

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年5月31日
【計算期間】	第63期中（自 2023年9月1日 至 2024年2月29日）
【発行者名】	ブラックロック・グローバル・ファンズ （BLACKROCK GLOBAL FUNDS）
【代表者の役職氏名】	取締役 ジェフ・ラドクリフ （Geoff Radcliffe）
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグ L - 2453、 ユージン・リュペール通り 2 - 4 番 （2-4, rue Eugène Ruppert, L-2453 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 中野 春芽
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【事務連絡者氏名】	弁護士 中野 春芽 同 三宅 章仁
【連絡場所】	東京都千代田区大手町一丁目1番1号 大手町パークビルディング アンダーソン・毛利・友常法律事務所外国法共同事業
【電話番号】	03（6775）1000
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

- （注1）アメリカ合衆国ドル（以下「米ドル」という。）、スターリング・ポンド（以下「英ポンド」という。）、スイス・フラン、ユーロ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ、人民元、シンガポール・ドルおよびニュージーランド・ドルの円貨換算は、別段の記載がない限り、便宜上、株式会社三菱ＵＦＪ銀行の2024年3月29日現在における対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝151.41円、1英ポンド＝191.22円、1スイス・フラン＝167.92円、1ユーロ＝163.24円、1デンマーク・クローネ＝21.88円、1ノルウェー・クローネ＝13.94円、1人民元＝20.83円、1シンガポール・ドル＝112.11円および1ニュージーランド・ドル＝90.50円）による。
- （注2）ブラックロック・グローバル・ファンズ（以下「ファンド」という。）は、ルクセンブルグ大公国（以下「ルクセンブルグ」という。）の法律に基づいて設立されているが、サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（以下「サブ・ファンド」ということがある。）のクラスA無分配投資証券（以下「ファンド証券」という。）は米ドル建のため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルをもって行う。
- （注3）サステナブル・ワールド・ボンド・ファンドの名称は、2022年12月15日付でワールド・ボンド・ファンドから変更された。
- （注4）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入して記載してある。したがって、合計の数字が一致しない場合がある。また、円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入して記載してある。したがって、本書の中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もある。以下、別段の記載がない限り同じ。
- （注5）ファンドの会計年度（以下「計算期間」ということがある。）は、9月1日に始まり、翌年の8月31日に終わる1年である。
- （注6）サブ・ファンドは、アンブレラ・ファンドであるファンドのサブ・ファンドであり、本書において、サブ・ファンドのみが開示される。2024年3月末日現在、ファンドは、サブ・ファンドを含む106個のサブ・ファンドにより構成されている。

1 【外国投資法人の概況】

(1) 【主要な経営指標等の推移】

	第61会計年度中間 (2022年 2 月末日)	第61会計年度 (2022年 8 月末日)	第62会計年度中間 (2023年 2 月末日)	第62会計年度 (2023年 8 月末日)	第63会計年度中間 (2024年 2 月末日)
(a) 営業収益(注1)	17,887,070米ドル (2,708,281千円)	36,759,641米ドル (5,565,777千円)	18,449,535米ドル (2,793,444千円)	42,079,261米ドル (6,371,221千円)	22,701,241米ドル (3,437,195千円)
(b) 経常利益（損失）金額	14,249,592米ドル (2,157,531千円)	28,166,571米ドル (4,264,701千円)	15,112,851米ドル (2,288,237千円)	31,312,418米ドル (4,741,013千円)	17,641,832米ドル (2,671,150千円)
(c) 当期純利益（損失）金額	-2,220,389米ドル (-336,189千円)	-79,592,247米ドル (-12,051,062千円)	-68,309,802米ドル (-10,342,787千円)	-92,059,941米ドル (-13,938,796千円)	-11,730,371米ドル (-1,776,095千円)
(d) 出資総額(注2)	1,300,128,123米ドル (196,852,399千円)	1,128,318,997米ドル (170,838,779千円)	1,078,391,072米ドル (163,279,192千円)	925,326,117米ドル (140,103,627千円)	999,225,767米ドル (151,292,773千円)
(e) 発行済投資証券総数	□	□	□	□	□
クラス A 毎日分配型投資証券	120,930	100,985	58,110	28,171	32,528
クラス A 毎月分配型投資証券	228,735	200,673	237,466	210,919	195,018
クラス A オフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	5,699	5,826	8,289	8,380	5,764
クラス A シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	20,757	21,233	22,215	22,334	21,818
クラス A 無分配投資証券	1,272,926	1,088,332	885,697	874,040	828,179
クラス A ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	98,151	235,080	103,050	110,094	122,188
クラス A 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	393,087	380,127	378,944	397,667	381,146
クラス C 毎日分配型投資証券	14,295	14,197	13,011	12,986	13,063
クラス D 毎月分配型投資証券	68,689	69,194	69,819	70,579	71,406
クラス D 無分配投資証券	1,608,138	1,743,877	1,899,925	1,447,605	1,398,716
クラス D スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	526,909	526,909	525,409	497,410	499,185
クラス D ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	177,570	79,158	84,527	84,462	80,687
クラス D 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,503,135	2,267,755	2,482,942	2,235,260	1,858,630
クラス E 無分配投資証券	436,449	465,044	512,467	507,476	510,964
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	2,171,315	2,598,665	4,203,020	2,947,513	3,816,816

クラスⅠ無分配投資証券	421,277	392,265	917,977	1,127,633	1,086,825
クラスⅩ無分配投資証券	4,581,189	4,350,456	3,883,753	2,472,338	2,803,924
クラスⅩスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8	8	8	8	8
クラスⅩデンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5	5	5	5	5
クラスⅩユーロ・ヘッジ無分配投資証券	242,391	242,391	236,950	258,164	266,900
クラスⅩ英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	17,904,636	17,080,519	17,028,280	16,325,743	16,374,560
クラスⅩノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	33,142,500	40,693,062	46,101,771	46,101,771	56,300,974
クラスⅩニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795	795	795	795	795
(f) 純資産額	1,300,128,123米ドル (196,852,399千円)	1,128,318,997米ドル (170,838,779千円)	1,078,391,072米ドル (163,279,192千円)	925,326,117米ドル (140,103,627千円)	999,225,767米ドル (151,292,773千円)
(g) 総資産額	1,491,949,760米ドル (225,896,113千円)	1,198,602,243米ドル (181,480,366千円)	1,235,963,458米ドル (187,137,227千円)	1,038,984,728米ドル (157,312,678千円)	1,134,156,016米ドル (171,722,562千円)
(h) 1口当たり純資産価格(注3)					
クラスA毎日分配型投資証券	57.88米ドル (8,764円)	53.53米ドル (8,105円)	51.47米ドル (7,793円)	51.60米ドル (7,813円)	52.58米ドル (7,961円)
クラスA毎月分配型投資証券	57.73米ドル (8,741円)	53.40米ドル (8,085円)	51.34米ドル (7,773円)	51.46米ドル (7,792円)	52.45米ドル (7,941円)
クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	100.89人民元 (2,102円)	92.36人民元 (1,924円)	87.05人民元 (1,813円)	86.01人民元 (1,792円)	87.46人民元 (1,822円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	9.86シンガポール・ドル (1,105円)	9.05シンガポール・ドル (1,015円)	8.62シンガポール・ドル (966円)	8.55シンガポール・ドル (959円)	8.61シンガポール・ドル (965円)
クラスA無分配投資証券	81.85米ドル (12,393円)	76.31米ドル (11,554円)	74.12米ドル (11,223円)	75.25米ドル (11,394円)	77.85米ドル (11,787円)
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	188.78ユーロ (30,816円)	174.06ユーロ (28,414円)	166.31ユーロ (27,148円)	166.93ユーロ (27,250円)	170.98ユーロ (27,911円)
クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	11.90英ポンド (2,276円)	11.05英ポンド (2,113円)	10.65英ポンド (2,036円)	10.76英ポンド (2,058円)	11.09英ポンド (2,121円)

クラスC 毎日分配型投資証券	58.18米ドル (8,809円)	53.81米ドル (8,147円)	51.74米ドル (7,834円)	51.87米ドル (7,854円)	52.85米ドル (8,002円)
クラスD 毎月分配型投資証券	57.80米ドル (8,751円)	53.45米ドル (8,093円)	51.39米ドル (7,781円)	51.52米ドル (7,801円)	52.50米ドル (7,949円)
クラスD 無分配投資証券	86.84米ドル (13,148円)	81.12米ドル (12,282円)	78.95米ドル (11,954円)	80.32米ドル (12,161円)	83.26米ドル (12,606円)
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	10.27スイス・フラン (1,725円)	9.49スイス・フラン (1,594円)	9.04スイス・フラン (1,518円)	9.00スイス・フラン (1,511円)	9.13スイス・フラン (1,533円)
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	195.77ユーロ (31,957円)	180.88ユーロ (29,527円)	173.17ユーロ (28,268円)	174.16ユーロ (28,430円)	178.75ユーロ (29,179円)
クラスD 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	12.04英債券 (2,302円)	11.21英債券 (2,144円)	10.82英債券 (2,069円)	10.96英債券 (2,096円)	11.32英債券 (2,165円)
クラスE 無分配投資証券	74.91米ドル (11,342円)	69.66米ドル (10,547円)	67.50米ドル (10,220円)	68.35米ドル (10,349円)	70.54米ドル (10,680円)
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	9.89ユーロ (1,614円)	8.94ユーロ (1,459円)	8.57ユーロ (1,399円)	8.38ユーロ (1,368円)	8.60ユーロ (1,404円)
クラスI 無分配投資証券	11.30米ドル (1,711円)	10.57米ドル (1,600円)	10.29米ドル (1,558円)	10.48米ドル (1,587円)	10.87米ドル (1,646円)
クラスX 無分配投資証券	94.26米ドル (14,272円)	88.33米ドル (13,374円)	86.23米ドル (13,056円)	87.99米ドル (13,323円)	91.48米ドル (13,851円)
クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	14.67スイス・フラン (2,463円)	13.59スイス・フラン (2,282円)	12.99スイス・フラン (2,181円)	12.97スイス・フラン (2,178円)	13.21スイス・フラン (2,218円)
クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	119.19デンマーク・ クローネ (2,608円)	111.26デンマーク・ クローネ (2,434円)	107.48デンマーク・ クローネ (2,352円)	108.37デンマーク・ クローネ (2,371円)	111.39デンマーク・ クローネ (2,437円)
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	208.92ユーロ (34,104円)	193.62ユーロ (31,607円)	185.93ユーロ (30,351円)	187.56ユーロ (30,617円)	193.09ユーロ (31,520円)
クラスX 英債券・ヘッジ無分配投資証券	13.13英債券 (2,511円)	12.26英債券 (2,344円)	11.87英債券 (2,270円)	12.06英債券 (2,306円)	12.50英債券 (2,390円)
クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	14.18ノルウェー・ クローネ (198円)	13.25ノルウェー・ クローネ (185円)	12.81ノルウェー・ クローネ (179円)	12.94ノルウェー・ クローネ (180円)	13.34ノルウェー・ クローネ (186円)
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	12.43ニュージー ランド・ドル (1,125円)	11.65ニュージー ランド・ドル (1,054円)	11.31ニュージー ランド・ドル (1,024円)	11.53ニュージー ランド・ドル (1,043円)	11.96ニュージー ランド・ドル (1,082円)

(i) 1口当たり当期純利益金額(注4)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	204,307米ドル (30,934千円)	965,028米ドル (146,115千円)	209,901米ドル (31,781千円)	1,207,239米ドル (182,788千円)	254,634米ドル (38,554千円)
(k) 1口当たり分配金額(注4)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	87.14%	94.14%	87.25%	89.06%	88.10%
(m) 自己資本利益率	-0.17%	-7.05%	-6.33%	-9.95%	-1.17%

(注1) 営業収益には投資収益を記載している。

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

(注3) 1口当たり純資産価格は、該当する投資証券クラスの取引通貨にて表示される。投資証券クラスに2つ以上の取引通貨が利用可能な場合、表示される価格は当該投資証券クラスの基準通貨が使用される。他の取引通貨による価格は、評価時における関連する直物為替相場で換算して算定される。第62会計年度以降、ヘッジなし英国報告型投資証券について、比較価格は英ポンドで表示される。当期末価格は、該当するサブ・ファンドの基準通貨で表示される。以下同じ。

(注4) (i)および(k)は、ファンドの性格上、算定していない。

(注5) サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンドは、2004年4月2日より運用を開始した。

（２）【外国投資法人の出資総額】

サブ・ファンドの2024年３月末日現在の発行済投資証券総口数、ならびに下記の各会計年度末現在および2024年３月末日現在の純資産総額およびクラスＡ無分配投資証券の発行済投資証券総口数は、以下のとおりである。

サブ・ファンドにつき、発行可能投資証券総口数の定めはない。

クラス投資証券	発行済投資証券総口数（口）
クラスＡ毎日分配型投資証券	32,531
クラスＡ毎月分配型投資証券	192,302
クラスＡオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	5,770
クラスＡシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	21,704
クラスＡ無分配投資証券	789,127
クラスＡユーロ・ヘッジ無分配投資証券	120,580
クラスＡ英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	381,883
クラスＣ毎日分配型投資証券	13,076
クラスＤ毎月分配型投資証券	71,550
クラスＤ無分配投資証券	1,498,669
クラスＤスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	499,185
クラスＤユーロ・ヘッジ無分配投資証券	79,265
クラスＤ英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,815,942
クラスＥ無分配投資証券	513,493
クラスＩユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	3,816,816
クラスＩ無分配投資証券	1,084,273
クラスＸ無分配投資証券	2,086,020
クラスＸスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	8
クラスＸデンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	5
クラスＸユーロ・ヘッジ無分配投資証券	273,554
クラスＸ英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	16,374,560
クラスＸノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	56,300,974
クラスＸニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	795

会計年度	純資産総額	クラスA無分配投資証券 発行済投資証券総口数
第57会計年度末 (2018年8月末日)	1,340,682,994米ドル (202,992,812千円)	1,757,513口
第58会計年度末 (2019年8月末日)	1,375,012,111米ドル (208,190,584千円)	1,984,448口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	1,365,243,468米ドル (206,711,513千円)	1,552,663口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	1,365,246,053米ドル (206,711,905千円)	1,433,219口
第61会計年度末 (2022年8月末日)	1,128,318,997米ドル (170,838,779千円)	1,088,332口
第62会計年度末 (2023年8月末日)	925,326,117米ドル (140,103,627千円)	874,040口
2024年3月末日	946,745,951米ドル (143,346,804千円)	789,127口

(3) 【主要な投資主の状況】

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

（４）【役員の状況】

（2024年４月末日現在）

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

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

（５）【その他】

a．定款の変更

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

b．事業譲渡または事業譲受

合併

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

併合による合併の結果、吸収されるU C I T Sは、その資産および債務を相手方のU C I T Sに拋出し、清算を行わずに解散される。

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

S I C A Vは、2010年法に基づき契約型投資信託（以下「F C P」という。）および会社型投資信託との合併が可能である。

資産の譲渡

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

U C I T Sは、特別な状況において、またC S S Fおよび適用法により要求される手続きに従い（例えば、サブ・ファンドの合併によるかまたは分離により）、その資産の一部を相手方のU C I T Sに譲渡することができる。

c．出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d．訴訟事件その他の重要事項

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

2【外国投資法人の運用状況】

(1)【投資状況】

(資産別および地域別の投資状況)

(2024年3月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率(注1) (%)
国債	中国	83,318,206	8.00
	日本	38,478,687	3.70
	ドイツ	31,181,981	3.00
	メキシコ	19,294,275	1.85
	イタリア	16,797,166	1.61
	フランス	16,762,986	1.61
	米国	15,383,082	1.48
	スペイン	15,302,570	1.47
	韓国	15,039,005	1.44
	インドネシア	13,093,237	1.26
	ブラジル	12,718,895	1.22
	カナダ	10,385,958	1.00
	ポーランド	7,061,350	0.68
	コロンビア	6,912,814	0.66
	英国	6,566,099	0.63
	タイ	6,173,704	0.59
	ベルギー	5,062,409	0.49
	オーストリア	4,848,492	0.47
	オランダ	4,627,244	0.44
	南アフリカ	4,371,934	0.42
	チェコ共和国	4,105,960	0.39
	チリ	4,094,242	0.39
	マレーシア	3,954,807	0.38
	ルーマニア	3,279,847	0.32
	ペルー	2,799,706	0.27
	ポルトガル	2,731,768	0.26
	ルクセンブルグ	2,602,504	0.25
	ハンガリー	2,503,718	0.24
	スイス	2,295,230	0.22
	サウジアラビア	2,123,258	0.20
	シンガポール	1,878,357	0.18
	ノルウェー	1,730,435	0.17
	スウェーデン	1,675,447	0.16
	パナマ	1,605,378	0.15
	アイルランド	1,536,030	0.15
	ニュージーランド	1,515,056	0.15
	デンマーク	1,432,733	0.14
	フィンランド	1,428,379	0.14
	アラブ首長国連邦	1,261,266	0.12

	カタール	1,133,900	0.11
	スロバキア	1,129,154	0.11
	ギリシャ	1,089,419	0.10
	オーストラリア	862,236	0.08
	スロベニア	686,257	0.07
	フィリピン	628,000	0.06
	クロアチア	570,016	0.05
	カザフスタン	393,575	0.04
	ウルグアイ	392,827	0.04
	ドミニカ共和国	291,041	0.03
	グアテマラ	212,700	0.02
	香港	204,684	0.02
	オマーン	202,472	0.02
	コートジボワール	200,850	0.02
	小計	385,931,346	37.07
社債	米国	197,213,982	18.94
	英国	26,466,460	2.54
	フランス	25,404,306	2.44
	ドイツ	20,095,734	1.93
	オランダ	17,152,876	1.65
	デンマーク	8,371,687	0.80
	スイス	7,804,015	0.75
	イタリア	7,139,710	0.69
	カナダ	5,053,236	0.49
	ルクセンブルグ	4,903,665	0.47
	スペイン	4,172,171	0.40
	オーストラリア	3,987,203	0.38
	ケイマン諸島	2,723,813	0.26
	ベルギー	2,616,067	0.25
	日本	1,963,950	0.19
	シンガポール	1,717,033	0.16
	ノルウェー	1,593,819	0.15
	チリ	1,029,443	0.10
	アイルランド	932,056	0.09
	アラブ首長国連邦	682,057	0.07
	スウェーデン	575,823	0.06
	ジャージー	553,943	0.05
	タイ	515,455	0.05
	インドネシア	475,584	0.05
	バミューダ	466,701	0.04
	ブラジル	406,946	0.04
	インド	382,924	0.04
	ニュージーランド	380,228	0.04
	メキシコ	370,767	0.04
	香港	354,535	0.03

	コロンビア	226,569	0.02
	オーストリア	214,819	0.02
	ポルトガル	208,484	0.02
	韓国	198,420	0.02
	中国	183,769	0.02
	フィンランド	101,764	0.01
	マルタ	54,970	0.01
	小計	346,694,984	33.30
政府機関債	米国	200,971,867	19.30
	ケイマン諸島	32,914,886	3.16
	アイルランド	11,949,913	1.15
	英国	9,874,275	0.95
	バミューダ	1,205,215	0.12
	ジャージー	969,929	0.09
	オランダ	478,480	0.05
	スペイン	422,326	0.04
	イタリア	200,734	0.02
	ドイツ	108,503	0.01
	ルクセンブルグ	65,239	0.01
	小計	259,161,367	24.89
国際機関債	国際機関	14,597,048	1.40
	小計	14,597,048	1.40
投資資産合計		1,006,384,745	96.67
現金・その他の資産（負債控除後）		34,651,154	3.33
資産総額		1,041,035,899	100.00
負債総額		94,289,948	9.06（注2）
純資産総額		946,745,951 (約143,347百万円)	90.94（注3）

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

（注2）資産総額に対する負債総額の比率である。

（注3）資産総額に対する純資産総額の比率である。

（２）【運用実績】

【純資産等の推移】

2024年３月末日および同日前１年以内における各月末のサブ・ファンドの総資産額および純資産総額ならびにクラスＡ無分配投資証券の１口当たり純資産価格の推移は、以下のとおりである。

	総資産額		純資産総額		１口当たり純資産価格	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2023年４月末日	1,246,729	188,767	999,876	151,391	75.81	11,478
５月末日	1,098,907	166,386	977,239	147,964	75.33	11,406
６月末日	1,062,103	160,813	951,894	144,126	75.40	11,416
７月末日	1,063,489	161,023	957,474	144,971	75.62	11,450
８月末日	1,038,985	157,313	925,326	140,104	75.25	11,394
９月末日	981,124	148,552	883,795	133,815	73.91	11,191
10月末日	993,605	150,442	900,125	136,288	73.36	11,107
11月末日	1,080,409	163,585	950,125	143,858	76.13	11,527
12月末日	1,097,159	166,121	994,242	150,538	78.86	11,940
2024年１月末日	1,118,333	169,327	1,008,481	152,694	78.66	11,910
２月末日	1,134,156	171,723	999,226	151,293	77.85	11,787
３月末日	1,051,928	159,272	946,746	143,347	78.74	11,922

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

【分配の推移】

2024年３月末日前１年間ににおけるサブ・ファンドの分配金の額は、以下のとおりである。

総額 485,033.00米ドル（約73,439千円）

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

【自己資本利益率（収益率）の推移】

下記の期間におけるサブ・ファンドの自己資本利益率は、以下のとおりである。

期間	自己資本利益率（収益率）
（ 2023年４月１日～ 2024年３月31日 ）	3.70%

（３）【投資リスク】

第63会計年度中間期において、2024年２月29日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第
1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載されたリスク要因について、重要な変更はない。

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

3【資産運用会社の概況】

（１）【名称及び資本金の額】

名称

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

資本金（株主資本）の額

2024年４月30日現在、6,309,670ユーロ（約10億2,999万円）

（２）【大株主の状況】

ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーは、ブラックロック・インコーポレイテッド・グループ内の完全子会社である。

（３）【役員の状況】

（2024年４月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有 株式数
ジョナサン・グリフィン (Jonathan Griffin)	取締役会長 および 独立 非常勤取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーの取締役会長および独立非常勤取締役	0
ジョアン・フィッツジェラルド (Joanne Fitzgerald)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーのマネージング・ディレクターおよびE M E A・ファンド・ボード・ガバナンス	0
レオン・シュワブ (Leon Schwab)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーの取締役、ブラックロック・グローバル・ファンズ・アドミニストレーション・サービス・グループおよびレギュラトリー・アンド・タックス・サブスタンス・E M E A・オルタナティブのヘッド	0
スヴェトラナ・ブトビナ (Svetlana Butvina)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーのマネージング・ディレクターおよびE M E A・ファンズ・リスクのヘッド	0
リチャード・ガードナー (Richard Gardner)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーのマネージング・ディレクター、E M E A・クライアント・コア・ビジネスのC O Oおよびブラックロック・ライフ・リミテッドのC O O	0
タレク・マフムード (Tarek Mahmoud)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーのマネージング・ディレクターおよびマルチ・オルタナティブのヘッド	0
マイケル・レンナー (Michael Renner)	独立 非常勤取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーの独立非常勤取締役	0
ベンジャミン・ ダニエル・グREGSON (Benjamin Daniel Gregson)	取締役	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーのマネージング・ディレクター、同社ルクセンブルグ・レギュラトリー・ガバナンスのヘッド、および同社内部監査のコンダクティング・オフィサー	0

（４）【事業の内容及び営業の概況】

ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーは、2010年法第15章に基づき運用会社として行為することを認可されている。運用会社契約に基づきファンドの投資運用、管理およびサブ・ファンドのマーケティングに関するあらゆる運営機能を、直接または委託により遂行する責任とともに、ファンドの日々の運用を行っている。2024年３月末日現在、運用会社は、以下の３本の投資法人（合計純資産総額は、133,672,815,910.56米ドル、769,397,755.57英ポンド、513,266,047.45スイス・フラン、36,683,316,178.94ユーロ、21,396,470,659.54人民元および99,823,298,977.82円）を運用、助言および／または管理している。

名称（設立国）	基本的性格	設立年月日	純資産総額（通貨別）
ブラックロック・ グローバル・ファンズ （ルクセンブルグ）	変動資本を有する会社型 投資信託 （アンブレラ型）	1962年 6 月14日	118,519,899,881.51 米ドル 199,707,428.17 英ポンド 513,266,047.45 スイス・フラン 28,361,740,848.85 ユーロ 21,396,470,659.54 人民元 99,823,298,977.82 円
ブラックロック・ ストラテジック・ ファンズ （ルクセンブルグ）	変動資本を有する会社型 投資信託 （アンブレラ型）	2007年 5 月 2 日	7,583,293,977.45 米ドル 7,746,199,541.49 ユーロ 569,690,327.40 英ポンド
ブラックロック・ グローバル・ インデックス・ファンズ （ルクセンブルグ）	変動資本を有する会社型 投資信託 （アンブレラ型）	2012年 8 月30日	7,569,622,051.60 米ドル 575,375,788.60 ユーロ

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

4【外国投資法人の経理状況】

- (a) サブ・ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成されたファンドの原文（英文）の中間財務書類を翻訳したものである（ただし、円換算部分を除く。）。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」（平成5年大蔵省令第22号。その後の改正を含む。）に基づき、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。その後の改正を含む。）第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである（但し、円換算額を除く。）。
- (b) ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号。その後の改正を含む。）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- (c) ファンドの原文の中間財務書類は、外貨で表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円換算額が併記されている。日本円への換算には、2024年3月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝151.41円、1英ポンド＝191.22円、1スイス・フラン＝167.92円、1ユーロ＝163.24円、1デンマーク・クローネ＝21.88円、1ノルウェー・クローネ＝13.94円、1人民元＝20.83円、1シンガポール・ドル＝112.11円および1ニュージーランド・ドル＝90.50円）が使用されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。日本円に換算された金額は、四捨五入のため、合計欄の数値が総数と一致しない場合がある。
- (注) ファンドの原文の中間財務書類には、現在ファンドを構成するすべてのサブ・ファンドの情報が掲載されているが、日本語の中間財務書類には、サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（旧名称 ワールド・ボンド・ファンド）の情報のみが掲載されている（ただし、「財務書類に対する注記」を除く。）。

（１）【資産及び負債の状況】

純資産計算書 2024年2月29日現在（未監査）

		サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
	注記	米ドル	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		1,036,516,696	156,938,993
未実現評価損		(51,831,538)	(7,847,813)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	984,685,158	149,091,180
銀行預金	2 (a)	11,716,928	1,774,060
ブローカーに対する債権	14	8,786,687	1,330,392
未収利息および未収配当金	2 (a)	9,216,087	1,395,408
売却投資有価証券未収金	2 (a)	18,897,987*	2,861,344*
販売投資証券未収金	2 (a)	964,968	146,106
以下に係る未実現評価益：			
未決済上場先物取引	2 (c)	1,135,433	171,916
未決済先渡為替予約	2 (c)	6,234,188	943,918
事後通告証券契約の時価	2 (c)	91,845,782	13,906,370
買建オプション / スワップションの時価	2 (c)	586,831	88,852
その他の資産	2 (a , c)	85,967	13,016
資産合計		1,134,156,016	171,722,562
負債			
当座借越	2 (a)	1,946,235	294,679
ブローカーに対する債務	14	936,448	141,788
未払収益分配金	2 (a)	39,771	6,022
購入投資有価証券未払金	2 (a)	125,390,273*	18,985,341*
買戻し投資証券未払金	2 (a)	529,327	80,145
スワップの時価 / 未実現評価損	2 (c)	3,726,951	564,298
売建オプション / スワップションの時価	2 (c)	1,437,699	217,682
その他の負債	4 , 5 , 6 , 7 , 8	923,545	139,834
負債合計		134,930,249	20,429,789
純資産合計		999,225,767	151,292,773

