.23-15.08.23	15 000 000.00	14 780 933.40	0.75
米ドル合計		14 780 933.40	0.75
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン合計		14 780 933.40	0.75
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-REG-S 2.37500% 19-21.11.24	1 000 000.00	954 710.38	0.05
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT ML SA-REG-S 4.93500% 23-26.01.26	2 355 000.00	2 348 155.66	0.12
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 5.31600% 23-13.03.26	969 000.00	986 969.91	0.05
USD FANNIE MAE 0.50000% 20-17.06.25	20 000 000.00	18 550 563.40	0.94
USD FANNIE MAE 0.50000% 20-07.11.25	15 000 000.00	13 778 252.70	0.70
USD FREDDIE MAC 0.37500% 20-23.09.25	25 000 000.00	22 922 767.50	1.16
USD FREDDIE MAC 1.50000% 20-12.02.25	15 000 000.00	14 303 567.55	0.72
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.50000% 23-10.04.26	3 000 000.00	2 993 318.91	0.15
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.95000% 18-11.01.25	3 000 000.00	2 905 300.35	0.15
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.15000% 22-26.08.25	1 400 000.00	1 376 114.42	0.07
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.05000% 22-25.08.25	2 310 000.00	2 261 374.06	0.11
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND I-REG-S 5.00000% 23-06.01.26	7 500 000.00	7 533 641.02	0.38
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 0.62500% 20-15.01.26	3 000 000.00	2 730 449.70	0.14
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	8 000 000.00	7 029 208.88	0.36
USD NORDEA BANK ABP -REG-S 3.60000% 22-06.06.25	1 400 000.00	1 356 383.85	0.07
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-144A 0.80000% 20-01.09.25	5 000 000.00	4 553 712.25	0.23
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 0.99100% 21-05.03.26	5 000 000.00	4 571 631.05	0.23
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.31400% 22-10.03.27	12 000 000.00	11 229 917.64	0.57
USD SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 1.20000% 21-09.09.26	10 000 000.00	8 836 735.00	0.45
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 1.20000% 21-09.09.26	7 000 000.00	6 185 714.50	0.31
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 0.85000% 20-02.09.25	6 000 000.00	5 437 140.00	0.27
米ドル合計		142 845 628.73	7.23
ノート、固定利付債合計		142 845 628.73	7.23
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD DNB BANK ASA-144A 2.968%/VAR 22-28.03.25	640 000.00	625 251.04	0.03
米ドル合計		625 251.04	0.03
ノート、変動利付債合計		625 251.04	0.03
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD DBS GROUP HOLDINGS-REG-S 1.16900% 21-22.11.24	4 000 000.00	3 791 720.00	0.19
米ドル合計		3 791 720.00	0.19
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		3 791 720.00	0.19
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF NEW YORK MELLON/THE 5.224%/VAR 22-21.11.25	2 500 000.00	2 503 908.08	0.13
米ドル合計		2 503 908.08	0.13
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		2 503 908.08	0.13

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
債券、固定利付債			
米ドル			
USD FANNIE MAE 1.87500% 16-24.09.26	15 300 000.00	14 394 105.97	0.73
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 5.00000% 23-28.02.25	7 500 000.00	7 596 049.05	0.39
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 1.20000% 21-14.10.26	6 000 000.00	5 400 735.30	0.27
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.75000% 17-22.06.24	2 000 000.00	1 950 499.40	0.10
米ドル合計		29 341 389.72	1.49
債券、固定利付債合計		29 341 389.72	1.49
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		193 888 830.97	9.82
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.03.23-14.09.23	30 000 000.00	29 454 980.10	1.49
米ドル合計		29 454 980.10	1.49
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン合計		29 454 980.10	1.49
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		29 454 980.10	1.49
投資有価証券合計		1 952 970 882.00	98.89

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	360.00	-424 492.33	-0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	50.00	12 500.05	0.00
債券関連金融先物合計		-411 992.28	-0.02
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-411 992.28	-0.02
金融派生商品合計		-411 992.28	-0.02

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日			
GBP	54 163 000.00 USD	66 959 566.63 2.5.2023	1 117 908.08 0.06
JPY	1 279 478 000.00 USD	9 687 119.22 2.5.2023	-290 592.97 -0.01
EUR	406 886 200.00 USD	442 967 647.56 2.5.2023	6 234 717.26 0.31
SGD	4 896 400.00 USD	3 689 652.06 2.5.2023	-19 599.97 0.00
CHF	185 788 700.00 USD	203 368 259.05 2.5.2023	5 371 362.32 0.27
USD	385 615.36 CHF	351 200.00 2.5.2023	-8 969.21 0.00
GBP	398 900.00 USD	494 166.73 2.5.2023	7 210.68 0.00
USD	951 549.76 EUR	874 600.00 2.5.2023	-14 008.64 0.00
USD	424 275.78 CHF	383 900.00 2.5.2023	-7 048.30 0.00
USD	234 113.63 GBP	187 200.00 2.5.2023	-1 178.05 0.00
CHF	70 072 600.00 USD	77 593 162.04 2.5.2023	1 135 673.42 0.06
EUR	60 992 200.00 USD	66 618 382.79 2.5.2023	717 006.01 0.03
USD	9 775 479.90 GBP	7 850 100.00 2.5.2023	-91 310.79 0.00
SGD	133 100.00 USD	100 152.45 2.5.2023	-388.56 0.00
GBP	581 800.00 USD	724 418.26 2.5.2023	6 846.16 0.00
USD	788 608.44 EUR	722 100.00 2.5.2023	-8 589.96 0.00
USD	179 072.90 GBP	144 100.00 2.5.2023	-2 046.39 0.00
JPY	13 216 200.00 USD	99 460.22 2.5.2023	-2 400.04 0.00
USD	722 502.60 CHF	646 900.00 2.5.2023	-4 310.50 0.00
USD	27 640.95 SGD	36 700.00 2.5.2023	132.80 0.00
USD	767 455.23 CHF	684 500.00 2.5.2023	-1 602.69 0.00
USD	433 986.52 GBP	348 900.00 2.5.2023	-4 545.89 0.00
EUR	798 300.00 USD	878 995.28 2.5.2023	2 327.92 0.00
USD	1 192 673.66 EUR	1 092 000.00 2.5.2023	-12 894.34 0.00
GBP	254 000.00 USD	313 973.46 2.5.2023	5 279.14 0.00
USD	191 562.92 GBP	154 200.00 2.5.2023	-2 251.06 0.00
SGD	92 900.00 USD	69 714.28 2.5.2023	-81.93 0.00
USD	17 123 027.90 GBP	13 756 100.00 2.5.2023	-167 014.19 -0.01
USD	19 112 295.38 EUR	17 435 200.00 2.5.2023	-136 165.42 -0.01
USD	28 822 887.44 CHF	25 829 400.00 2.5.2023	-197 279.97 -0.01
USD	720 051.28 CHF	642 800.00 2.5.2023	-2 155.34 0.00
SGD	21 000.00 USD	15 742.83 2.5.2023	-2.47 0.00
USD	486 617.51 CHF	432 600.00 2.5.2023	577.40 0.00
USD	556 565.77 CHF	495 200.00 2.5.2023	192.53 0.00
GBP	101 400.00 USD	126 588.59 2.5.2023	861.07 0.00
SGD	5 106 700.00 USD	3 827 729.61 1.6.2023	4 692.59 0.00
JPY	1 292 694 200.00 USD	9 698 227.50 1.6.2023	-157 405.47 -0.01
GBP	33 058 500.00 USD	41 222 604.02 1.6.2023	359 890.57 0.02
EUR	448 552 800.00 USD	496 484 255.10 1.6.2023	-295 484.03 -0.01
CHF	226 394 800.00 USD	254 693 545.10 1.6.2023	683 733.29 0.03
USD	1 482 524.79 EUR	1 341 200.00 1.6.2023	-1 109.64 0.00
先渡為替契約合計			14 219 975.42 0.72
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			10 662 866.93 0.54
その他の資産および負債			-2 607 201.29 -0.13
純資産総額			1 974 834 530.78 100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2023年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	2 000 000.00	1 891 000.00	0.05
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.87500% 23-12.01.30	8 214 000.00	8 445 758.83	0.24
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.87500% 23-12.01.33	5 000 000.00	5 156 035.00	0.15
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 1.62500% 21-04.02.31	10 000 000.00	8 190 903.00	0.23
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	18 580 000.00	15 373 776.12	0.44
USD AMAZON.COM INC 1.50000% 20-03.06.30	15 000 000.00	12 538 085.10	0.36
USD AMAZON.COM INC 2.10000% 21-12.05.31	12 500 000.00	10 734 030.25	0.30
USD AMAZON.COM INC 3.45000% 22-13.04.29	10 000 000.00	9 663 744.29	0.27
USD AMAZON.COM INC 3.60000% 22-13.04.32	15 000 000.00	14 262 141.30	0.41
USD AMAZON.COM INC 4.65000% 22-01.12.29	10 000 000.00	10 237 248.50	0.29
USD AMAZON.COM INC 4.70000% 22-01.12.32	20 000 000.00	20 568 523.00	0.58
USD APPLE INC 1.25000% 20-20.08.30	15 000 000.00	12 375 269.10	0.35
USD APPLE INC 1.40000% 21-05.08.28	10 000 000.00	8 796 961.40	0.25
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	10 000 000.00	8 539 544.00	0.24
USD APPLE INC 1.65000% 21-08.02.31	15 000 000.00	12 671 328.60	0.36
USD APPLE INC 1.70000% 21-05.08.31	10 000 000.00	8 364 759.90	0.24
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	12 800 000.00	11 516 300.29	0.33
USD APPLE INC 3.35000% 22-08.08.32	12 500 000.00	11 861 140.25	0.34
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.25000% 20-01.09.30	4 000 000.00	3 298 241.92	0.09
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.70000% 21-15.05.28	5 000 000.00	4 474 129.15	0.13
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 2.87500% 22-15.03.32	13 000 000.00	11 774 945.78	0.33
USD BLACKROCK INC 1.90000% 20-28.01.31	4 000 000.00	3 356 673.68	0.10
USD BLACKROCK INC 2.40000% 20-30.04.30	10 000 000.00	8 865 318.60	0.25
USD BLACKROCK INC 3.25000% 19-30.04.29	2 000 000.00	1 916 365.83	0.05
USD BLACKROCK INC/NEW YORK 2.10000% 21-25.02.32	12 000 000.00	10 052 909.16	0.29
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	20 000 000.00	16 734 688.39	0.48
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A-1.37500% 21-20.01.31	10 000 000.00	8 397 133.90	0.24
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	9 539 000.00	8 503 445.30	0.24
USD CME GROUP INC 2.65000% 22-15.03.32	8 500 000.00	7 453 577.75	0.21
USD COLGATE-PALMOLIVE CO 3.25000% 22-15.08.32	10 000 000.00	9 382 486.20	0.27
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 3.90000% 18-16.03.28	3 100 000.00	3 021 508.31	0.09
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	11 730 000.00	9 668 622.59	0.27
USD CPPIB CAPITAL INC-144A 2.00000% 19-01.11.29	5 000 000.00	4 455 184.15	0.13
USD CPPIB CAPITAL INC-144A 1.25000% 21-28.01.31	3 500 000.00	2 880 526.18	0.08
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.00000% 19-01.11.29	2 500 000.00	2 227 592.08	0.06
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	11 200 000.00	9 217 683.78	0.26
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 5.30100% 23-12.07.28	6 200 000.00	6 343 296.00	0.18
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	12 635 000.00	11 229 860.89	0.32
USD EQUINOR ASA 3.12500% 20-06.04.30	20 000 000.00	18 776 368.20	0.53
USD EQUINOR ASA 3.62500% 18-10.09.28	5 000 000.00	4 902 520.60	0.14
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	10 000 000.00	8 338 518.00	0.24
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 21-13.05.31	3 000 000.00	2 610 827.79	0.07
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.12500% 22-18.01.32	7 000 000.00	5 856 340.00	0.17
USD EXXON MOBIL CORP 2.44000% 19-16.08.29	7 500 000.00	6 868 259.85	0.20
USD EXXON MOBIL CORP 2.61000% 20-15.10.30	12 000 000.00	10 843 408.80	0.31
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	15 000 000.00	14 400 943.20	0.41
USD FANNIE MAE 7.12500% 00-15.01.30	8 000 000.00	9 593 456.56	0.27
USD FINLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.87500% 20-20.05.30	20 000 000.00	16 493 360.00	0.47
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	30 000 000.00	35 718 372.90	1.02
USD FREDDIE MAC 6.75000% 99-15.09.29	4 000 000.00	4 670 688.56	0.13
USD FREDDIE MAC 6.75000% 00-15.03.31	20 000 000.00	24 129 036.80	0.69
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32	3 250 000.00	2 799 249.70	0.08
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 18-18.09.28	2 500 000.00	2 436 223.85	0.07

