

【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9月29日

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

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

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹 野 康 造
弁護士 廣 本 文 晴

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

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

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

【電話番号】 03（6212）8316

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

【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
クラスA（米ドル建て）受益証券
100億米ドル（約1兆3,413億円）を上限とします。
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）受益証券
100億豪ドル（約8,898億円）を上限とします。
（注）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2023年4月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝134.13円および1豪ドル＝88.98円）によります。

【縦覧に供する場所】 該当事項ありません。

1 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2023年6月30日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により追加・更新するため、また、2023年7月付でファンドの設立地における英文目論見書が更新され、申込（販売）手続等に関する事項が修正されたため、これに関連する記載およびその他一部の情報を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

（「5 管理会社の経理の概況」は訂正内容に該当しないため省略します。）

[次へ](#)

１ ファンドの運用状況

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

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

（１）投資状況

資産別および地域別の投資状況

本表は、ファンドの全クラスの資産を合計して表示したものです。

（2023年7月末日現在）

資産の種類	国名／地域名	時価合計 （米ドル）	投資比率 （％）
変動利付債	アメリカ合衆国	56,332,351	54.33
	カナダ	445,188	0.43
	ケイマン諸島	369,844	0.36
	フランス	242,075	0.23
	ドイツ	231,362	0.22
	ペルー	200,546	0.19
	パナマ	171,203	0.17
	日本	61,384	0.06
国債	アメリカ合衆国	23,445,358	22.61
債券	アメリカ合衆国	19,207,925	18.53
	イギリス	593,953	0.57
	アイルランド	562,968	0.54
	ルクセンブルグ	376,420	0.36
	バミューダ	199,456	0.19
	カタール	198,961	0.19
	オランダ	185,280	0.18
	オーストラリア	168,150	0.16
	ノルウェー	150,991	0.15
	シンガポール	138,029	0.13
小計		103,281,444	99.62
現金その他の資産（負債控除後）		397,611	0.38
合計 （純資産総額）		103,679,055 （約14,616百万円）	100.00

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

（注２）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2023年7月31日現在の株式会社三菱ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝140.97円および１豪ドル＝93.96円）によります。以下同じです。

（注３）ファンドは、ケイマン諸島の法律に基づいて設立されていますが、受益証券は、米ドル建てまたは豪ドル建てのため以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたは豪ドルをもって行います。

（注４）本書の中で金額および比率を表示する場合、適宜の単位に四捨五入している場合があります。したがって、合計の数字が一致しない場合があります。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。したがって、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。

投資有価証券の主要銘柄

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

（2023年7月末日現在）

順位	銘柄	発行国 （発行地）	種類	利率 （％）	償還日	数量	（米ドル）				投資 比率 （％）
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
1	US TREASURY 3.75% 30/06/2030	アメリカ 合衆国	国債	3.750	2030年 6 月30日	6,805,000	0.99	6,711,311	0.98	6,695,025	6.46
2	US TREASURY 3.375% 15/05/2033	アメリカ 合衆国	国債	3.375	2033年 5 月15日	5,551,000	0.97	5,399,883	0.96	5,334,846	5.15
3	US TREASURY 3.625% 15/02/2053	アメリカ 合衆国	国債	3.625	2053年 2 月15日	3,138,000	0.96	3,014,144	0.95	2,980,673	2.87
4	US TREASURY 4% 15/11/2042	アメリカ 合衆国	国債	4.000	2042年11月15日	2,895,000	1.00	2,892,697	0.98	2,847,263	2.75
5	US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	アメリカ 合衆国	国債	2.500	2045年 2 月15日	2,791,000	1.13	3,161,716	0.77	2,144,893	2.07
6	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年12月 1 日	3,100,000	0.77	2,375,412	0.60	1,869,587	1.80
7	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2052年 1 月 1 日	2,380,000	0.89	2,119,818	0.77	1,839,755	1.77
8	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2053年 3 月 1 日	1,842,000	0.98	1,803,749	0.95	1,753,878	1.69
9	US TREASURY 3.875% 15/05/2043	アメリカ 合衆国	国債	3.875	2043年 5 月15日	1,613,000	0.97	1,567,840	0.97	1,556,998	1.50
10	FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年 4 月 1 日	1,446,000	0.99	1,429,041	0.96	1,395,333	1.35
11	US TREASURY 3% 15/08/2052	アメリカ 合衆国	国債	3.000	2052年 8 月15日	1,354,000	0.83	1,118,248	0.84	1,137,676	1.10
12	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2048	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2048年 1 月 1 日	6,250,000	0.17	1,059,928	0.17	1,036,092	1.00
13	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2049年 5 月 1 日	3,250,000	0.32	1,034,404	0.31	1,014,888	0.98
14	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2050年 5 月 1 日	1,800,000	0.57	1,028,140	0.56	1,008,058	0.97
15	FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2052年 8 月 1 日	1,036,000	0.93	967,212	0.94	977,696	0.94
16	FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2052年 6 月 1 日	1,097,000	0.89	971,380	0.88	962,395	0.93
17	FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2052年 7 月 1 日	986,000	0.90	882,564	0.89	878,995	0.85
18	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年 9 月 1 日	900,000	0.94	845,190	0.93	834,942	0.81
19	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2052年12月 1 日	800,000	0.96	768,401	0.95	763,288	0.74
20	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2037	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2037年 9 月 1 日	785,000	0.89	701,904	0.87	679,980	0.66
21	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年 1 月 1 日	690,000	0.98	677,795	0.97	670,565	0.65
22	FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年10月 1 日	708,000	0.92	654,592	0.92	653,962	0.63
23	FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年 7 月 1 日	620,000	0.98	610,313	0.98	609,226	0.59

順位	銘柄	発行国 (発行地)	種類	利率 (%)	償還日	数量	(米ドル)				投資 比率 (%)
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
24	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2049年12月 1 日	1,350,000	0.53	710,392	0.42	566,569	0.55
25	US TREASURY 3.375% 15/11/2048	アメリカ 合衆国	国債	3.375	2048年11月15日	614,000	0.93	568,876	0.89	544,672	0.53
26	FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年 6 月 1 日	601,000	0.90	537,959	0.90	541,403	0.52
27	FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.500	2052年 9 月 1 日	569,000	0.94	537,465	0.95	538,237	0.52
28	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2051年 3 月 1 日	646,000	0.86	552,381	0.81	520,698	0.50
29	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2036	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2036年 5 月 1 日	758,000	0.68	514,248	0.66	498,686	0.48
30	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2052年 9 月 1 日	535,000	0.94	500,526	0.93	494,907	0.48

投資不動産物件

該当事項はありません。（2023年7月末日現在）

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。（2023年7月末日現在）

（２）運用実績

純資産の推移

2023年7月末日および同日前1年間における各月末の純資産の推移は次の通りです。

<クラスA（米ドル建て）>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2022年8月末日	93,062,653	13,119,042	85.29	12,023
9月末日	89,183,838	12,572,246	80.96	11,413
10月末日	83,243,153	11,734,787	79.37	11,189
11月末日	83,129,258	11,718,732	82.30	11,602
12月末日	82,443,719	11,622,091	82.04	11,565
2023年1月末日	85,474,285	12,049,310	84.90	11,968
2月末日	82,188,479	11,586,110	82.80	11,672
3月末日	82,504,859	11,630,710	83.96	11,836
4月末日	87,365,929	12,315,975	84.37	11,894
5月末日	77,844,505	10,973,740	83.39	11,755
6月末日	74,624,601	10,519,830	83.15	11,722
7月末日	74,444,404	10,494,428	82.99	11,699

（参考情報）

純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移（2023年7月末日現在）

【クラスA（米ドル建て）】



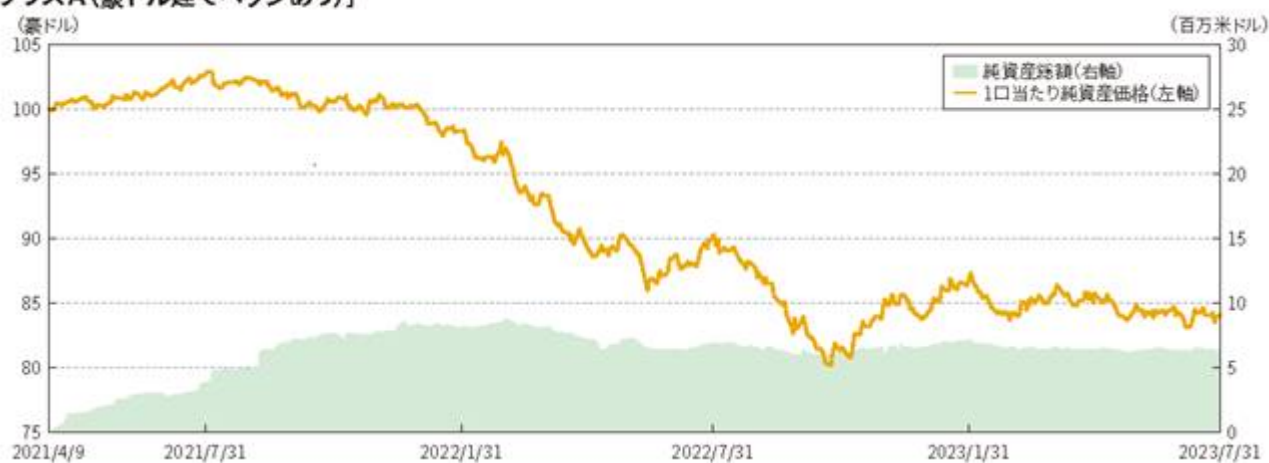
<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	豪ドル	円
2022年8月末日	6,568,755	925,997	87.67	8,237
9月末日	5,912,926	833,545	83.05	7,803
10月末日	6,083,160	857,543	81.33	7,642
11月末日	6,616,976	932,795	84.16	7,908
12月末日	6,603,291	930,866	83.84	7,878
2023年1月末日	7,063,154	995,693	86.64	8,141
2月末日	6,556,371	924,252	84.38	7,928
3月末日	6,449,604	909,201	85.44	8,028
4月末日	6,414,473	904,248	85.78	8,060
5月末日	6,221,376	877,027	84.66	7,955
6月末日	6,346,879	894,720	84.31	7,922
7月末日	6,381,202	899,558	84.06	7,898

（参考情報）

純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移(2023年7月末日現在)

【クラスA(豪ドル建てヘッジあり)】



分配の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
2022年8月1日～2023年7月末日	1.00	141

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
第6会計年度中 （2023年1月1日～2023年7月末日）	0.50	70
設定来累計	2.50	352

（注）設定来累計とは、運用開始日である2020年9月25日から2023年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
2022年8月1日～2023年7月末日	1.00	94

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
第6会計年度中 （2023年1月1日～2023年7月末日）	0.50	47
設定来累計	2.00	188

（注）設定来累計とは、運用開始日である2021年4月9日から2023年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