* 事後通告証券を含む。詳細については、注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2月29日現在（未監査）

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
		（円換算額）	
2024年 2月29日現在			
純資産合計	米ドル	999,225,767	151,292,773 千円
以下の 1 口当たり純資産価額：			
クラス A 毎日分配型投資証券	米ドル	52.58	7,961 円
クラス A 毎月分配型投資証券	米ドル	52.45	7,941 円
クラス A オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	87.46	1,822 円
クラス A シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	8.61	965 円
クラス A 無分配投資証券	米ドル	77.85	11,787 円
クラス A ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	170.98	27,911 円
クラス A 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.09	2,121 円
クラス C 毎日分配型投資証券	米ドル	52.85	8,002 円
クラス D 毎月分配型投資証券	米ドル	52.50	7,949 円
クラス D 無分配投資証券	米ドル	83.26	12,606 円
クラス D スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	9.13	1,533 円
クラス D ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	178.75	29,179 円
クラス D 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.32	2,165 円
クラス E 無分配投資証券	米ドル	70.54	10,680 円
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.60	1,404 円
クラス I 無分配投資証券	米ドル	10.87	1,646 円
クラス X 無分配投資証券	米ドル	91.48	13,851 円
クラス X スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	13.21	2,218 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
 （ 続 き ）

		サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
通貨		(円換算額)	
2024年2月29日現在(続き)			
以下の1口当たり純資産価額(続き)：			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	111.39	2,437 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	193.09	31,520 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	12.50	2,390 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	13.34	186 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジール ランド・ドル	11.96	1,082 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
（ 続き ）

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
		（ 円換算額 ）	
2023年 8 月31日現在			
純資産合計	米ドル	925,326,117	140,103,627 千円
以下の 1 口当たり純資産価額：			
クラス A 毎日分配型投資証券	米ドル	51.60	7,813 円
クラス A 毎月分配型投資証券	米ドル	51.46	7,792 円
クラス A オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	86.01	1,792 円
クラス A シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	8.55	959 円
クラス A 無分配投資証券	米ドル	75.25	11,394 円
クラス A ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	166.93	27,250 円
クラス A 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	10.76	2,058 円
クラス C 毎日分配型投資証券	米ドル	51.87	7,854 円
クラス D 毎月分配型投資証券	米ドル	51.52	7,801 円
クラス D 無分配投資証券	米ドル	80.32	12,161 円
クラス D スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	9.00	1,511 円
クラス D ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	174.16	28,430 円
クラス D 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	10.96	2,096 円
クラス E 無分配投資証券	米ドル	68.35	10,349 円
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.38	1,368 円
クラス I 無分配投資証券	米ドル	10.48	1,587 円
クラス X 無分配投資証券	米ドル	87.99	13,323 円
クラス X スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	12.97	2,178 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
（ 続き ）

		サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
	通貨	(円換算額)	
2023年 8 月31日現在 (続き)			
以下の 1 口当たり純資産価額 (続き) :			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	108.37	2,371 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	187.56	30,617 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	12.06	2,306 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	12.94	180 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジール ランド ・ドル	11.53	1,043 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
（ 続き ）

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
		（ 円換算額 ）	
2022年 8 月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,128,318,997	170,838,779 千円
以下の 1 口当たり純資産価額：			
クラス A 毎日分配型投資証券	米ドル	53.53	8,105 円
クラス A 毎月分配型投資証券	米ドル	53.40	8,085 円
クラス A オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	92.36	1,924 円
クラス A シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	9.05	1,015 円
クラス A 無分配投資証券	米ドル	76.31	11,554 円
クラス A ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	174.06	28,414 円
クラス A 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.05	2,113 円
クラス C 毎日分配型投資証券	米ドル	53.81	8,147 円
クラス D 毎月分配型投資証券	米ドル	53.45	8,093 円
クラス D 無分配投資証券	米ドル	81.12	12,282 円
クラス D スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	9.49	1,594 円
クラス D ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	180.88	29,527 円
クラス D 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	11.21	2,144 円
クラス E 無分配投資証券	米ドル	69.66	10,547 円
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	8.94	1,459 円
クラス I 無分配投資証券	米ドル	10.57	1,600 円
クラス X 無分配投資証券	米ドル	88.33	13,374 円
クラス X スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	13.59	2,282 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
（ 続き ）

サステイナブル・ワールド・
ボンド・ファンド

通貨

（ 円換算額 ）

2022年 8 月31日現在（ 続き ）

以下の 1 口当たり純資産価額（ 続き ）：

クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ーク・ク ローネ	111.26	2,434 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	193.62	31,607 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	12.26	2,344 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	13.25	185 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジール ランド・ドル	11.65	1,054 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年 2 月29日現在（未監査）
（ 続き ）

	通貨	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
		（ 円換算額 ）	
2021年 8 月31日現在			
純資産合計	米ドル	1,365,246,053	206,711,905 千円
以下の 1 口当たり純資産価額：			
クラス A 毎日分配型投資証券	米ドル	61.89	9,371 円
クラス A 毎月分配型投資証券	米ドル	61.73	9,347 円
クラス A オフショア中国人民元・ヘッジ 金利差毎月総収益分配型投資証券	オフショア 中国人民元	108.18	2,253 円
クラス A シンガポール・ドル・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	シンガポー ル・ドル	10.60	1,188 円
クラス A 無分配投資証券	米ドル	86.91	13,159 円
クラス A ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	201.30	32,860 円
クラス A 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.63	2,415 円
クラス C 毎日分配型投資証券	米ドル	62.21	9,419 円
クラス D 毎月分配型投資証券	米ドル	61.80	9,357 円
クラス D 無分配投資証券	米ドル	92.02	13,933 円
クラス D スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	10.95	1,839 円
クラス D ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	208.35	34,011 円
クラス D 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	英ポンド	12.76	2,440 円
クラス E 無分配投資証券	米ドル	79.74	12,073 円
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	ユーロ	10.51	1,716 円
クラス I 無分配投資証券	米ドル	11.97	1,812 円
クラス X 無分配投資証券	米ドル	99.59	15,079 円
クラス X スイス・フラン・ヘッジ無分配 投資証券	スイス・ フラン	15.57	2,615 円

3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2024年2月29日現在（未監査）
（続き）

		サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
	通貨	(円換算額)	
2021年 8 月31日現在 (続き)			
以下の 1 口当たり純資産価額 (続き) :			
クラスXデンマーク・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	デンマ ク・ク ローネ	125.88	2,754 円
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	221.67	36,185 円
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	13.88	2,654 円
クラスXノルウェー・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	ノル ウェー・ クローネ	14.96	209 円
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュー ジール ランド ・ドル	13.12	1,187 円

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2023年9月1日から2024年2月29日までの期間（未監査）

	注記	サステナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
期首純資産		925,326,117	140,103,627
収益			
現金および現金同等物に係る利息	2 (b)	621,851	94,154
債券利息（源泉徴収税控除後）	2 (b)	18,354,952	2,779,123
スワップ利息	2 (c)	2,883,854	436,644
短期金融商品預け入れによる利息	2 (b)	767,125	116,150
有価証券貸付収益	2 (b)	73,237	11,089
その他の払戻し	11	222	34
収益合計	2 (b)	22,701,241	3,437,195
費用			
スワップ利息	2 (c)	3,471,917	525,683
年次サービス料	6	323,219	48,939
ローン・コミットメント・フィー	16	3,105	470
保管および預託報酬	2 (h) , 7	12,493	1,892
販売報酬	5	91,624	13,873
税金	8	108,449	16,420
投資運用報酬	4	1,048,602	158,769
費用合計		5,059,409	766,045
純利益		17,641,832	2,671,150
以下に係る実現純評価益 / （損）：			
投資有価証券	2 (a)	(5,678,051)	(859,714)
事後通告証券契約	2 (c)	236,648	35,831
上場先物取引	2 (c)	1,088,686	164,838
オプション / スワップション契約	2 (c)	51,174	7,748
スワップ取引	2 (c)	(10,582,124)	(1,602,239)
先渡し為替予約	2 (c)	3,861,369	584,650
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(708,073)	(107,209)
当期実現純評価損		(11,730,371)	(1,776,095)

損益および純資産変動計算書 2023年9月1日から2024年2月29日までの期間（未監査）（続き）

		サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド	
	注記	米ドル	千円
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :			
投資有価証券	2 (a)	22,049,696	3,338,544
事後通告証券契約	2 (c)	(450,462)	(68,204)
上場先物取引	2 (c)	1,260,240	190,813
オプション / スワップション契約	2 (c)	679,142	102,829
スワップ取引	2 (c)	4,633,846	701,611
先渡為替予約	2 (c)	(320,935)	(48,593)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	114,743	17,373
当期末実現評価益 / (損) の純変動		27,966,270	4,234,373
運用成績による純資産の増加		33,877,731	5,129,427
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		96,283,925	14,578,349
投資証券買戻しによる正味支払額		(56,007,372)	(8,480,076)
資本の変動による純資産の増加		40,276,553	6,098,273
配当金宣言額	15	(254,634)	(38,554)
期末純資産		999,225,767	151,292,773

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2023年9月1日から2024年2月29日までの期間（未監査）

	サステナブル・ワールド・ ボンド・ファンド			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 毎日分配型投資証券	28,171	5,066	709	32,528
クラスA 毎月分配型投資証券	210,919	4,694	20,595	195,018
クラスA オフショア中国人民元・ ヘッジ金利差毎月総収益分配型 投資証券	8,380	47	2,663	5,764
クラスA シンガポール・ドル・ ヘッジ安定毎月総収益分配型 投資証券	22,334	5	521	21,818
クラスA 無分配投資証券	874,040	71,948	117,809	828,179
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	110,094	13,927	1,833	122,188
クラスA 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	397,667	35,325	51,846	381,146
クラスC 毎日分配型投資証券	12,986	151	74	13,063
クラスD 毎月分配型投資証券	70,579	904	77	71,406
クラスD 無分配投資証券	1,447,605	84,667	133,556	1,398,716
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	497,410	1,775	-	499,185
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	84,462	3,752	7,527	80,687
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配 英国報告型投資証券	2,235,260	94,266	470,896	1,858,630
クラスE 無分配投資証券	507,476	51,023	47,535	510,964
クラスI ユーロ・ヘッジ毎年分配 型投資証券	2,947,513	869,677	374	3,816,816
クラスI 無分配投資証券	1,127,633	14,544	55,352	1,086,825
クラスX 無分配投資証券	2,472,338	343,781	12,195	2,803,924
クラスX スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	8	-	-	8
クラスX デンマーク・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	5	-	-	5

発行済投資証券口数変動表 2023年9月1日から2024年2月29日までの期間（未監査）（続き）

	サステイナブル・ワールド・ ボンド・ファンド			
	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスXユーロ・ヘッジ無分配 投資証券	258,164	10,311	1,575	266,900
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配 投資証券	16,325,743	1,404,311	1,355,494	16,374,560
クラスXノルウェー・クローネ・ ヘッジ無分配投資証券	46,101,771	10,199,203	-	56,300,974
クラスXニュージーランド・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	795	-	-	795

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

（２）【投資有価証券明細表等】

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引 されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品 債券				EUR 320,000	Kingdom of Belgium Government Bond 3.45% 22/6/2043	352,639	0.03
	オーストラリア					6,354,573	0.63
EUR 200,000	AusNet Services 1.5% 26/2/2027	204,612	0.02	USD 36,651	パミューダ Digicel 0% 31/12/2030	10,075	0.00
AUD 580,000	Australia Government Bond 1.75% 21/6/2051	215,929	0.02	USD 82,566	Digicel 0% 31/12/2030	18,578	0.00
AUD 1,220,000	Australia Government Bond 3% 21/3/2047	625,423	0.06	USD 125,000	NCL 8.125% 15/1/2029	131,729	0.01
USD 25,000	FMG Resources August 2006 4.375% 1/4/2031	22,451	0.00	USD 25,000	NCL 8.375% 1/2/2028	26,188	0.00
USD 106,000	Mineral Resources 9.25% 1/10/2028	111,362	0.01	USD 1,083,000	OHA Credit Funding 12 8.318% 20/7/2036	1,089,626	0.11
		1,179,777	0.11	USD 2,381,000	RR 24 7.077% 15/1/2036	2,390,396	0.24
	オーストリア			USD 300,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038	275,219	0.03
EUR 200,000	ams-OSRAM 10.5% 30/3/2029*	221,262	0.02	USD 1,190,000	Symphony CLO 38 8.219% 24/4/2036	1,197,736	0.12
EUR 300,000	Republic of Austria Government Bond 0% 20/10/2040	194,880	0.02			5,139,547	0.51
EUR 1,460,000	Republic of Austria Government Bond 0.75% 20/10/2026	1,501,136	0.15	USD 400,000	ブラジル Banco do Brasil 6.25% 18/4/2030*	406,374	0.04
EUR 690,000	Republic of Austria Government Bond 1.5% 2/11/2086	444,239	0.04	BRL 163,000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/4/2024	3,250,609	0.33
EUR 350,000	Republic of Austria Government Bond 1.85% 23/5/2049	295,806	0.03	BRL 169,260	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	3,401,018	0.34
EUR 990,000	Republic of Austria Government Bond 2.1% 20/9/2117	814,098	0.08	BRL 141,210	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	2,877,870	0.29
EUR 1,426,000	Republic of Austria Government Bond 2.9% 23/5/2029	1,552,986	0.16	BRL 150,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2033	2,942,005	0.29
		5,024,407	0.50			12,877,876	1.29
	ベルギー			USD 22,000	カナダ 1011778 BC ULC / New Red Finance 3.5% 15/2/2029	19,851	0.00
GBP 100,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	124,748	0.01	USD 22,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	20,487	0.00
EUR 100,000	Elia Transmission Belgium 3.75% 16/1/2036	107,780	0.01	USD 25,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	21,989	0.00
EUR 900,000	FLUVIUS System Operator CVBA 3.875% 18/3/2031	989,861	0.10	USD 30,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	28,158	0.01
GBP 100,000	KBC 1.25% 21/9/2027	114,505	0.01	USD 25,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	25,192	0.00
EUR 2,690,000	Kingdom of Belgium Government Bond 0.1% 22/6/2030	2,471,203	0.25	USD 122,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029	123,855	0.01
EUR 450,000	Kingdom of Belgium Government Bond 1.4% 22/6/2053	309,017	0.03	USD 25,000	Bombardier 8.75% 15/11/2030	26,216	0.01
EUR 326,000	Kingdom of Belgium Government Bond 2.15% 22/6/2066*	264,318	0.03	CAD 872,000	Canadian Government Bond 1.75% 1/12/2053	445,522	0.04
EUR 1,581,000	Kingdom of Belgium Government Bond 2.75% 22/4/2039	1,620,502	0.16	CAD 960,000	Canadian Government Bond 2% 1/12/2051	527,969	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
CAD 420,000	Canadian Government Bond 2.75% 1/12/2048	274,490	0.03	USD 834,000	Bain Capital Credit CLO 2020-4 7.068% 20/10/2036	837,099	0.08
CAD 480,000	Canadian Government Bond 2.75% 1/12/2064	306,825	0.03	USD 487,768	Ballyrock CLO 2020-2 6.589% 20/10/2031	487,837	0.05
CAD 3,200,000	Canadian Government Bond 3.5% 1/3/2034	2,359,744	0.24	USD 698,973	CIFC Funding 2014-III 6.779% 22/10/2031	701,358	0.07
CAD 833,000	Canadian Government Bond 3.5% 1/12/2045	617,001	0.06	USD 950,000	CIFC Funding 2017-IV 7.13% 24/10/2030	952,645	0.10
CAD 510,000	Canadian Government Bond 4% 1/6/2041	400,070	0.04	USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2015-1 6.829% 20/1/2030	1,000,398	0.10
USD 80,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	73,276	0.01	USD 250,000	Eaton Vance CLO 2015-1 7.029% 20/1/2030	250,411	0.03
USD 25,000	Methanex 5.125% 15/10/2027	23,973	0.00	USD 200,000	Fantasia 0% 9/1/2023***	5,500	0.00
USD 7,000	Parkland 4.5% 1/10/2029	6,394	0.00	USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023***	5,500	0.00
CAD 4,000	Province of New Brunswick Canada 3.05% 14/8/2050	2,305	0.00	USD 200,000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	198,963	0.02
CAD 3,345,000	Province of Ontario Canada 2.4% 2/6/2026	2,373,367	0.24	USD 200,000	Gaci First Investment 5.25% 13/10/2032*	200,500	0.02
CAD 900,000	Province of Quebec Canada 3.9% 22/11/2032	653,286	0.07	USD 1,250,000	Galaxy XXII CLO 6.776% 16/4/2034	1,250,885	0.13
CAD 4,598,000	Province of Saskatchewan Canada 2.95% 2/6/2058	2,540,270	0.25	USD 320,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7.129% 20/10/2032	320,851	0.03
USD 219,000	Rogers Communications 5.3% 15/2/2034*	215,247	0.02	USD 1,000,000	KKR CLO 17 6.656% 15/4/2034	996,228	0.10
GBP 100,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027	118,241	0.01	USD 400,000	KSA Sukuk 3.628% 20/4/2027	385,654	0.04
		11,203,728	1.12	USD 706,695	Madison Park Funding XXVI 6.781% 29/7/2030	708,886	0.07
	ケイマン諸島			USD 400,000	MAF Sukuk 4.5% 3/11/2025	393,674	0.04
USD 350,000	ACAS CLO 2015-1 7.16% 18/10/2028	349,212	0.03	USD 3,000,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 35 6.911% 19/1/2033	3,014,147	0.30
USD 2,500,000	AGL CLO 3 6.876% 15/1/2033	2,500,909	0.25	USD 500,000	OCP CLO 2020-18 6.669% 20/7/2032	500,275	0.05
USD 500,000	AGL CLO 3 7.276% 15/1/2033	498,865	0.05	USD 645,411	Octagon Investment Partners 18-R 6.536% 16/4/2031	646,301	0.06
USD 1,413,000	AGL CLO 3 8.876% 15/1/2033	1,409,078	0.14	USD 600,000	OZLM VI 7.328% 17/4/2031	600,300	0.06
USD 500,000	AGL Core CLO 2 6.969% 20/4/2032	501,576	0.05	USD 625,270	Palmer Square CLO 2018-2 6.676% 16/7/2031	626,020	0.06
USD 585,000	AGL Core CLO 2 7.479% 20/4/2032	585,104	0.06	USD 320,000	Palmer Square CLO 2020-3 7.607% 15/11/2036	321,046	0.03
USD 500,000	AGL Core CLO 4 6.649% 20/4/2033	500,957	0.05	USD 800,000	Peace Park CLO 6.709% 20/10/2034	801,750	0.08
USD 532,445	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 6.566% 13/4/2031	532,656	0.05	USD 250,000	Pikes Peak CLO 4 6.776% 15/7/2034	250,626	0.03
USD 400,000	Apidos CLO XX 7.126% 16/7/2031	400,429	0.04	USD 300,000	Regatta IX Funding 8.028% 17/4/2030	300,136	0.03
USD 597,206	Apidos CLO XXX 6.7% 18/10/2031	599,031	0.06	USD 250,000	Regatta XVI Funding 9.476% 15/1/2033	251,826	0.03
USD 2,267,000	Apidos CLO XXXII 6.899% 20/1/2033	2,271,543	0.23				
USD 250,000	Apidos CLO XXXII 7.979% 20/1/2033	250,190	0.02				
USD 750,000	Apidos CLO XXXIX 6.618% 21/4/2035	750,454	0.08				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 585,000	Regatta XXI Funding 7.279% 20/10/2034	585,371	0.06	CNY 36,900,000	中国 China Government Bond 1.99% 9/4/2025	5,133,400	0.51
USD 408,516	Rockford Tower CLO 2018-1 6.681% 20/5/2031	408,509	0.04	CNY 14,520,000	China Government Bond 2.29% 25/12/2024	2,027,509	0.20
USD 685,000	RR 5 7.226% 15/10/2031	688,470	0.07	CNY 61,000,000	China Government Bond 2.37% 20/1/2027	8,535,452	0.85
USD 200,000	Saudi Electricity Sukuk Programme 4.632% 11/4/2033	193,250	0.02	CNY 50,000,000	China Government Bond 2.5% 25/7/2027	7,018,653	0.70
USD 77,000	Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	87,230	0.01	CNY 6,700,000	China Government Bond 2.6% 1/9/2032	946,394	0.10
USD 250,000	Symphony CLO XXIV 6.777% 23/1/2032	250,328	0.02	CNY 25,000,000	China Government Bond 2.62% 25/9/2029	3,532,734	0.35
USD 500,000	TIAA CLO IV 6.809% 20/1/2032	501,186	0.05	CNY 67,400,000	China Government Bond 2.68% 21/5/2030	9,553,855	0.96
USD 303,715	TICP CLO IX 6.719% 20/1/2031	304,059	0.03	CNY 10,000,000	China Government Bond 2.7% 3/11/2026	1,408,551	0.14
GBP 200,000	Trafford Centre Finance 6.165% 28/7/2035	181,217	0.02	CNY 90,000,000	China Government Bond 2.75% 17/2/2032	12,833,680	1.29
USD 476,000	Trinitas CLO XII 7.323% 25/4/2033	477,754	0.05	CNY 60,000,000	China Government Bond 2.79% 15/12/2029	8,554,712	0.86
USD 1,750,000	Trinitas CLO XIV 7.586% 25/1/2034	1,750,087	0.18	CNY 27,700,000	China Government Bond 2.8% 24/3/2029	3,951,047	0.40
USD 2,000,000	Trinitas CLO XIV 8.586% 25/1/2034	2,000,100	0.20	CNY 21,800,000	China Government Bond 2.8% 15/11/2032	3,128,484	0.31
USD 835,000	Voya CLO 2014-4 7.176% 14/7/2031	836,333	0.08	CNY 26,000,000	China Government Bond 2.85% 4/6/2027	3,694,180	0.37
USD 241,953	Voya CLO 2018-1 6.521% 19/4/2031	242,254	0.02	CNY 10,000,000	China Government Bond 2.89% 18/11/2031	1,440,358	0.14
USD 1,000,000	Voya CLO 2018-2 6.826% 15/7/2031	1,002,750	0.10	CNY 28,350,000	China Government Bond 3.39% 16/3/2050	4,551,144	0.46
		36,667,718	3.67	CNY 1,900,000	China Government Bond 3.4% 15/7/2072	320,028	0.03
	チリ			CNY 6,900,000	China Government Bond 3.72% 12/4/2051	1,170,304	0.12
USD 200,000	Celulosa Arauco y Constitucion 4.2% 29/1/2030	183,387	0.02	CNY 2,950,000	China Government Bond 3.73% 25/5/2070	527,424	0.05
USD 200,000	Chile Government International Bond 2.45% 31/1/2031	170,201	0.02	CNY 2,000,000	China Government Bond 3.74% 22/9/2035	317,485	0.03
USD 500,000	Chile Government International Bond 3.1% 7/5/2041*	365,913	0.04	CNY 1,500,000	China Government Bond 3.81% 14/9/2050	257,891	0.03
USD 200,000	Chile Government International Bond 3.125% 21/1/2026	193,587	0.02	CNY 8,800,000	China Government Bond 3.97% 23/7/2048	1,526,174	0.15
USD 1,176,000	Chile Government International Bond 3.5% 25/1/2050*	849,489	0.08	CNY 3,000,000	China Government Bond 4% 24/6/2069	565,940	0.06
USD 2,500,000	Chile Government International Bond 4.85% 22/1/2029	2,480,638	0.25	CNY 4,800,000	China Government Bond 4.03% 21/6/2040	806,798	0.08
USD 500,000	Inversiones CMPC 4.375% 4/4/2027	481,737	0.05	CNY 2,300,000	China Government Bond 4.05% 24/7/2047	400,996	0.04
USD 200,000	Nacional del Cobre de Chile 4.25% 17/7/2042	154,175	0.01	CNY 6,000,000	China Government Bond 4.08% 22/10/2048	1,059,572	0.11
		4,879,127	0.49	CNY 3,000,000	China Government Bond 4.5% 23/6/2041	538,635	0.05
				USD 200,000	Industrial & Commercial Bank of China 1.625% 28/10/2026	183,004	0.02
						83,984,404	8.41