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	25 000 000.00	23 095 500.00	0.66
USD INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000% 22-29.03.32	27 500 000.00	25 189 079.85	0.72
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	30 000 000.00	25 699 038.60	0.73
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	15 000 000.00	12 340 469.85	0.35
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	15 000 000.00	13 374 465.60	0.38
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500% 22-21.09.29	7 500 000.00	7 494 860.85	0.21
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	11 050 000.00	9 274 030.52	0.26
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 1.12500% 20-14.06.30	20 000 000.00	16 655 120.00	0.47
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.00000% 21-25.10.31	5 000 000.00	4 149 375.00	0.12
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.33	5 000 000.00	4 986 095.09	0.14
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.75000% 21-15.10.31	10 000 000.00	8 488 400.00	0.24
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	7 500 000.00	6 742 990.65	0.19
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	25 000 000.00	20 661 871.75	0.59
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.15000% 23-28.03.33	3 000 000.00	3 045 924.15	0.09
USD NEDERLANDSE WATERCHAPS BANK NV-144A 1.00000% 20-28.05.30	200 000.00	165 621.60	0.00
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	1 200 000.00	993 729.60	0.03
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.85000% 23-14.03.33	10 000 000.00	10 477 722.80	0.30
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-24.09.28	10 000 000.00	9 840 223.50	0.28
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	7 150 000.00	5 820 727.69	0.17
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 21-14.09.31	750 000.00	629 220.46	0.02
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	4 079 000.00	3 833 623.19	0.11
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	15 000 000.00	13 263 963.76	0.38
USD OMERS FINANCE TRUST-REG-S 3.50000% 22-19.04.32	5 000 000.00	4 709 323.50	0.13
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 1.25000% 20-27.09.30	4 000 000.00	3 272 864.04	0.09
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-REG-S 2.00000% 21-16.04.31	15 000 000.00	12 846 744.60	0.37
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 19-02.10.29	3 000 000.00	2 688 313.02	0.08
USD ONTARIO, PROVINCE OF TB 1.60000% 21-25.02.31	5 000 000.00	4 232 610.90	0.12
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.80000% 21-14.10.31	15 000 000.00	12 768 309.15	0.36
USD PROCTER & GAMBLE CO 3.00000% 20-25.03.30	15 000 000.00	14 112 854.70	0.40
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.20000% 20-29.10.30	8 900 000.00	7 316 747.76	0.21
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.95000% 21-23.04.31	5 000 000.00	4 343 484.00	0.12
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.30000% 22-01.02.32	2 500 000.00	2 224 647.07	0.06
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.05000% 23-26.01.33	2 000 000.00	2 015 891.64	0.06
USD PROVINCE OF ONTARIO CANADA 2.12500% 22-21.01.32	10 000 000.00	8 709 403.60	0.25
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 1.62500% 21-26.10.28	5 000 000.00	4 426 548.80	0.13
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 2.25000% 21-12.07.31	6 000 000.00	5 164 875.00	0.15
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	5 000 000.00	5 110 312.50	0.15
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	25 000 000.00	25 090 625.00	0.71
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	25 000 000.00	24 754 687.50	0.70
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.35000% 20-28.05.30	10 000 000.00	8 477 640.00	0.24
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.90000% 21-21.04.31	10 000 000.00	8 682 555.69	0.25
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	5 000 000.00	4 867 963.30	0.14
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.37500% 19-07.11.29	20 000 000.00	17 882 219.00	0.51
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.75000% 20-06.04.30	12 500 000.00	11 425 577.88	0.32
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	5 000 000.00	4 258 750.00	0.12
USD TSMC ARIZONA CORP 4.12500% 22-22.04.29	10 000 000.00	9 823 750.00	0.28
USD TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32	7 000 000.00	6 887 562.50	0.20
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.37500% 20-28.09.30	3 650 000.00	2 920 684.38	0.08
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	10 000 000.00	8 396 100.00	0.24
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 4.62500% 22-22.07.32	5 000 000.00	5 055 550.00	0.14
USD VISA INC 1.10000% 20-15.02.31	10 000 000.00	8 023 180.50	0.23
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	9 825 000.00	8 596 096.76	0.24
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	18 350 000.00	15 572 266.55	0.44
USD WALMART INC 1.50000% 21-22.09.28	5 000 000.00	4 422 547.80	0.13
USD WALMART INC 2.37500% 19-24.09.29	3 000 000.00	2 727 271.05	0.08
USD WALMART INC 3.25000% 19-08.07.29	5 000 000.00	4 798 329.40	0.14
USD WALMART INC 4.15000% 22-09.09.32	5 000 000.00	5 047 143.70	0.14
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 20-16.01.30	11 468 000.00	10 228 864.25	0.29
USD WESTPAC BANKING CORP 2.15000% 21-03.06.31	2 500 000.00	2 125 440.50	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP 1.95300% 21-20.11.28	10 000 000.00	8 769 821.00	0.25
米ドル合計		1 031 877 924.93	29.35
ノート、固定利付債合計		1 031 877 924.93	29.35