収益率の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	収益率（注）
2022年8月1日～2023年7月末日	- 3.88%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

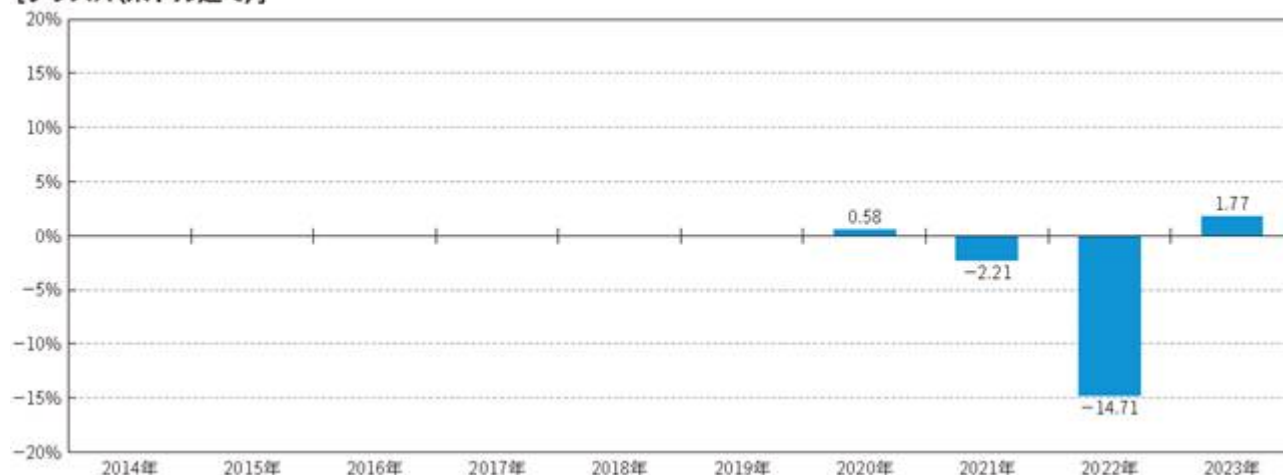
a：2023年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2022年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）

収益率の推移（暦年ベース）

【クラスA（米ドル建て）】



（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

* 2023年の場合は、7月末日の1口当たり純資産価格（7月末日までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

* クラスA（米ドル建て）については、2020年の場合は、100米ドル

なお、ファンドにはベンチマークはありません。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

期間	収益率（注）
2022年8月1日～2023年7月末日	- 5.33%

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：2023年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2022年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

＊2023年の場合は、7月末の1口当たり純資産価格（7月末までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

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

なお、ファンドにはベンチマークはありません。

2 販売及び買戻しの実績

2023年7月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年7月末日現在の発行済口数は次のとおりです。

<クラスA（米ドル建て）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
298,828 (298,828)	463,029 (463,029)	897,035 (897,035)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
27,252 (27,252)	23,750 (23,750)	113,004 (113,004)

（注）（ ）内の数字は本邦における販売・買戻しおよび発行済口数です。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a．ファンドの日本語の中間財務書類は、香港財務報告基準に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものです（ただし、円換算部分を除きます。）。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものです。
- b．ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいいます。）の監査を受けていません。
- c．ファンドの中間財務書類において記載されているクラスA（円ヘッジあり）およびクラスA（円ヘッジなし）は、本書に基づく開示の対象ではなく、参考情報として記載されています。
- d．ファンドの原文の中間財務書類は、別途記載される場合を除き、米ドル、日本円または豪ドルで表示されています。日本語の中間財務書類には、主要な金額について2023年7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＝140.97円および1豪ドル＝93.96円）で換算された円換算額が併記されています。なお、千円未満の金額は四捨五入されているため、円換算額は合計欄の数値が総数と一致しない場合があります。

[次へ](#)

（１）資産及び負債の状況

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
 ＵＳ・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 財政状態計算書（未監査）
 2023年 6 月30日現在

	2023年 6 月30日現在	
	米ドル	千円
資産		
損益を通じて公正価値で測定される金融資産	102,770,933	14,487,618
利付証券に係る未収利息	593,995	83,735
預金未収利息	69	10
受益証券発行未収金	41,460	5,845
投資対象売却未収金	2,430,329	342,603
現金および現金同等物	1,061,168	149,593
資産合計	106,897,954	15,069,405
負債		
デリバティブ金融負債	386,995	54,555
受益証券買戻未払金	172,540	24,323
投資対象購入未払金	3,090,243	435,632
その他の未払金	109,686	15,462
負債合計（受益者に帰属する純資産を除く）	3,759,464	529,972
受益者に帰属する純資産	103,138,490	14,539,433
発行済受益証券口数		
クラスＡ（円ヘッジあり）	2,598,653	口
クラスＡ（円ヘッジなし）	1,367,424	口
クラスＡ（米ドル建て）	896,385	口
クラスＡ（豪ドル建てヘッジあり）	113,002	口
受益証券 1 口当たり純資産価格		
クラスＡ（円ヘッジあり）	705	円
クラスＡ（円ヘッジなし）	1,009	円
クラスＡ（米ドル建て）	83.15	米ドル 11,722 円
クラスＡ（豪ドル建てヘッジあり）	84.31	豪ドル 7,922 円

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
 ＵＳ・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 包括利益計算書（未監査）
 2023年１月１日から2023年６月30日までの期間

2023年１月１日から2023年６月30日
 までの期間

米ドル 千円

収益

利付証券利息	4,010,919	565,419
銀行利息	28,064	3,956
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る実現純損失	(6,602,632)	(930,773)
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る未実現利益の純変動	4,030,641	568,199
為替差損の純額	(62,673)	(8,835)
	<u>1,404,319</u>	<u>197,967</u>

費用

運用報酬	(139,439)	(19,657)
保管および手続費用	(30,395)	(4,285)
受託会社報酬	(5,952)	(839)
監査報酬	(17,965)	(2,533)
評価費用	(46,800)	(6,597)
取引取扱手数料	(7,663)	(1,080)
年次費用	(1,337)	(188)
会計およびその他の専門家報酬	(2,238)	(315)
販売報酬および管理会社代行サービス会社報酬	(355,215)	(50,075)
その他の運用費用	(11,655)	(1,643)
運用費用合計	<u>(618,659)</u>	<u>(87,212)</u>

運用利益 785,660 110,754

財務費用

受益者への分配 (1,062,144) (149,730)

分配後および税引前損失 (276,484) (38,976)

税金

源泉税 (11,523) (1,624)

受益者に帰属する純資産の減少 (288,007) (40,600)

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
ＵＳ・コア・フィクスト・インカム・ファンド
受益者に帰属する純資産変動計算書（未監査）
2023年１月１日から2023年６月30日までの期間

	2023年１月１日から2023年６月30日 までの期間	
	米ドル	千円
期首現在受益者に帰属する純資産	115,706,420	16,311,134
受益証券の発行	14,525,319	2,047,634
分配金再投資	532,112	75,012
受益証券の買戻し	(27,337,354)	(3,853,747)
	(12,279,923)	(1,731,101)
受益者に帰属する純資産の減少	(288,007)	(40,600)
期末現在受益者に帰属する純資産	103,138,490	14,539,433

（２）投資有価証券明細表等

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

[次へ](#)

< 参考情報 >

投資サマリー（2023年6月末時点）

投資対象	保有高 （米ドル）	単価 （米ドル）	時価 （米ドル）	国名	純資産 比率 （％）
US TREASURY 3.75% 31/05/2030	5,955,000	98.65175	5,874,712	アメリカ合衆国	5.70
US TREASURY 3.375% 15/05/2033	3,575,000	96.469112	3,448,771	アメリカ合衆国	3.34
US TREASURY 3.625% 15/02/2053	3,127,000	96.018567	3,002,501	アメリカ合衆国	2.91
US TREASURY 4% 15/11/2042	2,895,000	99.474767	2,879,795	アメリカ合衆国	2.79
US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	2,791,000	77.49723	2,162,948	アメリカ合衆国	2.10
US TREASURY 3% 15/08/2052	2,353,000	85.062488	2,001,520	アメリカ合衆国	1.94
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	3,100,000	61.090669	1,893,811	アメリカ合衆国	1.84
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	2,380,000	78.509013	1,868,515	アメリカ合衆国	1.81
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2053	1,842,000	95.414318	1,757,532	アメリカ合衆国	1.70
US TREASURY 3.875% 15/05/2043	1,613,000	97.69399	1,575,804	アメリカ合衆国	1.53
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2053	1,446,000	96.555368	1,396,191	アメリカ合衆国	1.35
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2048	6,250,000	16.763298	1,047,706	アメリカ合衆国	1.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2037	1,200,000	87.198595	1,046,383	アメリカ合衆国	1.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2049	3,250,000	31.553323	1,025,483	アメリカ合衆国	0.99
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2050	1,800,000	56.723401	1,021,021	アメリカ合衆国	0.99
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	1,036,000	95.062301	984,845	アメリカ合衆国	0.95
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	1,097,000	88.899752	975,230	アメリカ合衆国	0.95
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	986,000	89.583911	883,297	アメリカ合衆国	0.86
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	900,000	92.386057	831,475	アメリカ合衆国	0.81
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	800,000	95.724017	765,792	アメリカ合衆国	0.74
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2053	690,000	97.783305	674,705	アメリカ合衆国	0.65
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	708,000	92.607094	655,658	アメリカ合衆国	0.64
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	1,350,000	42.386394	572,216	アメリカ合衆国	0.55
US TREASURY 3.375% 15/11/2048	614,000	90.480638	555,551	アメリカ合衆国	0.54
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	601,000	90.952847	546,627	アメリカ合衆国	0.53
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	569,000	94.717702	538,944	アメリカ合衆国	0.52
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	646,000	81.627185	527,312	アメリカ合衆国	0.51
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2036	758,000	66.68424	505,467	アメリカ合衆国	0.49
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	535,000	93.032729	497,725	アメリカ合衆国	0.48
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	801,000	62.026205	496,830	アメリカ合衆国	0.48
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2050	1,000,000	49.244121	492,441	アメリカ合衆国	0.48
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	507,000	94.89151	481,100	アメリカ合衆国	0.47
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/04/2045	2,580,000	18.255082	470,981	アメリカ合衆国	0.46
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2036	653,000	69.325415	452,695	アメリカ合衆国	0.44
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	491,000	90.798348	445,820	アメリカ合衆国	0.43
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	478,000	91.974096	439,636	アメリカ合衆国	0.43
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	437,000	96.421288	421,361	アメリカ合衆国	0.41
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2052	440,000	95.083783	418,369	アメリカ合衆国	0.41
BROADCOM INC (REG) 4.75% 15/04/2029	416,000	96.9664	403,380	アメリカ合衆国	0.39
WELLS FARGO & COMPANY SER U (REG) VAR PERP 29/12/2049	408,000	98.375	401,370	アメリカ合衆国	0.39
FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2053	428,000	93.604383	400,627	アメリカ合衆国	0.39
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	414,000	91.667114	379,502	アメリカ合衆国	0.37
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2037	423,000	88.52074	374,443	アメリカ合衆国	0.36