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	コロンビア						
USD 800,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	753,508	0.07	EUR 100,000	Altice France 11.5% 1/2/2027	110,934	0.01
COP 5,091,500,000	Colombian TES 6% 28/4/2028	1,159,604	0.12	EUR 100,000	AXA 6.375% 16/7/2033	111,129	0.01
COP 4,912,300,000	Colombian TES 7% 26/3/2031	1,088,879	0.11	EUR 100,000	Banijay Entertainment 7% 1/5/2029	113,888	0.01
COP 1,074,000,000	Colombian TES 7.25% 26/10/2050	194,052	0.02	EUR 1,700,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.625% 14/9/2032*	1,832,509	0.18
COP 4,606,000,000	Colombian TES 13.25% 9/2/2033	1,388,196	0.14	EUR 1,100,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.75% 1/2/2033	1,196,923	0.12
USD 100,000	Ecopetrol 5.375% 26/6/2026*	98,546	0.01	EUR 700,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4.125% 18/9/2030	779,882	0.08
USD 100,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	73,970	0.01	EUR 100,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4.125% 14/6/2033	111,646	0.01
		4,756,755	0.48	EUR 300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4.375% 11/1/2034*	318,236	0.03
	クロアチア			EUR 2,500,000	BNP Paribas 0.5% 19/2/2028	2,458,851	0.25
EUR 630,000	Croatia Government International Bond 1.125% 4/3/2033*	565,986	0.06	GBP 100,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027*	112,285	0.01
	チェコ共和国			GBP 100,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	122,147	0.01
CZK 9,800,000	Czech Republic Government Bond 1.75% 23/6/2032	361,641	0.03	EUR 600,000	BNP Paribas 4.042% 10/1/2032*	649,469	0.07
CZK 47,990,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	1,971,565	0.20	EUR 1,500,000	BNP Paribas 4.25% 13/4/2031*	1,666,766	0.17
CZK 41,160,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	1,900,331	0.19	EUR 200,000	BNP Paribas 6.875% 6/12/2029*	222,958	0.02
		4,233,537	0.42	EUR 2,100,000	BPCE 3.5% 25/1/2028*	2,267,032	0.23
	デンマーク			EUR 200,000	BPCE 3.875% 25/1/2036	216,666	0.02
EUR 450,000	AP Moller - Maersk 3.75% 5/3/2032	485,957	0.05	EUR 2,200,000	Credit Agricole 0.375% 20/4/2028*	2,086,528	0.21
EUR 1,002,000	Carlsberg Breweries 4.25% 5/10/2033*	1,138,594	0.11	EUR 100,000	Crown European 3.375% 15/5/2025	107,930	0.01
EUR 2,219,000	Danske Bank 4.125% 10/1/2031	2,442,363	0.25	EUR 200,000	Electricite de France 3.375% 15/6/2030*	193,063	0.02
DKK 4,800,000	Denmark Government Bond 0.5% 15/11/2027	650,339	0.06	EUR 300,000	Electricite de France 3.75% 5/6/2027	326,469	0.03
DKK 4,300,000	Denmark Government Bond 4.5% 15/11/2039	778,328	0.08	EUR 400,000	Electricite de France 4.25% 25/1/2032	446,719	0.05
		5,495,581	0.55	EUR 300,000	Electricite de France 4.625% 25/1/2043*	336,327	0.03
	フィンランド			GBP 200,000	Electricite de France 6% 29/1/2026	248,318	0.03
EUR 100,000	Ahlstrom 3 Oy 3.625% 4/2/2028*	101,796	0.01	EUR 1,400,000	Engie 3.875% 6/1/2031	1,528,263	0.15
EUR 630,000	Finland Government Bond 0.125% 15/9/2031	560,176	0.05	EUR 400,000	Engie 4.5% 6/9/2042	448,114	0.05
EUR 150,000	Finland Government Bond 0.125% 15/4/2052	75,233	0.01	EUR 100,000	Forvia 3.75% 15/6/2028*	104,107	0.01
EUR 80,000	Finland Government Bond 1.375% 15/4/2047	62,721	0.01	EUR 25,000	French Republic Government Bond OAT 0% 25/3/2025	26,174	0.00
EUR 170,000	Finland Government Bond 2.625% 4/7/2042	171,875	0.02	EUR 2,449,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/5/2040	1,758,395	0.18
EUR 500,000	Finland Government Bond 3% 15/9/2033	547,078	0.05	EUR 2,720,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/6/2044	1,765,401	0.18
		1,518,879	0.15				
	フランス						
EUR 100,000	Altice France 4.25% 15/10/2029*	85,305	0.01				
USD 200,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	183,483	0.02				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 390,000	French Republic Government Bond OAT 0.5% 25/5/2072	161,950	0.02	EUR 856,000	Bayer 4.625% 26/5/2033*	934,564	0.10
EUR 4,320,000	French Republic Government Bond OAT 0.75% 25/2/2028	4,336,075	0.43	EUR 100,000	Bayer 5.375% 25/3/2082	100,562	0.01
EUR 880,000	French Republic Government Bond OAT 1.5% 25/5/2050	654,567	0.07	EUR 100,000	Bayer 7% 25/9/2083	109,144	0.01
EUR 240,000	French Republic Government Bond OAT 2% 25/5/2048	204,726	0.02	EUR 17,407,000	Bundesobligation 0% 10/10/2025*	18,032,371	1.80
EUR 2,900,000	French Republic Government Bond OAT 2.75% 25/2/2029	3,142,201	0.31	EUR 31,780,000	Bundesobligation 1.3% 15/10/2027	33,062,647	3.31
EUR 897,000	French Republic Government Bond OAT 3% 25/6/2049	927,290	0.09	EUR 3,300,000	Bundesobligation 2.4% 19/10/2028*	3,566,920	0.36
EUR 10,000	French Republic Government Bond OAT 3.25% 25/5/2045	10,804	0.00	EUR 1,150,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0% 15/8/2052	616,032	0.06
EUR 1,030,000	French Republic Government Bond OAT 3.5% 25/11/2033	1,173,550	0.12	EUR 200,000	Cheplapharm Arzneimittel 7.5% 15/5/2030	229,759	0.02
EUR 519,000	French Republic Government Bond OAT 4% 25/4/2060	642,505	0.06	EUR 100,000	Commerzbank 4.625% 17/1/2031	109,170	0.01
EUR 100,000	iliad 5.375% 15/2/2029	110,122	0.01	EUR 400,000	Commerzbank 5.25% 25/3/2029	447,554	0.05
EUR 300,000	iliad 5.625% 15/2/2030*	334,074	0.03	EUR 200,000	Commerzbank 6.125% 9/10/2025	210,096	0.02
EUR 100,000	Loxam 3.75% 15/7/2026	107,504	0.01	EUR 200,000	Commerzbank 6.5% 9/10/2029*	203,522	0.02
EUR 200,000	Orange 2.375% 15/1/2025	212,355	0.02	EUR 160,000	Deutsche Bahn Finance 4% 23/11/2043*	183,181	0.02
EUR 100,000	Paprec 7.25% 17/11/2029	115,494	0.01	EUR 700,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	707,152	0.07
EUR 200,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	212,121	0.02	GBP 100,000	Deutsche Bank 2.625% 16/12/2024	123,673	0.01
EUR 400,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	426,377	0.05	EUR 600,000	Deutsche Bank 3.25% 24/5/2028*	629,074	0.07
EUR 400,000	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR 3.75% 4/7/2035	437,799	0.04	GBP 100,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2026	123,237	0.01
EUR 2,100,000	Societe Des Grands Projets EPIC 1.125% 25/5/2034	1,855,510	0.19	EUR 100,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	103,394	0.01
GBP 100,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024	124,132	0.01	EUR 281,000	E.ON 3.75% 15/1/2036*	300,604	0.03
EUR 300,000	Teleperformance 5.75% 22/11/2031*	333,067	0.03	EUR 100,000	EnBW Energie Baden- Wuerttemberg 5.25% 23/1/2084	109,573	0.01
GBP 100,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	118,221	0.01	EUR 200,000	Eurogrid 3.279% 5/9/2031	212,047	0.02
EUR 200,000	Veolia Environnement 1.625% 1/6/2026*	201,037	0.02	EUR 1,100,000	Eurogrid 3.722% 27/4/2030	1,196,402	0.12
		37,777,398	3.78	EUR 300,000	Eurogrid 3.915% 1/2/2034	324,265	0.03
	ドイツ			EUR 167,652	FCT Autonoria DE 2023 5.014% 26/1/2043	182,411	0.02
EUR 500,000	Bayer 1.375% 6/7/2032*	427,369	0.04	EUR 100,000	Gruenenthal 3.625% 15/11/2026*	107,166	0.01
EUR 1,170,000	Bayer 4% 26/8/2026	1,268,407	0.13	EUR 100,000	HT Troplast 9.375% 15/7/2028*	112,415	0.01
EUR 100,000	Bayer 4.5% 25/3/2082*	101,609	0.01	EUR 132,456	IHO Verwaltungs 8.75% 15/5/2028*	156,222	0.02
				EUR 2,500,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0% 15/9/2028	2,389,654	0.24
				EUR 5,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.375% 23/4/2030	4,688	0.00

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 2,514,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.875% 4/7/2039	2,006,797	0.20	IDR 25,876,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	1,771,390	0.18
EUR 200,000	Merck 1.625% 25/6/2079	212,550	0.02	IDR 27,431,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	1,967,840	0.20
EUR 100,000	Red & Black Auto Germany 10 UG 5.062% 15/9/2032	109,015	0.01	IDR 6,894,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	459,966	0.04
EUR 100,000	Schaeffler 4.5% 14/8/2026	109,506	0.01	USD 350,000	Pertamina Persero 4.175% 21/1/2050	269,281	0.02
EUR 640,000	State of North Rhine- Westphalia Germany 1.65% 16/5/2047	522,588	0.05	USD 200,000	Pertamina Persero 5.625% 20/5/2043	191,073	0.02
EUR 124,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	132,824	0.01	USD 880,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.7% 6/6/2032	863,302	0.09
EUR 100,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025	67,646	0.01	USD 1,000,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 5.6% 15/11/2033*	1,038,275	0.10
EUR 200,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	222,469	0.02			12,648,196	1.26
		69,768,279	6.98		国際機関		
	香港			EUR 660,000	Asian Development Bank 1.95% 22/7/2032*	663,998	0.06
USD 200,000	Hong Kong Government International Bond 4.625% 11/1/2033	202,058	0.02	USD 2,260,000	Asian Development Bank 4.875% 26/9/2028	2,266,686	0.23
USD 200,000	Lenovo 6.536% 27/7/2032	209,197	0.02	EUR 550,000	European Investment Bank 0.25% 15/6/2040	378,452	0.04
USD 200,000	Xiaomi Best Time International 4.1% 14/7/2051	141,327	0.01	EUR 2,622,000	European Investment Bank 2.75% 28/7/2028*	2,833,245	0.28
		552,582	0.05	EUR 5,400,000	European Union 0.4% 4/2/2037	4,188,906	0.42
	ハンガリー			EUR 1,580,000	European Union 1.25% 4/2/2043	1,223,843	0.12
HUF 168,640,000	Hungary Government Bond 3% 21/8/2030	390,500	0.04	USD 3,630,000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 26/8/2030	2,887,794	0.29
HUF 257,850,000	Hungary Government Bond 6.75% 22/10/2028	731,748	0.07			14,442,924	1.44
EUR 1,315,000	Hungary Government International Bond 1.75% 5/6/2035	1,059,531	0.11		アイルランド		
		2,181,779	0.22	EUR 200,000	AIB 5.25% 9/10/2024	214,110	0.02
	インド			EUR 200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	196,242	0.02
EUR 200,000	Power Finance 1.841% 21/9/2028	192,230	0.02	EUR 500,000	Ares European CLO VII 5.442% 15/10/2030	540,581	0.05
USD 200,000	REC 3.875% 7/7/2027	189,363	0.02	EUR 255,000	Avoca CLO XXII 5.242% 15/4/2035	270,399	0.03
		381,593	0.04	EUR 200,000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2031	221,342	0.02
	インドネシア			EUR 350,000	CRH SMW Finance 4.25% 11/7/2035	390,463	0.04
USD 400,000	Indonesia Government International Bond 5.125% 15/1/2045*	389,426	0.04	EUR 318,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5.243% 22/2/2034	336,914	0.03
IDR 4,374,000,000	Indonesia Treasury Bond 5.5% 15/4/2026	274,436	0.03	EUR 250,000	CVC Cordatus Loan Fund V 5.47% 21/7/2030	268,062	0.03
IDR 7,535,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.125% 15/5/2028	474,444	0.05	EUR 150,000	Henley CLO IV 5.298% 25/4/2034	159,145	0.01
IDR 20,159,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	1,305,320	0.13	EUR 172,000	Invesco Euro CLO III 5.692% 15/7/2032	184,582	0.02
IDR 18,605,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	1,221,903	0.12	EUR 250,000	Invesco Euro CLO IV 5.642% 15/4/2033	266,895	0.03
IDR 19,728,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.5% 15/5/2038	1,333,821	0.13	EUR 500,000	Invesco Euro CLO V 7.742% 15/1/2034	534,346	0.05
IDR 17,000,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.125% 15/5/2024	1,087,719	0.11				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 990,000	Ireland Government Bond 1.7% 15/5/2037	927,682	0.09	EUR 100,000	doValue 3.375% 31/7/2026*	94,375	0.01
EUR 551,000	Ireland Government Bond 3% 18/10/2043	598,004	0.06	EUR 100,000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11.125% 15/5/2028*	117,063	0.02
GBP 400,000	CMBS 2023-1 UK 7.57% 17/8/2033	510,427	0.05	EUR 1,405,000	Eni 1% 11/10/2034*	1,146,894	0.11
EUR 499,897	Last Mile PE 2021 4.815% 17/8/2031	537,862	0.05	EUR 1,335,000	Eni 4.25% 19/5/2033	1,479,866	0.15
EUR 151,968	Last Mile PE 2021 5.115% 17/8/2031	163,032	0.02	EUR 200,000	Fiber Bidco 7.97% 15/1/2030	219,585	0.02
EUR 136,971	Last Mile PE 2021 5.515% 17/8/2031	146,952	0.02	EUR 100,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	103,819	0.01
EUR 500,000	Linde 1.375% 31/3/2031	476,244	0.05	EUR 100,000	Wireless Italiane 1.625% 21/10/2028	98,951	0.01
EUR 200,000	Linde 3.2% 14/2/2031*	215,006	0.02	EUR 260,000	Intesa Sanpaolo 0.75% 4/12/2024	275,651	0.03
EUR 1,100,000	Linde 3.375% 12/6/2029*	1,195,819	0.13	GBP 219,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030	254,271	0.02
EUR 200,000	LT Autorahoitus III 6.627% 18/12/2032	222,394	0.02	EUR 850,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.1% 1/4/2027	864,975	0.09
EUR 200,626	Lt Autorahoitus IV 4.567% 18/7/2033	218,495	0.02	EUR 2,256,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.45% 1/3/2036	1,859,498	0.19
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 6.445% 25/11/2033	265,922	0.03	EUR 2,526,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.5% 30/4/2045	1,714,985	0.17
EUR 527,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 5.57% 20/1/2033	563,737	0.06	EUR 866,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.45% 1/9/2050	676,028	0.07
EUR 999,000	RRE 5 Loan Management 5.692% 15/1/2037	1,074,817	0.11	EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.7% 1/3/2047*	4,225	0.00
EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 6.242% 15/4/2033	268,879	0.03	EUR 1,970,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.95% 1/9/2038	1,865,957	0.19
GBP 110,191	Taurus 2021-1 UK 6.52% 17/5/2031	138,419	0.01	EUR 5,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.45% 1/3/2048	4,780	0.00
GBP 99,271	Taurus 2021-1 UK 6.87% 17/5/2031	124,580	0.01	EUR 5,810,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.5% 15/1/2026	6,319,940	0.63
GBP 145,928	Taurus 2021-1 UK 7.82% 17/5/2031	183,203	0.02	EUR 270,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.85% 1/9/2049	274,728	0.03
GBP 100,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028	113,078	0.01	EUR 3,010,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4% 30/10/2031	3,353,954	0.33
EUR 158,000	Voya Euro CLO III 5.592% 15/4/2033	168,943	0.02	EUR 5,460,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.1% 1/2/2029	6,126,068	0.61
EUR 1,186,000	Voya Euro CLO IV 5.692% 15/10/2034	1,268,557	0.13	EUR 1,100,000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.35% 1/11/2033	1,248,475	0.12
		12,965,133	1.31	EUR 191,363	Koromo Italy 4.664% 26/2/2035	208,134	0.02
EUR 900,000	イタリア ASTM 1.5% 25/1/2030	832,777	0.08	EUR 200,000	Nexi 2.125% 30/4/2029*	192,718	0.02
EUR 149,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	160,578	0.02	EUR 216,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029	203,341	0.02
EUR 100,000	Azzurra Aeroporti 2.625% 30/5/2027	102,428	0.01				
EUR 100,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6.75% 5/9/2027*	113,855	0.01				
EUR 115,000	Banco BPM 3.25% 14/1/2031	121,803	0.01				
EUR 150,000	Banco BPM 6% 14/6/2028	170,188	0.02				
EUR 100,000	Cedacri Mergeco 9.401% 15/5/2028	109,128	0.01				
EUR 100,000	Cerved 9.175% 15/2/2029*	105,139	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 100,000	Telecom Italia 6.875% 15/2/2028	115,369	0.01	JPY 151,850,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.3% 20/9/2039	891,055	0.09
EUR 150,000	UniCredit 4.45% 16/2/2029	164,542	0.02	JPY 603,650,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.4% 20/6/2040	3,546,173	0.36
USD 200,000	UniCredit 7.296% 2/4/2034*	204,154	0.02	JPY 122,000,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/6/2037	777,081	0.08
		30,908,242	3.09	JPY 3,500,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.6% 20/12/2037	22,127	0.00
EUR 700,000	日本 East Japan Railway 4.389% 5/9/2043*	805,328	0.08	JPY 33,200,000	Japan Government Twenty Year Bond 0.7% 20/3/2037	214,820	0.02
USD 800,000	Japan Bank for International Cooperation 4.875% 18/10/2028	807,534	0.08	JPY 1,870,000,000	Japan Government Two Year Bond 0.005% 1/8/2025	12,495,774	1.25
JPY 100,000,000	Japan Expressway and Debt Repayment Agency 0.306% 31/3/2050	472,152	0.05	USD 200,000	Mitsubishi UFJ Financial 2.309% 20/7/2032*	164,097	0.02
JPY 674,100,000	Japan Government Five Year Bond 0.2% 20/6/2028	4,488,270	0.45	USD 200,000	Mitsubishi UFJ Financial 5.441% 22/2/2034	202,666	0.02
JPY 607,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.5% 20/3/2059	2,727,494	0.27	EUR 200,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	214,618	0.02
JPY 57,900,000	Japan Government Forty Year Bond 0.7% 20/3/2061	273,546	0.03	EUR 250,000	SoftBank 3.875% 6/7/2032*	244,637	0.03
JPY 560,000,000	Japan Government Forty Year Bond 0.8% 20/3/2058	2,830,666	0.28	USD 381,000	Takeda Pharmaceutical 2.05% 31/3/2030	320,820	0.03
JPY 121,200,000	Japan Government Forty Year Bond 0.9% 20/3/2057	638,829	0.06			51,189,772	5.13
JPY 191,800,000	Japan Government Forty Year Bond 1% 20/3/2062	998,132	0.10	USD 44,000	ジャージー Adient Global 8.25% 15/4/2031	46,346	0.01
JPY 525,000,000	Japan Government Ten Year Bond 0.1% 20/9/2031	3,405,694	0.34	USD 500,000	AGL CLO 20 8.268% 20/7/2035	501,487	0.05
JPY 154,300,000	Japan Government Ten Year Bond 0.4% 20/6/2033	1,009,069	0.10	EUR 109,000	Ardonagh Finco 6.875% 15/2/2031*	117,407	0.01
JPY 217,450,000	Japan Government Ten Year Bond 0.5% 20/3/2033	1,438,656	0.14	GBP 100,000	CPUK Finance 4.875% 28/8/2025	124,941	0.01
JPY 456,150,000	Japan Government Ten Year Bond 0.8% 20/9/2033	3,086,295	0.31	GBP 110,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	138,508	0.01
JPY 125,600,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.6% 20/9/2050	650,958	0.07	USD 500,000	Golub Capital Partners CLO 70 B 7.087% 25/10/2036	501,159	0.05
JPY 110,150,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/12/2048	601,199	0.06			1,429,848	0.14
JPY 753,500,000	Japan Government Thirty Year Bond 0.7% 20/9/2051	3,954,910	0.40		カザフスタン Kazakhstan Government International Bond 4.875% 14/10/2044*	187,535	0.02
JPY 230,200,000	Japan Government Thirty Year Bond 1.3% 20/6/2052	1,402,030	0.14	USD 200,000	Kazakhstan Government International Bond 5.125% 21/7/2025	202,000	0.02
JPY 402,900,000	Japan Government Thirty Year Bond 1.4% 20/3/2053	2,505,142	0.25			389,535	0.04
					ルクセンブルグ Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	196,654	0.02

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 100,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029*	95,694	0.01	MYR 4,420,000	マレーシア Malaysia Government Bond 4.893% 8/6/2038	1,022,265	0.10
EUR 100,000	Aroundtown 0.375% 15/4/2027	89,230	0.01	MYR 5,600,000	Malaysia Government Investment Issue 4.07% 30/9/2026	1,196,489	0.12
GBP 100,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028	122,923	0.01	MYR 5,200,000	Malaysia Government Investment Issue 4.245% 30/9/2030	1,126,843	0.11
EUR 147,000	Compartment BL Consumer Credit 2021 5.514% 25/9/2038	159,491	0.02	MYR 500,000	Malaysia Government Investment Issue 4.662% 31/3/2038	113,172	0.01
EUR 191,000	Compartment BL Consumer Credit 2021 6.714% 25/9/2038	207,284	0.02	USD 500,000	Malaysia Sukuk Global 3.179% 27/4/2026	483,624	0.05
USD 200,000	Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	196,322	0.02			3,942,393	0.39
EUR 100,000	Cullinan Holdco Scsp 8.682% 15/10/2026*	100,898	0.01		マルタ		
EUR 100,000	Dana Financing Luxembourg 8.5% 15/7/2031*	119,583	0.01	USD 11,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6.375% 1/2/2030	8,072	0.00
EUR 100,000	Ephios Subco 3 7.875% 31/1/2031	116,017	0.01	USD 55,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 9.5% 1/6/2028*	46,475	0.01
EUR 2,390,000	European Financial Stability Facility 1.75% 17/7/2053	1,887,765	0.19			54,547	0.01
EUR 640,000	European Financial Stability Facility 2.375% 21/6/2032	667,094	0.07		メキシコ		
EUR 100,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025*	85,879	0.01	MXN 600,000	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	3,149,323	0.31
EUR 31,409	Germany Compartment Consumer 2020-1 5.632% 14/11/2034	34,118	0.00	MXN 868,655	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	4,713,476	0.47
EUR 31,410	Germany Compartment Consumer 2020-1 6.382% 14/11/2034	33,944	0.00	MXN 180,000	Mexican Bonos 7.75% 23/11/2034	953,090	0.10
USD 121,000	Intelsat Jackson 6.5% 15/3/2030	113,032	0.01	MXN 500,000	Mexican Bonos 8% 24/5/2035	2,676,499	0.27
USD 174,000	Medtronic Global 4.5% 30/3/2033	168,029	0.02	MXN 61,633	Mexican Bonos 8.5% 1/3/2029	349,494	0.03
EUR 100,000	Monitchem HoldCo 3 8.75% 1/5/2028	113,903	0.01	MXN 190,000	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	1,082,079	0.11
EUR 480,000	Nestle Finance International 3.25% 23/1/2037	505,963	0.05	MXN 46,607	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	256,263	0.03
EUR 900,000	Nestle Finance International 3.375% 15/11/2034*	990,485	0.10	MXN 2,258,082	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	1,287,422	0.13
USD 200,000	Rumo Luxembourg 5.25% 10/1/2028	192,295	0.02	EUR 190,000	Mexico Government International Bond 1.35% 18/9/2027	191,642	0.02
USD 200,000	Stena International 7.25% 15/1/2031	198,819	0.02	EUR 260,000	Mexico Government International Bond 2.25% 12/8/2036*	218,637	0.02
USD 230,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	221,026	0.02	EUR 2,280,000	Mexico Government International Bond 4.49% 25/5/2032	2,493,932	0.25
USD 78,000	Telecom Italia Capital 7.2% 18/7/2036	77,554	0.01	USD 600,000	Mexico Government International Bond 4.6% 23/1/2046	477,369	0.05
EUR 400,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	428,911	0.05	USD 650,000	Mexico Government International Bond 4.875% 19/5/2033*	611,634	0.06
		7,122,913	0.72	USD 230,000	Mexico Government International Bond 6.338% 4/5/2053*	223,580	0.02
						18,684,440	1.87

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
	オランダ						
EUR 260,000	ABB Finance 3.375% 15/1/2034*	276,283	0.03	EUR 300,000	Sartorius Finance 4.5% 14/9/2032*	334,641	0.03
EUR 1,448,000	BP Capital Markets 4.323% 12/5/2035	1,639,013	0.16	EUR 1,300,000	Sartorius Finance 4.875% 14/9/2035	1,487,022	0.15
GBP 100,000	Cooperatieve Rabobank 1.875% 12/7/2028	113,670	0.01	USD 446,000	Shell International Finance 2.75% 6/4/2030	397,993	0.04
EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank 4.375% 29/6/2027*	203,424	0.02	EUR 1,500,000	Financieringsmaatschappij 3.125% 22/5/2032*	1,594,543	0.16
EUR 138,128	Domi 2023-1 5.021% 15/2/2055	151,730	0.02	USD 300,000	Suzano International Finance 5.5% 17/1/2027	300,065	0.03
EUR 125,000	Dutch Property Finance 2020-5.275% 28/1/2058	135,939	0.01	EUR 500,000	Telefonica Europe 4.375% 14/12/2024	541,650	0.06
EUR 178,000	Dutch Property Finance 2021-5.025% 28/7/2058	192,990	0.02	EUR 200,000	Telefonica Europe 6.135% 3/2/2030	220,397	0.02
EUR 710,000	EnBW International Finance 4.3% 23/5/2034	792,980	0.08	EUR 200,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	198,273	0.02
EUR 300,000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	321,897	0.03	EUR 100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029*	119,010	0.01
EUR 100,000	Heimstaden Bostad Treasury 1.375% 3/3/2027	92,533	0.01	USD 200,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	195,166	0.02
EUR 1,487,000	IMCD 4.875% 18/9/2028*	1,662,041	0.17	EUR 100,000	United 6.75% 15/2/2031*	109,908	0.01
GBP 100,000	ING Groep 3% 18/2/2026*	121,290	0.01	EUR 570,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	582,434	0.06
USD 200,000	ING Groep 6.5% 16/4/2025	196,844	0.02	EUR 2,275,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	2,176,234	0.22
EUR 390,000	JDE Peet's 4.5% 23/1/2034	430,990	0.04	EUR 200,000	Volkswagen International Finance 3.875% 17/6/2029	196,962	0.02
EUR 100,000	Koninklijke KPN 2% 8/11/2024*	106,304	0.01	EUR 100,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032	97,101	0.01
EUR 100,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2024*	108,493	0.01	EUR 150,000	VZ Vendor Financing II 2.875% 15/1/2029	141,705	0.02
EUR 1,110,000	Netherlands Government Bond 0% 15/7/2030	1,019,113	0.10	EUR 200,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	207,144	0.02
EUR 1,620,000	Netherlands Government Bond 0.25% 15/7/2029	1,551,318	0.16	USD 200,000	Ziggo 4.875% 15/1/2030	178,393	0.02
EUR 693,000	Netherlands Government Bond 2.75% 15/1/2047	745,075	0.07			22,671,293	2.27
EUR 1,040,000	Netherlands Government Bond 4% 15/1/2037	1,269,919	0.13		ニュージーランド		
USD 785,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	705,021	0.07	EUR 1,783,000	Chorus 3.625% 7/9/2029	1,913,796	0.19
USD 227,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	216,956	0.02	NZD 1,000,000	New Zealand Government Bond 4.25% 15/5/2034	586,653	0.06
USD 207,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	200,346	0.02	NZD 555,000	New Zealand Government Bond 4.5% 15/4/2027	337,755	0.03
EUR 100,000	OI European 6.25% 15/5/2028*	113,018	0.01	NZD 1,000,000	New Zealand Government Bond 4.5% 15/5/2030	608,164	0.06
USD 460,000	Prosus 4.987% 19/1/2052*	337,440	0.03			3,446,368	0.34
EUR 200,000	Q-Park I 5.942% 1/3/2026	218,313	0.02		ノルウェー		
EUR 100,000	Repsol International Finance 4.247% 11/9/2028	105,265	0.01	EUR 1,300,000	Equinor 1.375% 22/5/2032	1,208,110	0.12
EUR 500,000	REWE International Finance 4.875% 13/9/2030	564,447	0.06	NOK 6,650,000	Norway Government Bond 1.75% 17/2/2027	590,217	0.06
				NOK 13,000,000	Norway Government Bond 3% 15/8/2033	1,145,500	0.11
				EUR 100,000	Var Energi 7.862% 15/11/2083	114,324	0.01
						3,058,151	0.30