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI GOVERNMENT INTL-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	10 000 000.00	8 555 000.00	0.24
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	17 500 000.00	16 677 500.00	0.48
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 1.70000% 20-02.03.31	15 000 000.00	12 804 375.00	0.36
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 1.62500% 21-02.06.28	5 000 000.00	4 486 875.00	0.13
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 19-19.09.29	10 000 000.00	8 932 479.29	0.25
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 20-24.01.30	7 500 000.00	6 707 796.97	0.19
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.75000% 20-08.10.30	10 000 000.00	8 150 100.00	0.23
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 21-04.03.31	10 000 000.00	8 588 544.20	0.25
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 22-15.03.29	5 000 000.00	4 537 447.70	0.13
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 22-28.09.32	20 000 000.00	20 370 082.00	0.58
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.00000% 23-12.01.33	30 000 000.00	30 808 200.91	0.88
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	9 630 000.00	7 978 627.57	0.23
USD BNG BANK NV-REG-S 1.00000% 20-03.06.30	20 000 000.00	16 563 896.41	0.47
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCI-REG-S 1.00000% 20-21.10.30	10 000 000.00	8 224 739.79	0.23
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCI-REG-S 1.37500% 21-20.01.31	5 000 000.00	4 198 566.95	0.12
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.12500% 22-26.01.32	15 000 000.00	13 124 050.50	0.37
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 1.75000% 21-19.10.28	5 000 000.00	4 380 625.00	0.13
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 4.37500% 23-24.04.28	4 632 000.00	4 585 101.00	0.13
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 1.75000% 21-24.11.31	13 000 000.00	11 013 916.81	0.31
USD HONG KONG GOVERNMENT INTER BOND-REG-S 1.37500% 21-02.02.31	5 000 000.00	4 175 856.75	0.12
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 23-11.01.33	4 000 000.00	4 251 446.00	0.12
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	28 300 000.00	23 617 823.86	0.67
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 22-14.09.29	10 000 000.00	9 912 600.00	0.28
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 23-12.04.33	10 000 000.00	9 859 561.00	0.28
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 20-27.08.30	5 000 000.00	4 096 145.25	0.12
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDER-REG-S 1.37500% 21-12.10.28	10 000 000.00	8 796 300.00	0.25
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.75000% 17-19.04.29	2 900 000.00	2 809 012.50	0.08
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	9 000 000.00	8 233 875.00	0.23
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	8 800 000.00	8 004 150.00	0.23
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.37500% 22-28.03.32	2 700 000.00	2 498 499.00	0.07
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	12 500 000.00	10 491 400.38	0.30
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.55000% 23-28.01.33	3 000 000.00	2 982 039.00	0.09
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.25000% 20-30.04.30	3 737 000.00	3 266 995.26	0.09
USD QUEBEC, PROVINCE OF 7.50000% 99-15.09.29	3 000 000.00	3 575 011.32	0.10
USD ST ENGINEERING URBAN SOLUTIONS US-REG-S 3.75000% 22-05.05.32	500 000.00	470 473.32	0.01
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-144A 1.00000% 20-06.10.30	2 000 000.00	1 613 167.28	0.05
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 1.00000% 20-06.10.30	5 000 000.00	4 016 080.00	0.11
USD TEMASEK FINANCIAL LTD-REG-S 1.62500% 21-02.08.31	12 500 000.00	10 357 373.75	0.30
USD UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 2.00000% 21-19.10.31	5 000 000.00	4 318 125.00	0.12
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32	15 000 000.00	15 068 437.50	0.43
米ドル合計		343 102 297.27	9.76

メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計	343 102 297.27	9.76
------------------------------	-----------------------	-------------

債券、固定利付債

米ドル			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 19-30.09.29	20 000 000.00	18 422 500.00	0.52
USD ALBERTA, PROVINCE OF 1.30000% 20-22.07.30	20 000 000.00	16 717 903.39	0.48
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 19-09.10.29	15 000 000.00	13 307 700.00	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 20-23.09.30	15 800 000.00	12 961 009.08	0.37
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.75000% 22-15.03.29	15 000 000.00	13 552 050.00	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.75000% 23-14.02.33	60 000 000.00	60 951 895.20	1.73
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 1.25000% 20-21.09.30	1 200 000.00	965 592.00	0.03
USD FANNIE MAE 6.25000% 99-15.05.29	20 000 000.00	22 763 036.20	0.65
USD FANNIE MAE 6.62500% 00-15.11.30	40 000 000.00	47 769 920.80	1.36
USD FANNIE MAE 7.25000% 00-15.05.30	20 000 000.00	24 379 943.40	0.69
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.45000% 22-03.02.32	10 000 000.00	8 581 954.30	0.24
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.05000% 23-01.04.28	5 000 000.00	5 176 998.80	0.15
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-20.07.28	15 000 000.00	13 211 622.74	0.38
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 3.87500% 23-14.02.30	30 000 000.00	30 413 630.40	0.87
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	30 000 000.00	24 862 239.60	0.71
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	30 000 000.00	24 450 014.40	0.69

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	10 000 000.00	8 433 761.80	0.24
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	10 000 000.00	8 781 431.30	0.25
USD JOHNSON & JOHNSON 4.95000% 03-15.05.33	2 000 000.00	2 178 723.98	0.06
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.62500% 21-19.01.31	2 000 000.00	1 635 960.00	0.05
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	5 000 000.00	4 561 875.00	0.13
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-16.09.30	3 500 000.00	2 866 395.00	0.08
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	10 000 000.00	8 225 560.40	0.23
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	15 000 000.00	12 358 117.80	0.35
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 7.12500% 00-01.05.30	5 631 000.00	6 679 691.03	0.19
米ドル合計		394 209 526.62	11.21

債券、固定利付債合計	394 209 526.62	11.21
------------	----------------	-------

財務省証券（T-note）、固定利付債

米ドル

USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.05.28	17 500 000.00	16 968 164.15	0.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.08.28	50 000 000.00	48 437 500.00	1.38
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 18-15.11.28	15 000 000.00	14 691 796.80	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 19-15.02.29	90 000 000.00	85 763 672.09	2.44
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.05.29	50 000 000.00	46 910 155.99	1.33
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-15.08.29	50 000 000.00	44 847 656.00	1.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	50 000 000.00	45 166 015.50	1.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30	43 000 000.00	37 944 140.84	1.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	60 000 000.00	49 492 968.61	1.41
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	60 000 000.00	49 242 187.20	1.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	40 000 000.00	33 387 500.00	0.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.01.28	40 000 000.00	35 165 624.80	1.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	75 000 000.00	63 706 054.50	1.81
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-29.02.28	35 000 000.00	31 286 718.75	0.89
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.03.28	30 000 000.00	26 936 718.60	0.77
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.04.28	40 000 000.00	35 848 437.60	1.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31	75 000 000.00	65 742 187.51	1.87
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.05.28	60 000 000.00	53 688 281.40	1.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.06.28	50 000 000.00	44 652 344.00	1.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 21-31.07.28	60 000 000.00	52 776 562.80	1.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-15.08.31	40 000 000.00	33 825 000.00	0.96
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-31.08.28	50 000 000.00	44 181 640.49	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.2500% 21-30.09.28	50 000 000.00	44 398 437.50	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.10.28	50 000 000.00	44 650 390.50	1.27
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-15.11.31	75 000 000.00	63 767 578.49	1.81
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.500000% 21-30.11.28	50 000 000.00	44 888 672.00	1.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.12.28	85 000 000.00	75 752 929.90	2.15
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 31.01.22-31.01.29	45 000 000.00	40 860 351.45	1.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-15.02.32	40 000 000.00	35 351 562.40	1.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-28.02.29	60 000 000.00	54 834 375.00	1.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-30.04.29	5 000 000.00	4 825 195.30	0.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.32	40 000 000.00	38 284 375.20	1.09
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-15.08.32	40 000 000.00	37 856 250.00	1.08
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-15.02.33	47 500 000.00	47 782 031.25	1.36
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32	30 000 000.00	31 664 062.51	0.90
米ドル合計		1 525 577 539.13	43.39

財務省証券（T-note）、固定利付債合計	1 525 577 539.13	43.39
-----------------------	------------------	-------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計	3 294 767 287.95	93.71
---------------------------------------	------------------	-------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル

USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 5.30100% 23-12.07.28	5 000 000.00	5 115 561.30	0.14
--	--------------	--------------	------

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FANNIE MAE 0.87500% 20-05.08.30	40 000 000.00	32 872 790.00	0.93
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 20-19.11.27	3 000 000.00	2 583 795.30	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 1.55000% 20-09.10.30	2 900 000.00	2 323 966.19	0.07
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.55000% 20-09.10.30	5 800 000.00	4 647 932.37	0.13
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 1.55000% 21-07.01.31	2 000 000.00	1 608 684.96	0.05
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.30000% 22-25.08.29	3 000 000.00	2 922 206.70	0.08
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.30000% 22-01.10.32	3 000 000.00	3 041 886.81	0.09
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.00000% 18-10.01.28	5 000 000.00	4 699 219.40	0.13
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.20000% 20-07.08.30	2 740 000.00	2 170 814.35	0.06
USD NUVEEN LLC-144A 4.00000% 18-01.11.28	2 500 000.00	2 402 160.10	0.07
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-144A 2.00000% 21-16.04.31	2 000 000.00	1 712 899.28	0.05
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 2.45000% 22-11.01.32	4 100 000.00	3 374 833.00	0.10
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.45000% 21-20.01.28	6 020 000.00	5 141 381.00	0.15
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.73700% 20-21.09.30	2 500 000.00	1 959 251.10	0.06
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 1.93000% 21-13.12.28	3 500 000.00	3 116 605.63	0.09
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 1.93000% 21-13.12.28	7 550 000.00	6 722 963.56	0.19
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.07600% 21-13.12.31	17 500 000.00	14 888 376.30	0.42
米ドル合計		101 305 327.35	2.88
ノート、固定利付債合計		101 305 327.35	2.88
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850% 19-13.09.29	20 000 000.00	18 986 382.20	0.54
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.4000% 22-11.01.32	10 000 000.00	8 389 427.20	0.24
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-144A 3.30000% 22-21.03.29	3 000 000.00	2 779 516.11	0.08
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.15000% 23-28.03.33	3 000 000.00	3 045 924.15	0.09
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.05000% 19-17.06.29	4 100 000.00	3 717 097.51	0.10
USD NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FUNDING-144A 1.70000% 21-01.06.28	879 000.00	767 418.90	0.02
米ドル合計		37 685 766.07	1.07
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		37 685 766.07	1.07
債券、固定利付債			
米ドル			
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM 3.25000% 18-16.11.28	15 000 000.00	14 757 630.45	0.42
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 300 000.00	2 921 947.54	0.08
USD QATAR, STATE OF-144A 9.75000% 00-15.06.30	2 000 000.00	2 689 125.00	0.08
米ドル合計		20 368 702.99	0.58
債券、固定利付債合計		20 368 702.99	0.58
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		159 359 796.41	4.53
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
アイルランド			
USD UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-USD-S-DIST	2 500.00	25 000 000.00	0.71
アイルランド合計		25 000 000.00	0.71
投資信託、オープン・エンド型合計		25 000 000.00	0.71
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		25 000 000.00	0.71
投資有価証券合計		3 479 127 084.36	98.95