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	399,000	93.051621	371,276	アメリカ合衆国	0.36
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 2.45 % 29/10/2026	405,000	89.30885	361,701	アイルランド	0.35
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2052	403,160	87.604703	353,187	アメリカ合衆国	0.34
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2033	1,075,000	30.960003	332,820	アメリカ合衆国	0.32
BXHPP TRUST FRN 15/08/2036	358,000	92.21041	330,113	アメリカ合衆国	0.32
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 3.6% 2 1/06/2030	376,000	86.53315	325,365	アメリカ合衆国	0.32
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2036	376,000	85.324822	320,821	アメリカ合衆国	0.31
ENERGY TRANSFER OPERATNG (REG) 5.25 % 15/04/2029	326,000	97.44735	317,678	アメリカ合衆国	0.31
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 22/04/2 032	386,000	81.946	316,312	アメリカ合衆国	0.31
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	341,000	91.600652	312,358	アメリカ合衆国	0.30
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) VAR 02/06/2028	348,000	89.1935	310,393	アメリカ合衆国	0.30
FANNIE 30YR JUL FRN 25/04/2040	312,000	97.99219	305,736	アメリカ合衆国	0.30
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2035	691,000	43.980679	303,906	アメリカ合衆国	0.29
BOEING CO 5.15% 01/05/2030	299,000	99.1705	296,520	アメリカ合衆国	0.29
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 5.327% 06/02/2029	295,000	98.5	290,575	アメリカ合衆国	0.28
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (REG) VAR 02/03/2033	337,000	85.51335	288,180	アメリカ合衆国	0.28
T-MOBILE USA INC (REG) 3.875% 15/04 /2030	308,000	92.1906	283,947	アメリカ合衆国	0.28
WARNERMEDIA HOLDINGS INC (REG) 5.14 1% 15/03/2052	346,000	81.4035	281,656	アメリカ合衆国	0.27
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	363,000	76.518831	277,763	アメリカ合衆国	0.27
MORGAN STANLEY VAR 28/04/2026	295,000	93.93705	277,114	アメリカ合衆国	0.27
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2053	279,000	97.362548	271,642	アメリカ合衆国	0.26
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2050	445,000	60.064698	267,288	アメリカ合衆国	0.26
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	289,000	91.960866	265,767	アメリカ合衆国	0.26
BANK OF AMERICA CORP VAR 22/04/2032	320,000	83.0318	265,702	アメリカ合衆国	0.26
CITIGROUP INC (REG) 4.6% 09/03/2026	273,000	96.7407	264,102	アメリカ合衆国	0.26
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 2.4% 1 5/10/2028	303,000	84.7882	256,908	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2051	329,000	77.072219	253,568	アメリカ合衆国	0.25
BANK OF AMERICA CORP (REG) VAR 23/07/2029	264,000	94.7933	250,254	アメリカ合衆国	0.24
CENTENE CORP (REG) 4.625% 15/12/202 9	268,000	92.5	247,900	アメリカ合衆国	0.24
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2037	261,000	94.57359	246,837	アメリカ合衆国	0.24
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2051	343,000	71.69113	245,901	アメリカ合衆国	0.24
MONROE CAPITAL ABS FUNDING 2021-1 LTD SER 1A CL A2 FRN 22/04/2031	257,000	94.65518	243,264	ケイマン諸島	0.24
EXPEDIA INC SER WI (REG) 3.8% 15/02/2028 W/I	258,000	93.4716	241,157	アメリカ合衆国	0.23
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.5% 15/05/2030	252,000	95	239,400	アメリカ合衆国	0.23
SOCIETE GENERALE (SER 144A) VAR 10/ 01/2029	238,000	100.08	238,190	フランス	0.23
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	261,000	90.480111	236,153	アメリカ合衆国	0.23
UNITED AIR 2020-1 A PTT (SER 20-1) 5.875% 15/10/2027	328,000	71.149649	233,371	アメリカ合衆国	0.23
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 3.244% 05/10/2026	259,000	89.98655	233,065	アメリカ合衆国	0.23
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 3.45% 02/06/2025	246,000	94.5055	232,484	アメリカ合衆国	0.23
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2051	310,000	73.735112	228,579	アメリカ合衆国	0.22
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 4.185% 15/02/2027	238,000	96	228,480	アメリカ合衆国	0.22
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 4.2% 15/03/2028	242,000	93.714476	226,789	アメリカ合衆国	0.22
NEW ECONOMY ASSETS PHASE 1 SPONSOR LLC SER 1 CL A1 FRN 20/10/2061	264,000	85.65047	226,117	アメリカ合衆国	0.22

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST SER SFR2 CL A FRN 19/04/2038	257,000	87.78534	225,608	アメリカ合衆国	0.22
CHENIERE ENERGY PARTNERS (REG) 3.25 % 31/01/2032	268,000	82.575	221,301	アメリカ合衆国	0.21
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2052	238,000	92.9541	221,231	アメリカ合衆国	0.21
FIRSTKEY HOMES 2020-SFR1 TRUST SER SFR1 CL C FRN 17/08/2028	254,000	86.87484	220,662	アメリカ合衆国	0.21
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2052	230,000	95.799377	220,339	アメリカ合衆国	0.21
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 3.75% 15/06/2029	250,000	87.75	219,375	アメリカ合衆国	0.21
SLG OFFICE TRUST 2021-OVA SER OVA CL C FRN 15/07/2041	286,000	76.63667	219,181	アメリカ合衆国	0.21
CANTOR COMMERCIAL REAL ESTATE LENDING 2019-CF1 SER CF1 CL A2 FRN	232,000	94.02681	218,142	アメリカ合衆国	0.21
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	228,000	95.374896	217,455	アメリカ合衆国	0.21
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	234,000	92.172653	215,684	アメリカ合衆国	0.21
MARYLAND HLTH & HGR EDUCTNL 3.197% 01/07/2050	300,000	69.094	207,282	アメリカ合衆国	0.20
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	634,923	32.346907	205,378	アメリカ合衆国	0.20
DB MASTER FINANCE LLC FRN 20/11/205 1	238,000	86.206244	205,171	アメリカ合衆国	0.20
AMERICAN TOWER CORP 3.8% 15/08/2029	225,000	90.92165	204,574	アメリカ合衆国	0.20
ENTERPRISE PRODUCTS OPER (SER E) VAR 16/08/2077	231,000	88.4955	204,425	アメリカ合衆国	0.20
BOEING CO 5.04% 01/05/2027	205,000	99.01795	202,987	アメリカ合衆国	0.20
STATE OF QATAR SER REGS (REG) 5.103% 23/04/2048	200,000	100.112	200,224	カタール	0.19
PNC FINANCIAL SERVICES VAR 12/06/2029	200,000	99.67265	199,345	アメリカ合衆国	0.19
VISTRA CORP (SER 144A) (REG) 4.3% 1 5/07/2029	226,000	88.125	199,163	アメリカ合衆国	0.19
ABENGOA TRANSMISION SUR SER 144A 6.875% 30/04/2043	222,000	88.820625	197,182	ペルー	0.19
ATHENE HOLDING LTD 3.5% 15/01/2031	239,000	82.34325	196,800	バミューダ	0.19
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 3% 2 9/10/2028	227,000	86.521	196,403	アイルランド	0.19
JPMORGAN CHASE & CO VAR 13/05/2031	229,000	85.70305	196,260	アメリカ合衆国	0.19
VISTRA CORP (SER 144A) (REG) 3.7% 3 0/01/2027	214,000	91.5	195,810	アメリカ合衆国	0.19
DATABANK ISSUER SER 1A CL A2 FRN 27/02/2051	222,000	88.05788	195,488	アメリカ合衆国	0.19
SCF EQUIPMENT LEASING 2019-2 LLC SE R 2A CL C FRN 21/06/2027	203,000	95.72754	194,327	アメリカ合衆国	0.19
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	206,000	93.41377	192,432	アメリカ合衆国	0.19
KRAFT HEINZ FOODS CO (REG) 4.375% 0 1/06/2046	225,000	85.2886	191,899	アメリカ合衆国	0.19
WINGSTOP FUNDING LLC FRN 05/12/2050	224,000	85.101153	190,627	アメリカ合衆国	0.18
UNIV OF CALIFORNIA CA RGTS MED 3.006% 15/05/2050	270,000	70.519	190,401	アメリカ合衆国	0.18
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2047	470,000	40.211002	188,992	アメリカ合衆国	0.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45% (REG) 08/05/2025	194,000	96.992	188,164	イギリス	0.18
ARES CAPITAL CORP 2.15% 15/07/2026	217,000	86.5397	187,791	アメリカ合衆国	0.18
DIAMOND INFRASTRUCTURE FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 15/04/2049	216,000	86.33143	186,476	アメリカ合衆国	0.18
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (RE G) VAR 30/10/2030	215,000	86.62685	186,248	アメリカ合衆国	0.18
NATWEST MARKETS PLC (SER 144A) 1.6% 29/09/2026	211,000	87.77235	185,200	イギリス	0.18
NXP BV/NXP FDG/NXP USA (REG) 3.875% 18/06/2026	193,000	95.75	184,798	オランダ	0.18
CHARTER COMM OPT LLC/CAP 4.8% 01/03 /2050	241,000	75.6795	182,388	アメリカ合衆国	0.18
FLEX LTD (REG) 6% 15/01/2028	179,000	101.5085	181,700	シンガポール	0.18
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	388,000	46.763437	181,442	アメリカ合衆国	0.18