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 1,135,000	パナマ Panama Government International Bond 3.298% 19/1/2033*	857,776	0.09	EUR 200,000	ポルトガル EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	208,360	0.02
USD 400,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	362,900	0.04	EUR 610,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.95% 15/6/2029	637,366	0.06
USD 200,000	Panama Government International Bond 4.5% 15/5/2047*	133,577	0.01	EUR 1,570,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.125% 17/10/2028	1,663,905	0.17
		1,354,253	0.14	EUR 357,000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.1% 15/4/2037*	419,389	0.04
USD 460,000	ペルー Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031*	390,754	0.04			2,929,020	0.29
USD 600,000	Peruvian Government International Bond 2.844% 20/6/2030	524,379	0.05	USD 500,000	カタール Qatar Government International Bond 3.25% 2/6/2026	484,375	0.05
USD 260,000	Peruvian Government International Bond 3% 15/1/2034*	211,087	0.02	USD 280,000	Qatar Government International Bond 3.75% 16/4/2030	268,100	0.02
PEN 2,871,000	Peruvian Government International Bond 6.95% 12/8/2031	779,995	0.08	USD 200,000	Qatar Government International Bond 4.625% 2/6/2046*	182,575	0.02
		1,906,215	0.19	USD 200,000	Qatar Government International Bond 5.103% 23/4/2048	192,951	0.02
USD 500,000	フィリピン Philippine Government International Bond 3.7% 1/3/2041*	408,873	0.04			1,128,001	0.11
USD 200,000	Philippine Government International Bond 5.95% 13/10/2047	212,937	0.02	RON 1,870,000	ルーマニア Romania Government Bond 4.15% 26/1/2028*	381,041	0.04
		621,810	0.06	EUR 2,530,000	Romanian Government International Bond 2.375% 19/4/2027*	2,597,619	0.26
PLN 5,930,000	ポーランド Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2026	1,410,015	0.14			2,978,660	0.30
PLN 3,300,000	Republic of Poland Government Bond 2.5% 25/7/2027	766,730	0.08	USD 270,000	サウジアラビア Saudi Government International Bond 3.25% 22/10/2030	243,000	0.02
PLN 11,072,000	Republic of Poland Government Bond 2.75% 25/10/2029*	2,470,256	0.25	USD 770,000	Saudi Government International Bond 3.45% 2/2/2061*	502,506	0.05
PLN 640,000	Republic of Poland Government Bond 6% 25/10/2033	168,935	0.02	USD 400,000	Saudi Government International Bond 3.625% 4/3/2028	381,200	0.04
EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.375% 22/10/2027	514,503	0.05	USD 400,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030*	388,810	0.04
EUR 500,000	Republic of Poland Government International Bond 1.5% 9/9/2025	528,683	0.05			1,515,516	0.15
USD 500,000	Republic of Poland Government International Bond 3.25% 6/4/2026*	486,852	0.05	USD 315,000	シンガポール Pfizer Investment Enterprises 5.3% 19/5/2053	309,189	0.03
		6,345,974	0.64	USD 1,432,000	Pfizer Investment Enterprises 5.34% 19/5/2063*	1,381,138	0.14
				SGD 830,000	Singapore Government Bond 2.625% 1/8/2032	597,216	0.06
				SGD 700,000	Singapore Government Bond 2.75% 1/4/2042	500,305	0.05

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
SGD 1,050,000	Singapore Government Bond 3.5% 1/3/2027	790,594	0.08		スペイン		
		3,578,442	0.36	EUR 50,911	Autonoria Spain 2021 FT 7.764% 31/1/2039	54,352	0.00
	スロバキア			EUR 74,237	Autonoria Spain 2022 FT 6.664% 27/1/2040	81,642	0.01
EUR 580,000	Slovakia Government Bond 0.75% 9/4/2030	539,205	0.05	EUR 76,438	Autonoria Spain 2022 FT 10.864% 29/1/2040	86,545	0.01
EUR 530,000	Slovakia Government Bond 3.625% 8/6/2033	574,207	0.06		Banco de Credito Social Cooperativo 1.75% 9/3/2028	99,342	0.01
		1,113,412	0.11	EUR 100,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	105,479	0.01
	スロベニア			EUR 400,000	Banco de Sabadell 4% 15/1/2030	433,001	0.04
EUR 110,000	Slovenia Government Bond 1.75% 3/11/2040*	94,068	0.01	EUR 100,000	Banco de Sabadell 5.25% 7/2/2029	111,613	0.01
EUR 520,000	Slovenia Government Bond 3.625% 11/3/2033	581,697	0.06	EUR 100,000	Banco de Sabadell 5.5% 8/9/2029	112,989	0.01
		675,765	0.07	GBP 300,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	364,503	0.04
	南アフリカ			EUR 800,000	Banco Santander 3.5% 9/1/2030	850,427	0.09
ZAR 15,561,000	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031	669,392	0.07	EUR 200,000	CaixaBank 5.25% 23/3/2026*	205,086	0.02
ZAR 23,248,831	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030*	1,099,663	0.11	EUR 100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	98,220	0.01
ZAR 3,520,484	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044	133,607	0.01	EUR 400,000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	367,416	0.04
ZAR 17,769,139	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	710,600	0.07	EUR 100,000	Cellnex Telecom 1% 20/4/2027	99,263	0.01
ZAR 36,981,813	Republic of South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026*	2,001,866	0.20	EUR 896,000	EDP Servicios Financieros Espana 4.375% 4/4/2032*	1,015,523	0.10
		4,615,128	0.46	EUR 100,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027	108,491	0.01
	韓国			EUR 30,888	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5.888% 21/3/2033	33,469	0.00
USD 600,000	Korea International Bond 2.75% 19/1/2027	569,262	0.06	EUR 100,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	107,001	0.01
KRW 743,530,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2025	539,191	0.05	EUR 3,808,000	Spain Government Bond 0.1% 30/4/2031	3,349,785	0.33
KRW 2,190,680,000	Korea Treasury Bond 1.125% 10/9/2039	1,200,046	0.12	EUR 1,030,000	Spain Government Bond 0.5% 31/10/2031*	920,074	0.09
KRW 2,686,940,000	Korea Treasury Bond 1.25% 10/3/2026	1,934,559	0.19	EUR 730,000	Spain Government Bond 0.7% 30/4/2032	656,150	0.07
KRW 3,290,120,000	Korea Treasury Bond 1.5% 10/3/2025	2,422,663	0.24	EUR 3,421,000	Spain Government Bond 0.85% 30/7/2037	2,656,125	0.27
KRW 4,904,750,000	Korea Treasury Bond 1.875% 10/6/2029	3,416,897	0.34	EUR 1,013,000	Spain Government Bond 1% 31/10/2050	591,818	0.06
KRW 1,200,000,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2046	708,882	0.07	EUR 212,000	Spain Government Bond 2.35% 30/7/2033*	213,617	0.02
KRW 1,702,290,000	Korea Treasury Bond 2% 10/3/2049	992,621	0.10	EUR 1,400,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	1,364,167	0.14
KRW 420,000,000	Korea Treasury Bond 2.125% 10/3/2047	253,215	0.03	EUR 5,980,000	Spain Government Bond 3.55% 31/10/2033	6,634,462	0.66
KRW 2,169,270,000	Korea Treasury Bond 2.25% 10/12/2025	1,596,620	0.16	EUR 28,000	Spain Government Bond 5.15% 31/10/2044	36,439	0.00
KRW 530,000,000	Korea Treasury Bond 2.375% 10/9/2038	351,856	0.04	EUR 400,000	Telefonica Emisiones 4.055% 24/1/2036	431,873	0.04
KRW 1,552,320,000	Korea Treasury Bond 3.25% 10/6/2033	1,150,046	0.12				
KRW 17,854,400,000	Korea Treasury Bond 3.625% 10/9/2025	13,438,610	1.34				
USD 200,000	POSCO 2.75% 15/7/2024	198,312	0.02				
		28,772,780	2.88				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
GBP 200,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026*	254,103	0.03		アラブ首長国連邦		
		21,442,975	2.14	USD 500,000	Abu Dhabi Commercial Bank 4.5% 14/9/2027	490,000	0.05
	スウェーデン				Abu Dhabi Government International Bond	613,522	0.06
EUR 100,000	Fastighets Balder 1.125% 29/1/2027*	96,133	0.01	USD 670,000	3.125% 16/4/2030		
EUR 350,000	Stadshypotek 0.5% 11/7/2025	364,573	0.03	USD 760,000	Abu Dhabi Government International Bond	631,503	0.07
SEK 11,000,000	Stadshypotek 1.5% 1/3/2024	1,065,854	0.11		4.125% 11/10/2047*		
GBP 100,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	113,622	0.01			1,735,025	0.18
SEK 4,110,000	Sweden Government Bond 0.75% 12/5/2028*	369,017	0.04		英国		
SEK 12,000,000	Sweden Government Bond 1.75% 11/11/2033	1,087,451	0.11	USD 2,152,000	Anglo American Capital 4% 11/9/2027	2,051,314	0.21
SEK 2,300,000	Sweden Government Bond 3.5% 30/3/2039	245,565	0.02	EUR 1,799,000	Anglo American Capital 4.75% 21/9/2032*	2,033,985	0.20
		3,342,215	0.33	GBP 277,341	Atlas Funding 2023-1 6.348% 20/1/2061	353,571	0.04
	スイス			GBP 100,000	Atlas Funding 2023-1 7.098% 20/1/2061	127,867	0.01
CHF 1,420,000	Swiss Confederation Government Bond 0% 26/6/2034	1,482,560	0.15	EUR 200,000	Barclays 1.106% 12/5/2032	175,453	0.02
CHF 460,000	Swiss Confederation Government Bond 0.25% 23/6/2035	490,001	0.05	USD 259,000	Barclays 2.894% 24/11/2032	211,147	0.02
CHF 200,000	Swiss Confederation Government Bond 2% 25/6/2064	330,700	0.03	GBP 100,000	Barclays 3% 8/5/2026	120,274	0.01
CHF 2,780,000	Swiss Confederation Government Bond 3.5% 8/4/2033	3,900,193	0.39	GBP 100,000	Barclays 3.25% 12/2/2027*	118,458	0.01
EUR 400,000	UBS 1.25% 17/4/2025*	432,648	0.04	EUR 1,600,000	Barclays 4.918% 8/8/2030*	1,788,666	0.18
USD 200,000	UBS 2.095% 11/2/2032	158,151	0.02	EUR 1,024,000	Barclays 5.262% 29/1/2034	1,172,197	0.12
USD 429,000	UBS 2.746% 11/2/2033	346,332	0.03	USD 253,000	Barclays 5.746% 9/8/2033	251,184	0.03
USD 966,000	UBS 3.091% 14/5/2032	814,048	0.08	USD 321,000	Barclays 6.224% 9/5/2034*	326,029	0.03
USD 564,000	UBS 3.75% 26/3/2025	552,995	0.06	GBP 1,060,000	Barclays 7.09% 6/11/2029*	1,406,836	0.14
USD 3,159,000	UBS 6.246% 22/9/2029*	3,254,082	0.33	USD 200,000	Barclays 9.625% 15/12/2029	207,554	0.02
USD 655,000	UBS 6.537% 12/8/2033	686,832	0.07	GBP 200,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	244,811	0.02
USD 250,000	UBS 9.016% 15/11/2033	301,071	0.03	EUR 1,600,000	BG Energy Capital 2.25% 21/11/2029	1,623,027	0.16
		12,749,613	1.28	GBP 200,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	253,640	0.03
	タイ			EUR 634,000	BP Capital Markets 2.822% 7/4/2032*	649,451	0.07
USD 200,000	Bangkok Bank 3.733% 25/9/2034	177,701	0.02	EUR 100,000	BP Capital Markets 3.25% 22/3/2026	104,909	0.01
USD 200,000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025*	194,493	0.02	GBP 194,524	Brants Bridge 2023-1 6.12% 14/6/2066	247,035	0.03
THB 12,800,000	Thailand Government Bond 1.585% 17/12/2035	318,551	0.03		British		
THB 149,400,000	Thailand Government Bond 2.4% 17/3/2029	4,195,819	0.42	EUR 972,000	Telecommunications 4.25% 6/1/2033	1,077,339	0.11
THB 25,320,000	Thailand Government Bond 2.875% 17/6/2046	680,890	0.07		British		
THB 10,510,000	Thailand Government Bond 3.3% 17/6/2038	309,665	0.03	GBP 100,000	Telecommunications 8.375% 20/12/2083*	133,577	0.01
THB 25,820,000	Thailand Government Bond 3.35% 17/6/2033	766,752	0.08	GBP 115,000	Canada Square Funding 6 6.671% 17/1/2059	143,821	0.02
USD 200,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050*	140,607	0.01	GBP 130,000	Canada Square Funding 6 7.071% 17/1/2059	160,081	0.02
		6,784,478	0.68				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
EUR 350,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	351,327	0.04	EUR 200,000	Lloyds Banking 4.947% 27/6/2025*	211,290	0.02
GBP 110,000	CMF 2020-1 6.199% 16/1/2057	139,557	0.01	GBP 139,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	160,560	0.02
GBP 100,000	Dowson 2022-2 10.448% 20/8/2029	128,302	0.01	GBP 50,000	Mitchells & Butlers Finance 7.584% 15/6/2036	52,000	0.01
EUR 100,000	EC Finance 3% 15/10/2026	105,321	0.01	EUR 703,000	Mobico 4.875% 26/9/2031	752,869	0.08
GBP 221,611	Friary No 8 5.771% 21/10/2071	281,948	0.03	GBP 100,000	Mortimer BTL 2021-1 6.671% 23/6/2053	125,408	0.01
GBP 500,000	Funding VI 6.598% 15/7/2026	636,102	0.07	EUR 480,000	Motability Operations 3.875% 24/1/2034	520,870	0.05
GBP 100,000	Funding VI 8.298% 15/7/2026	127,610	0.01	EUR 234,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	245,975	0.02
GBP 100,000	Gemgarto 2021-1 6.521% 16/12/2067	126,438	0.01	GBP 200,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/6/2027*	234,952	0.02
GBP 160,000	Gemgarto 2023-1 6.688% 16/12/2073	204,929	0.02	GBP 100,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	121,545	0.01
GBP 179,437	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	205,528	0.02	GBP 100,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	120,517	0.01
GBP 181,000	Harben Finance 6.371% 28/9/2055	225,606	0.02	GBP 128,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6.748% 15/3/2029	162,268	0.02
GBP 179,000	Harben Finance 6.721% 28/9/2055	220,283	0.02	GBP 136,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.548% 15/11/2029	172,713	0.02
GBP 200,000	Heathrow Finance 3.875%1/3/2027	239,627	0.02	GBP 100,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 10.198% 15/7/2030	131,089	0.01
GBP 100,000	Hermitage 2023 7.648% 21/9/2033	129,109	0.01	EUR 38,041	Paragon Mortgages No 12 4.381% 15/11/2038	39,411	0.00
GBP 99,996	Hops Hill No 1 7.048% 27/5/2054	127,222	0.01	GBP 396,027	Parkmore Point RMBS 2022- 1 6.721% 25/7/2045	503,883	0.05
GBP 99,997	Hops Hill No 1 7.548% 27/5/2054	127,000	0.01	GBP 100,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025	124,376	0.01
GBP 100,000	Hops Hill No2 7.448% 27/11/2054	129,136	0.01	GBP 100,000	Pinnacle Bidco 10% 11/10/2028	133,539	0.01
GBP 100,000	Hops Hill No2 8.048% 27/11/2054	129,420	0.01	GBP 226,000	PMF 2024-1 6.185% 16/7/2060	287,038	0.03
GBP 1,604,000	HSBC 1.75% 24/7/2027*	1,858,785	0.19	GBP 100,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	121,029	0.01
EUR 3,242,000	HSBC 4.752% 10/3/2028*	3,596,842	0.36	GBP 100,000	Residential Mortgage 32 7.421% 20/6/2070	127,043	0.01
EUR 1,620,000	HSBC 4.856% 23/5/2033	1,842,597	0.18	GBP 150,000	Sage AR Funding No 1 7.37% 17/11/2030	184,307	0.02
GBP 740,000	HSBC 6.8% 14/9/2031	990,050	0.10	GBP 100,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026*	122,143	0.01
EUR 100,000	INEOS Finance 6.375% 15/4/2029	108,857	0.01	EUR 3,470,000	Standard Chartered 0.8% 17/11/2029	3,256,614	0.33
EUR 100,000	INEOS Quattro Finance 2 8.5% 15/3/2029	113,858	0.01	EUR 1,316,000	Standard Chartered 4.874% 10/5/2031	1,479,742	0.15
EUR 118,000	Informa 2.125% 6/10/2025	124,278	0.01	GBP 308,983	Together Asset Backed Securitisation 2023- 1ST2 6.428% 20/4/2065	394,494	0.04
GBP 100,000	Informa 3.125% 5/7/2026	120,278	0.01				
GBP 358,000	Jupiter Mortgage NO 1 6.189% 20/7/2055	454,388	0.05				
GBP 130,000	Jupiter Mortgage NO 1 7.439% 20/7/2055	166,090	0.02				
GBP 100,000	Jupiter Mortgage NO 1 8.189% 20/7/2055	126,869	0.01				
GBP 140,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7.47% 12/6/2057	177,859	0.02				
GBP 200,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	248,202	0.03				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
GBP 124,000	Tower Bridge Funding 2021- 1 7.071% 21/7/2064	157,357	0.02	USD 870,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	763,840	0.08
GBP 106,000	Tower Bridge Funding 2021- 1 7.371% 21/7/2064	134,454	0.01	USD 820,000	280 Park Avenue 2017- 280P Mortgage Trust 7.158% 15/9/2034	772,415	0.08
GBP 246,563	Tower Bridge Funding 2022- 1 5.941% 20/12/2063	312,618	0.03	USD 4,640,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	4,255,217	0.43
GBP 100,000	Tower Bridge Funding 2024- 1 9.188% 20/1/2066	129,620	0.01	USD 285,000	AbbVie 5.05% 15/3/2034	286,690	0.03
GBP 115,000	Twin Bridges 2020-1 7.47% 12/12/2054	146,146	0.02	USD 75,000	AbbVie 5.4% 15/3/2054	76,177	0.01
GBP 125,000	Twin Bridges 2020-1 8.22% 12/12/2054	158,836	0.02	USD 25,000	AdaptHealth 4.625% 1/8/2029	20,805	0.00
GBP 138,000	Twin Bridges 2021-1 6.82% 12/3/2055	174,821	0.02	USD 25,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.25% 15/3/2026	23,758	0.00
GBP 100,000	Twin Bridges 2021-1 7.32% 12/3/2055	125,507	0.01	USD 25,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028	25,152	0.00
GBP 100,000	Twin Bridges 2022-2 7.22% 12/6/2055	128,307	0.01	USD 15,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	14,613	0.00
GBP 437,945	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	550,831	0.06	USD 25,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4.25% 15/10/2027	23,156	0.00
GBP 2,780,000	United Kingdom Gilt 0.875% 31/7/2033	2,642,181	0.26	USD 110,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6.75% 15/4/2028	109,260	0.01
GBP 840,000	United Kingdom Gilt 0.875% 31/1/2046	525,507	0.05	USD 191,000	Allied Universal Holdco 7.875% 15/2/2031	189,558	0.02
GBP 2,170,000	United Kingdom Gilt 1.125% 22/10/2073*	1,002,818	0.10	USD 823,307	Alternative Loan Trust 2005-76 5.955% 25/1/2046	710,217	0.07
GBP 1,140,000	United Kingdom Gilt 1.5% 31/7/2053	734,822	0.07	USD 794,000	Amazon.com 2.5% 3/6/2050	501,495	0.05
GBP 1,460,000	United Kingdom Gilt 1.625% 22/10/2028*	1,664,713	0.17	USD 419,000	Amazon.com 4.7% 1/12/2032	417,363	0.04
GBP 1,998,000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/1/2049	1,480,845	0.15	USD 95,000	AMC Networks 4.25% 15/2/2029	61,600	0.01
GBP 2,370,000	United Kingdom Gilt 3.5% 22/10/2025	2,952,370	0.30	USD 14,250	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	14,126	0.00
GBP 1,760,000	United Kingdom Gilt 4.5% 7/6/2028*	2,260,124	0.23	USD 25,000	American Airlines/AAdvantage Loyalty IP 5.75% 20/4/2029	24,449	0.00
USD 200,000	Vmed 02 UK Financing I 4.25% 31/1/2031	169,695	0.02	USD 32,000	American Axle & Manufacturing 5% 1/10/2029	27,749	0.00
GBP 300,000	Vmed 02 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	314,971	0.03	USD 271,000	American Express 4.42% 3/8/2033	257,308	0.03
EUR 450,000	Vodafone 3% 27/8/2080*	434,973	0.05	USD 1,196,918	American Homes 4 Rent 2015-SFR2 Trust 3.732% 17/10/2052	1,165,539	0.12
		54,532,835	5.47	EUR 640,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	627,741	0.06
	米国			EUR 775,000	American Tower 0.875% 21/5/2029	722,125	0.07
USD 881,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 3.901% 10/8/2035	848,880	0.08				
USD 750,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 4.142% 10/8/2035	695,267	0.07				
USD 840,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015- 1211 4.142% 10/8/2035	795,713	0.08				
USD 613,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	501,116	0.05				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 736,000	American Tower 2.1% 15/6/2030	607,613	0.06	USD 15,000	Avis Budget Car Rental / Avis Budget Finance 4.75% 1/4/2028	13,621	0.00
USD 1,210,000	American Tower 2.3% 15/9/2031	978,175	0.10	USD 11,000	Avis Budget Car Rental / Avis Budget Finance 5.375% 1/3/2029	10,030	0.00
USD 125,000	American Tower 4.05% 15/3/2032	113,743	0.01	USD 25,000	Avis Budget Car Rental / Avis Budget Finance 8% 15/2/2031	24,216	0.00
USD 25,000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9.375% 1/6/2028	25,343	0.00	USD 25,000	Ball 5.25% 1/7/2025	25,007	0.00
USD 774,000	Amgen 2% 15/1/2032	622,351	0.06	USD 96,000	Ball 6.875% 15/3/2028	98,426	0.01
USD 2,092,000	Amgen 2.45% 21/2/2030	1,819,130	0.18	USD 505,000	Baltimore Gas and Electric 5.4% 1/6/2053	497,596	0.05
GBP 645,000	Amgen 4% 13/9/2029	780,112	0.08	USD 450,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015- 200P 3.596% 14/4/2033	417,493	0.04
USD 2,545,000	Amgen 5.25% 2/3/2030	2,568,048	0.26	USD 922,024	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018- DSNY 7.315% 15/9/2034	913,187	0.09
GBP 100,000	Amgen 5.5% 7/12/2026	128,374	0.01	EUR 2,333,000	Bank of America 0.654% 26/10/2031	2,057,131	0.21
USD 25,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.375% 15/6/2029	23,858	0.00	EUR 375,000	Bank of America 0.694% 22/3/2031	337,503	0.03
USD 70,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 6.625% 1/2/2032	69,817	0.01	USD 99,000	Bank of America 0.981% 25/9/2025	96,424	0.01
USD 343,000	Aon / Aon Global 2.6% 2/12/2031	285,643	0.03	EUR 400,000	Bank of America 1.776% 4/5/2027*	415,074	0.04
USD 94,000	Aon / Aon Global 5% 12/9/2032	91,909	0.01	USD 2,589,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	2,091,721	0.21
USD 25,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	24,008	0.00	USD 128,000	Bank of America 2.299% 21/7/2032	103,791	0.01
USD 25,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	24,401	0.00	EUR 506,000	Bank of America 2.824% 27/4/2033	506,611	0.05
EUR 200,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	189,071	0.02	USD 1,080,000	Bank of America 2.972% 4/2/2033	909,449	0.09
USD 333,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	288,777	0.03	USD 1,706,000	Bank of America 3.194% 23/7/2030	1,537,938	0.16
USD 1,104,000	AREIT 2022-CRE7 7.562% 17/6/2039	1,099,360	0.11	EUR 2,155,000	Bank of America 4.134% 12/6/2028*	2,374,095	0.24
USD 15,000	Asbury Automotive 4.625% 15/11/2029	13,685	0.00	USD 889,000	Bank of America 4.271% 23/7/2029	854,833	0.09
USD 297,000	Astrazeneca Finance 2.25% 28/5/2031	250,203	0.03	USD 98,000	Bank of America 5.015% 22/7/2033	95,585	0.01
USD 1,164,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	1,083,286	0.11	USD 2,171,000	Bank of America 5.202% 25/4/2029	2,162,662	0.22
EUR 349,000	AT&T 2.35% 5/9/2029	354,896	0.04	USD 70,000	Bath & Body Works 6.625% 1/10/2030	70,485	0.01
EUR 170,000	AT&T 2.45% 15/3/2035	159,586	0.02	USD 496,000	Bayer US Finance 6.5% 21/11/2033	498,133	0.05
USD 1,048,000	AT&T 2.55% 1/12/2033*	829,785	0.08	USD 1,295,134	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.84% 25/4/2036	1,188,418	0.12
GBP 200,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	238,914	0.02	USD 414,025	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6.11% 25/9/2037	382,505	0.04
USD 1,132,000	AT&T 3.65% 1/6/2051	814,082	0.08	USD 2,035,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.237% 15/3/2037	1,938,941	0.19
USD 815,000	AT&T 3.65% 15/9/2059	555,317	0.06	USD 200,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.486% 15/3/2037	184,412	0.02
EUR 1,339,000	AT&T 3.95% 30/4/2031*	1,474,357	0.15				
EUR 580,000	AT&T 4.3% 18/11/2034*	645,402	0.07				
GBP 708,000	AT&T 4.375% 14/9/2029	863,402	0.09				
USD 220,000	AT&T 5.4% 15/2/2034	220,675	0.02				
GBP 200,000	AT&T 5.5% 15/3/2027	255,146	0.03				
USD 25,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	23,575	0.00				
USD 22,000	Avient 7.125% 1/8/2030	22,474	0.00				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 549,995	BDS 2022-FL12 7.452% 19/8/2038	546,492	0.05	USD 25,000	CCO / CCO Capital 4.5% 1/5/2032	19,795	0.00
USD 1,182,119	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 5.755% 25/1/2047	948,771	0.09	USD 169,000	CCO / CCO Capital 4.75% 1/3/2030	143,915	0.01
EUR 200,000	Belden 3.875% 15/3/2028*	211,535	0.02	USD 25,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	23,648	0.00
USD 416,000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 4.295% 10/4/2051	359,108	0.04	USD 210,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	189,784	0.02
USD 655,682	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust 4.57% 15/7/2051	597,765	0.06	USD 37,000	CenterPoint Energy Houston Electric 3.95% 1/3/2048	30,049	0.00
USD 25,000	Block 2.75% 1/6/2026	23,289	0.00	USD 711,000	CenterPoint Energy Houston Electric 5.3% 1/4/2053	707,310	0.07
EUR 150,000	Booking 4% 1/3/2044	161,157	0.02	USD 25,000	Charles River Laboratories International 3.75% 15/3/2029	22,586	0.00
EUR 600,000	Booking 4.5% 15/11/2031	685,197	0.07	USD 33,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	27,857	0.00
EUR 200,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025*	215,749	0.02	USD 335,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.85% 1/4/2061	194,620	0.02
USD 455,000	Bristol-Myers Squibb 5.1% 22/2/2031	456,706	0.05	USD 756,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.95% 30/6/2062	449,260	0.05
USD 205,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	171,461	0.02	USD 23,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.4% 1/4/2033	20,152	0.00
USD 159,000	Broadcom 3.137% 15/11/2035	126,412	0.01	USD 164,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.8% 1/3/2050	119,476	0.01
USD 1,042,000	Broadcom 3.419% 15/4/2033	890,732	0.09	USD 374,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5.375% 1/5/2047	295,818	0.03
USD 834,000	Broadcom 3.469% 15/4/2034	704,127	0.07	EUR 200,000	Chemours 4% 15/5/2026*	199,701	0.02
USD 217,000	Broadcom 4% 15/4/2029	205,967	0.02	USD 49,000	Chemours 4.625% 15/11/2029	40,934	0.00
USD 558,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030*	523,062	0.05	USD 3,419	CHL Mortgage Pass- Through Trust 2004-29 5.705% 25/2/2035	3,125	0.00
USD 289,000	Broadcom 4.15% 15/4/2032	265,871	0.03	USD 25,000	CHS/Community Health Systems 4.75% 15/2/2031	18,958	0.00
USD 15,000	Builders FirstSource 6.375% 15/6/2032	15,015	0.00	USD 155,000	CHS/Community Health Systems 5.25% 15/5/2030	123,347	0.01
USD 756,000	Burlington Northern Santa Fe 3.05% 15/2/2051	517,484	0.05				
USD 440,000	BXP Trust 2017-GM 3.379% 13/6/2039	408,127	0.04				
USD 1,220,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	1,108,410	0.11				
USD 730,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	657,697	0.07				
USD 25,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	22,995	0.00				
USD 543,000	Cameron LNG 3.302% 15/1/2035	450,201	0.05				
USD 280,000	Cameron LNG 3.402% 15/1/2038	230,249	0.03				
EUR 200,000	Carrier Global 4.5% 29/11/2032	227,482	0.02				
EUR 200,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	209,218	0.02				
USD 180,000	CCO / CCO Capital 4.25% 1/2/2031	145,061	0.01				
USD 169,000	CCO / CCO Capital 4.5% 15/8/2030	140,542	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 25,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	22,883	0.00	USD 716,000	Comcast 4.25% 15/1/2033	672,687	0.07
USD 25,000	CHS/Community Health Systems 8% 15/3/2026	24,807	0.00	USD 1,837,717	COMM 2015-CCRE27 Mortgage Trust 4.337% 10/10/2048	1,751,307	0.18
USD 895,000	Cisco Systems 4.95% 26/2/2031	897,633	0.09	USD 635,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3.829% 10/2/2048	594,605	0.06
GBP 200,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	231,659	0.02	USD 584,000	Commonwealth Edison 5.3% 1/2/2053	564,662	0.06
USD 135,000	Citigroup 2.561% 1/5/2032	111,387	0.01	USD 25,000	Compass Diversified 5.25% 15/4/2029	23,540	0.00
USD 136,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	115,348	0.01	USD 4,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	4,051	0.00
USD 210,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	180,471	0.02	USD 170,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	149,157	0.02
USD 130,000	Citigroup 2.976% 5/11/2030	114,948	0.01	USD 1,095,000	Credit Suisse USA 7.125% 15/7/2032	1,224,978	0.12
USD 278,000	Citigroup 3.057% 25/1/2033	233,975	0.02	USD 25,000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4.75% 1/2/2026	24,467	0.00
USD 246,000	Citigroup 3.785% 17/3/2033	218,175	0.02	USD 122,000	Crown Castle 2.5% 15/7/2031	100,097	0.01
USD 124,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	116,424	0.01	USD 148,000	Crown Castle 3.1% 15/11/2029	131,312	0.01
USD 289,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	273,422	0.03	USD 872,000	Crown Castle 3.3% 1/7/2030	770,135	0.08
USD 941,000	Citigroup 4.91% 24/5/2033*	902,471	0.09	USD 25,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	24,861	0.00
USD 1,195,000	Citigroup 5.174% 13/2/2030	1,183,987	0.12	USD 351,000	CSAIL 2015-C4 Commercial Mortgage Trust 3.555% 15/11/2048	313,424	0.03
USD 708,000	Citigroup 6.031% 30/10/2024	708,904	0.07	USD 220,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 3.458% 15/11/2050	199,915	0.02
USD 1,117,000	Citigroup 6.27% 17/11/2033*	1,174,403	0.12	USD 885,000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 4.878% 15/11/2051	822,487	0.08
USD 204,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 3.176% 10/8/2049	180,271	0.02	USD 200,000	CSC 4.5% 15/11/2031	148,627	0.02
USD 915,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5 4.408% 10/6/2051	867,476	0.09	USD 200,000	CSC 5.5% 15/4/2027	179,725	0.02
USD 219,733	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-FX1 7.275% 25/10/2036	122,179	0.01	USD 544,000	CSX 4.1% 15/11/2032	509,045	0.06
USD 446,591	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A5 6% 25/5/2037	397,145	0.04	USD 307,000	CVS Health 4.3% 25/3/2028	298,208	0.03
USD 25,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.75% 15/5/2028	25,312	0.00	USD 1,279,000	CVS Health 5.125% 20/7/2045	1,166,761	0.12
USD 92,000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	96,135	0.01	USD 291,472	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-25 5.575% 25/6/2037	268,459	0.03
USD 85,000	Cleveland-Cliffs 6.75% 15/4/2030	84,787	0.01	USD 65,000	DaVita 3.75% 15/2/2031	53,156	0.01
USD 712,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	662,267	0.07	USD 26,000	DaVita 4.625% 1/6/2030	22,886	0.00
EUR 1,400,000	Comcast 0.75% 20/2/2032	1,239,996	0.12	USD 700,000	DBUBS 2017-BRBR Mortgage Trust 3.53% 10/10/2034	600,832	0.06
USD 1,374,000	Comcast 1.5% 15/2/2031	1,098,050	0.11				
USD 276,000	Comcast 3.4% 15/7/2046	202,968	0.02				
USD 1,179,000	Comcast 3.969% 1/11/2047	938,153	0.09				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 25,000	Delta Air Lines 7.375% 15/1/2026	25,775	0.00	USD 1,814,431	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2042	1,507,215	0.15
USD 43,000	Directv Financing 8.875% 1/2/2030	43,267	0.00	USD 166,946	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	132,514	0.01
USD 22,000	Directv Financing / Directv Financing Co- Obligor 5.875% 15/8/2027	20,767	0.00	USD 300,695	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	239,048	0.02
USD 25,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029*	22,811	0.00	USD 88,170	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	70,769	0.01
USD 25,000	Edgewell Personal Care 4.125% 1/4/2029	22,478	0.00	USD 287,512	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2050	230,780	0.02
USD 1,976,000	Edison International 6.95% 15/11/2029	2,111,966	0.21	USD 312,388	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2051	248,065	0.02
USD 252,000	Elevance Health 3.6% 15/3/2051	188,805	0.02	USD 239,507	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2051	190,402	0.02
USD 484,000	Elevance Health 5.125% 15/2/2053	460,183	0.05	USD 189,445	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	152,055	0.02
EUR 100,000	EMRLD Borrower / Emerald Co-Issuer 6.375% 15/12/2030	114,267	0.01	USD 104,970	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2051	84,238	0.01
USD 25,000	Encompass Health 4.5% 1/2/2028	23,672	0.00	USD 95,452	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	76,744	0.01
EUR 200,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025	216,390	0.02	USD 143,638	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	115,224	0.01
USD 32,000	Energizer 4.375% 31/3/2029	28,270	0.00	USD 165,930	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	133,179	0.01
USD 50,000	Entegris 4.75% 15/4/2029	47,231	0.00	USD 51,661	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2051	41,463	0.00
USD 25,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	25,257	0.00	USD 727,347	Fannie Mae Pool 2% 1/8/2051	575,507	0.06
USD 840,000	Equinix 3.9% 15/4/2032	764,013	0.08	USD 336,991	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	269,559	0.03
USD 470,000	Eversource Energy 1.65% 15/8/2030	375,090	0.04	USD 107,122	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	85,878	0.01
USD 226,000	Eversource Energy 3.375% 1/3/2032	194,617	0.02	USD 88,604	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	71,048	0.01
USD 338,000	Eversource Energy 5.125% 15/5/2033	326,892	0.03	USD 195,176	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	156,292	0.02
USD 977,000	Exelon 4.7% 15/4/2050	850,709	0.09	USD 305,193	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	241,799	0.02
USD 613,584	Fannie Mae Pool 1.5% 1/11/2041	489,481	0.05	USD 65,769	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2051	51,958	0.01
USD 1,385,363	Fannie Mae Pool 1.5% 1/12/2041	1,105,158	0.11	USD 121,279	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	96,960	0.01
USD 195,924	Fannie Mae Pool 1.5% 1/11/2050	146,862	0.01	USD 52,779	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	42,999	0.00
USD 263,257	Fannie Mae Pool 1.5% 1/3/2051	197,300	0.02	USD 79,559	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	62,782	0.01
USD 218,954	Fannie Mae Pool 2% 1/11/2031	201,546	0.02	USD 180,318	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	144,325	0.01
USD 593,322	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2036	526,058	0.05	USD 269,723	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	214,942	0.02
USD 127,874	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2037	113,602	0.01	USD 273,033	Fannie Mae Pool 2% 1/12/2051	218,366	0.02
USD 728,754	Fannie Mae Pool 2% 1/6/2041	611,124	0.06	USD 247,858	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	198,544	0.02
USD 850,235	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2042	707,142	0.07	USD 251,056	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	201,092	0.02
USD 109,628	Fannie Mae Pool 2% 1/4/2042	90,862	0.01	USD 216,520	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	173,419	0.02
				USD 332,865	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	269,331	0.03