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	79.00	48 070.39	0.00
債券関連金融先物合計		48 070.39	0.00
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計			48 070.39 0.00
金融派生商品合計			48 070.39 0.00
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日			
GBP 127 324 200.00 USD 157 405 853.69 2.5.2023		2 627 933.31	0.07
JPY 2 745 900 000.00 USD 20 789 619.41 2.5.2023		-623 644.35	-0.02
EUR 1 145 002 100.00 USD 1 246 537 451.22 2.5.2023		17 544 867.25	0.50
SGD 16 136 500.00 USD 12 159 560.20 2.5.2023		-64 593.37	0.00
CHF 450 955 400.00 USD 493 625 363.69 2.5.2023		13 037 632.77	0.37
USD 271 625.17 JPY 35 900 000.00 2.5.2023		7 974.45	0.00
USD 1 082 607.94 GBP 873 900.00 2.5.2023		-15 796.97	0.00
USD 15 572 806.41 EUR 14 240 700.00 2.5.2023		-148 926.39	0.00
USD 148 137.29 SGD 196 600.00 2.5.2023		777.55	0.00
USD 2 997 465.56 EUR 2 755 200.00 2.5.2023		-44 275.24	0.00
USD 1 118 710.34 CHF 1 018 800.00 2.5.2023		-25 944.45	0.00
USD 323 910.15 GBP 258 600.00 2.5.2023		-1 124.19	0.00
USD 22 631 624.99 CHF 20 438 100.00 2.5.2023		-331 242.26	-0.01
USD 23 095 505.72 EUR 21 145 000.00 2.5.2023		-248 574.28	-0.01
USD 20 501 099.43 GBP 16 463 200.00 2.5.2023		-191 496.65	-0.01
SGD 259 100.00 USD 195 262.66 2.5.2023		-1 056.61	0.00
SGD 510 400.00 USD 384 027.41 2.5.2023		-1 461.73	0.00
EUR 21 775 100.00 USD 23 817 976.73 2.5.2023		221 733.67	0.01
CHF 7 445 400.00 USD 8 251 348.85 2.5.2023		113 799.18	0.00
JPY 50 000 000.00 USD 380 779.06 2.5.2023		-13 577.50	0.00
USD 104 446.12 SGD 138 700.00 2.5.2023		484.80	0.00
USD 759 648.59 CHF 674 100.00 2.5.2023		2 275.41	0.00
USD 1 970 288.97 EUR 1 781 400.00 2.5.2023		3 623.37	0.00
USD 887 728.87 CHF 791 800.00 2.5.2023		-1 884.07	0.00
USD 655 235.16 GBP 526 800.00 2.5.2023		-6 899.76	0.00
USD 3 631 107.02 EUR 3 324 000.00 2.5.2023		-38 588.98	0.00
GBP 959 200.00 USD 1 185 644.96 2.5.2023		19 973.52	0.00
USD 373 345.97 JPY 50 000 000.00 2.5.2023		6 144.41	0.00
USD 19 582 422.54 GBP 15 731 900.00 2.5.2023		-191 002.57	-0.01
USD 161 810.48 SGD 215 800.00 2.5.2023		59.55	0.00
USD 112 925 568.12 EUR 103 016 400.00 2.5.2023		-804 537.49	-0.02
USD 128 372 958.75 CHF 115 040 400.00 2.5.2023		-878 656.33	-0.02
EUR 2 234 400.00 USD 2 451 842.87 2.5.2023		14 934.73	0.00
USD 950 524.45 CHF 848 500.00 2.5.2023		-2 792.78	0.00
EUR 1 608 300.00 USD 1 765 768.65 2.5.2023		9 794.55	0.00
SGD 92 800.00 USD 69 552.61 2.5.2023		4.79	0.00
JPY 2 710 000 000.00 USD 20 331 333.21 1.6.2023		-329 984.32	-0.01
SGD 16 447 700.00 USD 12 328 381.98 1.6.2023		15 113.93	0.00
GBP 94 429 000.00 USD 117 749 119.74 1.6.2023		1 027 999.06	0.03
EUR 1 024 357 200.00 USD 1 133 817 961.68 1.6.2023		-674 795.02	-0.02
CHF 319 589 100.00 USD 359 536 883.60 1.6.2023		965 188.71	0.03
GBP 971 600.00 USD 1 210 828.62 1.6.2023		11 294.34	0.00
USD 2 848 876.00 EUR 2 577 400.00 1.6.2023		-2 241.95	0.00
先渡為替契約合計		30 988 512.09	0.88
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			
		22 580 396.24	0.64
当座借越およびその他の短期負債			
		-23 452.21	0.00
その他の資産および負債			
		-16 697 220.61	-0.47
純資産総額		3 516 023 390.26	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

2023年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	7 200 000.00	6 653 357.64	0.39
USD ADOBE INC 2.30000% 20-01.02.30	6 500 000.00	5 775 216.65	0.34
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 5.90000% 23-09.03.26	3 850 000.00	3 952 351.86	0.23
USD AERCAP IRELAND CAP/ GBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	5 350 000.00	5 402 191.17	0.31
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP 1.65000% 21-29.10.24	3 000 000.00	2 805 147.00	0.16
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	10 000 000.00	8 966 441.50	0.52
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32	3 000 000.00	2 457 218.46	0.14
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	6 500 000.00	6 230 876.21	0.36
USD AIR LEASE CORP 5.85000% 22-15.12.27	7 000 000.00	7 083 341.09	0.41
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	8 000 000.00	6 047 464.64	0.35
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.00000% 21-18.05.32	2 250 000.00	1 735 139.81	0.10
USD ALLY FINANCIAL INC 5.12500% 14-30.09.24	2 878 000.00	2 822 254.43	0.16
USD ALLY FINANCIAL INC 5.80000% 20-01.05.25	5 000 000.00	4 956 650.00	0.29
USD AMAZON.COM INC 1.20000% 20-03.06.27	5 000 000.00	4 478 513.00	0.26
USD AMAZON.COM INC 4.55000% 22-01.12.27	12 500 000.00	12 727 515.87	0.74
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.25000% 19-15.03.29	2 400 000.00	2 303 493.36	0.13
USD AMGEN INC 5.15000% 23-02.03.28	9 000 000.00	9 211 611.69	0.54
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.30	4 050 000.00	4 159 534.32	0.24
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33	2 750 000.00	2 829 470.03	0.16
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	7 000 000.00	7 158 517.10	0.42
USD AON CORP/AON GLOBAL HOLDINGS PLC 5.35000% 23-28.02.33	2 500 000.00	2 586 053.93	0.15
USD AON GLOBAL LTD 3.87500% 16-15.12.25	6 575 000.00	6 425 828.76	0.37
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	6 200 000.00	5 482 470.84	0.32
USD APPLE INC 2.05000% 19-11.09.26	8 400 000.00	7 882 258.86	0.46
USD ARCELORMITTAL SA 6.80000% 22-29.11.32	4 500 000.00	4 709 776.68	0.27
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 4.25000% 19-01.11.29	9 225 000.00	8 605 559.43	0.50
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 1.50000% 21-12.08.26	3 600 000.00	3 182 257.98	0.19
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.87500% 23-03.03.33	5 427 000.00	5 638 457.69	0.33
USD AT&T INC 2.75000% 20-01.06.31	7 800 000.00	6 726 207.70	0.39
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 3.45000% 22-11.04.25	13 670 000.00	13 263 230.97	0.77
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	5 000 000.00	4 785 144.35	0.28
USD BARCLAYS PLC 5.50100% 22-09.08.28	5 000 000.00	4 985 971.75	0.29
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 4.23400% 18-06.11.28	3 000 000.00	3 008 073.48	0.18
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.62500% 15-16.09.25	5 200 000.00	4 919 616.00	0.29
USD BROADCOM INC 4.30000% 20-15.11.32	2 500 000.00	2 292 254.18	0.13
USD BROADCOM INC 5.00000% 20-15.04.30	7 500 000.00	7 424 312.10	0.43
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 3.30000% 22-07.04.25	8 200 000.00	7 923 149.80	0.46
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.75000% 21-02.12.26	10 000 000.00	9 130 913.20	0.53
USD CCO LLC/CAPITAL 2.80000% 20-01.04.31	6 000 000.00	4 841 525.52	0.28
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.33000% 22-15.07.29	4 042 000.00	4 094 787.91	0.24
USD CENTENE CORP 2.45000% 21-15.07.28	12 750 000.00	11 080 101.13	0.65
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	900 000.00	863 015.84	0.05
USD CF INDUSTRIES INC 5.15000% 14-15.03.34	3 000 000.00	2 916 777.00	0.17
USD CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	3 600 000.00	3 121 473.78	0.18
USD CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25	4 500 000.00	4 442 518.21	0.26
USD CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	3 050 000.00	2 980 268.10	0.17
USD CMS ENERGY CORP 2.95000% 16-15.02.27	2 000 000.00	1 876 892.52	0.11
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.55000% 23-10.04.28	5 000 000.00	4 947 989.60	0.29
USD COMCAST CORP 1.95000% 20-15.01.31	5 000 000.00	4 184 887.50	0.24
USD COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	3 200 000.00	3 173 842.33	0.18
USD COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	5 000 000.00	4 951 790.70	0.29
USD CONSTELLATION BRANDS INC 5.00000% 23-02.02.26	6 000 000.00	5 980 359.90	0.35
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 3.70000% 22-21.02.25	10 640 000.00	10 078 208.00	0.59