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
VMWARE INC (REG) 4.7% 15/05/2030	189,000	95.6812	180,837	アメリカ合衆国	0.18
TACO BELL FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 25/08/2051	212,000	85.127009	180,469	アメリカ合衆国	0.17
CROWN CASTLE INTL CORP (REG) 3.65% 01/09/2027	190,000	93.49705	177,644	アメリカ合衆国	0.17
KNDL 2019-KNSQ MORTGAGE TRUST SER K NSQ CL C FRN 15/05/2036	179,000	98.88669	177,007	アメリカ合衆国	0.17
PNC FINANCIAL SERVICES (SER T) VAR PERP 31/12/2049	237,000	74.375	176,269	アメリカ合衆国	0.17
NATIONAL GRID PLC 5.809% 12/06/2033	173,000	101.6159	175,796	イギリス	0.17
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 29/01 /2027	182,000	96.0133	174,744	アメリカ合衆国	0.17
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 5.75% 01/04/2048	204,000	85.3349	174,083	アメリカ合衆国	0.17
INDIANAPOLIS PWR & LIGHT (SER 144A) (REG) 5.65% 01/12/2032	170,000	101.96955	173,348	アメリカ合衆国	0.17
ORACLE CORP (REG) 2.95% 01/04/2030	198,000	87.4371	173,125	アメリカ合衆国	0.17
NETFLIX INC (SER 144A) (REG) 4.875% 15/06/2030	175,000	98.75	172,813	アメリカ合衆国	0.17
VR FUNDING LLC FRN 15/11/2050	291,000	59.171046	172,188	アメリカ合衆国	0.17
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 2.375% 16/02/2031	226,000	76.125	172,043	アメリカ合衆国	0.17
BANK OF AMERICA CORP (SER MTN) (REG) 3.248% 21/10/2027	184,000	93.2115	171,509	アメリカ合衆国	0.17
AES PANAMA GENERATION HL (SER 144A) (REG) 4.375% 31/05/2030	200,000	85.353959	170,708	パナマ	0.17
FN BM1277 FRN 01/05/2047	700,000	24.345611	170,419	アメリカ合衆国	0.17
CLI FUNDING VI LLC SER 1A CL A FRN 18/09/2045	272,000	62.404685	169,741	アメリカ合衆国	0.16
OCCIDENTAL PETROLEUM COR (REG) 6.45 % 15/09/2036	164,000	103.125	169,125	アメリカ合衆国	0.16
CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC/CAP (REG) 6.484% 23/10/2045	180,000	93.56305	168,413	アメリカ合衆国	0.16
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 4.9% 01/10/2026	169,000	99.44065	168,055	アメリカ合衆国	0.16
MACQUARIE BANK LTD (SER 144A) (REG) 3.624% 03/06/2030	200,000	83.8486	167,697	オーストラリア	0.16
BANK OF AMERICA CORP (SER MTN) (REG) VAR 14/06/2029	196,000	85.3486	167,283	アメリカ合衆国	0.16
JBS USA/FOOD/FINANCE (REG) (SER 144A) 3.625% 15/01/2032	205,000	81.25	166,563	ルクセンブルグ	0.16
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2049	571,000	29.11217	166,230	アメリカ合衆国	0.16
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 22/04/2031	193,000	84.699	163,469	アメリカ合衆国	0.16
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	167,000	97.182766	162,295	アメリカ合衆国	0.16
N/A SER INV1 CL A1 FRN 25/06/2026	269,000	59.565781	160,232	アメリカ合衆国	0.16
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST SER SFR5 CL A FRN 16/07/2026	185,000	85.41587	158,019	アメリカ合衆国	0.15
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/10/2051	196,000	80.272626	157,334	アメリカ合衆国	0.15
BENCHMARK 2018-B1 MORTGAGE TRUST SER B12 CL A2 FRN 15/08/2052	185,000	84.973206	157,200	アメリカ合衆国	0.15
MORGAN STANLEY (REG) VAR 20/04/2029	159,000	98.8122	157,111	アメリカ合衆国	0.15
CITIZENS FINANCIAL GROUP (REG) 3.25% 30/04/2030	192,000	81.7122	156,887	アメリカ合衆国	0.15
JPMORGAN CHASE & CO (SER HH) (REG) VAR PERP 31/12/2049	167,000	93.375	155,936	アメリカ合衆国	0.15
MORGAN STANLEY VAR 16/09/2036	204,000	76.09475	155,233	アメリカ合衆国	0.15
TRICON AMERICAN HOMES 2020-SFR2 TRUST SER SFR2 CL A FRN 17/11/2039	203,000	76.359213	155,009	アメリカ合衆国	0.15
BANK OF AMERICA CORP VAR 29/04/2031	184,000	83.8378	154,262	アメリカ合衆国	0.15

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER H) (R EG) 3.375% 15/12/2029	180,000	85.2852	153,513	アメリカ合衆国	0.15
NEIGHBORLY ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 30/04/2051	188,000	81.604373	153,416	アメリカ合衆国	0.15
DOMINOS PIZZA MASTER ISSUER LL FRN 25/07/2047	175,000	87.653689	153,394	アメリカ合衆国	0.15
CLI FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 18/02/2046	235,000	64.78681	152,249	アメリカ合衆国	0.15
EBAY INC (REG) 2.7% 11/03/2030	177,000	85.85965	151,972	アメリカ合衆国	0.15
DISCOVER FINANCIAL SVS (REG) 6.7% 2 9/11/2032	147,000	102.99025	151,396	アメリカ合衆国	0.15
PNC FINANCIAL SERVICES (REG) VAR PERP	151,000	100	151,000	アメリカ合衆国	0.15
AKER BP ASA (SER 144A) (REG) 4% 15/01/2031	170,000	88.6711	150,741	ノルウェー	0.15
BX COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2021-VOLT SER VOLT CL C FRN	158,000	95.19553	150,409	アメリカ合衆国	0.15
DBJPM 20-C9 MORTGAGE TRUST SER C9 CL A2 FRN 15/09/2053	166,000	90.58528	150,372	アメリカ合衆国	0.15
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 15/05/2 030	173,000	86.80995	150,181	アメリカ合衆国	0.15
UNITED AIR 2014-2 A PTT SER A 03/09/2026	275,000	54.603997	150,161	アメリカ合衆国	0.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.3% 1 5/11/2030	185,000	80.77755	149,438	アメリカ合衆国	0.14
BROADCOM INC (SER 144A) (REG) 3.419 % 15/04/2033	178,000	83.6037	148,815	アメリカ合衆国	0.14
OWENS CORNING (REG) 3.95% 15/08/202 9	159,000	92.9799	147,838	アメリカ合衆国	0.14
CHOICE HOTELS INTL INC (REG) 3.7% 0 1/12/2029	171,000	86.39685	147,739	アメリカ合衆国	0.14
T-MOBILE USA INC (REG) 5.75% 15/01/ 2054	143,000	102.96855	147,245	アメリカ合衆国	0.14
JACK IN THE BOX FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 26/02/2052	170,000	86.343591	146,784	アメリカ合衆国	0.14
DELTA AIR LINES/SKYMILES (SER 144A) (REG) 4.75% 20/10/2028	151,102	97.02365	146,605	アメリカ合衆国	0.14
ENBRIDGE INC (SER 20-A) (REG) VAR 15/07/2079	161,000	90.7343	146,082	カナダ	0.14
JPMORGAN CHASE & CO SER (S) (REG) VAR 29/12/2049	145,000	100.5	145,725	アメリカ合衆国	0.14
FLAGSTAR MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 1 CL A2 FRN 01/02/2051	258,000	56.245058	145,112	アメリカ合衆国	0.14
EXPEDIA GROUP INC (REG) 4.625% 01/0 8/2027	147,000	97.00175	142,593	アメリカ合衆国	0.14
DEUTSCHE BANK NY (REG) VAR 07/01/2028	164,000	86.90695	142,527	ドイツ	0.14
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	580,000	24.361223	141,295	アメリカ合衆国	0.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2045	616,000	22.915501	141,159	アメリカ合衆国	0.14
CSMC 2021-RPL2TRUST SER RPL2 CL A1A FRN 25/01/2060	278,000	50.738161	141,052	アメリカ合衆国	0.14
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (RE G) 4% 15/01/2029 WI	167,000	84.34885	140,863	アメリカ合衆国	0.14
ENBRIDGE INC (REG) VAR 01/03/2078	153,000	91.875	140,569	カナダ	0.14
CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST SER GC46 CL A2 FRN 15/01/2053	150,000	93.65561	140,483	アメリカ合衆国	0.14
AMSR 2019-SFR1 TRUST 2.153% 17/06/2038	167,000	83.86855	140,060	アメリカ合衆国	0.14
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.75% 19/05 /2033	139,000	99.6501	138,514	シンガポール	0.13
JBS USA/FOOD/FINANCE (SER 144A) (REG) 5.75% 01/04/2033	146,000	94	137,240	ルクセンブルグ	0.13
CHARLES SCHWAB CORP VAR 19/05/2029	137,000	100.0339	137,046	アメリカ合衆国	0.13
CNO FINANCIAL GROUP INC (REG) 5.25% 30/05/2029	144,000	94.696449	136,363	アメリカ合衆国	0.13
CITIGROUP INC VAR 25/05/2034	135,000	100.70645	135,954	アメリカ合衆国	0.13
PROLOGIS LP 5.125% 15/01/2034	136,000	99.1915	134,900	アメリカ合衆国	0.13
US BANCORP VAR 12/06/2034	133,000	100.955	134,270	アメリカ合衆国	0.13
TEACHERS INSUR & ANNUITY (REG) SER 144A 4.27% 15/05/2047	162,000	82.79315	134,125	アメリカ合衆国	0.13

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
ENERGY TRANSFER OPERATNG 5.5% 01/06/2027	133,000	99.46835	132,293	アメリカ合衆国	0.13
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2047	400,000	33.04303	132,172	アメリカ合衆国	0.13
CYRUSONE DATA CENTERS ISSUER I LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2048	147,000	89.77627	131,971	アメリカ合衆国	0.13
FREEPORT-MCMORAN INC (REG) 5.45% 15 /03/2043	142,000	92.68795	131,617	アメリカ合衆国	0.13
TIF FUNDING II LLC SER 1A CL A FRN 20/08/2045	194,000	67.821421	131,574	アメリカ合衆国	0.13
CSMC 2020-NET SER NET CL A FRN 15/08/2037	150,000	87.336611	131,005	アメリカ合衆国	0.13
SUNOCO LOGISTICS PARTNER (REG) 5.4% 01/10/2047	148,000	88.3011	130,686	アメリカ合衆国	0.13
UNITED AIR 2023-1 A PTT 5.8% 15/07/ 2036	127,000	101.78755	129,270	アメリカ合衆国	0.13
UNITED AIR 2016-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 07/01/2030	208,000	61.971549	128,901	アメリカ合衆国	0.12
METLIFE INC (REG) 6.4% 15/12/2036	129,000	99.6221	128,513	アメリカ合衆国	0.12
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV (SER *) (REG) 4.7% 01/02/2036	132,000	97.1311	128,213	アメリカ合衆国	0.12
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2050	470,000	27.19845	127,833	アメリカ合衆国	0.12
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2019-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	137,000	92.23284	126,359	ケイマン諸島	0.12
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2050	180,000	69.467312	125,041	アメリカ合衆国	0.12
GENERAL MOTORS CO (REG) 5.4% 15/10/ 2029	128,000	97.62675	124,962	アメリカ合衆国	0.12
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2052	136,000	90.436788	122,994	アメリカ合衆国	0.12
BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030	126,000	97.49355	122,842	アメリカ合衆国	0.12
DATABANK ISSUER SER 2A CL A2 FRN 25/10/2051	141,000	86.45329	121,899	アメリカ合衆国	0.12
SERVPRO MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 25/04/2051	150,000	80.918198	121,377	アメリカ合衆国	0.12
ABPCI DIRECT LENDING FUND ABS I LTD SER 1A CL A FRN 20/12/2030	130,000	93.26713	121,247	アメリカ合衆国	0.12
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES 2019-ICE4 SER ICE4 CL	122,000	98.701842	120,416	アメリカ合衆国	0.12
LAZARD GROUP LLC (REG) 4.375% 11/03 /2029	129,000	93.06945	120,060	アメリカ合衆国	0.12
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2037	134,000	89.109	119,406	アメリカ合衆国	0.12
NRG ENERGY INC (SER 144A) 7% 15/03/ 2033	118,000	101.18395	119,397	アメリカ合衆国	0.12
N/A SER 1A CL A2 FRN 01/02/2062	130,000	91.79615	119,335	カナダ	0.12
TRUIST FINANCIAL CORP (SER MTN) VAR 08/06/2034	119,000	100.2603	119,310	アメリカ合衆国	0.12
LIFE 2021-BMR MORTGAGE TRUST SER BMR CL D FRN 15/03/2038	126,000	94.681218	119,298	アメリカ合衆国	0.12
AVIS BUDGET RENTAL CAR FUNDING AESO P LLC SER 1A CL A FRN 20/08/2026	128,000	93.06687	119,126	アメリカ合衆国	0.12
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 2A CL A2 FRN 20/01/2051	140,000	84.548442	118,368	アメリカ合衆国	0.11
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2021-A SER A CL A FRN	329,000	35.879711	118,044	アメリカ合衆国	0.11
HOTWIRE FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/05/2053	120,000	97.42512	116,910	アメリカ合衆国	0.11
PILGRIM'S PRIDE CORP (REG) 6.25% 01 /07/2033	120,000	97.25	116,700	アメリカ合衆国	0.11
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.75% 24/05/2031	143,000	81.58175	116,662	アメリカ合衆国	0.11
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE (SER 144A) (REG) 1.85% 16/09/2026	137,000	85.14415	116,647	アメリカ合衆国	0.11
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 137 CL IO FRN	2,604,000	4.451665	115,921	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC FRN 01/12/2049	270,000	42.876207	115,766	アメリカ合衆国	0.11
FOOTHILL ESTRN TRANSPRTN CORRI 4.094% 15/01/2049	139,000	82.9839	115,348	アメリカ合衆国	0.11