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年 2 月29日現在

保有高	銘柄	時価 （米ドル）	純資産 比率 （％）	保有高	銘柄	時価 （米ドル）	純資産 比率 （％）
USD 66,016	Fannie Mae Pool 2% 1/1/2052	52,180	0.01	USD 382,845	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2050	332,349	0.03
USD 127,264	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	101,960	0.01	USD 375,149	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	323,837	0.03
USD 292,328	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	234,017	0.02	USD 166,345	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2051	144,547	0.01
USD 151,645	Fannie Mae Pool 2% 1/2/2052	121,393	0.01	USD 648,313	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	562,134	0.06
USD 277,245	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	221,528	0.02	USD 55,469	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2052	48,254	0.00
USD 193,764	Fannie Mae Pool 2% 1/3/2052	155,067	0.02	USD 87,307	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2052	75,521	0.01
USD 461,776	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2031	432,372	0.04	USD 208,759	Fannie Mae Pool 3.5% 1/10/2030	201,651	0.02
USD 342,959	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	287,482	0.03	USD 5,135	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2032	4,922	0.00
USD 337,431	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	282,849	0.03	USD 272,590	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2047	246,941	0.02
USD 347,341	Fannie Mae Pool 2.5% 1/7/2050	291,156	0.03	USD 164,988	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	149,770	0.01
USD 373,461	Fannie Mae Pool 2.5% 1/8/2050	313,049	0.03	USD 125,167	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2048	113,621	0.01
USD 115,245	Fannie Mae Pool 2.5% 1/8/2050	96,498	0.01	USD 12,313	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	11,954	0.00
USD 260,688	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2050	220,024	0.02	USD 33,081	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2033	32,341	0.00
USD 64,920	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2051	54,381	0.01	USD 112,675	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2045	106,287	0.01
USD 700,404	Fannie Mae Pool 2.5% 1/10/2051	590,444	0.06	USD 124,229	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2049	116,611	0.01
USD 171,886	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2051	144,132	0.01	USD 135,552	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	127,664	0.01
USD 557,943	Fannie Mae Pool 2.5% 1/11/2051	470,635	0.05	USD 33,837	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2050	31,415	0.00
USD 571,092	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	480,944	0.05	USD 180,690	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2052	168,712	0.02
USD 1,007,828	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	839,440	0.08	USD 90,365	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2042	88,241	0.01
USD 145,871	Fannie Mae Pool 2.5% 1/1/2052	122,022	0.01	USD 30,432	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2043	29,706	0.00
USD 102,383	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	86,019	0.01	USD 75,572	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2045	73,411	0.01
USD 371,172	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	309,935	0.03	USD 54,091	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2049	51,968	0.01
USD 438,884	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	366,302	0.04	USD 70,349	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2052	66,652	0.01
USD 69,924	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2052	58,913	0.01	USD 1,011,373	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2035	1,005,077	0.10
USD 29,870	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	28,633	0.00	USD 123,509	Fannie Mae Pool 5% 1/3/2050	121,899	0.01
USD 162,756	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2029	156,018	0.02	USD 62,723	Fannie Mae Pool 5% 1/9/2052	61,459	0.01
USD 170,730	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2029	163,348	0.02	USD 4,748	Fannie Mae Pool 5.5% 1/2/2035	4,797	0.00
USD 85,263	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2030	81,319	0.01	USD 355,719	Fannie Mae Pool 5.5% 1/8/2037	361,515	0.04
USD 38,099	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2030	36,406	0.00	USD 248,228	Fannie Mae Pool 5.5% 1/8/2037	252,207	0.03
USD 1,018,009	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2047	890,922	0.09	USD 599,934	Fannie Mae Pool 5.5% 1/7/2053	595,498	0.06

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 143,165	Fannie Mae Pool 5.5% 1/10/2053	142,481	0.01	USD 86,850	Freddie Mac Pool 1.5% 1/8/2050	65,219	0.01
USD 334,608	Fannie Mae Pool 6% 1/5/2041	345,238	0.03	USD 215,839	Freddie Mac Pool 1.5% 1/10/2050	161,951	0.02
USD 289,491	Fannie Mae Pool 6.5% 1/10/2053	295,414	0.03	USD 95,306	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2036	84,768	0.01
USD 247,562	Fannie Mae-Aces 3.547% 25/9/2028	236,361	0.02	USD 588,802	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2037	523,664	0.05
USD 700,226	FBR Securitization Trust 6.14% 25/11/2035	683,765	0.07	USD 121,115	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2042	100,357	0.01
USD 1,500,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.1% 19/11/2040	968,771	0.10	USD 56,693	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	45,411	0.00
USD 1,130,000	Federal Home Loan Banks 2% 4/5/2035	848,512	0.08	USD 87,683	Freddie Mac Pool 2% 1/11/2050	70,516	0.01
USD 1,230,000	Federal Home Loan Banks 2.125% 14/9/2029	1,100,059	0.11	USD 534,984	Freddie Mac Pool 2% 1/3/2051	423,183	0.04
USD 500,000	Federal Home Loan Mortgage 4% 18/11/2024	495,335	0.05	USD 269,908	Freddie Mac Pool 2% 1/4/2051	216,853	0.02
USD 2,423,000	Federal Home Loan Mortgage 6.25% 15/7/2032	2,750,102	0.27	USD 158,182	Freddie Mac Pool 2% 1/5/2051	126,910	0.01
USD 492,000	FirstEnergy Transmission 4.55% 1/4/2049	408,128	0.04	USD 45,634	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	36,564	0.00
USD 2,000	FirstEnergy Transmission 5.45% 15/7/2044	1,894	0.00	USD 212,720	Freddie Mac Pool 2% 1/9/2051	169,732	0.02
EUR 128,000	Fiserv 1.625% 1/7/2030	122,304	0.01	USD 44,035	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	34,737	0.00
EUR 1,659,000	Fiserv 4.5% 24/5/2031	1,849,788	0.19	USD 589,480	Freddie Mac Pool 2% 1/10/2051	465,547	0.05
USD 115,000	Fiserv 5.6% 2/3/2033	116,162	0.01	USD 70,574	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	56,403	0.01
USD 1,412,000	Florida Power & Light 2.45% 3/2/2032	1,181,856	0.12	USD 151,348	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	120,990	0.01
USD 955,000	Florida Power & Light 3.15% 1/10/2049	662,725	0.07	USD 188,533	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	151,015	0.02
USD 155,000	Florida Power & Light 3.99% 1/3/2049	126,310	0.01	USD 29,054	Freddie Mac Pool 2% 1/12/2051	23,509	0.00
USD 330,000	Florida Power & Light 4.8% 15/5/2033	323,573	0.03	USD 449,072	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	359,704	0.04
USD 200,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032*	164,465	0.02	USD 328,127	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	265,497	0.03
USD 456,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	454,936	0.05	USD 240,185	Freddie Mac Pool 2% 1/1/2052	192,327	0.02
USD 400,000	Ford Motor Credit 7.122% 7/11/2033	427,163	0.04	USD 81,586	Freddie Mac Pool 2% 1/2/2052	64,372	0.01
USD 372,668	Freddie Mac Gold Pool 2.5% 1/12/2027	355,396	0.04	USD 61,932	Freddie Mac Pool 2.5% 1/7/2050	51,765	0.01
USD 932,147	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/8/2044	881,004	0.09	USD 531,909	Freddie Mac Pool 2.5% 1/2/2051	447,216	0.04
USD 489,141	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2045	466,320	0.05	USD 308,512	Freddie Mac Pool 2.5% 1/5/2051	261,427	0.03
USD 274,559	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2045	259,525	0.03	USD 461,832	Freddie Mac Pool 2.5% 1/5/2051	387,117	0.04
USD 176,368	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/9/2039	172,254	0.02	USD 303,586	Freddie Mac Pool 2.5% 1/11/2051	255,197	0.03
USD 71,789	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/2/2040	69,794	0.01	USD 222,779	Freddie Mac Pool 2.5% 1/12/2051	185,909	0.02
USD 39,645	Freddie Mac Gold Pool 5% 1/10/2036	39,443	0.00	USD 647,531	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	564,619	0.06
USD 451	Freddie Mac Gold Pool 6.5% 1/8/2032	462	0.00	USD 131,659	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	113,826	0.01

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 335,935	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2050	295,755	0.03	USD 875,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.896% 17/8/2037	879,162	0.09
USD 86,008	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	74,896	0.01	USD 99,000	Gap 3.625% 1/10/2029	83,652	0.01
USD 112,026	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	97,000	0.01	USD 313,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	314,714	0.03
USD 63,428	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	55,412	0.01	USD 25,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8% 15/1/2027	25,237	0.00
USD 626,194	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2052	543,633	0.05	USD 25,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.875% 15/4/2030	25,941	0.01
USD 70,716	Freddie Mac Pool 3.5% 1/1/2034	67,231	0.01	USD 932,000	Gilead Sciences 2.8% 1/10/2050	601,913	0.06
USD 2,032,465	Freddie Mac Pool 3.5% 1/9/2046	1,836,638	0.18	USD 375,000	Gilead Sciences 4.75% 1/3/2046	341,761	0.04
USD 165,447	Freddie Mac Pool 3.5% 1/1/2048	150,213	0.01	USD 713	Ginnie Mae I Pool 6.5% 15/4/2031	726	0.00
USD 514,949	Freddie Mac Pool 4% 1/1/2045	485,784	0.05	USD 2,366	Ginnie Mae I Pool 6.5% 15/7/2031	2,428	0.00
USD 9,243	Freddie Mac Pool 4% 1/7/2048	8,686	0.00	USD 982,434	Ginnie Mae II Pool 2% 20/8/2050	800,763	0.08
USD 147,947	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	139,555	0.01	USD 124,242	Ginnie Mae II Pool 2% 20/11/2050	101,267	0.01
USD 365,940	Freddie Mac Pool 4.5% 1/10/2047	353,937	0.04	USD 368,311	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/4/2051	312,508	0.03
USD 66,584	Freddie Mac Pool 4.5% 1/7/2052	63,114	0.01	USD 492,912	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/10/2051	417,816	0.04
USD 404,331	Freddie Mac Pool 4.5% 1/7/2052	383,236	0.04	USD 343,543	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/12/2051	291,202	0.03
USD 129,973	Freddie Mac Pool 4.5% 1/8/2052	123,143	0.01	USD 283,569	Ginnie Mae II Pool 2.5% 20/7/2052	240,167	0.02
USD 36,590	Freddie Mac Pool 4.5% 1/12/2052	34,672	0.00	USD 89,609	Ginnie Mae II Pool 3% 20/4/2050	79,105	0.01
USD 459,167	Freddie Mac Pool 4.5% 1/6/2053	437,907	0.04	USD 112,681	Ginnie Mae II Pool 3% 20/5/2050	99,439	0.01
USD 347,289	Freddie Mac Pool 5% 1/7/2053	337,536	0.03	USD 523,586	Ginnie Mae II Pool 3% 20/6/2051	458,986	0.05
USD 127,000	Freddie Mac Pool 5.5% 1/3/2054	125,868	0.01	USD 166,355	Ginnie Mae II Pool 3% 20/12/2051	145,818	0.01
USD 1,039,954	Freddie Mac Pool 6% 1/10/2053	1,047,862	0.10	USD 103,079	Ginnie Mae II Pool 3% 20/1/2052	90,360	0.01
USD 304,216	Freddie Mac Pool 6% 1/11/2053	306,114	0.03	USD 939,331	Ginnie Mae II Pool 3.5% 20/11/2046	861,504	0.09
USD 221,651	Freddie Mac Pool 6.5% 1/1/2054	226,172	0.02	USD 670,458	Ginnie Mae II Pool 4% 20/6/2047	632,980	0.06
USD 221,821	Freddie Mac Pool 6.5% 1/1/2054	226,428	0.02	USD 573,713	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/5/2041	563,046	0.06
USD 33,000	Freedom Mortgage 9.25% 1/2/2029	33,507	0.00	USD 42,188	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/9/2048	40,845	0.00
USD 30,000	Freedom Mortgage 12% 1/10/2028	32,505	0.00	USD 16,458	Ginnie Mae II Pool 4.5% 20/4/2050	15,942	0.00
USD 7,000	Freedom Mortgage 12.25% 1/10/2030	7,707	0.00	USD 231,087	Ginnie Mae II Pool 5% 20/7/2040	229,395	0.02
USD 1,265,000	FREMF 2018-K72 Mortgage Trust 3.994% 25/12/2050	1,193,055	0.12	USD 1,249,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	1,147,464	0.12
USD 80,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	74,084	0.01	EUR 1,414,000	Global Payments 4.875% 17/3/2031	1,580,231	0.16
USD 162,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	164,918	0.02	USD 340,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	273,337	0.03

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 2,152,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032	1,754,291	0.18	USD 44,000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	39,106	0.01
USD 306,000	Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	255,251	0.02		Hilton Grand Vacations Borrower Escrow /		
USD 160,000	Goldman Sachs 2.65% 21/10/2032	132,330	0.01	USD 73,000	Hilton Grand Vacations Borrower Esc 5%	67,673	0.01
USD 211,000	Goldman Sachs 3.102% 24/2/2033	179,345	0.02		1/6/2029 Hilton Worldwide		
GBP 1,119,000	Goldman Sachs 3.625% 29/10/2029	1,313,797	0.13	USD 22,000	Finance / Hilton Worldwide Finance	21,486	0.00
EUR 3,536,000	Goldman Sachs 4% 21/9/2029*	3,891,266	0.39		4.875% 1/4/2027		
USD 672,000	Goldman Sachs 4.223% 1/5/2029	644,650	0.07	USD 25,000	Hologic 3.25% 15/2/2029	22,289	0.00
USD 1,906,000	Goldman Sachs 6.484% 24/10/2029	2,000,005	0.20	USD 206,000	Home Depot 2.7% 15/4/2030	182,361	0.02
USD 736,000	Goldman Sachs 6.561% 24/10/2034	796,325	0.08	USD 700,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982%	658,808	0.07
GBP 100,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028	135,546	0.01		5/3/2037		
	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			USD 44,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	41,400	0.00
USD 159,084	2021-5 2.31% 20/10/2048	127,294	0.01		HSI Asset		
	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust			USD 1,939,227	Securitization Trust 2007-NC1 5.715%	1,286,644	0.13
USD 1,499,887	2022-3 4.95% 20/7/2049	1,414,338	0.14		25/4/2037		
USD 80,000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029	73,617	0.01	USD 25,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	23,181	0.00
USD 103,000	Gray Television 4.75% 15/10/2030	65,101	0.01	USD 561,044	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15	542,410	0.05
USD 1,260,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.515%	1,250,571	0.13		5.675% 25/7/2036		
	3/5/2032			USD 600,000	Intel 5.15% 21/2/2034	595,937	0.06
	GS Mortgage Trust			USD 960,000	Intel 5.2% 10/2/2033	962,181	0.10
USD 1,162,000	2016-GS2 3.759% 10/5/2049	1,086,131	0.11	USD 154,000	Iron Mountain 4.5% 15/2/2031	136,702	0.01
	GSMPS Mortgage Loan				15/2/2029		
USD 710,241	Trust 2005-RP1 3.986% 25/1/2035	604,567	0.06	USD 69,000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	70,139	0.01
	GSMPS Mortgage Loan				IXIS Real Estate		
USD 486,546	Trust 2005-RP3 3.986% 25/9/2035	404,769	0.04	USD 4,839,004	Capital Trust 2006-HE2 5.955% 25/8/2036	1,372,835	0.14
USD 25,000	H&E Equipment Services 3.875% 15/12/2028	22,537	0.00		JP Morgan Chase		
USD 33,000	Hanesbrands 4.875% 15/5/2026	31,870	0.00	USD 460,000	Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.723%	408,321	0.04
USD 25,000	Hanesbrands 9% 15/2/2031	24,951	0.00		15/1/2049		
USD 123,000	HCA 2.375% 15/7/2031	100,368	0.01	USD 527,570	JP Morgan Mortgage Trust 2017-2 3.649%	465,144	0.05
USD 971,000	HCA 3.5% 1/9/2030	868,036	0.09		25/5/2047		
USD 1,616,000	HCA 3.625% 15/3/2032	1,412,797	0.14	USD 425,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1	363,039	0.04
USD 739,000	HCA 5.5% 1/6/2033	736,760	0.08		4.202% 17/3/2049		
USD 84,000	Hertz 5% 1/12/2029	63,910	0.01	GBP 200,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	241,228	0.02
	Hess Midstream			USD 139,000	JPMorgan Chase 2.545% 8/11/2032	114,784	0.01
USD 25,000	Operations 5.625% 15/2/2026	24,655	0.00	USD 2,411,000	JPMorgan Chase 2.963% 25/1/2033	2,040,410	0.20
	Hilcorp Energy I /				JPMorgan Chase 4.457% 13/11/2031		
USD 25,000	Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	24,195	0.00	EUR 1,800,000	JPMorgan Chase 4.565% 14/6/2030	2,026,864	0.20
				USD 1,549,000	JPMorgan Chase 4.912% 25/7/2033	1,502,204	0.15
				USD 464,000		451,208	0.04