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	4 500 000.00	3 945 672.45	0.23
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	2 721 000.00	2 595 928.63	0.15
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	2 366 000.00	2 337 029.75	0.14
USD CVS HEALTH CORP 5.12500% 23-21.02.30	6 500 000.00	6 612 497.45	0.38
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	3 200 000.00	2 848 728.10	0.17
USD DTE ENERGY CO 3.40000% 19-15.06.29	4 500 000.00	4 157 061.08	0.24
USD DUKE ENERGY CORP 5.00000% 22-08.12.27	6 000 000.00	6 119 732.34	0.36
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	6 830 000.00	6 206 988.43	0.36
USD ENBRIDGE INC 5.70000% 23-08.03.33	2 000 000.00	2 076 980.84	0.12
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	6 000 000.00	5 676 300.00	0.33
USD EQUINIX INC 1.80000% 20-15.07.27	3 400 000.00	2 987 831.06	0.17
USD EQUINIX INC 3.20000% 19-18.11.29	2 515 000.00	2 258 914.10	0.13
USD EVERSOURCE ENERGY 3.37500% 22-01.03.32	10 000 000.00	8 996 469.50	0.52
USD EVERSOURCE ENERGY 5.45000% 23-01.03.28	2 500 000.00	2 592 711.10	0.15
USD EXELON CORP 4.05000% 20-15.04.30	7 322 000.00	7 028 749.72	0.41
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	6 500 000.00	5 916 652.69	0.34
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	3 200 000.00	2 980 581.82	0.17
USD FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	3 200 000.00	2 971 710.08	0.17
USD GENERAL MOTORS CO 6.80000% 20-01.10.27	9 700 000.00	10 252 349.72	0.60
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 17-07.11.24	6 500 000.00	6 335 026.62	0.37
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	3 200 000.00	3 132 768.96	0.18
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.00000% 23-09.01.28	7 500 000.00	7 655 235.23	0.45
USD GEORGIA POWER CO 2.65000% 19-15.09.29	3 019 000.00	2 677 901.01	0.16
USD GILEAD SCIENCES INC 1.65000% 20-01.10.30	15 000 000.00	12 404 421.00	0.72
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.80000% 20-15.03.30	9 700 000.00	9 109 272.52	0.53
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.50000% 16-16.11.26	3 900 000.00	3 720 185.78	0.22
USD HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	4 000 000.00	3 792 380.04	0.22
USD HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	9 500 000.00	9 534 276.95	0.56
USD HEALTHPEAK OP LLC 2.12500% 21-01.12.28	7 000 000.00	6 068 981.17	0.35
USD HEALTHPEAK OP LLC 5.25000% 23-15.12.32	2 000 000.00	2 018 145.56	0.12
USD HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	5 700 000.00	5 194 857.34	0.30
USD HOME DEPOT INC 2.87500% 22-15.04.27	6 000 000.00	5 747 975.58	0.33
USD HUMANA INC 5.70000% 23-13.03.26	6 500 000.00	6 551 576.85	0.38
USD INTEL CORP 4.15000% 22-05.08.32	4 000 000.00	3 864 084.40	0.23
USD INTEL CORP 5.20000% 23-10.02.33	7 700 000.00	7 862 670.28	0.46
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 3.750000% 15-01.12.25	4 102 000.00	4 022 359.25	0.23
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	7 500 000.00	7 271 452.28	0.42
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.50000% 19-15.05.29	3 200 000.00	3 002 616.80	0.17
USD KINROSS GOLD CORP 5.95000% 14-15.03.24	5 100 000.00	5 101 811.92	0.30
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	3 000 000.00	2 872 618.05	0.17
USD KROGER CO/THE 1.70000% 21-15.01.31	6 000 000.00	4 815 801.60	0.28
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	4 335 000.00	4 257 535.02	0.25
USD LOWE'S COS INC 1.30000% 20-15.04.28	4 129 000.00	3 572 409.97	0.21
USD LOWE'S COS INC 4.50000% 20-15.04.30	3 200 000.00	3 167 199.42	0.18
USD LOWE'S COS INC 4.80000% 23-01.04.26	3 000 000.00	3 021 525.99	0.18
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.00000% 21-06.04.28	7 000 000.00	6 106 620.38	0.36
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	5 000 000.00	4 298 259.95	0.25
USD MAGALLANES INC-144A 4.27900% 22-15.03.32	8 000 000.00	7 105 279.44	0.41
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.75000% 22-01.11.32	7 500 000.00	8 054 474.17	0.47
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC 2.19300% 20-25.02.25	3 200 000.00	3 026 048.64	0.18
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 1.41200% 20-17.07.25	10 000 000.00	9 189 403.00	0.53
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.66700% 23-27.05.29	2 500 000.00	2 541 563.00	0.15
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 4.45000% 23-13.03.26	2 500 000.00	2 509 169.63	0.15
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 0.80000% 21-12.08.24	1 761 000.00	1 661 979.96	0.10
USD NEXTERA ENERGY 1.90000% 21-15.06.28	5 000 000.00	4 407 619.50	0.26
USD NEXTERA ENERGY CAP 2.44000% 21-15.01.32	8 000 000.00	6 642 448.72	0.39
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL 4.90000% 23-28.02.28	7 600 000.00	7 691 186.09	0.45
USD NUTRIEN LTD 5.90000% 22-07.11.24	3 250 000.00	3 290 873.69	0.19
USD NUTRIEN LTD 5.95000% 22-07.11.25	2 000 000.00	2 059 982.14	0.12
USD NVIDIA CORP 2.85000% 20-01.04.30	5 200 000.00	4 768 909.76	0.28
USD ONEOK INC 6.10000% 22-15.11.32	5 000 000.00	5 227 371.90	0.30
USD ORACLE CORP 2.95000% 20-01.04.30	3 000 000.00	2 657 629.20	0.15
USD ORACLE CORP 6.25000% 22-09.11.32	12 000 000.00	12 955 726.80	0.75
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	2 600 000.00	2 237 558.81	0.13

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	3 200 000.00	3 065 230.84	0.18
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 5.85000% 22-15.11.27	5 000 000.00	5 239 865.00	0.31
USD PUBLIC STORAGE 1.95000% 21-09.11.28	4 000 000.00	3 513 100.76	0.20
USD PUBLIC STORAGE 2.25000% 21-09.11.31	3 000 000.00	2 516 631.81	0.15
USD QUALCOMM INC 3.25000% 17-20.05.27	3 200 000.00	3 099 917.09	0.18
USD QUANTA SERVICES INC 2.90000% 20-01.10.30	10 750 000.00	9 324 875.08	0.54
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	4 900 000.00	4 611 965.06	0.27
USD REALTY INCOME CORP 4.70000% 23-15.12.28	4 000 000.00	3 959 667.44	0.23
USD REPUBLIC SERVICES INC 5.00000% 23-01.04.34	2 350 000.00	2 404 052.51	0.14
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.87500% 17-30.06.26	3 000 000.00	3 062 487.63	0.18
USD SEALED AIR CORP-144A 5.12500% 14-01.12.24	4 165 000.00	4 132 839.95	0.24
USD SEMPRA ENERGY 3.25000% 17-15.06.27	5 050 000.00	4 759 274.07	0.28
USD SEMPRA ENERGY 3.70000% 22-01.04.29	7 000 000.00	6 603 918.51	0.38
USD STEEL DYNAMICS INC 2.40000% 20-15.06.25	3 000 000.00	2 842 375.02	0.17
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.34800% 20-15.01.25	3 200 000.00	3 041 827.84	0.18
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC5.52000% 23-13.01.28	7 000 000.00	7 142 056.60	0.42
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.94800% 21-12.01.26	3 200 000.00	2 870 142.08	0.17
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.76600% 23-13.01.33	5 000 000.00	5 221 370.00	0.30
USD SWEDBANK AB-144A 1.53800% 21-16.11.26	6 500 000.00	5 805 669.74	0.34
USD T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	9 000 000.00	8 248 872.60	0.48
USD T-MOBILE USA INC 4.95000% 23-15.03.28	2 500 000.00	2 526 723.50	0.15
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.70000% 18-15.12.25	2 600 000.00	2 548 665.02	0.15
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.87500% 19-15.08.29	2 340 000.00	2 164 242.22	0.13
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	9 900 000.00	9 366 119.92	0.55
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	2 000 000.00	1 920 495.68	0.11
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	3 200 000.00	2 860 700.48	0.17
USD VICI PROPERTIES LP 5.12500% 22-15.05.32	4 500 000.00	4 294 514.24	0.25
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 2.30000% 21-15.11.31	7 500 000.00	6 258 626.32	0.36
USD VMWARE INC 3.90000% 17-21.08.27	5 200 000.00	5 007 958.86	0.29
USD WALT DISNEY CO 2.00000% 19-01.09.29	8 400 000.00	7 345 692.40	0.43
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	4 500 000.00	4 538 808.22	0.26
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 6.15000% 23-01.04.33	3 600 000.00	3 660 515.64	0.21
USD WEYERHAEUSER CO 4.00000% 20-15.04.30	3 500 000.00	3 308 346.02	0.19
USD ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	6 500 000.00	5 517 206.50	0.32
米ドル合計		760 817 119.45	44.28