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
STARWOOD MORTGAGE RESIDENTIAL TRUST 2022-1 SER 1 CL A1 FRN 25/12/2066	172,000	66.81229	114,917	アメリカ合衆国	0.11
SONIC CAPITAL LLC SER 1A CL A2I FRN 20/08/2051	144,000	79.25685	114,130	アメリカ合衆国	0.11
COSTAR GROUP INC (SER 144A) 2.8% 15 /07/2030	138,000	82.01425	113,180	アメリカ合衆国	0.11
BX TRUST 2022-CLS SER CLS CL A FRN 13/10/2027	117,000	96.46325	112,862	アメリカ合衆国	0.11
AUTONATION INC 4.75% 01/06/2030	121,000	93.09615	112,646	アメリカ合衆国	0.11
DUKE ENERGY CAROLINAS (REG) 4.95% 1 5/01/2033	113,000	99.3052	112,215	アメリカ合衆国	0.11
SCF EQUIPMENT LEASING 2021-1 LLC SER 1A CL B FRN 20/08/2029	122,000	91.84901	112,056	アメリカ合衆国	0.11
BEACON CONTAINER FINANCE II LLC SER 1A CL A 22/10/2046	157,000	71.307517	111,953	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC FRN 01/12/2046	385,000	29.001627	111,656	アメリカ合衆国	0.11
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 40 CL IO FRN	1,975,000	5.572597	110,059	アメリカ合衆国	0.11
VANTAGE DATA CENTERS LLC SER 2A CL A2 FRN 15/09/2045	130,000	84.61967	110,006	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2052	116,000	94.796846	109,964	アメリカ合衆国	0.11
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2050	400,000	27.486265	109,945	アメリカ合衆国	0.11
SESAC FINANCE LLC SER 1 CL A2 FRN 25/07/2049	121,000	90.218888	109,165	アメリカ合衆国	0.11
ALIGNED DATA CENTERS ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 15/08/2046	124,000	87.65874	108,697	アメリカ合衆国	0.11
VANTAGE DATA CENTERS LLC SER 1A CL A2 FRN 15/09/2045	121,000	89.75086	108,599	アメリカ合衆国	0.11
BANK OF AMERICA CORP VAR 08/03/2037	126,000	85.94095	108,286	アメリカ合衆国	0.10
DOMINION ENERGY INC (SER C) 3.375% 01/04/2030	121,000	89.45895	108,245	アメリカ合衆国	0.10
SONIC CAPITAL LLC SER 1A CL A2I FRN 20/01/2050	123,000	87.867437	108,077	アメリカ合衆国	0.10
J.P. MORGAN CHASE COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES TRUST 2021-OP0	135,000	79.89393	107,857	アメリカ合衆国	0.10
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 5% 15/03/2027	109,000	98.75	107,638	アメリカ合衆国	0.10
WILLIAMS COMPANIES INC (REG) 4.65% 15/08/2032	113,000	94.6143	106,914	アメリカ合衆国	0.10
AMER AIRLINE 16-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/01/2028	166,000	63.777612	105,871	アメリカ合衆国	0.10
CLI FUNDING VIII LLC SER 1A CL A1 FRN 18/01/2047	140,000	74.783191	104,696	アメリカ合衆国	0.10
AMER AIRLINE 19-1AA PTT (SER AA) (R EG) 3.15% 15/08/2033	144,000	72.583154	104,520	アメリカ合衆国	0.10
ALLY FINANCIAL INC (REG) VAR 13/06/2029	105,000	98.6653	103,599	アメリカ合衆国	0.10
WESTERN MIDSTREAM OPERAT (REG) 5.3% 01/02/2030	115,000	90.05215	103,560	アメリカ合衆国	0.10
DIAMONDBACK ENERGY INC (REG) 3.125% 24/03/2031	120,000	85.6051	102,726	アメリカ合衆国	0.10
ZAXBY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 30/07/2051	125,000	81.805278	102,257	アメリカ合衆国	0.10
SEMPRA ENERGY 5.5% 01/08/2033	102,000	99.3847	101,372	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/09 /2047	415,000	24.082665	99,943	アメリカ合衆国	0.10
FLORIDA ST BRD OF ADMIN FIN CO 1.705% 01/07/2027	112,000	89.031	99,715	アメリカ合衆国	0.10
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST 20 19-B SER B CL A2A FRN 15/06/2037	210,000	47.46185	99,670	アメリカ合衆国	0.10
TARGA RESOURCES CORP (REG) 4.95% 15/04/2052	120,000	82.442	98,930	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	320,000	30.835117	98,672	アメリカ合衆国	0.10
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 4.975% 06/02/2026	100,000	98.625	98,625	アメリカ合衆国	0.10
DEEPHAVEN RESIDENTIAL MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 2 CL A1 FRN	224,000	44.009106	98,580	アメリカ合衆国	0.10

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
ENERGY TRANSFER LP (REG) 4.2% 15/04/2027	103,000	95.2055	98,062	アメリカ合衆国	0.10
CITIGROUP INC VAR 01/05/2032	119,000	81.82905	97,377	アメリカ合衆国	0.09
FREEPORT-MCMORAN INC (REG) 4.25% 01 /03/2030	105,000	92.625	97,256	アメリカ合衆国	0.09
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (RE G) 2.35% 22/11/2024 WI	104,000	93.5035	97,244	アメリカ合衆国	0.09
FIRSTKEY HOMES 2020-SFR1 TRUST SER SFR1 CL A FRN 17/08/2028	112,000	86.742622	97,152	アメリカ合衆国	0.09
NEW RESIDENTIAL MORTGAGE LOAN TRUST SER 1A CL A1B FRN 25/10/2059	250,000	38.769724	96,924	アメリカ合衆国	0.09
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2020-H SER HA CL A FRN	335,000	28.862385	96,689	アメリカ合衆国	0.09
EVERSOURCE ENERGY (REG) 5.125% 15/0 5/2033	98,000	98.6274	96,655	アメリカ合衆国	0.09
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 2.7% 22/ 06/2030 WI	119,000	81.0262	96,421	アメリカ合衆国	0.09
MPLX LP (SER WI) (REG) 4.25% 01/12/ 2027	101,000	95.10915	96,060	アメリカ合衆国	0.09
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 21/10/2032	117,000	81.45155	95,298	アメリカ合衆国	0.09
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 4.4 5% 15/06/2029	107,000	88.75	94,963	アメリカ合衆国	0.09
UNITED AIR 2019-1 A PTT SER A (REG) 4.55% 25/08/2031	141,000	67.087399	94,593	アメリカ合衆国	0.09
HUNTINGTON INGALLS INDUS (SER WI) (REG) 4.2% 01/05/2030 (WHEN ISSUED)	102,000	92.7129	94,567	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A FRN 16/06/2062	2,131,000	4.420537	94,202	アメリカ合衆国	0.09
PNC FINANCIAL SERVICES (SER W) VAR PERP 31/12/2049	105,000	89.562	94,040	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 3 CL IO FRN	1,880,000	4.997149	93,946	アメリカ合衆国	0.09
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2020-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	100,000	93.26342	93,263	アメリカ合衆国	0.09
NISOURCE INC (REG) 3.6% 01/05/2030	103,000	90.23845	92,946	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/11/2046	315,000	29.489556	92,892	アメリカ合衆国	0.09
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/03/2046	136,000	68.239259	92,805	アメリカ合衆国	0.09
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST 2020-PT-A SER PTA CL A2A FRN	183,000	50.686717	92,757	アメリカ合衆国	0.09
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2050	305,000	30.235135	92,217	アメリカ合衆国	0.09
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2I FRN 25/04/2051	110,000	83.828131	92,211	アメリカ合衆国	0.09
REGAL REXNORD CORP (SER 144A) 6.05% 15/02/2026	92,000	100.1982	92,182	アメリカ合衆国	0.09
VERUS SECURITIZATION TRUST SER 3 CL A1 FRN 25/06/2066	207,000	44.07645	91,238	アメリカ合衆国	0.09
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST FRN 17/09/2038	105,000	86.78565	91,125	アメリカ合衆国	0.09
QORVO INC (SER 144A) (REG) 3.375% 0 1/04/2031	113,000	80.625	91,106	アメリカ合衆国	0.09
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2051	128,000	71.138961	91,058	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 203 CL IO FRN	1,500,000	6.042075	90,631	アメリカ合衆国	0.09
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 4% 22/06 /2050 WI	136,000	66.35845	90,247	アメリカ合衆国	0.09
UNIVERSAL HEALTH SVCS (SER WI) (REG) 2.65% 15/10/2030	110,000	81.25	89,375	アメリカ合衆国	0.09
WENDY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 15/06/2051	109,000	81.83539	89,201	アメリカ合衆国	0.09
FANNIE MAE INTEREST STRIP SER 427 CL C20 FRN 25/02/2051	834,000	10.676972	89,046	アメリカ合衆国	0.09
AMER AIRLINE 17-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/08/2030	137,000	64.904117	88,919	アメリカ合衆国	0.09