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 631,000	JPMorgan Chase 5.012% 23/1/2030	625,340	0.06	EUR 658,000	Moody's 0.95% 25/2/2030	613,045	0.06
USD 5,000	JPMorgan Chase 5.299% 24/7/2029	5,023	0.00	EUR 1,400,000	Moody's 1.75% 9/3/2027*	1,451,836	0.15
USD 1,574,000	JPMorgan Chase 5.336% 23/1/2035	1,569,368	0.16	USD 286,000	Moody's 3.1% 29/11/2061	183,714	0.02
USD 815,000	JPMorgan Chase 6.07% 22/10/2027	831,309	0.08	EUR 1,155,000	Morgan Stanley 0.497% 7/2/2031	1,029,719	0.10
USD 311,000	JPMorgan Chase 6.087% 23/10/2029	322,085	0.03	USD 2,356,000	Morgan Stanley 2.239% 21/7/2032	1,904,149	0.20
USD 379,000	KLA 5.25% 15/7/2062	372,698	0.04	USD 522,000	Morgan Stanley 2.511% 20/10/2032	429,021	0.05
USD 58,000	Kohl's 4.625% 1/5/2031	45,889	0.01	USD 450,000	Morgan Stanley 2.943% 21/1/2033	379,008	0.04
GBP 100,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	123,661	0.01	USD 167,000	Morgan Stanley 3.622% 1/4/2031	152,015	0.02
USD 30,000	Lamar Media 3.75% 15/2/2028	27,979	0.00	EUR 1,471,000	Morgan Stanley 4.656% 2/3/2029	1,638,109	0.16
USD 25,000	Lamar Media 4.875% 15/1/2029	23,709	0.00	EUR 2,161,000	Morgan Stanley 4.813% 25/10/2028*	2,422,207	0.24
EUR 100,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	108,205	0.01	USD 3,307,000	Morgan Stanley 4.889% 20/7/2033	3,187,788	0.32
USD 43,000	Lithia Motors 3.875% 1/6/2029	38,498	0.01	USD 377,000	Morgan Stanley 5.164% 20/4/2029	375,339	0.04
USD 59,000	Lithia Motors 4.375% 15/1/2031	52,286	0.01	USD 1,071,000	Morgan Stanley 5.173% 16/1/2030	1,065,377	0.11
USD 25,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	23,772	0.00	USD 281,000	Morgan Stanley 5.25% 21/4/2034	276,464	0.03
USD 26,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	26,214	0.00	USD 27,000	Morgan Stanley 5.424% 21/7/2034	26,884	0.00
USD 682,000	Lowe's 4.25% 1/4/2052	551,050	0.06	USD 262,000	Morgan Stanley 5.449% 20/7/2029	263,631	0.03
USD 124,000	Lowe's 5.125% 15/4/2050	114,911	0.01	USD 10,000	Morgan Stanley 5.466% 18/1/2035*	10,005	0.00
USD 7,000	Macy's Retail 5.875% 1/4/2029	6,743	0.00	USD 223,000	Morgan Stanley 6.407% 1/11/2029	233,069	0.02
USD 170,000	Marsh & McLennan 5.45% 15/3/2053	169,827	0.02	USD 555,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3.994% 15/12/2049	517,524	0.05
USD 216,000	Marsh & McLennan 6.25% 1/11/2052	240,251	0.02	USD 1,000,000	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 3.89% 15/12/2050	936,131	0.09
USD 916,731	Mastr Asset Backed Trust 2004-OPT2 6.135% 25/9/2034	840,403	0.08	USD 1,449,748	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 4.62% 15/7/2051	1,309,237	0.13
USD 312,324	Mastr Asset Backed Trust 2005-WF1 7.16% 25/6/2035	317,070	0.03	USD 289,971	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 4.709% 15/10/2051	264,902	0.03
USD 398,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	403,005	0.04	USD 634,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.276% 11/7/2040	561,032	0.06
EUR 450,000	McDonald's 4.125% 28/11/2035*	495,472	0.05	USD 111,579	Mosaic Solar Loan Trust 2020-1 3.1% 20/4/2046	97,355	0.01
USD 101,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	90,230	0.01	USD 297,563	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 1.44% 20/8/2046	246,209	0.03
USD 25,000	Medline Borrower 5.25% 1/10/2029	23,141	0.00	USD 180,489	Mosaic Solar Loan Trust 2020-2 2.21% 20/8/2046	145,196	0.01
EUR 100,000	Metropolitan Life Global Funding I 0.375% 9/4/2024	108,099	0.01				
USD 853,000	MF1 2022-FL10 7.951% 17/9/2037	858,788	0.09				
USD 75,000	MidAmerican Energy 5.3% 1/2/2055	73,354	0.01				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 204,724	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	193,350	0.02	USD 1,010,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3.56% 10/5/2039	871,672	0.09
USD 315,000	Nasdaq 5.55% 15/2/2034	318,523	0.03	USD 690,000	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3.945% 10/5/2039	516,397	0.05
USD 235,000	Nasdaq 6.1% 28/6/2063	246,165	0.03	EUR 100,000	Olympus Water US 9.625% 15/11/2028*	116,900	0.01
EUR 1,030,000	National Grid North America 4.668% 12/9/2033	1,169,964	0.12	USD 159,000	Oncor Electric Delivery 3.1% 15/9/2049	109,298	0.01
USD 25,000	Navient 11.5% 15/3/2031	27,327	0.00	USD 37,000	Oncor Electric Delivery 3.8% 30/9/2047	28,566	0.00
USD 560,438	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-C 7.032% 15/11/2068	567,416	0.06	USD 949,000	Oncor Electric Delivery 4.15% 1/6/2032	890,191	0.09
USD 25,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	23,489	0.00	USD 551,000	Oncor Electric Delivery 4.55% 15/9/2032	530,158	0.05
USD 454,072	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 6.155% 25/10/2035	436,511	0.04	USD 25,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	25,418	0.00
USD 140,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	105,316	0.01	USD 195,000	OneMain Finance 7.875% 15/3/2030	198,347	0.02
GBP 150,000	New York Life Global Funding 4.35% 16/9/2025	187,781	0.02	USD 25,000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	26,330	0.00
USD 776,272	Newcastle Mortgage Trust 2007-1 5.665% 25/4/2037	758,192	0.08	USD 150,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	128,348	0.01
USD 25,000	Newell Brands 5.2% 1/4/2026	24,217	0.00	USD 170,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.47% 16/6/2036	142,523	0.01
USD 37,000	Newell Brands 6.375% 15/9/2027	35,931	0.01	USD 132,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	122,755	0.01
USD 11,000	Newell Brands 6.625% 15/9/2029	10,537	0.00	USD 1,158,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	1,000,680	0.10
USD 25,000	News 3.875% 15/5/2029	22,616	0.00	USD 2,621,000	Oracle 2.95% 1/4/2030*	2,315,668	0.23
USD 25,000	Nexstar Media 4.75% 1/11/2028	22,216	0.00	EUR 200,000	Oracle 3.125% 10/7/2025	214,914	0.02
USD 1,851,000	NextEra Energy Capital 2.25% 1/6/2030	1,558,150	0.16	USD 832,000	Oracle 3.85% 15/7/2036	702,643	0.07
USD 352,000	NextEra Energy Capital 2.75% 1/11/2029	310,998	0.03	USD 200,000	Oracle 3.95% 25/3/2051	149,467	0.02
USD 223,000	NextEra Energy Capital 5.05% 28/2/2033	217,986	0.02	USD 230,000	Oracle 4.3% 8/7/2034*	209,101	0.02
USD 425,000	NextEra Energy Capital 5.749% 1/9/2025	427,320	0.04	USD 169,000	Oracle 6.15% 9/11/2029	177,289	0.02
USD 40,000	Nordstrom 4.25% 1/8/2031	33,897	0.00	USD 739,000	Oracle 6.25% 9/11/2032	781,058	0.08
USD 454,000	Norfolk Southern 2.3% 15/5/2031	379,901	0.04	EUR 100,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2.875% 30/4/2028	100,806	0.01
USD 656,000	Norfolk Southern 3% 15/3/2032	565,626	0.06	USD 77,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	68,625	0.01
USD 26,000	Novelis 3.875% 15/8/2031	21,961	0.00	USD 450,000	Pacific Gas and Electric 4.55% 1/7/2030	423,352	0.04
USD 25,000	NRG Energy 3.375% 15/2/2029	21,869	0.00	USD 755,000	Pacific Gas and Electric 4.95% 1/7/2050	645,844	0.07
USD 11,000	NuStar Logistics 6.375% 1/10/2030	10,983	0.00	USD 25,000	Pactiv Evergreen Group Issuer/Pactiv Evergreen Issuer 4% 15/10/2027	23,213	0.00
USD 254,000	NVIDIA 2% 15/6/2031	212,555	0.02				
USD 741,000	Ohio Power 5% 1/6/2033	728,598	0.07				

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 77,000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4.875% 15/5/2029	70,974	0.01	USD 1,052,000	Ryder System 5.25% 1/6/2028	1,055,775	0.11
USD 204,000	PECO Energy 2.85% 15/9/2051	131,592	0.01	USD 25,000	Sabre GLBL 8.625% 1/6/2027	22,125	0.00
USD 490,000	PECO Energy 4.375% 15/8/2052	421,019	0.04	USD 15,000	Sabre GLBL 11.25% 15/12/2027	14,128	0.00
USD 104,000	PECO Energy 4.6% 15/5/2052	92,739	0.01	USD 269,000	Salesforce 1.95% 15/7/2031	221,587	0.02
USD 25,000	PennyMac Financial Services 7.875% 15/12/2029	25,641	0.00	USD 2,425,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052 San Diego Gas & Electric 1.7% 1/10/2030	2,703,024	0.27
USD 31,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	30,313	0.00	USD 299,000	San Diego Gas & Electric 3% 15/3/2032	243,999	0.02
USD 350,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5.35% 12/1/2027	349,208	0.04	USD 415,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	359,146	0.04
USD 200,000	Periana 5.95% 19/4/2026	197,320	0.02	USD 85,000	SCIL IV / SCIL USA 9.5% 15/7/2028*	75,286	0.01
USD 25,000	Pilgrim's Pride 4.25% 15/4/2031	22,371	0.00	EUR 100,000	Scotts Miracle-Gro 4.375% 1/2/2032	118,262	0.01
USD 25,000	Pilgrim's Pride 6.25% 1/7/2033	25,274	0.00	USD 18,000	Scotts Miracle-Gro 4.5% 15/10/2029	15,070	0.00
USD 30,000	PNC Financial Services 5.676% 22/1/2035*	30,114	0.00	USD 25,000	Sealed Air 5.5% 15/9/2025	22,247	0.00
USD 92,000	Post 4.5% 15/9/2031	82,001	0.01	USD 25,000	Sensata Technologies 3.75% 15/2/2031	24,904	0.00
USD 25,000	Post 4.625% 15/4/2030	22,778	0.00	USD 22,000	Service International 4% 15/5/2031	18,876	0.00
USD 25,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028*	24,769	0.00	USD 22,000	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	19,275	0.00
USD 1,179,000	Prologis 5.125% 15/1/2034	1,171,889	0.12	USD 496,600	Sherwin-Williams 2.9% 15/3/2052	484,180	0.05
USD 209,000	Public Service Electric and Gas 3.1% 15/3/2032	183,051	0.02	USD 168,000	Sirius XM Radio 3.875% 1/9/2031	109,150	0.01
USD 9,000	Public Service Electric and Gas 3.6% 1/12/2047	6,900	0.00	USD 25,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	20,688	0.00
USD 914,000	Public Service Electric and Gas 3.7% 1/5/2028	875,023	0.09	USD 140,000	Sirius XM Radio 4.125% 1/7/2030	126,225	0.01
USD 475,000	Public Service Electric and Gas 4.65% 15/3/2033	460,478	0.05	USD 33,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027*	28,451	0.00
USD 490,000	Public Service Electric and Gas 4.9% 15/12/2032	485,276	0.05	USD 25,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	23,857	0.00
USD 651,000	QUALCOMM 2.15% 20/5/2030	558,443	0.06	USD 25,000	Six Flags Entertainment 7.25% 15/5/2031	23,609	0.00
USD 424,113	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7.788% 25/6/2037	425,059	0.04	USD 78,000	SLM Private Credit Student Loan Trust 2004-A 6.046% 15/6/2033	78,485	0.01
USD 171,261	Renaissance Home Equity Loan Trust 2005-3 5.14% 25/11/2035	168,815	0.02	USD 326,526	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5.976% 15/6/2039	324,588	0.03
USD 313,000	Republic Services 2.375% 15/3/2033	251,218	0.03	USD 1,326,831	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5.936% 15/6/2039	1,299,977	0.13
				USD 1,686,154		1,637,740	0.16

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 346,075	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5.846% 15/12/2039	334,088	0.03	USD 25,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7.375% 15/2/2029	24,926	0.00
USD 937,500	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.182% 15/10/2041	1,008,582	0.10	USD 11,000	TEGNA 5% 15/9/2029	9,686	0.00
USD 489,554	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3.5% 15/9/2043	474,961	0.05	USD 4,000	Tempur Sealy International 3.875% 15/10/2031	3,328	0.00
USD 885,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	758,327	0.08	USD 25,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	24,987	0.00
USD 1,595,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2.5% 15/9/2054	1,294,774	0.13	USD 235,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	232,843	0.02
USD 1,090,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2.5% 15/9/2054	881,408	0.09	USD 25,000	Tenet Healthcare 6.75% 15/5/2031	25,188	0.00
USD 1,617,512	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 6.162% 15/1/2053	1,603,385	0.16	USD 130,000	Texas Instruments 4.9% 14/3/2033	130,445	0.01
USD 1,633,068	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6.775% 16/2/2055	1,641,523	0.16	USD 692,000	Thermo Fisher Scientific 1.75% 15/10/2028	608,496	0.06
USD 1,348,556	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	1,308,522	0.13	USD 475,000	Thermo Fisher Scientific 2.6% 1/10/2029	424,311	0.04
USD 182,000	SoFi Professional Loan Program 2017-D 3.61% 25/9/2040	164,465	0.02	USD 136,000	Time Warner Cable 6.55% 1/5/2037	128,540	0.01
USD 292,000	SoFi Professional Loan Program 2017-E 4.16% 26/11/2040	267,914	0.03	USD 2,379,000	T-Mobile USA 3.875% 15/4/2030	2,211,555	0.22
USD 312,794	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	304,643	0.03	USD 1,320,000	T-Mobile USA 5.05% 15/7/2033	1,296,104	0.13
USD 314,000	Southern California Edison 2.5% 1/6/2031	264,118	0.03	USD 972,000	T-Mobile USA 5.15% 15/4/2034	957,895	0.10
USD 1,188,000	Southern California Edison 2.75% 1/2/2032	1,001,454	0.10	USD 210,000	Toyota Motor Credit 4.8% 5/1/2034	205,357	0.02
USD 806,000	Southern California Edison 5.2% 1/6/2034	790,980	0.08	USD 4,000	Travel + Leisure 4.5% 1/12/2029	3,663	0.00
USD 1,224,000	Southern California Edison 5.95% 1/11/2032	1,277,550	0.13	USD 25,000	Travel + Leisure 6.625% 31/7/2026	25,148	0.00
USD 1,414,000	Sprint Capital 8.75% 15/3/2032	1,706,917	0.17	USD 1,383,014	Tricon American Homes 2019-SFR1 Trust 2.75% 17/3/2038	1,307,257	0.13
USD 25,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	24,354	0.00	USD 22,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	20,562	0.00
USD 25,000	Standard Industries 3.375% 15/1/2031	20,766	0.00	USD 25,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	25,583	0.00
USD 22,000	Standard Industries 4.375% 15/7/2030	19,635	0.00	USD 186,000	Union Pacific 3.799% 6/4/2071	137,175	0.01
USD 25,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	23,428	0.00	USD 919,000	Union Pacific 3.839% 20/3/2060	701,307	0.07
USD 25,000	Sunoco / Sunoco Finance 7% 15/9/2028	25,600	0.01	USD 25,000	United Airlines 4.375% 15/4/2026	24,062	0.00
				USD 37,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	34,090	0.00
				USD 25,000	United Rentals North America 3.75% 15/1/2032	21,644	0.00
				USD 96,000	United Rentals North America 5.25% 15/1/2030	92,868	0.01

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 25,000	United Rentals North America 5.5% 15/5/2027	24,876	0.00	USD 389,000	Verizon Communications 3.7% 22/3/2061	277,746	0.03
USD 4,795,000	United States Treasury Floating Rate Note 5.545% 31/1/2026†	4,802,213	0.48	USD 1,486,000	Verizon Communications 4.329% 21/9/2028	1,445,350	0.15
USD 4,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	5,380	0.00	USD 1,047,000	Verizon Communications 4.4% 1/11/2034	975,882	0.10
USD 2,600,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2026	2,783,667	0.28	USD 15,000	Walgreens Boots Alliance 3.2% 15/4/2030	12,994	0.00
USD 2,060,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2031†	2,153,637	0.22	USD 836,000	Walt Disney 2% 1/9/2029	722,652	0.07
USD 111,000	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/2/2031	90,621	0.01	USD 237,000	Walt Disney 3.8% 22/3/2030	223,954	0.02
USD 640,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2040	407,050	0.04	USD 1,295,510	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR11 Trust 6.041% 25/9/2046	1,017,678	0.10
USD 26,000	United Wholesale Mortgage 5.5% 15/4/2029	24,357	0.00	USD 2,325,267	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust 5.961% 25/10/2046	1,918,075	0.19
USD 765,000	UnitedHealth 2.875% 15/8/2029	694,370	0.07	USD 1,461,697	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-0A5 Trust 5.879% 25/6/2047	1,149,616	0.12
USD 388,000	UnitedHealth 3.875% 15/12/2028	373,036	0.04	USD 2,146,546	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR8 Trust 5.931% 25/10/2046	1,681,144	0.17
USD 1,674,000	UnitedHealth 5.3% 15/2/2030*	1,707,818	0.18	EUR 803,000	Wells Fargo 1.625% 2/6/2025*	846,506	0.09
USD 78,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 4.75% 15/4/2028	67,888	0.01	EUR 530,000	Wells Fargo 2.125% 4/6/2024	572,214	0.06
USD 43,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	44,655	0.00	USD 1,207,000	Wells Fargo 3.35% 2/3/2033	1,038,438	0.10
USD 148,000	Univision Communications 4.5% 1/5/2029	129,679	0.01	USD 70,000	Wells Fargo 5.389% 24/4/2034	68,938	0.01
USD 25,000	Univision Communications 8% 15/8/2028	25,007	0.00	USD 592,000	Wells Fargo 5.499% 23/1/2035	588,734	0.06
USD 25,000	US Foods 6.875% 15/9/2028	25,415	0.00	USD 1,260,000	Wells Fargo 5.557% 25/7/2034	1,258,875	0.13
USD 52,000	US Foods 7.25% 15/1/2032	53,732	0.01	USD 296,000	Wells Fargo 5.574% 25/7/2029	298,245	0.03
USD 99,000	Venture Global Calcasieu Pass 6.25% 15/1/2030	98,981	0.01	USD 1,116,000	Wells Fargo 6.303% 23/10/2029*	1,160,646	0.12
GBP 100,000	Verizon Communications 1.125% 3/11/2028	107,754	0.01	USD 163,000	Wells Fargo 6.491% 23/10/2034*	173,721	0.02
USD 2,664,000	Verizon Communications 1.45% 20/3/2026	2,472,725	0.25	USD 255,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-LC24 3.621% 15/10/2049	229,961	0.02
USD 692,000	Verizon Communications 1.5% 18/9/2030	556,234	0.06	USD 257,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3.903% 15/7/2050	225,913	0.02
USD 596,000	Verizon Communications 1.68% 30/10/2030	480,860	0.05	USD 1,390,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.749% 15/6/2036	1,213,956	0.12
USD 108,000	Verizon Communications 2.355% 15/3/2032	87,782	0.01	USD 25,000	Western Digital 4.75% 15/2/2026	24,388	0.00

† 当該有価証券の全額または一部は、差入れたまたは保証として引渡した有価証券である。詳細については注記13を参照のこと。

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

投資有価証券明細表 2024年2月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
USD 440,000	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014- C21 3.891% 15/8/2047	422,647	0.04	預託証書			
USD 307,386	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-1 3.92% 20/6/2044	287,169	0.03	USD 1,100,000	カナダ Bank of Nova Scotia (Houston Branch) 6% 18/10/2024	1,103,475	0.11
USD 25,000	WMG Acquisition 3.875% 15/7/2030	22,157	0.00	USD 1,395,000	Toronto Dominion Bank (New York Branch) 5.93% 15/8/2024	1,397,411	0.14
USD 25,000	Xerox 5.5% 15/8/2028	22,684	0.00	USD 1,840,000	Toronto Dominion Bank (New York Branch) 6% 9/9/2024	1,844,833	0.18
USD 73,000	Yum! Brands 3.625% 15/3/2031	64,134	0.01			4,345,719	0.43
		313,952,352	31.41		フランス Natixis (New York Branch) 5.97% 20/5/2024	955,804	0.10
	ウルグアイ Uruguay Government International Bond 4.375% 27/10/2027	198,175	0.02	USD 2,205,000	Natixis (New York Branch) 5.99% 17/10/2024	2,211,300	0.22
	Uruguay Government International Bond 5.1% 18/6/2050	190,979	0.02			3,167,104	0.32
		389,154	0.04		米国 Bank of America 5.22% 6/2/2025	1,318,245	0.13
債券合計		949,960,904	95.06	USD 1,320,000	Citibank (New York Branch) 5.89% 10/5/2024	1,405,808	0.14
コマーシャル・ペーパー						2,724,053	0.27
	オーストラリア Macquarie Bank 0% 13/5/2024	899,677	0.09	預託証書合計			
USD 1,395,000	Macquarie Bank 0% 20/8/2024	1,359,096	0.14			10,236,876	1.02
USD 1,395,000	Westpac Banking 0% 6/6/2024	1,374,588	0.14	公認の証券取引所に上場されているまたはそ の他の規制市場で取引されている譲渡可能な 有価証券および短期金融商品合計			
		3,633,361	0.37			981,833,358	98.25
	フランス BPCE 0% 5/4/2024	994,517	0.10	その他の譲渡可能な有価証券			
USD 1,320,000	LVMH Moet 0% 5/2/2025	1,257,610	0.13	債券			
USD 955,000	Societe Generale 0% 24/4/2024	947,099	0.09	USD 633,000	バミューダ Trinitas CLO XXIV 7.128% 25/4/2037**	633,000	0.06
		3,199,226	0.32		ジャージー Bain Capital CLO 2024- 1 0% 16/4/2037**	474,000	0.05
	ドイツ Bayer 0% 9/7/2024	1,292,598	0.13	USD 468,000	CarVal CLO IX-C 0% 20/4/2037**	468,000	0.05
USD 1,000,000	Bayer 0% 12/8/2024	973,980	0.10			942,000	0.10
USD 1,395,000	Bayer 0% 10/9/2024	1,352,621	0.13		米国 MF1 2024-FL14 7.055% 19/3/2039**	1,276,800	0.13
		3,619,199	0.36	債券合計		2,851,800	0.29
	ノルウェー DNB Bank 0% 13/6/2024	1,373,305	0.14	その他の譲渡可能な有価証券合計			
USD 1,395,000	英国 Natwest Markets 0% 20/5/2024	1,377,484	0.14			2,851,800	0.29
	米国 HSBC USA 0% 22/8/2024	1,945,997	0.19	投資有価証券合計			
USD 1,395,000	HSBC USA 0% 9/9/2024	1,353,471	0.14			984,685,158	98.54
USD 1,395,000	HSBC USA 0% 11/10/2024	1,346,607	0.13		その他の純資産	14,540,609	1.46
USD 925,000	HSBC USA 0% 27/11/2024	885,766	0.09	純資産合計（米ドル）			
USD 975,000	HSBC USA 0% 12/2/2025	922,395	0.09			999,225,767	100.00
USD 1,990,000	Walgreens Boots Alliance 0% 1/4/2024	1,978,767	0.20				
		8,433,003	0.84				
コマーシャル・ペーパー合計		21,635,578	2.17				

** 注記2(j)に記載されるとおり、公正価値評価の対象となる有価証券。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
AUD	664,535	NZD	617,000	State Street	20/3/2024	(3,008)
AUD	384,266	USD	580,000	ANZ	20/3/2024	(5,530)
AUD	646,201	USD	982,000	BNY Mellon	14/3/2024	(5,089)
AUD	73,342	EUR	120,000	UBS	20/3/2024	(1,265)
AUD	128,986	NZD	120,000	UBS	20/3/2024	(427)
AUD	993,985	NZD	930,000	JP Morgan	20/3/2024	147
AUD	279,147	NZD	260,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(728)
AUD	182,686	NZD	170,000	Standard Chartered Bank	20/3/2024	(578)
AUD	928,599	NZD	870,000	Barclays	20/3/2024	906
AUD	183,663	USD	280,000	Bank of America	20/3/2024	(825)
BRL	12,260,346	USD	61,092,078	Toronto-Dominion	20/3/2024	3,251
BRL	191,294	USD	959,877	Goldman Sachs	14/3/2024	1,516
BRL	503,448	USD	2,490,000	Barclays	20/3/2024	(3,607)
BRL	229,709	USD	1,139,000	Citigroup	14/3/2024	(919)
BRL	1,693,772	USD	8,440,000	Goldman Sachs	20/3/2024	470
BRL	62,563	USD	310,000	Citigroup	20/3/2024	(334)
CAD	2,180,000	USD	2,954,371	Morgan Stanley	20/3/2024	1,430
CAD	381,998	USD	510,000	Bank of America	20/3/2024	(5,427)
CAD	4,092,414	EUR	5,965,000	Royal Bank of Canada	5/3/2024	(36,787)
CHF	670,000	USD	579,533	BNP Paribas	20/3/2024	(9,396)
CHF	266,830	EUR	250,000	UBS	20/3/2024	(4,710)
CLP	528,746	USD	467,782,000	Goldman Sachs	14/3/2024	(46,205)
CLP	452,096	USD	414,871,000	Citigroup	14/3/2024	(24,136)
CNH	3,160,512	USD	22,559,472	Deutsche Bank	20/3/2024	(26,030)
COP	705,406	USD	3,096,026,000	BNP Paribas	17/5/2024	72,090
COP	554,646	USD	2,362,374,280	Barclays	15/8/2024	30,021
COP	1,404,842	USD	6,074,676,720	BNP Paribas	15/8/2024	98,587
COP	1,375,583	USD	5,591,881,275	Citigroup	14/3/2024	43,606
COP	3,051,542	USD	12,247,090,000	Citigroup	20/3/2024	53,391
COP	2,127,477	USD	8,850,000,000	BNP Paribas	23/10/2024	41,851
COP	371,079	USD	1,465,454,631	BNY Mellon	14/3/2024	846
COP	1,084,056	USD	4,496,666,000	HSBC Bank	24/2/2025	132
COP	63,387	USD	250,000,000	Goldman Sachs	20/3/2024	(6)
CZK	1,866,789	USD	42,303,170	Deutsche Bank	20/3/2024	(54,549)
CZK	56,359	EUR	1,400,000	Bank of America	20/3/2024	(1,210)
CZK	113,325	EUR	2,850,000	BNP Paribas	20/3/2024	(938)
CZK	55,908	EUR	1,400,000	HSBC Bank	20/3/2024	(721)
CZK	57,122	EUR	1,450,000	UBS	20/3/2024	103
CZK	57,128	EUR	1,450,000	JP Morgan	20/3/2024	97
EUR	3,313,236	USD	3,060,000	Barclays	20/3/2024	8,836
EUR	1,267,463	GBP	1,470,000	BNP Paribas	20/3/2024	(10,461)
EUR	5,063,336	USD	4,650,000	Société Générale	20/3/2024	(15,092)
EUR	2,967,320,650	JPY	19,150,000	Morgan Stanley	21/3/2024	883,049
EUR	9,437,649	USD	8,700,000	State Street	20/3/2024	7,455
EUR	703,100,000	JPY	4,434,714	UBS	21/3/2024	97,589
EUR	136,000,000	JPY	888,959	Deutsche Bank	21/3/2024	52,702
EUR	362,900,000	JPY	2,333,545	Bank of America	21/3/2024	98,790
EUR	2,336,729	NOK	205,000	Barclays	14/3/2024	1,576
EUR	76,745	USD	70,000	Deutsche Bank	20/3/2024	(750)
EUR	355,077	GBP	409,000	BNP Paribas	14/3/2024	(6,082)
EUR	5,349,478	USD	4,940,000	JP Morgan	20/3/2024	13,603
EUR	120,000	AUD	73,979	Barclays	20/3/2024	1,956
EUR	74,000,000	HUF	190,736	JP Morgan	20/3/2024	3,082
EUR	1,500,000	THB	39,624	Barclays	20/3/2024	1,139
EUR	7,175,449	USD	6,600,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(10,197)
EUR	250,000	CHF	270,181	HSBC Bank	20/3/2024	8,348
EUR	1,400,000	CZK	56,669	Deutsche Bank	20/3/2024	1,547
EUR	1,400,000	CZK	56,561	HSBC Bank	20/3/2024	1,430
EUR	112,000,000	HUF	289,887	Morgan Stanley	20/3/2024	5,975
EUR	105,500,000	HUF	272,089	Deutsche Bank	20/3/2024	4,569