ノート、固定利付債合計	760 817 119.45	44.28
-------------	----------------	-------

ノート、変動利付債

米ドル

USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	3 226 000.00	3 107 922.68	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	7 800 000.00	7 240 635.71	0.42
USD BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29	3 600 000.00	3 450 351.35	0.20
USD BANK OF AMERICA CORP 2.572%/VAR 21-20.10.32	9 500 000.00	7 800 999.29	0.45
USD BANK OF AMERICA CORP 5.080%/VAR 23-20.01.27	2 500 000.00	2 495 231.43	0.15
USD BANK OF AMERICA CORP 5.202%/VAR 23-25.04.29	8 500 000.00	8 556 506.73	0.50
USD BARCLAYS PLC 1.007%/VAR 20-10.12.24	9 700 000.00	9 364 985.76	0.55
USD BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26	5 500 000.00	5 182 866.15	0.30
USD BARCLAYS PLC 2.894%/VAR 21-24.11.32	7 000 000.00	5 607 079.45	0.33
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.468%/VAR 23-01.02.29	3 350 000.00	3 295 878.74	0.19
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.817%/VAR 23-01.02.34	3 500 000.00	3 410 290.48	0.20
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	11 700 000.00	10 510 265.61	0.61
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	11 000 000.00	9 308 137.85	0.54
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	5 000 000.00	4 285 858.85	0.25
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	10 000 000.00	9 765 798.30	0.57
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	4 500 000.00	4 224 219.26	0.25
USD CITIGROUP INC 6.270%/VAR 22-17.11.33	3 000 000.00	3 243 142.53	0.19
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.720%/VAR 23-18.01.29	6 000 000.00	6 100 558.32	0.36
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	3 200 000.00	3 096 123.04	0.18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.431%/VAR 21-09.03.27	3 200 000.00	2 872 874.91	0.17
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.102%/VAR 22-24.02.33	7 000 000.00	6 023 269.56	0.35
USD HSBC HOLDINGS PLC 0.976%/VAR 21-24.05.25	8 500 000.00	8 041 184.11	0.47
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	9 200 000.00	8 769 980.04	0.51
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	10 200 000.00	9 497 618.31	0.55

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.950%/VAR 18-18.05.24	4 500 000.00	4 496 970.92	0.26
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	5 425 000.00	5 312 477.53	0.31
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.161%/VAR 23-09.03.29	2 000 000.00	2 056 902.98	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.254%/VAR 23-09.03.34	6 000 000.00	6 252 108.96	0.36
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	4 200 000.00	4 031 492.43	0.23
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.540%/VAR 17-01.05.28	2 686 000.00	2 550 770.48	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	3 200 000.00	3 009 662.01	0.18
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	2 357 000.00	2 294 420.52	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.960%/3M LIBOR+124.5BP 19-29.01.27	2 600 000.00	2 529 381.22	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.702%/VAR 19-06.05.30	6 500 000.00	6 062 987.00	0.35
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.182%/VAR 20-01.06.28	5 800 000.00	5 209 823.67	0.30
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	17 900 000.00	16 060 563.43	0.93
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.545%/VAR 21-08.11.32	7 500 000.00	6 242 547.37	0.36
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.851%/VAR 22-25.07.28	5 000 000.00	5 013 597.40	0.29
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.912%/VAR 22-25.07.33	5 000 000.00	4 972 326.45	0.29
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	2 613 000.00	2 470 591.39	0.14
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.870%/VAR 20-09.07.25	4 919 000.00	4 800 863.87	0.28
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.953%/VAR 21-19.07.25	10 000 000.00	9 446 297.00	0.55
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.422%/VAR 23-22.02.29	2 750 000.00	2 782 696.13	0.16
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.475%/VAR 23-22.02.31	4 500 000.00	4 564 995.74	0.27
USD MORGAN STANLEY 5.250%/VAR 23-21.04.34	5 800 000.00	5 864 630.45	0.34
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.948%/VAR 23-19.01.38	3 500 000.00	3 518 582.90	0.21
USD NATWEST GROUP PLC 5.847%/VAR 23-02.03.27	3 500 000.00	3 540 675.70	0.21
USD NATWEST GROUP PLC 6.016%/VAR 23-02.03.34	3 000 000.00	3 117 910.74	0.18
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	3 000 000.00	3 015 516.75	0.18
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 6.534%/VAR 23-10.01.29	4 900 000.00	5 035 152.83	0.29
USD US BANCORP 4.653%/VAR 23-01.02.29	10 000 000.00	9 730 619.50	0.57
USD US BANCORP 4.839%/VAR 23-01.02.34	2 000 000.00	1 915 326.06	0.11
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	5 000 000.00	4 374 274.25	0.25
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	3 200 000.00	2 501 583.68	0.15
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 3.020%/VAR 21-18.11.36	6 900 000.00	5 400 520.98	0.31
米ドル合計		293 428 048.80	17.08

ノート、変動利付債合計	293 428 048.80	17.08
-------------	----------------	-------

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 20-01.02.30	2 000 000.00	1 714 616.56	0.10
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.45000% 16-03.03.26	5 800 000.00	5 714 036.99	0.33
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	5 600 000.00	5 401 406.92	0.32
USD BANK OF MONTREAL 1.25000% 21-15.09.26	15 000 000.00	13 362 947.40	0.78
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75000% 20-09.03.27	4 000 000.00	3 658 175.44	0.21
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.50000% 21-06.03.28	15 700 000.00	13 955 871.30	0.81
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.30000% 21-03.11.31	1 333 000.00	1 101 272.39	0.06
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	4 000 000.00	4 889 263.28	0.29
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.01000% 16-19.10.26	1 500 000.00	1 403 840.85	0.08
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE 4.45600% 22-08.06.32	5 000 000.00	4 823 493.05	0.28
USD UNILEVER CAPITAL CORP 5.90000% 02-15.11.32	7 500 000.00	8 456 229.45	0.49
米ドル合計		64 481 153.63	3.75

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計	64 481 153.63	3.75
-----------------------	---------------	------

ミディアム・ターム・ノート、変動利付債

米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	5 679 000.00	5 416 118.24	0.31
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	9 700 000.00	8 644 245.99	0.50
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	3 200 000.00	3 057 955.84	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	6 500 000.00	5 659 915.49	0.33
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	8 000 000.00	6 753 647.92	0.39
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	3 200 000.00	2 976 851.07	0.17
USD MORGAN STANLEY 1.794%/VAR 20-13.02.32	4 000 000.00	3 157 794.72	0.18

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	14 000 000.00	13 179 762.96	0.77
USD MORGAN STANLEY 2.475%/VAR 22-21.01.28	5 000 000.00	4 565 681.70	0.27
USD MORGAN STANLEY 3.772%/VAR 18-24.01.29	14 300 000.00	13 551 691.72	0.79
USD MORGAN STANLEY 4.889%/VAR 22-20.07.33	5 000 000.00	4 931 442.55	0.29
米ドル合計		71 895 108.20	4.18

ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		71 895 108.20	4.18
-----------------------	--	---------------	------

債券、固定利付債

米ドル

USD ALLSTATE CORP 3.28000% 16-15.12.26	2 067 000.00	1 979 156.94	0.12
USD CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELEC 4.95000% 23-01.04.33	2 500 000.00	2 563 602.58	0.15
USD CONSUMERS ENERGY CO 3.80000% 18-15.11.28	1 500 000.00	1 455 558.44	0.09
USD DUKE ENERGY OHIO INC 5.25000% 23-01.04.33	2 000 000.00	2 076 476.20	0.12
USD DUKE ENERGY PROGRESS LLC 5.25000% 23-15.03.33	3 000 000.00	3 140 106.51	0.18
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	5 300 000.00	5 231 936.39	0.30
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.90000% 18-01.11.28	2 000 000.00	1 937 509.30	0.11
USD NATL RURAL UTIL COOPERATIVE FIN CORP 3.70000% 19-15.03.29	5 000 000.00	4 817 051.20	0.28
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 4.55000% 20-01.07.30	4 000 000.00	3 717 272.68	0.22
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 5.45000% 22-15.06.27	4 000 000.00	3 972 641.16	0.23
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 6.15000% 23-15.01.33	3 900 000.00	3 956 659.82	0.23
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC 1.70000% 20-01.10.30	5 000 000.00	4 117 745.30	0.24
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	7 729 000.00	7 565 411.54	0.44
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 5.85000% 22-01.11.27	4 000 000.00	4 204 185.12	0.24
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 5.30000% 23-01.03.28	2 500 000.00	2 567 484.75	0.15
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	2 000 000.00	2 156 163.84	0.13
米ドル合計		55 458 961.77	3.23