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
MPLX LP (REG) 4% 15/03/2028	94,000	94.40815	88,744	アメリカ合衆国	0.09
NIPPON LIFE INSURANCE (SER 144A) VA R 21/01/2051	107,000	82.0899	87,836	日本	0.09
PROVIDENT FUNDING MORTGAGE TRUST 2020-F1 SER F1 CL A2 FRN 25/01/2036	207,000	42.357483	87,680	アメリカ合衆国	0.09
NEIGHBORLY ISSUER 2022-1 SER 1A CL A2 FRN 30/01/2052	109,000	80.236295	87,458	アメリカ合衆国	0.08
ARES CAPITAL CORP (REG) 2.875% 15/0 6/2028	105,000	82.66205	86,795	アメリカ合衆国	0.08
WARNERMEDIA HOLDINGS INC (SER WI) (REG) 4.279% 15/03/2032	97,000	88.9106	86,243	アメリカ合衆国	0.08
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2020-4 SER 4 CL A1 FRN 25/10/2060	184,000	46.841328	86,188	アメリカ合衆国	0.08
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 5.3% 01/10/2029	87,000	98.9655	86,100	アメリカ合衆国	0.08
DEUTSCHE BANK NY VAR 16/11/2027	100,000	86.0633	86,063	ドイツ	0.08
CF HIPPOLYTA LLC SER 1 CL A1 FRN 15/07/2060	106,000	80.753466	85,599	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2047	395,000	21.658507	85,551	アメリカ合衆国	0.08
GCAT SER NQM3 CL A1 FRN 25/05/2066	194,000	44.015382	85,390	アメリカ合衆国	0.08
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 2.4 5% 02/12/2027	102,000	83.6852	85,359	アメリカ合衆国	0.08
BROADCOM INC (SER 144A) 4.926% 15/0 5/2037	94,000	90.58295	85,148	アメリカ合衆国	0.08
CF HIPPOLYTA LLC SER 1A CL A1 FRN 15/03/2061	104,000	81.794382	85,066	アメリカ合衆国	0.08
FREDDIE MAC STRUCTURED AGENCY CREDIT RISK DEBT NOTES SER DNA5 CL	81,000	104.9755	85,030	アメリカ合衆国	0.08
ONE MARKET PLAZA TRUST SER 1MKT CLS D FRN 10/02/2032	100,000	84.93385	84,934	アメリカ合衆国	0.08
TIF FUNDING II LLC SER 1A CL A FRN 20/02/2046	126,000	66.930469	84,332	アメリカ合衆国	0.08
CVS HEALTH CORP (REG) 5.05% 25/03/2048	91,000	92.5479	84,219	アメリカ合衆国	0.08
AMERICAN TOWER TRUST I 5.49% 15/03/ 2028	84,000	100.1753	84,147	アメリカ合衆国	0.08
VISIO 2020-1R TRUST SER 1R CL A1 FRN 25/11/2055	360,000	23.308281	83,910	アメリカ合衆国	0.08
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) VAR 06/01/2028	96,000	86.4459	82,988	アメリカ合衆国	0.08
TARGA RESOURCES PARTNERS (REG) 4% 15/01/2032	96,000	86.4	82,944	アメリカ合衆国	0.08
VERUS SECURITIZATION TRUST SER 1 CL A1 FRN 25/01/2066	270,000	30.630387	82,702	アメリカ合衆国	0.08
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2051	106,000	77.773917	82,440	アメリカ合衆国	0.08
HOTWIRE FUNDING LLC SER 2021-1 CL A 2 20/11/2051	94,000	87.64955	82,391	アメリカ合衆国	0.08
ELARA HGV TIMESHARE ISSUER 2019-A L LC SER A CL A FRN 25/01/2034	300,000	27.462444	82,387	アメリカ合衆国	0.08
AIR LEASE CORP 3.625% 01/12/2027	90,000	91.2731	82,146	アメリカ合衆国	0.08
SBL HOLDINGS INC (SER 144A) 5% 18/02/2031	104,000	78.78995	81,942	アメリカ合衆国	0.08
ENERGY TRANSFER PARTNERS (REG) 5.15% 15/03/2045	95,000	86.16375	81,856	アメリカ合衆国	0.08
BARCLAYS COMMERCIAL MORTGAGE S SER SRCH CL D VAR 10/08/2035	100,000	81.82568	81,826	アメリカ合衆国	0.08
ONSLow BAY MORTGAGE LOAN TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2061	170,000	48.114125	81,794	アメリカ合衆国	0.08
METRONET INFRASTRUCTURE ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2053	83,000	97.93844	81,289	アメリカ合衆国	0.08
HOST HOTELS & RESORTS LP (SER I) (R EG) 3.5% 15/09/2030	96,000	84.4829	81,104	アメリカ合衆国	0.08
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP SER R VAR PERP	81,000	99.75	80,798	アメリカ合衆国	0.08
AIR LEASE CORP (SER MTN) (REG) 2.87 5% 15/01/2026	87,000	92.54855	80,517	アメリカ合衆国	0.08
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.2% 15/03/2028	85,000	94.625	80,431	アメリカ合衆国	0.08

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 53 CL IO FRN	1,413,000	5.649888	79,833	アメリカ合衆国	0.08
REGAL REXNORD CORP (SER 144A) 6.4% 15/04/2033	79,000	100.19775	79,156	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2049	100,000	79.030321	79,030	アメリカ合衆国	0.08
AIR LEASE CORP (REG) 2.1% 01/09/202 8	95,000	83.15425	78,997	アメリカ合衆国	0.08
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (RE G) 2.7% 15/01/2025	84,000	93.0256	78,142	アメリカ合衆国	0.08
KINDER MORGAN ENER PART (REG) 7.75% 15/03/2032	69,000	112.15235	77,385	アメリカ合衆国	0.08
VANTAGE DATA CENTERS LLC FRN 15/07/ 2044	83,000	92.810234	77,032	アメリカ合衆国	0.07
BOEING CO (REG) 3.2% 01/03/2029	86,000	89.53245	76,998	アメリカ合衆国	0.07
JETBLUE 2019-1 CLASS AA (SER AA) (REG) 2.75% 15/05/2032	108,000	71.283701	76,986	アメリカ合衆国	0.07
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	82,000	93.640946	76,786	アメリカ合衆国	0.07
GOLDEN ST TOBACCO SECURITIZATI 4.214% 01/06/2050	101,000	75.648	76,404	アメリカ合衆国	0.07
MPLX LP 4.95% 01/09/2032	79,000	95.84645	75,719	アメリカ合衆国	0.07
US AIRWAYS 2012-1A PTT (REG) FRN 01/04/2026	208,000	36.378317	75,667	アメリカ合衆国	0.07
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/09/2045	115,000	65.708197	75,564	アメリカ合衆国	0.07
UNITED AIR 2020-1 B PTT 4.875% 15/0 1/2026	115,000	65.4175	75,230	アメリカ合衆国	0.07
COMM 2020-CX MORTGAGE TRUST SER CX CL D FRN 10/11/2046	100,000	74.44685	74,447	アメリカ合衆国	0.07
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2048	81,000	91.184239	73,859	アメリカ合衆国	0.07
CSMC 2021-NQM2 SER NQM2 CL A1 FRN 25/02/2066	205,000	35.95875	73,715	アメリカ合衆国	0.07
VERUS SECURITIZATION TRUST 2021-5 SER 5 CL A1 FRN 25/09/2066	129,000	56.321092	72,654	アメリカ合衆国	0.07
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.625% 01/12/2029	80,000	90.75	72,600	アメリカ合衆国	0.07
GEORGIA POWER CO 4.95% 17/05/2033	73,000	98.88185	72,184	アメリカ合衆国	0.07
AMER AIRLINE 21-1A EETC (REG) 2.875 % 11/07/2034	87,000	82.58445	71,848	アメリカ合衆国	0.07
ELLINGTON FINANCIAL MORTGAGE TRUST 2017-1 SER 2 CL A1 FRN 25/06/2066	153,000	46.831927	71,653	アメリカ合衆国	0.07
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2037	80,000	89.410389	71,528	アメリカ合衆国	0.07
KRAFT FOODS GROUP INC (REG) 5% 04/06/2042	76,000	93.5928	71,131	アメリカ合衆国	0.07
MPLX LP 5% 01/03/2033	74,000	95.73455	70,844	アメリカ合衆国	0.07
CVS HEALTH CORP (REG) 5.3% 01/06/20 33	70,000	99.9562	69,969	アメリカ合衆国	0.07
MORGAN STANLEY (SER GMTN) (REG) VAR 21/07/2032	88,000	79.46195	69,927	アメリカ合衆国	0.07
APPLEBEE'S FUNDING LLC / IHOP FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN	71,000	98.42301	69,880	アメリカ合衆国	0.07
VERISIGN INC (REG) 2.7% 15/06/2031	83,000	83.5	69,305	アメリカ合衆国	0.07
GSMS 2019-GC40 A2 SER GC40 CL A2 FRN 10/07/2052	72,000	95.76156	68,948	アメリカ合衆国	0.07
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2019-F SER FA CL A2 FRN 15/0	200,000	34.402856	68,806	アメリカ合衆国	0.07
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 4.4% 13/07/2027	73,000	94.1694	68,744	アメリカ合衆国	0.07
BBCMS TRUST SER C6 CL A2 FRN 15/02/2053	74,000	92.42665	68,396	アメリカ合衆国	0.07
ARROYO MORTGAGE TRUST 2021-1R SER 1R CL A1 FRN 25/10/2048	171,000	39.682394	67,857	アメリカ合衆国	0.07
DB MASTER FINANCE LLC SER A1 CL A2II FRN 20/11/2047	78,000	86.818477	67,718	アメリカ合衆国	0.07
VIATRIS INC (REG) 2.3% 22/06/2027 WI	77,000	87.51825	67,389	アメリカ合衆国	0.07
ARES CAPITAL CORP (REG) 3.25% 15/07 /2025	72,000	92.5883	66,664	アメリカ合衆国	0.06