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損） （米ドル）
EUR	250,000	PLN	56,665	HSBC Bank	20/3/2024	(1,303)
EUR	770,000	PLN	176,199	Deutsche Bank	20/3/2024	(2,201)
EUR	15,300,000	THB	394,828	JP Morgan	20/3/2024	1,478
EUR	21,500,000	HUF	54,892	HSBC Bank	20/3/2024	326
EUR	3,170,000	THB	82,698	HSBC Bank	20/3/2024	1,276
EUR	3,170,000	THB	82,993	UBS	20/3/2024	1,597
EUR	500,000	PLN	115,061	Barclays	20/3/2024	(727)
EUR	1,110,000	AUD	674,017	Citigroup	5/3/2024	6,825
EUR	113,000,000	HUF	290,953	Goldman Sachs	20/3/2024	4,375
EUR	1,957,977	USD	1,800,000	Deutsche Bank	5/3/2024	(5,026)
EUR	1,400,000	CZK	56,046	Goldman Sachs	20/3/2024	871
EUR	83,288,606	HUF	216,000	UBS	14/3/2024	4,723
EUR	760,000	PLN	175,156	Morgan Stanley	20/3/2024	(819)
EUR	461,841	USD	428,000	Citigroup	14/3/2024	2,700
EUR	231,000,000	JPY	1,452,854	Goldman Sachs	21/3/2024	27,558
EUR	182,000,000	JPY	1,134,784	HSBC Bank	21/3/2024	10,975
EUR	161,744	USD	150,000	Royal Bank of Canada	20/3/2024	1,102
EUR	5,646,880	USD	5,240,000	BNP Paribas	20/3/2024	41,894
EUR	1,676,049	USD	1,550,000	UBS	5/3/2024	5,660
EUR	500,000	PLN	115,723	UBS	20/3/2024	(8)
EUR	500,000	PLN	116,256	Nomura	20/3/2024	571
GBP	14,970,000	EUR	12,909,215	Deutsche Bank	20/3/2024	108,791
GBP	1,470,000	EUR	1,269,339	Citigroup	20/3/2024	12,838
GBP	621,347	USD	490,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(331)
GBP	4,793,826	EUR	4,100,000	Nomura	5/3/2024	(5,411)
GBP	1,515,856	USD	1,190,000	Deutsche Bank	5/3/2024	(7,818)
GBP	2,490,129	USD	1,970,000	BNP Paribas	20/3/2024	6,610
GBP	188,250	USD	150,000	BNY Mellon	5/3/2024	1,839
GBP	1,302,413	USD	1,030,000	Royal Bank of Canada	5/3/2024	2,863
HUF	437,900	USD	156,002,000	Citigroup	14/3/2024	(7,632)
HUF	69,917	EUR	27,000,000	Nomura	20/3/2024	(1,477)
HUF	903,221	USD	323,507,755	State Street	14/3/2024	(10,957)
HUF	424,426	EUR	165,000,000	JP Morgan	20/3/2024	(5,936)
HUF	38,561	EUR	15,000,000	Société Générale	20/3/2024	(514)
HUF	339,669	EUR	131,500,000	BNP Paribas	20/3/2024	(6,264)
HUF	55,911	EUR	21,500,000	Goldman Sachs	20/3/2024	(1,433)
HUF	170,336	EUR	66,500,000	Citigroup	20/3/2024	(1,610)
HUF	113,895	EUR	44,500,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(979)
HUF	214,000	EUR	83,367,980	UBS	14/3/2024	(2,334)
HUF	59,470	EUR	23,000,000	Barclays	20/3/2024	(1,161)
HUF	115,043	EUR	45,000,000	Deutsche Bank	20/3/2024	(848)
IDR	6,106,943	USD	95,193,188,718	Deutsche Bank	20/3/2024	(53,049)
IDR	223,297	USD	3,448,824,000	Citigroup	14/3/2024	(3,918)
IDR	1,706,946	USD	26,730,000,000	BNP Paribas	20/3/2024	(7,028)
INR	831,155	USD	69,497,000	JP Morgan	14/3/2024	6,672
INR	62,085	USD	5,150,000	BNP Paribas	20/3/2024	(14)
JPY	1,586,399	USD	226,000,000	Barclays	21/3/2024	(70,155)
JPY	6,305,966	EUR	987,000,000	Barclays	21/3/2024	(224,489)
JPY	39,186,178	USD	5,597,530,000	State Street	21/3/2024	(1,632,089)
JPY	795,550	USD	114,000,000	Société Générale	21/3/2024	(30,719)
JPY	800,981	USD	115,000,000	HSBC Bank	21/3/2024	(29,440)
JPY	1,647,942	USD	230,000,000	Deutsche Bank	21/3/2024	(104,862)
JPY	1,018,820	EUR	158,025,000	Goldman Sachs	21/3/2024	(45,924)
JPY	2,085,000	USD	293,590,101	Nomura	21/3/2024	(115,290)
JPY	1,835,987	USD	262,000,000	Goldman Sachs	21/3/2024	(78,217)
JPY	2,323,223	EUR	369,000,000	UBS	21/3/2024	(46,659)
JPY	11,680,385	EUR	1,863,845,000	State Street	5/3/2024	(200,759)
JPY	2,998,285	USD	441,000,000	Morgan Stanley	21/3/2024	(39,596)
JPY	224,000	USD	33,541,040	BNY Mellon	22/3/2024	1,065
JPY	620,731	EUR	100,975,000	Bank of America	21/3/2024	3,525
KRW	385,604	USD	495,000,000	Citibank	20/6/2024	(12,328)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損） （米ドル）
KRW	1,284,706	USD	1,678,618,000	Citigroup	14/3/2024	(24,136)
KRW	747,994	USD	975,000,000	Royal Bank of Canada	20/3/2024	(15,821)
KRW	1,265,229	USD	1,654,160,000	BNP Paribas	20/3/2024	(23,043)
MXN	243,833	USD	4,300,000	Morgan Stanley	20/3/2024	7,542
MXN	11,003,362	USD	193,745,002	Citigroup	20/3/2024	322,773
MXN	450,473	USD	7,722,000	Goldman Sachs	14/3/2024	1,394
MXN	1,696,341	USD	29,100,000	Goldman Sachs	20/3/2024	4,816
MXN	61,265	USD	1,050,000	JP Morgan	20/3/2024	117
MYR	1,483,791	USD	6,901,854	Barclays	14/3/2024	(29,036)
NOK	447,783	USD	4,857,000	RBS	20/3/2024	11,494
NOK	17,155	EUR	202,018	Citigroup	14/3/2024	480
NOK	187,845	EUR	2,211,662	Barclays	14/3/2024	5,219
NOK	856,179	SEK	900,000	Bank of America	20/3/2024	2,075
NOK	36,476	USD	400,000	JP Morgan	20/3/2024	1,348
NOK	775,780	SEK	800,000	UBS	20/3/2024	416
NOK	36,506	USD	400,000	Deutsche Bank	20/3/2024	1,318
NOK	413,000	EUR	4,648,563	BNP Paribas	14/3/2024	(8,763)
NOK	1,463,847	SEK	1,480,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(2,010)
NOK	2,678,563	SEK	2,710,000	JP Morgan	20/3/2024	(3,501)
NOK	424,331	SEK	430,000	BNP Paribas	20/3/2024	(489)
NOK	881,302	SEK	890,000	Barclays	20/3/2024	(1,308)
NOK	423,850	SEK	430,000	Goldman Sachs	20/3/2024	(443)
NZD	580,000	AUD	621,777	Barclays	20/3/2024	1,052
NZD	190,000	AUD	205,247	Standard Chartered Bank	20/3/2024	1,299
NZD	120,000	AUD	129,170	JP Morgan	20/3/2024	539
NZD	80,000	AUD	85,913	Morgan Stanley	20/3/2024	237
NZD	120,000	AUD	127,602	Royal Bank of Canada	20/3/2024	(419)
NZD	185,007	USD	300,000	Goldman Sachs	20/3/2024	(1,764)
NZD	470,000	AUD	499,837	Goldman Sachs	20/3/2024	(1,601)
PEN	463,722	USD	1,764,000	Citigroup	14/3/2024	2,801
PEN	234,253	USD	900,000	Deutsche Bank	14/3/2024	3,769
PLN	1,918,094	USD	7,735,478	Citigroup	14/3/2024	25,870
PLN	180,493	USD	725,000	State Street	20/3/2024	1,689
PLN	2,181,039	USD	8,760,000	BNP Paribas	20/3/2024	20,214
PLN	1,171,069	USD	4,650,000	UBS	20/3/2024	(2,596)
PLN	114,509	EUR	500,000	JP Morgan	20/3/2024	1,326
PLN	57,392	EUR	250,000	Morgan Stanley	20/3/2024	514
PLN	2,016,459	USD	8,127,467	Morgan Stanley	14/3/2024	26,013
PLN	2,014,582	USD	8,110,000	Morgan Stanley	5/3/2024	23,747
PLN	57,478	EUR	250,000	HSBC Bank	20/3/2024	420
PLN	145,015	EUR	630,000	Goldman Sachs	20/3/2024	875
PLN	1,245,772	USD	5,000,000	UBS	5/3/2024	10,905
PLN	149,753	EUR	650,000	State Street	20/3/2024	756
PLN	459,691	USD	1,828,000	BNP Paribas	14/3/2024	(306)
PLN	115,726	EUR	500,000	Deutsche Bank	20/3/2024	5
PLN	115,970	EUR	500,000	Barclays	20/3/2024	(260)
RON	428,084	USD	1,980,000	BNP Paribas	14/3/2024	3,901
SEK	57,717	USD	600,000	BNP Paribas	20/3/2024	469
SEK	400,000	NOK	387,958	Deutsche Bank	20/3/2024	(201)
SEK	1,900,000	NOK	1,864,695	UBS	20/3/2024	1,167
SEK	245,765	USD	2,500,000	JP Morgan	20/3/2024	(3,325)
SEK	157,815	USD	1,600,000	Barclays	20/3/2024	(2,653)
SEK	68,019	USD	698,000	Morgan Stanley	20/3/2024	(330)
SEK	4,780,000	NOK	4,744,746	JP Morgan	20/3/2024	8,132
SEK	1,380,000	NOK	1,366,549	Standard Chartered Bank	20/3/2024	2,030
SEK	880,000	NOK	873,130	Morgan Stanley	20/3/2024	1,460
SEK	440,000	NOK	436,701	Goldman Sachs	20/3/2024	743
SEK	1,061,378	USD	11,110,000	Morgan Stanley	5/3/2024	15,332
SEK	780,000	NOK	773,966	Royal Bank of Canada	20/3/2024	1,299

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年 2 月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損） （米ドル）
SGD	1,189,638	USD	1,600,000	Barclays	5/3/2024	1,582
THB	98,245	EUR	3,730,000	JP Morgan	20/3/2024	(2,520)
THB	146,388	EUR	5,610,000	HSBC Bank	20/3/2024	(2,298)
THB	2,274,959	USD	80,717,819	Barclays	14/3/2024	(22,493)
THB	361,398	EUR	13,800,000	Barclays	20/3/2024	(7,064)
TRY	310,817	USD	12,085,710	Goldman Sachs	4/12/2024	(22,034)
TRY	129,982	USD	5,204,290	Barclays	4/12/2024	(5,628)
TRY	5,229	USD	164,000	BNP Paribas	5/3/2024	17
TWD	1,431,139	USD	44,400,000	State Street	20/3/2024	(25,834)
TWD	390,263	USD	11,800,000	BNP Paribas	20/6/2024	(13,832)
USD	15,494,177	BRL	2,976,614	BNY Mellon	2/4/2024	(129,327)
USD	11,800,000	TWD	384,490	Bank of America	20/6/2024	8,058
USD	510,000	CAD	375,959	Barclays	20/3/2024	(612)
USD	4,658,000	SEK	448,381	RBS	20/3/2024	(3,334)
USD	4,630,000	EUR	4,998,106	Société Générale	20/3/2024	(28,426)
USD	2,460,000	EUR	2,670,764	UBS	20/3/2024	79
USD	272,180,570	JPY	1,869,090	HSBC Bank	21/3/2024	43,017
USD	412,076,000	CLP	450,559	Citigroup	14/3/2024	25,481
USD	47,363,003	CZK	2,087,107	Barclays	14/3/2024	57,945
USD	48,490,380	ZAR	2,525,628	State Street	14/3/2024	1,283
USD	22,919,448	MXN	1,296,650	Barclays	14/3/2024	(44,523)
USD	21,412,704	BRL	4,283,280	Goldman Sachs	14/3/2024	(17,874)
USD	8,655,575	PLN	2,146,242	Citigroup	14/3/2024	(28,947)
USD	12,778,765,689	COP	3,145,375	Citigroup	14/3/2024	(97,806)
USD	44,462,430,530	IDR	2,834,685	UBS	14/3/2024	6,435
USD	3,130,000	EUR	3,380,914	BNP Paribas	20/3/2024	(17,152)
USD	676,500,000	JPY	4,716,944	Morgan Stanley	21/3/2024	178,273
USD	217,146,010,480	IDR	13,923,453	Standard Chartered Bank	20/3/2024	113,866
USD	186,290,000	INR	2,227,194	HSBC Bank	20/3/2024	(18,106)
USD	5,255,000	CNH	736,240	HSBC Bank	20/3/2024	6,094
USD	504,270,000	HUF	1,411,551	State Street	20/3/2024	21,475
USD	20,305,500	EUR	22,029,104	Deutsche Bank	20/3/2024	(15,442)
USD	14,460,000	GBP	18,207,789	Morgan Stanley	20/3/2024	(118,527)
USD	2,814,878,736	JPY	19,704,295	BNY Mellon	21/3/2024	819,143
USD	18,341,656,000	KRW	14,055,697	JP Morgan	20/3/2024	282,090
USD	43,664,410	MXN	2,478,468	Goldman Sachs	20/3/2024	(74,109)
USD	16,417,771	CNH	2,300,000	State Street	20/3/2024	18,865
USD	13,077,930,000	COP	3,258,558	Citigroup	20/3/2024	(57,013)
USD	4,468,504	PLN	1,111,739	HSBC Bank	14/3/2024	(11,218)
USD	79,235,883	BRL	15,901,560	Toronto-Dominion	20/3/2024	(4,218)
USD	16,530,000	MYR	3,550,639	Barclays	20/3/2024	65,973
USD	370,000	SEK	35,556	BNP Paribas	20/3/2024	(326)
USD	370,000	SEK	35,525	Goldman Sachs	20/3/2024	(356)
USD	600,000	NOK	54,973	Goldman Sachs	20/3/2024	(1,762)
USD	247,500,000	JPY	1,725,337	Goldman Sachs	21/3/2024	64,849
USD	2,950,000	EUR	3,207,143	Barclays	20/3/2024	4,492
USD	4,460,000	EUR	4,858,019	Morgan Stanley	20/3/2024	16,047
USD	2,200,000	ZAR	117,367	JP Morgan	20/3/2024	2,898
USD	86,680,000	MXN	4,912,116	Deutsche Bank	20/3/2024	(155,109)
USD	900,000	NOK	86,197	Morgan Stanley	20/3/2024	1,094
USD	1,800,000	NOK	173,293	JP Morgan	20/3/2024	3,086
USD	1,500,000	MXN	85,906	Barclays	20/3/2024	(1,782)
USD	1,700,000	NOK	165,716	Barclays	20/3/2024	4,965
USD	2,490,000	BRL	505,909	Barclays	20/3/2024	6,068
USD	1,005,000	AUD	683,326	Goldman Sachs	14/3/2024	27,198
USD	1,654,160,000	KRW	1,265,229	BNP Paribas	20/3/2024	23,043
USD	1,400,000	MXN	81,085	JP Morgan	20/3/2024	(757)
USD	8,559,000	ZAR	452,211	Citigroup	14/3/2024	6,641
USD	657,000	NOK	63,438	BNP Paribas	20/3/2024	1,313
USD	175,000,000	JPY	1,215,839	Toronto-Dominion	21/3/2024	41,756

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損） （米ドル）
USD	1,100,000	ZAR	58,400	UBS	20/3/2024	1,165
USD	1,754,658,000	COP	446,024	BNP Paribas	14/3/2024	701
USD	7,655,000	MXN	448,093	Goldman Sachs	14/3/2024	147
USD	495,000,000	KRW	378,527	Morgan Stanley	20/6/2024	5,251
USD	87,000,000	JPY	609,419	Deutsche Bank	21/3/2024	25,732
USD	3,500,000	ZAR	187,060	Barclays	20/3/2024	4,950
USD	580,000	AUD	389,145	Bank of America	20/3/2024	10,409
USD	2,083,511,844	COP	524,855	BNY Mellon	14/3/2024	(3,929)
USD	3,080,000	EUR	3,345,718	JP Morgan	20/3/2024	1,934
USD	8,850,000,000	COP	2,207,809	BNP Paribas	20/3/2024	(35,881)
USD	14,584,196	CNY	2,058,897	Citigroup	29/4/2024	4,303
USD	2,028,169,235	COP	511,789	BNY Mellon	20/3/2024	(2,401)
USD	22,263,690,000	IDR	1,410,564	BNP Paribas	20/3/2024	(5,315)
USD	70,000	GBP	88,903	Citigroup	5/3/2024	195
USD	11,490,000	CNH	1,601,557	BNP Paribas	5/3/2024	6,741
USD	22,230,000	JPY	151,016	Nomura	5/3/2024	2,261
USD	8,110,000	PLN	2,014,388	Morgan Stanley	20/3/2024	(23,530)
USD	13,105,268	EUR	14,190,991	Deutsche Bank	5/3/2024	(27,867)
USD	214,809,000	CLP	229,497	Morgan Stanley	14/3/2024	7,910
USD	31,000,000	CNH	4,322,307	HSBC Bank	4/3/2024	19,793
USD	421,880	AUD	277,947	Citigroup	5/3/2024	2,598
USD	628,901,857	JPY	4,276,597	Deutsche Bank	5/3/2024	68,226
USD	21,616,429	CAD	16,098,752	Toronto-Dominion	5/3/2024	141,481
USD	2,598,000	NZD	1,590,436	UBS	5/3/2024	3,549
USD	5,468,000	CHF	6,354,423	State Street	5/3/2024	131,840
USD	4,111,340	GBP	5,215,000	BNY Mellon	5/3/2024	4,871
USD	40,715,000	SEK	3,921,574	Goldman Sachs	5/3/2024	(24,261)
USD	432,780	AUD	285,000	Morgan Stanley	5/3/2024	2,537
USD	14,040,914	MXN	815,412	Morgan Stanley	5/3/2024	(7,436)
USD	99,804,269	ZAR	5,308,409	Morgan Stanley	5/3/2024	108,689
USD	19,810,000	NOK	1,895,906	Morgan Stanley	5/3/2024	23,414
USD	13,151,000	DKK	1,914,695	BNP Paribas	5/3/2024	436
USD	4,320,000	SGD	3,228,973	Toronto-Dominion	5/3/2024	12,680
USD	32,058,000	PLN	8,010,408	State Street	5/3/2024	(46,901)
USD	234,033,095	MXN	13,589,363	BNP Paribas	5/3/2024	(125,814)
USD	575,172,257	CNH	80,172,990	HSBC Bank	5/3/2024	338,914
USD	99,752,171	CZK	4,344,400	Citigroup	5/3/2024	70,236
USD	1,730,000	RON	376,680	Barclays	5/3/2024	(822)
USD	61,371,000	THB	1,732,734	UBS	5/3/2024	21,426
USD	33,082,640	GBP	41,977,033	State Street	5/3/2024	52,789
USD	455,070,000	HUF	1,278,372	Nomura	5/3/2024	22,237
USD	248,418,333	EUR	269,779,329	BNP Paribas	5/3/2024	252,236
USD	1,038,000	EUR	1,129,373	JP Morgan	14/3/2024	2,753
USD	8,585,361,808	JPY	59,025,963	UBS	5/3/2024	1,575,998
USD	11,660,000	CNH	1,628,590	Deutsche Bank	5/3/2024	10,179
USD	700,000	EUR	757,790	State Street	5/3/2024	(1,691)
USD	1,000,000	EUR	1,080,942	Morgan Stanley	5/3/2024	(4,030)
USD	3,077,000	PEN	808,078	Citigroup	14/3/2024	(5,692)
USD	83,727,000	HUF	231,725	UBS	14/3/2024	799
USD	1,400,000	MXN	81,311	Morgan Stanley	20/3/2024	(532)
USD	1,510,000	EUR	1,628,550	Citigroup	20/3/2024	(10,772)
USD	32,880,000	THB	916,042	Citigroup	14/3/2024	(1,489)
USD	220,500,000	JPY	1,499,949	Barclays	21/3/2024	20,604
USD	4,410,000	CHF	5,072,825	Barclays	20/3/2024	45,912
USD	580,000	GBP	732,073	HSBC Bank	20/3/2024	(3,007)
USD	222,567,000	CLP	229,687	Société Générale	14/3/2024	98
USD	50,000	GBP	63,064	UBS	5/3/2024	(299)
USD	200,000	EUR	215,968	Barclays	5/3/2024	(1,026)
USD	90,000	CAD	66,509	UBS	5/3/2024	71
USD	3,096,026,000	COP	785,544	Société Générale	21/3/2024	767
USD	250,000	EUR	270,642	Goldman Sachs	20/3/2024	(769)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／（損） （米ドル）
USD	1,280,000	EUR	1,378,395	UBS	5/3/2024	(10,370)
USD	7,016,937	TWD	224,000	Royal Bank of Canada	22/3/2024	1,894
USD	100,000	GBP	126,091	BNY Mellon	20/3/2024	(647)
USD	5,950,264,000	COP	1,508,630	Citigroup	22/3/2024	633
USD	300,000	NZD	185,434	Morgan Stanley	20/3/2024	2,191
USD	4,496,666,000	COP	1,138,973	HSBC Bank	22/3/2024	(633)
USD	300,000	NZD	186,093	Barclays	20/3/2024	2,850
USD	423,000	EUR	459,057	Citigroup	14/3/2024	(57)
USD	960,000	EUR	1,042,070	Bank of America	20/3/2024	(148)
USD	420,000	PLN	105,573	Barclays	5/3/2024	12
USD	1,470,000	EUR	1,594,033	Royal Bank of Canada	5/3/2024	(876)
USD	1,380,000	EUR	1,497,293	HSBC Bank	20/3/2024	(896)
USD	153,400,000	THB	4,260,697	JP Morgan	3/4/2024	(27,094)
ZAR	5,483,691	USD	104,533,426	State Street	20/3/2024	(44,645)
ZAR	77,983	USD	1,500,000	Goldman Sachs	20/3/2024	65
ZAR	79,600	USD	1,500,000	HSBC Bank	20/3/2024	(1,552)
ZAR	191,907	USD	3,623,372	JP Morgan	20/3/2024	(3,377)
ZAR	9,400	USD	176,628	Morgan Stanley	20/3/2024	(210)
ZAR	460,082	USD	8,816,000	BNP Paribas	14/3/2024	(1,133)
未実現純評価益						2,669,515
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	5,347,610	USD	4,632,146	BNY Mellon	15/3/2024	(70,308)
USD	76,243	CHF	87,681	BNY Mellon	15/3/2024	820
未実現純評価損						(69,488)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	100,876	USD	726,236	BNY Mellon	15/3/2024	(5)
USD	220,297	CNY	30,525	BNY Mellon	15/3/2024	(73)
未実現純評価損						(78)
ヘッジを使用したデンマーク・クローネ建投資証券クラス						
DKK	81	USD	556	BNY Mellon	15/3/2024	1
USD	8	DKK	2	BNY Mellon	15/3/2024	-
未実現純評価益						1
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	130,431,525	USD	121,092,653	BNY Mellon	15/3/2024	1,004,438
USD	1,712,837	EUR	1,838,928	BNY Mellon	15/3/2024	(20,212)
未実現純評価益						984,226
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	293,532,331	USD	233,392,244	BNY Mellon	15/3/2024	2,254,709
USD	4,147,650	GBP	5,210,083	BNY Mellon	15/3/2024	(46,394)
未実現純評価益						2,208,315
ヘッジを使用したノルウェー・クローネ建投資証券クラス						
NOK	71,531,007	USD	761,363,364	BNY Mellon	15/3/2024	453,707
USD	12,507,041	NOK	1,170,353	BNY Mellon	15/3/2024	(12,151)
未実現純評価益						441,556
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	5,843	USD	9,634	BNY Mellon	15/3/2024	42
USD	150	NZD	91	BNY Mellon	15/3/2024	(1)
未実現純評価益						41
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	142,407	USD	191,333	BNY Mellon	15/3/2024	109
USD	3,253	SGD	2,414	BNY Mellon	15/3/2024	(9)
未実現純評価益						100
未実現純評価益合計						6,234,188

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

未決済上場先物取引 2024年 2月29日現在

取引数	通貨	取引 / 摘要	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)
(254)	EUR	Euro BOBL	2024年 3月	415,372
(126)	EUR	Euro Bund	2024年 3月	228,118
(9)	EUR	Euro BUXL	2024年 3月	26,377
291	EUR	Euro Schatz	2024年 3月	(23,055)
9	EUR	Euro-BTP	2024年 3月	2,246
38	EUR	Euro-OAT	2024年 3月	242
21	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2024年 3月	14,569
82	AUD	Australian 10 Year Bond	2024年 3月	61,494
119	AUD	Australian 3 Year Bond	2024年 3月	36,933
15	KRW	Korean 3 Year Bond	2024年 3月	1,464
(57)	USD	30 Day Federal Funds	2024年 3月	17,814
190	USD	US Long Bond (CBT)	2024年 6月	291,495
244	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2024年 6月	85,465
(819)	USD	US Ultra 10 Year Note	2024年 6月	(277,183)
(6)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2024年 6月	180
84	CAD	Canadian 10 Year Bond	2024年 6月	24,604
82	GBP	Long Gilt	2024年 6月	8,756
678	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2024年 6月	110,680
351	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2024年 6月	109,169
(24)	AUD	90 Day Bank Bill	2024年12月	1,514
40	AUD	90 Day Bank Bill	2025年12月	(821)
合計				1,135,433