債券、固定利付債合計		55 458 961.77	3.23
------------	--	---------------	------

債券、変動利付債

米ドル

USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	5 000 000.00	4 796 558.30	0.28
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	6 800 000.00	6 532 961.21	0.38
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	3 407 000.00	3 223 884.31	0.19
米ドル合計		14 553 403.82	0.85

債券、変動利付債合計		14 553 403.82	0.85
------------	--	---------------	------

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 260 633 795.67	73.37
---------------------------------------	--	------------------	-------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル

USD AKER BP ASA-144A 2.00000% 21-15.07.26	5 000 000.00	4 557 727.30	0.27
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	5 750 000.00	5 545 458.24	0.32
USD ALCON FINANCE CORP-144A 2.60000% 20-27.05.30	3 900 000.00	3 398 180.17	0.20
USD ANTHEM INC 5.50000% 22-15.10.32	2 000 000.00	2 112 402.54	0.12
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 4.25000% 20-15.04.26	6 500 000.00	6 092 385.00	0.36
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.75000% 21-21.02.28	2 021 000.00	1 700 590.66	0.10
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.32200% 22-29.11.24	11 000 000.00	10 360 782.41	0.60
USD BERRY GLOBAL INC 1.65000% 21-15.01.27	6 350 000.00	5 574 479.58	0.32
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.12500% 17-30.06.27	5 000 000.00	5 022 258.20	0.29
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	6 500 000.00	5 813 765.10	0.34
USD CSL FINANCE PLC-144A 3.85000% 22-27.04.27	2 500 000.00	2 442 753.75	0.14
USD CSL FINANCE PLC-144A 4.25000% 22-27.04.32	6 250 000.00	6 069 623.12	0.35
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.62500% 20-15.07.27	6 000 000.00	6 085 668.00	0.35
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	3 900 000.00	3 942 102.37	0.23
USD DELTA AIR LINES INC-144A 7.00000% 20-01.05.25	10 000 000.00	10 316 033.70	0.60

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）
USD EAST OHIO GAS CO/THE-144A 1.30000% 20-15.06.25	5 143 000.00	4 743 650.47	0.28
USD EBAY INC 6.30000% 22-22.11.32	13 300 000.00	14 413 905.32	0.84
USD EXELON CORP 2.75000% 22-15.03.27	2 000 000.00	1 876 144.98	0.11
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST II -144A 2.85000% 20-15.05.30	2 600 000.00	2 260 546.97	0.13
USD HCA INC-144A 3.12500% 22-15.03.27	6 000 000.00	5 634 002.76	0.33
USD JABIL INC 5.45000% 23-01.02.29	5 425 000.00	5 460 243.95	0.32
USD KENVUE INC-144A 5.35000% 23-22.03.26	3 000 000.00	3 079 898.01	0.18
USD KENVUE INC-144A 5.50000% 23-22.03.25	5 000 000.00	5 084 446.95	0.30
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 5.85000% 22-15.11.27	3 000 000.00	2 995 934.64	0.17
USD MACQUARIE BANK LTD-144A-SUB 3.62400% 20-03.06.30	5 000 000.00	4 283 224.00	0.25
USD MAGALLANES INC-144A 3.75500% 22-15.03.27	8 000 000.00	7 539 254.16	0.44
USD MAGALLANES INC-144A 4.05400% 22-15.03.29	1 500 000.00	1 388 485.84	0.08
USD MARS INC-144A 4.65000% 23-20.04.31	2 500 000.00	2 522 553.23	0.15
USD MARS INC-144A 4.75000% 23-20.04.33	5 000 000.00	5 055 740.00	0.29
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.80000% 22-21.03.25	2 040 000.00	1 965 798.02	0.11
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 5.20000% 23-01.04.28	5 000 000.00	5 098 339.25	0.30
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26	2 395 000.00	2 280 952.11	0.13
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.50000% 21-14.09.28	14 000 000.00	12 327 390.60	0.72
USD NGPL PIPECO LLC-144A 3.25000% 21-15.07.31	5 000 000.00	4 249 862.25	0.25
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	2 000 000.00	2 033 750.00	0.12
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA 3.15000% 22-01.05.27	2 000 000.00	1 867 250.00	0.11
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA INC 3.87500% 22-18.06.26	4 677 000.00	4 522 074.38	0.26
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	2 345 000.00	2 292 130.20	0.13
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.55000% 23-15.09.32	4 000 000.00	4 004 337.56	0.23
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 1.20000% 20-15.11.25	11 000 000.00	9 894 168.79	0.58
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.02.26	3 000 000.00	3 042 350.01	0.18
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.04.28	7 000 000.00	7 066 470.95	0.41
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.07600% 21-13.12.31	7 500 000.00	6 380 732.70	0.37
USD SANTOS FINANCE LTD-144A 3.64900% 21-29.04.31	1 500 000.00	1 261 114.80	0.07
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 3.25000% 15-28.10.25	12 000 000.00	11 455 004.40	0.67
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.35000% 16-15.10.26	5 520 000.00	5 178 723.24	0.30
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 1.20000% 21-11.03.26	6 500 000.00	5 964 705.89	0.35
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	11 000 000.00	10 246 344.02	0.60
USD TENNESSEE GAS PIPELINE CO LLC-144A 2.90000% 20-01.03.30	6 900 000.00	6 032 480.80	0.35
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	8 800 000.00	8 299 500.00	0.48
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	4 000 000.00	3 820 076.80	0.22
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.25000% 22-15.02.28	3 850 000.00	4 023 053.22	0.23
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	3 250 000.00	3 037 612.50	0.18
米ドル合計		271 716 463.91	15.81

ノート、固定利付債合計	271 716 463.91	15.81
-------------	----------------	-------

ノート、変動利付債		
-----------	--	--

米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 2.570%/VAR 20-25.11.35	3 200 000.00	2 499 736.90	0.15
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 7.079%/VAR 23-10.02.34	4 500 000.00	4 209 968.29	0.25
USD FIFTH THIRD BANCORP 1.707%/VAR 21-01.11.27	2 053 000.00	1 781 042.08	0.10
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	7 000 000.00	6 777 913.80	0.39
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 4.758%/VAR 23-26.01.27	10 000 000.00	9 885 767.80	0.58
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 5.068%/VAR 23-24.01.34	2 000 000.00	1 968 871.06	0.11
米ドル合計		27 123 299.93	1.58

ノート、変動利付債合計	27 123 299.93	1.58
-------------	---------------	------

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債		
---------------------	--	--

米ドル			
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-144A 4.12500% 17-10.01.27	6 500 000.00	6 297 535.79	0.36
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 4.70000% 23-26.01.26	2 000 000.00	1 930 876.88	0.11
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 4.15000% 22-26.08.25	2 040 000.00	2 005 195.30	0.12
USD MET TOWER GLOBAL FUNDING-144A 3.70000% 22-13.06.25	4 000 000.00	3 895 324.52	0.23
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 2.33200% 20-21.08.30	9 380 000.00	7 409 624.07	0.43

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NBN CO LTD-144A 0.87500% 21-08.10.24	10 000 000.00	9 420 908.00	0.55
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	10 800 000.00	10 164 714.19	0.59
米ドル合計		41 124 178.75	2.39
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		41 124 178.75	2.39
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AUSTRALIA & NEWZEALAND BKG-144A-SUB 2.950%/VAR 20-22.07.30	9 700 000.00	8 964 682.77	0.52
USD COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA-144A-SUB 3.610%/VAR 19-12.09.34	3 200 000.00	2 774 068.48	0.16
USD COOPERATIEVE RABOBANK UA-144A 1.339%/VAR 20-24.06.26	5 500 000.00	5 048 555.99	0.30
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.873%/VAR 23-26.01.29	10 350 000.00	10 131 190.96	0.59
米ドル合計		26 918 498.20	1.57
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		26 918 498.20	1.57
債券、固定利付債			
米ドル			
USD DNB BANK ASA-144A 1.12700% 20-16.09.26	6 500 000.00	5 862 859.14	0.34
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC 0.98300% 21-01.09.24	12 200 000.00	11 482 262.90	0.67
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 2.25000% 19-21.11.24	5 175 000.00	4 949 276.12	0.29
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	5 000 000.00	4 833 196.00	0.28
米ドル合計		27 127 594.16	1.58
債券、固定利付債合計		27 127 594.16	1.58
債券、変動利付債			
米ドル			
USD CAIXABANK SA-144A 6.208%/VAR 23-18.01.29	5 750 000.00	5 818 851.42	0.34
米ドル合計		5 818 851.42	0.34
債券、変動利付債合計		5 818 851.42	0.34
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		399 828 886.37	23.27
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD FIFTH THIRD BANCORP 4.055%/VAR 22-25.04.28	1 500 000.00	1 419 475.54	0.08
米ドル合計		1 419 475.54	0.08
ノート、変動利付債合計		1 419 475.54	0.08
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 419 475.54	0.08
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ALCON FINANCE CORP-144A 5.37500% 22-06.12.32	3 000 000.00	3 088 293.42	0.18
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	6 750 000.00	6 992 909.35	0.41
米ドル合計		10 081 202.77	0.59
ノート、固定利付債合計		10 081 202.77	0.59