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 4.6% 23/05/2029	68,000	96.6869	65,747	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 11 CL IO FRN	1,123,000	5.831198	65,484	アメリカ合衆国	0.06
ALASKA AIR 2020-1 CL B (SER 144A) (REG) 8% 15/08/2025	119,000	55.021888	65,476	アメリカ合衆国	0.06
CROWN CASTLE INTL CORP (REG) 3.8% 1 5/02/2028	70,000	93.39805	65,379	アメリカ合衆国	0.06
CONTINENTAL RESOURCES (REG) 4.9% 01 /06/2044	84,000	77.75	65,310	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	175,000	37.127152	64,973	アメリカ合衆国	0.06
NISSAN MOTOR ACCEPTANCE (SER 144A) (REG) 2% 09/03/2026	74,000	87.60655	64,829	アメリカ合衆国	0.06
AUTODESK INC (REG) 2.85% 15/01/2030	74,000	87.39465	64,672	アメリカ合衆国	0.06
DISCOVER FINANCIAL SVS (REG) 4.1% 09/02/2027	70,000	92.25145	64,576	アメリカ合衆国	0.06
JBS USA/FOOD/FINANCE (SER 144A) (REG) 5.125% 01/02/2028	67,000	96.125	64,404	ルクセンブルグ	0.06
VCP RRL ABS I LTD 2021 SER 1A CL A FRN 20/10/2031	100,000	64.117626	64,118	アメリカ合衆国	0.06
EXPEDIA GROUP INC (REG) 2.95% 15/03 /2031	76,000	83.8462	63,723	アメリカ合衆国	0.06
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2019-1 SER 1 CL A1 FRN 25/03/2058	183,000	34.621235	63,357	アメリカ合衆国	0.06
SIERRA TIMESHARE 2021-1 RECEIVABLES FUNDING LLC SER 1A CL A FRN	232,000	27.299776	63,335	アメリカ合衆国	0.06
MARRIOTT INTERNATIONAL (SER FF) (RE G) 4.625% 15/06/2030	66,000	95.6075	63,101	アメリカ合衆国	0.06
CSMC 2021-NQM3 SER NQM3 CL A1 FRN 25/04/2066	147,000	42.795302	62,909	アメリカ合衆国	0.06
KRAFT HEINZ FOODS CO (REG) 4.875% 0 1/10/2049	69,000	91.01165	62,798	アメリカ合衆国	0.06
BRITISH AIR 20-1 B PTT (SER 144A) (REG) 8.375% 15/11/2028	141,000	44.070975	62,140	アメリカ合衆国	0.06
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SE R 1A CL A2 FRN 25/10/2049	73,000	85.111323	62,131	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	143,000	43.248776	61,846	アメリカ合衆国	0.06
FREDDIE MAC STACR REMIC TRUST 2022- DNA4 SER DNA4 CL M1B FRN 25/05/2042	61,000	101.0385	61,633	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2047	165,000	37.347918	61,624	アメリカ合衆国	0.06
CHENIERE ENERGY PARTNERS (REG) 4.5% 01/10/2029	67,000	91.75	61,473	アメリカ合衆国	0.06
ANHEUSER-BUSCH CO/INBEV (SER *) (RE G) 4.9% 01/02/2046	64,000	95.7891	61,305	アメリカ合衆国	0.06
CHOICE HOTELS INTL INC 3.7% 15/01/2 031	72,000	84.4969	60,838	アメリカ合衆国	0.06
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES SER NQM5 CL A1 FRN	119,000	50.893469	60,563	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	64,000	94.201883	60,289	アメリカ合衆国	0.06
BX 2021-MFM1 SER MFM1 CL D FRN 15/01/2034	68,000	87.937835	59,798	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO VAR 01/12/2062	1,090,000	5.484286	59,779	アメリカ合衆国	0.06
META PLATFORMS INC (REG) 4.8% 15/05 /2030	59,000	100.2694	59,159	アメリカ合衆国	0.06
BENCHMARK 2019-B13 MORTGAGE TRUST SER B13 CL A2 FRN 15/08/2057	65,000	91.00926	59,156	アメリカ合衆国	0.06
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST SER A CL APT2 FRN 15/01/2053	131,000	45.135874	59,128	アメリカ合衆国	0.06
STARVEST EMERGING MARKETS CBO I SER 2 CL A1 FRN 25/05/2065	209,000	28.133713	58,799	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 169 CL IO FRN	3,835,000	1.475763	56,596	アメリカ合衆国	0.05

投資対象	保有高 （米ドル）	単価 （米ドル）	時価 （米ドル）	国名	純資産 比率 （％）
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 17 CL IO FRN 31/12/	900,000	6.264425	56,380	アメリカ合衆国	0.05
OCCIDENTAL PETROLEUM COR (REG) 6.625% 01/09/2030	53,000	103.875	55,054	アメリカ合衆国	0.05
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 3.25% 15/01/2032	68,000	80.2792	54,590	アメリカ合衆国	0.05
HOME PARTNERS OF AMERICA 2021-2 TRUST SER 2 CL A FRN 17/12/2026	68,000	80.277564	54,589	アメリカ合衆国	0.05
NAVIENT STUDENT LOAN TRUST 2020-2 SER 2A CL A1A FRN 26/08/2069	100,000	54.400343	54,400	アメリカ合衆国	0.05
AMERICAN HOMES 4 RENT (REG) 4.25% 15/02/2028	58,000	93.65955	54,323	アメリカ合衆国	0.05
NEWMONT GOLDCORP CORP (REG) 2.8% 01 /10/2029	63,000	86.1022	54,244	アメリカ合衆国	0.05
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 4% 15 /01/2030	63,000	86.0479	54,210	アメリカ合衆国	0.05
GCAT 2021-NQM2 TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2066	117,000	45.50312	53,239	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2052	63,000	83.010852	52,297	アメリカ合衆国	0.05
IMPERIAL FUND MORTGAGE TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/06/2056	115,000	45.268693	52,059	アメリカ合衆国	0.05
AQUA FINANCE TRUST 2017-A SER A CL A FRN 17/07/2046	106,000	48.89361	51,827	アメリカ合衆国	0.05
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2020-G SER GA CL A FRN	200,000	25.826141	51,652	アメリカ合衆国	0.05
VICI PROPERTIES LP 4.375% 15/05/202 5	52,000	96.2092	50,029	アメリカ合衆国	0.05
WARNERMEDIA HOLDINGS INC (REG) 5.05 % 15/03/2042	59,000	83.9649	49,539	アメリカ合衆国	0.05
VERUS SECURITIZATION TRUST SER R2 CL A1 FRN 25/02/2064	172,000	28.749394	49,449	アメリカ合衆国	0.05
GCAT 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/01/2066	178,000	27.476532	48,908	アメリカ合衆国	0.05
AMER AIRLINE 17-2 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/04/2031	79,000	61.76276	48,793	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 163 CL IO FRN	884,994	5.508893	48,753	アメリカ合衆国	0.05
CVS HEALTH CORP 3.75% 01/04/2030	53,000	91.59555	48,546	アメリカ合衆国	0.05
BRAVO RESIDENTIAL FUNDING TRUST 2021-NQM1 SER NQM1 CL A1 FRN	136,000	35.614781	48,436	アメリカ合衆国	0.05
NEXTERA ENERGY CAPITAL (REG) 2.25% 01/06/2030	58,000	83.1983	48,255	アメリカ合衆国	0.05
M&T BANK CORPORATION SER F (REG) VAR PERP	60,000	79.625	47,775	アメリカ合衆国	0.05
SBA TOWER TRUST (SER 144A) (REG) 6. 559% 15/11/2052	47,000	101.59219	47,748	アメリカ合衆国	0.05
MFA 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/04/2065	179,000	26.462836	47,368	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 170 CL IO FRN	940,000	5.034567	47,325	アメリカ合衆国	0.05
BRE GRAND ISLANDER TIMESHARE ISSUER 2019-A LLC SER A CL A FRN 26/09/20	149,000	31.295183	46,630	アメリカ合衆国	0.05
AMER AIRLINE 16-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/07/2029	75,000	61.550372	46,163	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2048	175,000	25.95299	45,418	アメリカ合衆国	0.04
AMGEN INC 5.25% 02/03/2030	45,000	100.5091	45,229	アメリカ合衆国	0.04
CNA FINANCIAL CORP (REG) 2.05% 15/0 8/2030	55,000	79.9416	43,968	アメリカ合衆国	0.04
HYUNDAI CAPITAL AMERICA (SER 144A) (REG) 2.375% 15/10/2027	50,000	87.6762	43,838	アメリカ合衆国	0.04
HERSHEY COMPANY (REG) 4.5% 04/05/20 33	44,000	99.4031	43,737	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 110 CL IO FRN	712,000	6.102755	43,452	アメリカ合衆国	0.04
PRUDENTIAL FINANCIAL INC VAR 01/03/ 2052	48,000	90.48195	43,431	アメリカ合衆国	0.04
MPLX LP (REG) 4.125% 01/03/2027	45,000	95.87395	43,143	アメリカ合衆国	0.04

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	82,000	52.544011	43,086	アメリカ合衆国	0.04
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2020-R1 SER R1 CL A1 FRN 25/04/2053	209,000	20.593498	43,040	アメリカ合衆国	0.04
ROYALTY PHARMA PLC (SER WI) (REG) 1 .75% 02/09/2027	50,000	85.75985	42,880	イギリス	0.04
ARES CAPITAL CORP (REG) 4.2% 10/06/2024	43,000	98.04385	42,159	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 10 CL IO FRN	735,000	5.696779	41,871	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	78,000	53.054364	41,382	アメリカ合衆国	0.04
OVINTIV INC 6.25% 15/07/2033	41,000	98.52375	40,395	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 118 CL IO FRN	1,163,000	3.470501	40,362	アメリカ合衆国	0.04
AIR CANADA 2017-1B PTT (SER 144A) (REG) 3.7% 15/01/2026	78,000	51.618645	40,263	カナダ	0.04
OVINTIV INC (REG) 5.65% 15/05/2028	41,000	98.0001	40,180	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	195,000	20.596232	40,163	アメリカ合衆国	0.04
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 2 CL A1 FRN 25/04/2066	124,000	32.144555	39,859	アメリカ合衆国	0.04
LKQ CORP (SER 144A) 5.75% 15/06/202 8	40,000	99.3272	39,731	アメリカ合衆国	0.04
EXTRA SPACE STORAGE LP 5.7% 01/04/2 028	39,000	100.06125	39,024	アメリカ合衆国	0.04
MVW OWNER TRUST 2018-1 SER 1A CL A FRN 21/01/2036	263,000	14.826068	38,993	アメリカ合衆国	0.04
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	94,000	40.719977	38,277	アメリカ合衆国	0.04
AMER AIRLINE 17-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/08/2030	61,000	62.39125	38,059	アメリカ合衆国	0.04
UNITED AIR 2016-1 B PTT (REG) 07/01/2026	72,000	52.383725	37,716	アメリカ合衆国	0.04
DUKE ENERGY CORP (REG) 2.45% 01/06/ 2030	44,000	83.9832	36,953	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 183 CL IO FRN	597,000	6.13121	36,603	アメリカ合衆国	0.04
US TREASURY 3.625% 31/05/2028	37,000	97.852054	36,205	アメリカ合衆国	0.04
OXFORD FINANCE FUNDING 2020-1 LLC SER 1A CL A2 FRN 15/02/2028	100,000	35.703099	35,703	アメリカ合衆国	0.03
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.125% 15/08/2030	40,000	88.125	35,250	アメリカ合衆国	0.03
NISOURCE INC 1.7% 15/02/2031	44,000	78.35085	34,474	アメリカ合衆国	0.03
GS MORTGAGE-BACKED SECURITIES TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/07/2061	100,000	33.935534	33,936	アメリカ合衆国	0.03
MISSISSIPPI ST HOSP EQUIPMENT 3.72% 01/09/2026	36,000	93.24	33,566	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	85,000	37.893686	32,210	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2045	115,000	27.001672	31,052	アメリカ合衆国	0.03
OXFORD FINANCE FUNDING 2019-1 LLC SER 1A CL A2 FRN 15/02/2027	150,000	20.303529	30,455	アメリカ合衆国	0.03
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 181 CL IO FRN 16/07/2064	395,000	7.524695	29,723	アメリカ合衆国	0.03
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (RE G) 3.25% 15/03/2027 WI	34,000	86.495393	29,408	アメリカ合衆国	0.03
WESTERN MIDSTREAM OPERAT (REG) 6.15 % 01/04/2033	29,000	100.25	29,073	アメリカ合衆国	0.03
VICI PROPERTIES LP 5.125% 15/05/203 2	31,000	93.6629	29,036	アメリカ合衆国	0.03
BRITISH AIR 20-1 A PPT (SER 144A) (REG) 4.25% 15/11/2032	60,000	47.83747	28,702	アメリカ合衆国	0.03
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	75,000	36.233941	27,175	アメリカ合衆国	0.03
NISOURCE INC (REG) 5.25% 30/03/2028	27,000	99.97385	26,993	アメリカ合衆国	0.03

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2049	36,000	74.226282	26,721	アメリカ合衆国	0.03
VERUS SECURITIZATION TRUST 2020-5 SER 5 CL A1 FRN (STP) 25/05/2065	100,000	26.57544	26,575	アメリカ合衆国	0.03
CVS HEALTH CORP (REG) 5.25% 30/01/2 031	26,000	99.79415	25,946	アメリカ合衆国	0.03
MORGAN STANLEY (SER GMTN) (REG) VAR 23/01/2030	27,000	95.1578	25,693	アメリカ合衆国	0.02
OHIO ST TURNPIKE COMMISSION 3.216% 15/02/2048	35,000	72.723	25,453	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2048	90,970	26.827827	24,405	アメリカ合衆国	0.02
OVINTIV INC (REG) 7.2% 01/11/2031	23,000	105.09585	24,172	アメリカ合衆国	0.02
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 21 CL IO FRN	405,000	5.921063	23,980	アメリカ合衆国	0.02
NAVIENT PRIVATE EDUCATION LOAN TRUS T 2016-A SER AA CL A2A FRN 15/12/20	100,000	23.766505	23,767	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	155,000	14.639137	22,691	アメリカ合衆国	0.02
HILTON GRAND VACATIONS TRUST 2018-A SER AA CL A FRN 25/02/2032	100,000	22.197492	22,197	アメリカ合衆国	0.02
BRITISH AIR 13-1 A PTT (REG) SER 144A 4.625% 20/06/2024	63,000	29.817501	18,785	イギリス	0.02
PNC FINANCIAL SERVICES (REG) 3.15% 19/05/2027	20,000	92.3827	18,477	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	91,000	20.044123	18,240	アメリカ合衆国	0.02
AMER AIRLINE 19-1A PTT (SER A) (REG) 3.5% 15/08/2033	25,000	68.552749	17,138	アメリカ合衆国	0.02
OWENS CORNING (REG) 3.875% 01/06/20 30	18,000	91.5012	16,470	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2048	70,000	21.982894	15,388	アメリカ合衆国	0.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2048	53,000	28.31121	15,005	アメリカ合衆国	0.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	17,000	86.100029	14,637	アメリカ合衆国	0.01
FREDDIE MAC POOL FRN 01/05/2052	17,000	81.988794	13,938	アメリカ合衆国	0.01
COMM MORTGAGE TRUST SER COR3 CL XA FRN 10/05/2051	579,000	1.688769	9,778	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 9 CL IO FRN 16/01/2060	630,000	1.513891	9,538	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 158 CL IO VAR	409,000	2.307972	9,440	アメリカ合衆国	0.01
UNITED AIR 2018-1 B PTT SER B (REG) 4.6% 01/03/2026	17,000	55.180663	9,381	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A FRN 16/02/2062	185,000	4.852069	8,976	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 43 CL IO FRN 16/05/2060	670,000	1.249359	8,371	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 69 CL IO FRN 16/04/2060	565,000	1.367091	7,724	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO FRN 16/03/2060	435,000	1.751568	7,619	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 100 CL IO FRN	166,967	4.429694	7,396	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 99 CL IO FRN 16/06/2060	755,000	0.91823	6,933	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 131 CL IO FRN	241,000	2.85641	6,884	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 20 CL IO VAR	860,000	0.775189	6,667	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 119 CL IO FRN	175,000	3.654491	6,395	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 114 CL IO VAR 16/04/2060	520,000	0.812239	4,224	アメリカ合衆国	0.00

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
NEW JERSEY ST TRANSPRTN TRUST 4.081% 15/06/2039	4,000	88.5429	3,542	アメリカ合衆国	0.00
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 41 CL IO VAR	505,000	0.686611	3,467	アメリカ合衆国	0.00
純資産総額			103,138,490		

国別比率（2023年6月末時点）

国名	時価 (米ドル)	対純資産総額比率 (%)
アメリカ合衆国	98,106,605	95.12
イギリス	610,825	0.59
アイルランド	558,104	0.54
カナダ	446,249	0.43
ケイマン諸島	369,623	0.36
ルクセンブルグ	368,207	0.36
シンガポール	320,214	0.31
フランス	238,190	0.23
ドイツ	228,590	0.22
カタール	200,224	0.19
ペルー	197,182	0.19
バミューダ	196,800	0.19
オランダ	184,798	0.18
パナマ	170,708	0.17
オーストラリア	167,697	0.16
ノルウェー	150,741	0.15
日本	87,836	0.09
純資産総額	103,138,490	

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（１）資本金の額

2023年7月末日現在、管理会社の未監査発行済株式資本の額は2,409百万香港ドル（約43,555百万円）で、全額払込済です。管理会社の授権株式総数は、普通株式2,054,961,936株および優先株式301,000,000株です。

最近5年間で、資本金は810百万香港ドル（約14,645百万円）増加しました。

（注）香港ドルの円貨換算は、2023年7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香港ドル＝18.08円）によります。

（２）事業の内容及び営業の状況

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

2023年7月末日現在、管理会社は、下記のユニット・トラストの管理および運用を行っています。

国別（設立国）	種類別	本数	純資産総額の合計 （百万米ドル）
ケイマン諸島	ユニット・トラスト （マニユライフ・イン ベストメント・トラスト）	5	約490
香港	ユニット・トラスト （マニユライフ・香港・シリーズ）	3	約53
合計		8	約543

（３）その他

本書提出前6か月以内において、訴訟事件その他管理会社に重要な影響を与えた事実、または与えることが予想される事実は生じていません。

[次へ](#)

(2) その他の訂正

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

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

3 投資リスク

リスクに関する参考情報

<訂正前>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2018年5月～2023年4月の5年間ににおけるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格(毎月末時点)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。クラスA(米ドル建て)は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

【クラスA(米ドル建て)】

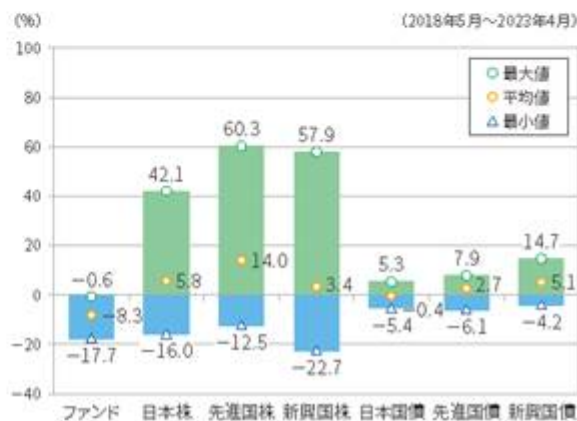


【クラスA(豪ドル建てヘッジあり)】



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

左のグラフと同じ期間(ただし、クラスA(米ドル建て)については2021年9月～2023年4月の期間、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)については2022年4月～2023年4月の期間)における年間騰落率(毎月末時点)の平均と振れ幅を、ファンドと他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



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

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

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

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

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

※ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX (配当込み)

先進国株・・・FTSE先進国株価指数 (除く日本、円ベース)

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数 (除く日本、円ベース)

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数 (円ベース)

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

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

<訂正後>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2018年8月～2023年7月の5年間に於けるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格(毎月末時点)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。クラスA(米ドル建て)は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

[クラスA(米ドル建て)]

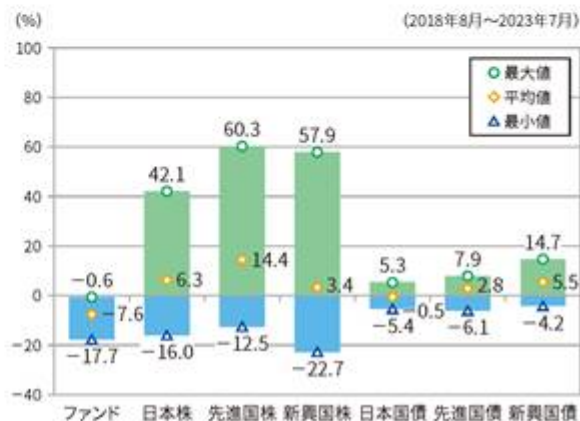


[クラスA(豪ドル建てヘッジあり)]



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

左のグラフと同じ期間(ただし、クラスA(米ドル建て)については2021年9月～2023年7月の期間、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)については2022年4月～2023年7月の期間)における年間騰落率(毎月末時点)の平均と振れ幅を、ファンドと他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



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

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

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

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

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

※ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格および年間騰落率は、実際の1口当たり純資産価格およびそれに基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

＜各資産クラスの指数＞

日 本 株・・・TOPIX（配当込み）

先進国株・・・FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数（円ベース）

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

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

[次へ](#)

第2 管理及び運営

1 申込（販売）手続等

（1）海外における販売手続等

<訂正前>

（前略）

手続

（中略）

受益証券の申込みは、価額に応じてのみ行うことができます。受益証券の端数は、四捨五入により小数点第2位まで端数処理され、かかる端数処理によって生じる利益は当該ファンドの利益として保持されます。

（後略）

<訂正後>

（前略）

手続

（中略）

受益証券の申込みは、価額に応じてのみ行うことができます。受益証券の端数は、英文目論見書に別途定める場合を除き四捨五入により小数点第2位まで端数処理され、かかる端数処理によって生じる利益は当該ファンドの利益として保持されます。

（後略）