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD DANSKE BANK A/S-144A 6.466%/VAR 23-09.01.26	5 500 000.00	5 539 201.91	0.32
米ドル合計		5 539 201.91	0.32
ノート、変動利付債合計		5 539 201.91	0.32
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		15 620 404.68	0.91
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs			
投資信託、オープン・エンド型			
ルクセンブルグ			
USD UBS(LUX)BOND SICAV-GLBL SDG CORPORATES SUSTNBL(USD) U-X-ACC	360.00	3 751 398.00	0.22
ルクセンブルグ合計		3 751 398.00	0.22
投資信託、オープン・エンド型合計		3 751 398.00	0.22
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		3 751 398.00	0.22
投資有価証券合計		1 681 253 960.26	97.85
金融派生商品			
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品			
債券関連金融先物			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 21.06.23	-125.00	-54 781.25	0.00
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	150.00	-69 945.24	-0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	-250.00	-3 656.41	0.00
債券関連金融先物合計		-128 382.90	-0.01
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-128 382.90	-0.01
金融派生商品合計		-128 382.90	-0.01
先渡為替契約			
購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日			
JPY 2 649 354 900.00 USD 19 994 145.95 15.5.2023		-498 277.57	-0.03
GBP 357 982 500.00 USD 445 622 665.90 15.5.2023		4 469 110.43	0.26
CHF 399 550 800.00 USD 443 238 859.84 15.5.2023		6 376 844.21	0.37
EUR 273 982 300.00 USD 299 595 809.30 15.5.2023		3 127 897.97	0.18
USD 3 149 848.92 EUR 2 846 000.00 15.5.2023		5 296.62	0.00
USD 11 134 773.94 CHF 9 967 500.00 15.5.2023		-81 683.47	0.00
USD 11 279 033.66 EUR 10 241 700.00 15.5.2023		-37 045.49	0.00
USD 4 088 453.29 EUR 3 702 800.00 15.5.2023		-2 779.40	0.00
USD 43 329 008.66 GBP 34 431 100.00 15.5.2023		38 750.17	0.00
先渡為替契約合計		13 398 113.47	0.78
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		72 244 512.22	4.20
その他の資産および負債		-48 544 863.44	-2.82
純資産総額		1 718 223 339.61	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2023年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル					
USD	INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000%	23-12.07.28	39 674 000.00	39 436 709.81	1.75
USD	INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000%	22-29.03.32	78 300 000.00	71 720 180.08	3.18
USD	INTERNATIONAL BK FOR RECONST& DEVELOP 1.62500%	21-03.11.31	340 000 000.00	291 255 770.80	12.92
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000%	19-23.10.29	170 000 000.00	151 577 276.80	6.73
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000%	20-24.11.27	80 000 000.00	70 286 088.00	3.12
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500%	22-21.09.29	32 500 000.00	32 477 730.35	1.44
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.75000%	05-15.02.35	12 553 000.00	13 590 083.04	0.60
米ドル合計				670 343 838.88	29.74
ノート、固定利付債合計				670 343 838.88	29.74

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル						
USD	INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE	1.37500%	21-20.04.28	315 000 000.00	282 911 762.70	12.55
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	1.87500%	16-27.10.26	500 000.00	468 976.71	0.02
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	2.50000%	17-22.11.27	80 000 000.00	76 090 685.60	3.37
米ドル合計					359 471 425.01	15.94
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計					359 471 425.01	15.94

債券、固定利付債

米ドル						
USD	INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK	3.87500%	23-14.02.30	80 000 000.00	81 103 014.40	3.60
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	0.87500%	20-14.05.30	251 000 000.00	208 014 071.32	9.23
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	0.75000%	20-26.08.30	297 270 000.00	242 275 192.69	10.75
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	1.25000%	21-10.02.31	416 064 000.00	350 898 466.95	15.56
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK	1.12500%	21-13.09.28	290 000 000.00	254 661 507.69	11.30
米ドル合計					1 136 952 253.05	50.44
債券、固定利付債合計					1 136 952 253.05	50.44

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			2 166 767 516.94	96.12
---------------------------------------	--	--	------------------	-------

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル					
USD	INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850%	19-13.09.29	40 000 000.00	37 972 764.40	1.68
米ドル合計				37 972 764.40	1.68
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計				37 972 764.40	1.68

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	6 284 000.00	4 837 599.78	0.22
米ドル合計		4 837 599.78	0.22
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		4 837 599.78	0.22
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		42 810 364.18	1.90
投資有価証券合計		2 209 577 881.12	98.02

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 21.06.23	100.00	542 187.50	0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.06.23	-50.00	-161 718.80	-0.01
債券関連金融先物合計		380 468.70	0.02
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		380 468.70	0.02
金融派生商品合計		380 468.70	0.02

先渡為替契約

購入通貨 / 購入額 / 売却通貨 / 売却額 / 満期日

GBP	84 139 700.00	USD	104 161 423.15	3.5.2023	1 600 047.45	0.07
EUR	451 009 900.00	USD	491 557 945.06	3.5.2023	6 430 026.63	0.28
CHF	468 541 500.00	USD	512 380 801.36	3.5.2023	14 181 156.55	0.63
USD	1 192 979.97	EUR	1 095 700.00	3.5.2023	-16 850.28	0.00
USD	1 451 580.61	EUR	1 331 000.00	3.5.2023	-18 058.95	0.00
USD	526 659.06	CHF	476 500.00	3.5.2023	-8 846.92	0.00
USD	1 998 340.09	EUR	1 828 400.00	3.5.2023	-20 509.62	0.00
USD	143 032.97	GBP	114 800.00	3.5.2023	-1 267.72	0.00
USD	239 285.87	GBP	192 200.00	3.5.2023	-2 304.66	0.00
USD	685 989.39	EUR	627 600.00	3.5.2023	-6 982.65	0.00
USD	1 301 096.42	EUR	1 184 000.00	3.5.2023	-6 231.33	0.00
USD	902 242.51	EUR	815 700.00	3.5.2023	1 577.61	0.00
USD	807 584.16	CHF	725 200.00	3.5.2023	-7 418.85	0.00
USD	122 150.85	GBP	98 300.00	3.5.2023	-1 409.76	0.00
USD	1 480 980.31	EUR	1 349 800.00	3.5.2023	-9 417.49	0.00
USD	486 793.33	EUR	443 600.00	3.5.2023	-3 012.91	0.00
USD	677 906.52	CHF	605 500.00	3.5.2023	-2 573.79	0.00
GBP	84 600.00	USD	104 851.11	3.5.2023	1 488.95	0.00
USD	1 185 453.50	EUR	1 075 600.00	3.5.2023	-2 183.10	0.00
USD	606 058.84	CHF	540 000.00	3.5.2023	-810.47	0.00
USD	108 202.79	GBP	87 300.00	3.5.2023	-1 531.10	0.00
EUR	820 600.00	USD	901 478.25	3.5.2023	4 597.05	0.00
GBP	116 600.00	USD	145 585.35	3.5.2023	977.90	0.00
USD	697 112.77	EUR	629 500.00	3.5.2023	2 042.82	0.00
GBP	83 848 300.00	USD	104 478 008.72	2.6.2023	992 014.74	0.04
EUR	441 449 600.00	USD	485 725 229.08	2.6.2023	2 631 430.21	0.12
CHF	466 194 300.00	USD	521 972 255.19	2.6.2023	3 958 764.17	0.18
USD	725 136.69	EUR	656 000.00	2.6.2023	-567.83	0.00
先渡為替契約合計					29 694 146.65	1.32
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					17 002 592.51	0.75
当座借越およびその他の短期負債					-38 525.73	0.00
その他の資産および負債					-2 456 973.77	-0.11
純資産総額					2 254 159 589.48	100.00

注記は当財務書類の一部である。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2022年6月1日から2023年5月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年5月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
フォーカス・シキャブ - グローバル・ボンド	クラス米ドル F-acc投資証券	203,450.318 (130,289.000)	265,613.619 (103,811.000)	1,455,115.267 (668,516.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	430,268.000 (434,078.000)	72,599.708 (72,424.708)	909,590.500 (848,665.000)
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	6,512,192.355 (11,680.000)	9,389,563.493 (88,015.000)	4,934,298.578 (107,248.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	12,530.000 (12,530.000)	42,949.000 (43,278.000)	134,634.000 (134,634.000)
フォーカス・シキャブ - ハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	7,128,569.507 (12,240.000)	7,383,575.480 (139,876.000)	7,655,642.988 (186,020.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	23,300.000 (23,300.000)	87,125.000 (89,020.000)	293,434.000 (293,434.000)
フォーカス・シキャブ - USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	クラスF-acc投資証券	1,471,294.185 (15,325.000)	1,732,176.156 (59,396.000)	4,401,152.526 (196,489.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	17,320.000 (17,320.000)	23,628.000 (23,628.000)	301,372.000 (301,372.000)
フォーカス・シキャブ - ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	1,371,746.706 (2,810.000)	1,346,532.279 (1,966.000)	6,724,177.409 (24,687.000)

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