スワップ 2024年 2月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (10,815)	ファンドはZiggo Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5 %の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2028	157	951
CDS	USD (11,583,000)	ファンドはCDX HY CDSI S41 5Y 12/20/2028に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5 %の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2028	647,529	745,405
CDS	EUR (15,575)	ファンドはZiggo Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5 %の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2028	191	1,369
CDS	EUR 10,172,688	ファンドはITRAXX.XO.40.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け、5 %の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2028	(49,849)	(870,119)
CDS	USD (9,000,000)	ファンドはMexicanに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1 %の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(36,417)	59,066
CDS	EUR (72,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5 %の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	2,158	8,717
CDS	USD 13,239,800	ファンドはCDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け、5 %の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(644,847)	(883,892)
IFS	EUR 1,205,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.14266%の固定金利を支払う	Bank of America	15/2/2034	7,696	9,968
IFS	USD 455,000	ファンドはUSCPIU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.466%の固定金利を支払う	Bank of America	6/12/2033	655	655
IFS	USD 2,290,000	ファンドはUSCPIU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.46%の固定金利を受け取る	Bank of America	8/2/2034	(9,584)	(9,584)
IFS	USD 2,290,000	ファンドはUSCPIU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.465%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2044	9,520	9,520
IFS	EUR 1,550,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを受け、2.2119%の固定金利を支払う	Bank of America	15/2/2034	1,879	1,879
IFS	EUR 1,550,000	ファンドはCPTFEMU + Obpsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2.3672%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/2/2044	(9,846)	(9,846)
IRS	BRL 2,280,000	ファンドは9.935%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Barclays	4/1/2027	(307)	(307)
IRS	BRL 1,512,656	ファンドは11.59825%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Barclays	2/1/2026	7,280	7,280
IRS	BRL 2,301,764	ファンドは11.856321%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Barclays	2/1/2026	14,251	14,251
IRS	EUR 2,175,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.97302%の固定金利を支払う	BNP Paribas	12/12/2025	14,005	13,395

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

スワップ 2024年 2月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益／（損） （米ドル）	時価 （米ドル）
IRS	USD 10,950,000	ファンドは3.3755%の固定金利を受け取り、 1日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/2/2029	(36,909)	(36,909)
IRS	JPY 186,000,000	ファンドは1.325%の固定金利を受け取り、 JPY 1日TONARの変動金利を支払う	BNP Paribas	21/9/2033	7,254	7,254
IRS	JPY 231,000,000	ファンドは1.335%の固定金利を受け取り、 JPY 1日TONARの変動金利を支払う	BNP Paribas	28/9/2033	9,553	9,553
IRS	EUR 740,000	ファンドは2.68451%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	12/2/2044	3,628	868
IRS	EUR 790,000	ファンドは2.45466%の固定金利を受け取り、 EUR 1日ESTRの変動金利を支払う	BNP Paribas	24/1/2054	4,111	2,349
IRS	EUR 780,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、 2.46833%の固定金利を支払う	BNP Paribas	24/1/2054	(5,258)	(2,639)
IRS	KRW 4,277,040,000	ファンドは3.865%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	3/7/2024	1,527	1,527
IRS	KRW 2,048,250,000	ファンドは3.925%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/11/2024	3,049	3,049
IRS	KRW 2,618,160,000	ファンドは3.865%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	16/11/2024	3,174	3,174
IRS	MXN 84,890,000	ファンドは1ヶ月MXN-TIIEの変動金利を受け取り、 10.95%の固定金利を支払う	Bank of America	3/12/2024	(1,494)	(1,494)
IRS	JPY 120,620,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.23%の固定金利を支払う	Bank of America	11/1/2025	(708)	(708)
IRS	JPY 741,200,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.235%の固定金利を支払う	Bank of America	19/1/2025	(4,547)	(4,547)
IRS	MXN 69,367,000	ファンドは1ヶ月MXN-TIIEの変動金利を受け取り、 10.755%の固定金利を支払う	Bank of America	23/1/2025	954	954
IRS	CZK 53,459,000	ファンドは3ヶ月CZK-PRIBORの変動金利を受け取り、 4.675%の固定金利を支払う	Bank of America	20/3/2025	(6,330)	(6,330)
IRS	MXN 43,733,000	ファンドは10.835%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	25/9/2025	31,064	31,064
IRS	JPY 591,000,000	ファンドは1日JPY-TONA-OIS Compoundの変動金利を受け取り、 0.325%の固定金利を支払う	Bank of America	6/11/2025	(6,394)	(6,394)
IRS	JPY 588,000,000	ファンドは1日JPY-TONA-OIS Compoundの変動金利を受け取り、 0.2335%の固定金利を支払う	Bank of America	14/12/2025	517	517
IRS	CZK 27,948,000	ファンドは6ヶ月CZK-PRIBORの変動金利を受け取り、 4.098%の固定金利を支払う	Bank of America	20/3/2026	(8,117)	(8,117)
IRS	JPY 752,070,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.266%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	9,209	9,209
IRS	JPY 169,670,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.2925%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	1,779	1,779
IRS	JPY 169,650,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.3205%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	1,463	1,463
IRS	JPY 169,680,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.324%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	1,424	1,424
IRS	JPY 508,930,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.33%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	4,068	4,068
IRS	JPY 259,590,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.331%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	2,058	2,058
IRS	JPY 249,410,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、 0.364%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	1,430	1,430
IRS	KRW 2,195,685,017	ファンドは3.376%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(1,029)	(1,029)
IRS	JPY 303,000,000	ファンドは1日JPY-TONA-OIS Compoundの変動金利を受け取り、 0.635%の固定金利を支払う	Bank of America	8/10/2026	(2,808)	(2,808)
IRS	JPY 303,000,000	ファンドは1日JPY-TONA-OIS Compoundの変動金利を受け取り、 0.6515%の固定金利を支払う	Bank of America	8/10/2026	(3,139)	(3,139)
IRS	USD 20,260,000	ファンドは4.2193%の固定金利を受け取り、 1日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	30/10/2026	98,619	98,619
IRS	JPY 2,806,850,542	ファンドは0.035%の固定金利を受け取り、 JPY 1日TONARの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2027	(108,074)	(167,309)
IRS	GBP 1,290,000	ファンドは3.44723%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	(6,340)	(4,779)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

スワップ 2024年 2 月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益／（損） （米ドル）	時価 （米ドル）
IRS	JPY 457,000,000	ファンドはJPY 1 日TONARの変動金利を受け取り、0.672%の固定金利を支払う	Bank of America	22/9/2027	(7,319)	(7,319)
IRS	JPY 549,000,000	ファンドはJPY 1 日TONARの変動金利を受け取り、0.705%の固定金利を支払う	Bank of America	29/9/2027	(11,021)	(11,021)
IRS	GBP 2,350,000	ファンドは4.11%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	13/10/2027	11,413	11,145
IRS	GBP 720,000	ファンドは4.39%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	20/10/2027	5,641	5,639
IRS	GBP 720,000	ファンドは4.398%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	20/10/2027	5,701	5,702
IRS	USD 10,220,000	ファンドは4.24%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	27/10/2027	108,157	109,433
IRS	USD 10,360,000	ファンドは4.1788%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	3/11/2027	84,816	99,964
IRS	USD 51,800,000	ファンドは3.95%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	6/11/2027	290,668	290,668
IRS	USD 5,170,000	ファンドは3.9703%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	6/11/2027	30,880	30,880
IRS	USD 10,470,000	ファンドは3.8668%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	13/11/2027	43,587	43,587
IRS	GBP 3,450,000	ファンドは3.70225%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	1/12/2027	1,512	1,902
IRS	USD 16,420,000	ファンドは3.4853%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	23/1/2028	(36,805)	(36,805)
IRS	GBP 2,740,000	ファンドは3.175%の固定金利を受け取り、GBP 1 日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/1/2028	(13,356)	(13,294)
IRS	EUR 1,890,000	ファンドは1.93909%の固定金利を受け取り、EUR 1 日ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2028	(8,254)	(13,483)
IRS	GBP 4,680,000	ファンドは3.32047%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2028	(8,178)	(15,180)
IRS	USD 12,849,200	ファンドは3.8761%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2028	60,675	60,675
IRS	USD 12,849,200	ファンドは 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を受け取り、3.2761%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2028	75,391	75,391
IRS	USD 13,382,000	ファンドは4.403%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	31/10/2028	214,958	214,958
IRS	GBP 1,730,000	ファンドは3.46724%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	6/12/2028	(595)	(1,038)
IRS	MXN 30,959,000	ファンドは8.67%の固定金利を受け取り、 1 ヶ月MXN-TIIEの変動金利を支払う	Bank of America	18/1/2029	(5,361)	(5,361)
IRS	USD 5,110,000	ファンドは3.223%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2029	(30,498)	(30,498)
IRS	USD 4,350,000	ファンドは3.356%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2029	(16,107)	(16,107)
IRS	USD 240,000	ファンドは3.4205%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2029	(625)	(625)
IRS	GBP 2,420,000	ファンドは3.3086%の固定金利を受け取り、 1 日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2029	(1,879)	(4,979)
IRS	KRW 2,216,180,000	ファンドは3.292%の固定金利を受け取り、KRW 3 ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2029	(937)	(937)
IRS	USD 4,900,000	ファンドは4.01%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	12/1/2034	61,185	61,185
IRS	USD 1,887,500	ファンドは4.0085%の固定金利を受け取り、 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Bank of America	17/1/2034	23,406	23,406
IRS	EUR 1,420,000	ファンドは2.611%の固定金利を受け取り、EUR 1 日ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2034	4,486	4,486
IRS	EUR 560,000	ファンドは2.59099%の固定金利を受け取り、EUR 1 日ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2034	1,490	1,126
IRS	GBP 5,410,000	ファンドは0.701161%の固定金利を受け取り、GBP 1 日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	13/9/2051	(2,992,903)	(3,622,682)
IRS	USD 2,631,000	ファンド 1 日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を受け取り、3.658%の固定金利を支払う	Bank of America	3/11/2053	(9,054)	(9,054)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

スワップ 2024年2月29日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益／（損） （米ドル）	時価 （米ドル）
IRS	USD 840,000	ファンド1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を受け取り、3.307%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2054	11,440	11,440
IRS	USD 720,000	ファンド1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を受け取り、3.3777%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2054	4,858	4,858
IRS	USD 1,800,000	ファンド1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を受け取り、3.3877%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2054	10,394	10,394
IRS	USD 310,000	ファンド1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を受け取り、3.4032%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2054	1,323	1,323
IRS	EUR 435,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.32257%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2064	(7,381)	(5,001)
IRS COP 5,893,088,000		ファンド1日COP-IBR-BANREPの変動金利を受け取り、10.3%の固定金利を支払う	Citibank	29/1/2025	3,377	3,377
IRS COP 4,139,223,421		ファンド1日COP-IBR-BANREPの変動金利を受け取り、10.1763%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(727)	(727)
IRS	BRL 1,493,894	ファンドは11.796128%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2026	8,743	8,743
IRS	PLN 19,413,000	ファンドは5.676%の固定金利を受け取り、3ヶ月PLN-WIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2025	(3,781)	(3,781)
IRS	USD 3,000	ファンドは4.051%の固定金利を受け取り、1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/10/2025	(31)	(31)
IRS CLP 1,155,303,000		ファンド1日CLP Sinacofi Chile Interbank Rateの変動金利を受け取り、4.44%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	26/1/2028	8,546	8,546
IRS	BRL 1,559,727	ファンドは11.811176%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2026	9,260	9,261
IRS	GBP 6,330,000	ファンドは4.18552%の固定金利を受け取り、1日GBP-SONIA-01S Compoundの変動金利を支払う	Morgan Stanley	28/2/2026	2,075	1,234
IRS	GBP 9,100,000	ファンドは3.57%の固定金利を受け取り、1日GBP-SONIA-01S Compoundの変動金利を支払う	Morgan Stanley	16/2/2028	(4,277)	(4,277)
IRS	GBP 1,040,000	ファンド1日GBP-SONIA-01S Compoundの変動金利を受け取り、4.04061%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	28/2/2044	(5,581)	(5,483)
IRS	BRL 85,653,168	ファンドは10.683879%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	(50,531)	(50,531)
IRS	BRL 2,742,905	ファンドは11.866354%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2026	17,136	17,136
IRS	BRL 5,976,000	ファンドは9.785%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(6,961)	(6,961)
IRS	USD 1,000	ファンドは3.5%の固定金利を受け取り、1日USD-SOFR-01S Compoundの変動金利を支払う	Goldman Sachs	17/10/2033	(29)	(29)
TRS	USD 998,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + Obpsを支払う	JP Morgan	20/3/2024	(7,366)	(11,071)
合計					(2,180,234)	(3,726,951)

CDS：クレジット・デフォルト・スワップ

IFS：インフレ・スワップ

IRS：金利スワップ

TRS：トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

買建オプション 2024年 2 月29日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
52,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.054	27/3/2024	(3,652)	2,057
70,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.04	1/8/2024	(5,808)	7,964
40,000	プット	OTC EUR/PLN	Bank of America	EUR 4.2	16/8/2024	794	6,243
18,460,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.06	11/4/2024	(67,194)	23,365
4,600,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.08	5/3/2024	(869)	5,814
4,600,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.065	11/3/2024	(11,324)	975
25,010,000	コール	OTC NOK/SEK	JP Morgan	NOK 0.99	13/3/2024	(8,504)	1,155
270	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 110.25	1/3/2024	(122,044)	18,984
合計						(218,601)	66,557

売建オプション 2024年 2 月29日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益 (米ドル)	時価 (米ドル)
(18,460,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.05	11/4/2024	41,553	(8,683)
(270)	プット	US Treasury 6-7 Year Note	Exchange Traded	USD 109	1/3/2024	41,769	-
合計						83,322	(8,683)

買建スワップション 2024年 2 月29日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 7,868,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは 3 %の固定金利を2024年 9 月 5 日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2025年 3 月 5 日から半期ごとに支払う	JP Morgan	1/3/2024	(43,284)	73,007
USD 20,280,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは 4 %の固定金利を2025年10月 28日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年10 月28日から毎年支払う	JP Morgan	24/10/2024	(8,907)	153,499
USD 13,440,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは 3 %の固定金利を2026年 1 月 27日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2026年 1 月27日 から毎年支払う	Goldman Sachs	23/1/2025	(28,195)	154,639
AUD 4,070,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは3.3%の固定金利を2025年 8 月11日から半期ごとに受け取り、AUD BBSWの変動金利を2025年 5 月11日から四半期ごとに支払う	JP Morgan	10/2/2025	(2,073)	14,401
EUR 14,680,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは2.3%の固定金利を2025年 8 月14日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2025年 2 月14日から半期ごとに支払う	Morgan Stanley	12/8/2024	(25,197)	79,960
GBP 7,300,000	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 買う。行使されれば、ファンドは 4 %の固定金利を2025年 8 月 23日から毎年受け取り、GBP SONIAの変動金利を2025年 8 月23 日から毎年支払う	Barclays	23/8/2024	(2,476)	44,768
合計				(110,132)	520,274

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

売建スワップション 2024年2月29日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益／（損） （米ドル）	時価 （米ドル）
EUR (7,868,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは3.45%の固定金利を2024年9 月5日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2025年3 月5日から半期ごとに支払う	JP Morgan	1/3/2024	56,812	-
EUR (7,868,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を 2024年9月5日から半期ごとに受け取り、2.5%の固定金利を 2025年3月5日から毎年支払う	JP Morgan	1/3/2024	46,011	-
USD (24,750,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは3.79%の固定金利を2025年3 月29日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年 3月29日から毎年支払う	JP Morgan	27/3/2024	(18,480)	(273,652)
USD (60,000,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4.4%の固定金利を2025年4 月8日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月8 日から毎年支払う	Citibank	4/4/2024	(118,755)	(198,780)
USD (21,250,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4%の固定金利を2025年4月 8日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月8日 から毎年支払う	Citibank	4/4/2024	(41,428)	(120,128)
USD (13,500,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4%の固定金利を2025年4月 18日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月18日 から毎年支払う	Deutsche Bank	16/4/2024	(39,404)	(86,296)
USD (13,500,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4.05%の固定金利を2025年4 月18日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月18 日から毎年支払う	Deutsche Bank	16/4/2024	(76,130)	(107,781)
USD (6,700,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4%の固定金利を2025年4月 24日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月24日 から毎年支払う	Deutsche Bank	22/4/2024	(15,920)	(45,099)
USD (16,100,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4.3%の固定金利を2025年4 月24日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年4月24 日から毎年支払う	Deutsche Bank	22/4/2024	(46,517)	(74,338)
EUR (2,130,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは2.85%の固定金利を2025年5 月2日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2024年11 月2日から半期ごとに支払う	JP Morgan	29/4/2024	(5,151)	(11,618)
EUR (2,130,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは2.85%の固定金利を2025年5 月2日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2024年11 月2日から半期ごとに支払う	Goldman Sachs	29/4/2024	(3,847)	(11,618)
USD (13,820,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4%の固定金利を2025年5月 6日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年5月6日 から毎年支払う	Deutsche Bank	2/5/2024	(42,893)	(98,587)
USD (26,570,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4.37%の固定金利を2025年7 月22日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年7月22 日から毎年支払う	Deutsche Bank	18/7/2024	(60,912)	(107,409)
USD (9,470,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは4.17%の固定金利を2025年7 月22日から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年7月22 日から毎年支払う	Citibank	18/7/2024	(18,746)	(65,149)
EUR (14,680,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を 2025年8月14日から半期ごとに受け取り、2%の固定金利を 2025年2月14日から毎年支払う	Morgan Stanley	12/8/2024	11,977	(40,207)
GBP (7,300,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはGBP SONIAの変動金利を2025 年8月23日から毎年受け取り、3.5%の固定金利を2025年8月 23日から毎年支払う	Barclays	23/8/2024	(1,087)	(23,042)
USD (20,280,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2025年 10月28日から毎年受け取り、3.3%の固定金利を2025年10月28 日から半期ごとに支払う	JP Morgan	24/10/2024	22,009	(67,003)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド（続き）

売建スワップション 2024年 2 月29日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (20,280,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは 5 % の固定金利を2025年10月 28日から半期ごとに受け取り、USD SOFRの変動金利を2025年10 月28日から毎年支払う	JP Morgan	24/10/2024	77,739	(33,174)
USD (13,440,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2026年 1 月27日から毎年受け取り、2.25%の固定金利を2026年 1 月27 日から毎年支払う	Goldman Sachs	23/1/2025	12,776	(42,558)
EUR (1,265,000)	ファンドは金利スワップを締結するためブット・オプションを 売る。行使されれば、ファンドは2.87%の固定金利を2026年 1 月31日から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を2025年 7 月31日から半期ごとに支払う	Barclays	29/1/2025	(2,759)	(14,759)
AUD (8,140,000)	ファンドは金利スワップを締結するためコール・オプションを 売る。行使されれば、ファンドはAUD BBSWの変動金利を2025年 8月11日から四半期ごとに受け取り、2.5%の固定金利を2025 年 5 月11日から半期ごとに支払う	JP Morgan	10/2/2025	2,810	(7,818)
合計				(261,895)	(1,429,016)

事後通告証券契約 2024年 2 月29日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)	保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産 比率 (%)
TBA	米国			USD 2,006,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	1,947,779	0.19
USD 2,015,000	Fannie Mae or Freddie Mac 1.5% TBA	1,737,613	0.17	USD 1,875,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5.5% TBA	1,856,250	0.18
USD 1,428,500	Fannie Mae or Freddie Mac 1.5% TBA	1,067,581	0.11	USD 4,377,700	Ginnie Mae 2% TBA	3,568,509	0.36
USD 10,777,008	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	8,483,526	0.85	USD 4,085,400	Ginnie Mae 2.5% TBA	3,460,148	0.35
USD 1,342,000	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	1,217,738	0.12	USD 3,018,600	Ginnie Mae 3% TBA	2,648,244	0.26
USD 9,095,900	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	7,484,943	0.75	USD 2,098,000	Ginnie Mae 3.5% TBA	1,899,677	0.19
USD 764,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	707,892	0.07	USD 1,353,000	Ginnie Mae 4% TBA	1,260,503	0.13
USD 4,843,537	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	4,152,406	0.41	USD 1,137,000	Ginnie Mae 4.5% TBA	1,087,286	0.11
USD 175,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	165,702	0.02	USD 1,410,000	Ginnie Mae 5% TBA	1,378,154	0.14
USD 18,684,025	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	16,655,089	1.67	USD 1,053,000	Ginnie Mae 6% TBA	1,057,860	0.11
USD 142,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	136,839	0.01	USD 2,700,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	2,408,489	0.24
USD 2,938,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	2,708,684	0.27	USD 856,000	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	860,052	0.09
USD 334,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	326,930	0.03	USD 1,273,000	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	1,123,217	0.11
USD 19,794,700	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	18,753,917	1.88	USD 1,429,800	Fannie Mae or Freddie Mac 6.5% TBA	1,454,584	0.14
				USD 1,368,000	Ginnie Mae 5.5% TBA	1,359,525	0.14
				USD 865,000	Ginnie Mae 6.5% TBA	876,645	0.09
				TBA合計		91,845,782	9.19

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

[次へ](#)

財務書類に対する注記

１．組織

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

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

2024年2月29日現在、当社は105のサブファンド（以下それぞれを「ファンド」という。）における投資証券を発行しており、以下総称して「当ファンド」という。各ファンドは、それぞれ個別の資産プールである。各ファンドは、アペンディクスに詳述のとおり投資証券クラスに分類されており、それぞれ個別の投資証券により表象されている。

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

当期に生じた重要な事象

2023年9月28日付で、スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドは募集を再開した。

2023年10月26日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2023年10月26日付で、ナチュラル・リソース・グロース・アンド・インカム・ファンドはナチュラル・リソース・ファンドに名称を変更した。

2023年11月7日付で、チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンドは終了した。

2024年2月6日付で、米ドル建てのグローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンドが設定された。

2024年2月23日付で、ESGシステマティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ファンドはシステマティックESGマルチ・アローケーション・クレジット・ファンドに、またグローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンドはサステイナブル・グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンドに名称を変更した。

2024年2月23日付で、当社の英文目論見書の改訂版が発行された。

2022年3月1日、BGFエマージング・ヨーロッパ・ファンド（本パラグラフの残りの部分では「ファンド」という。）の重大な投資エクスポージャーにより、取締役会は、ファンドのすべての投資証券クラスの販売、買戻し、転換、および純資産価額の決定については、英文目論見書に基づくファンドの裁量に基づき、それ以降の通知までの期間、一時的に停止されることが、ファンドおよびその投資家の利益になると考えた。2022年3月3日、取締役会は、ファンドが保有するロシアの有価証券の価値をさらに大幅に評価減することを決定した。2022年3月9日、運用会社の取締役会は、ファンドの評価、販売および買戻しについて、ブラックロックのウェブサイトを通じてさらなる通知がなされるまで停止する一方で、ファンドに関連する投資運用報酬および年次サービス料を放棄する（2022年3月1日発効）という追加の例外的な決定を下した。2023年1月以降、月末の想定純資産価額はブラックロックのウェブサイトで公表されている。半期報告書に開示されている純資産価額は2024年2月29日現在のファンドの想定純資産価額である。期末日後、取締役会は当ファンドの投資主に対し、資産のうち

流動性があり取引可能な部分を、当社内に新設されたサブファンドに移管する決定を通知した。このファンドに関する詳細については注記18を参照のこと。

2．重要な会計方針の要約

当社の財務書類は、チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンドおよびエマージング・ヨーロッパ・ファンドを除き継続企業の前提に基づいて作成されている。チャイナ・フレキシブル・エクイティ・ファンドおよびエマージング・ヨーロッパ・ファンドは、ファンドを終了するという取締役の決定に伴い、非継続企業の前提に基づいて作成されている。詳細については注記1および18を参照のこと。これらのファンドについては、2024年2月29日現在の残存資産の帳簿価額を見積正味実現可能価額にて、またすべての負債を見積決済額で表示していることを除き、以下の重要な会計方針が一貫して適用されている。この財務書類は、ルクセンブルグの投資法人のためにルクセンブルグの関係官庁が規定した財務書類の作成に関連する法律および規制上の要件に準拠して作成されており、以下の重要な会計方針を含む。

（a）投資有価証券およびその他の資産の評価

当社の投資有価証券およびその他の資産は以下のとおり評価されている。

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

- ・ 定期預金は、償却原価で評価され、その評価額は公正価値に近似している。
- ・ 現金、預金、要求払手形およびその他の債務ならびに前払費用は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未収利息および未収配当金、売却投資有価証券未収金ならびに販売投資証券未収金を含む資産は、入手できる見込みがない場合を除き額面金額で評価される。
- ・ 特に未払費用、未払収益分配金、購入投資有価証券未払金および買戻し投資証券未払金を含む負債は、それらの額面金額で評価される。

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

（b）投資有価証券からの収益 / 費用

当社は以下の方法で投資有価証券からの収益を会計処理している。

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

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

（c）デリバティブ商品

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

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

当ファンドは1つの商品から発生する利益を他の投資より発生する利益と交換するために、スワップ契約を締結している。クレジット・デフォルト・スワップの場合、信用事由の発生による偶発的な支払い（当該契約

にあらかじめ定義されている）と引き換えに、一連のプレミアムがプロテクションの売り手に支払われる。スワップは可能な限り、第三者の値付機関から入手し、実際のマーケット・メーカーに確認した日々の価格に基づいて時価評価される。こうした時価が入手できない場合、スワップはマーケット・メーカーから入手する日々の相場に基づいて値付される。いずれの場合も、価格の変動は損益および純資産変動計算書に未実現評価益／（損）の純変動額として計上される。スワップの満期または解約時における実現損益およびスワップに関連して稼得または負担した利息は、損益および純資産変動計算書上に表示される。

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

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

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

当ファンドは、適切と思われる場合は決済前に契約を処分することがある。TBAの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。TBA売却契約が残存している間、当該取引をカバーするために、相応の交付可能有価証券または相殺対象となる（売却契約日以前に交付可能な）TBA購入契約を保有する。二者の取引相手が同一のTBA契約に対して相殺対象となる取引を行っている場合、これらの取引は相殺される。決済日において売り手は、約定日の2日前に指定された有価証券を引渡し、約定日に指定された現金を受け取る。ただし実務上は、ほとんどのTBA取引において、最終的に不動産担証券現物の引渡しは行われない。売り手は、現物を決済するのではなく、満期前に残存取引を解消または「ロール」する。

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

2024年2月29日現在、当ファンドは未決済のTBAを有していた。これは、純資産計算書の「売却投資有価証券未収金」および「購入投資有価証券未払金」に含まれている。

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

（d）為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、2024年2月29日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートで換算されている。

（e）結合財務書類

各ファンドの財務書類はファンドの基準通貨で表示されている。

当社の結合数値は米ドルで表示されており、各ファンドの財務書類の合計を含んでいる。純資産計算書の換算レートは、2024年2月29日におけるルクセンブルグでのファンドの評価時の為替レートである。

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9276	0.8002	147.6725	0.8815	7.2319

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

通貨	ユーロ	英ポンド	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
米ドル	0.9217	0.7891	149.465	0.8788	7.2051

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

損益および純資産変動計算書の結合数値は、期中の平均為替レートを用いて算定されている。その結果生じる為替換算調整額17,291,974米ドルは、2023年 8 月31日と2024年 2 月29日の間の為替レートの変動を表す。これは想定金額であり、個々のファンドの純資産に対する影響はない。

(f) 為替レート

下記の為替レートは、2024年 2 月29日現在、当ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産ならびにその他の負債を換算するために使用された。

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
UAEディルハム	0.2148	0.2723	0.2509	40.6934	0.2393	1.9617
アルゼンチン・ペソ (公式レート)	0.0009	0.0012	0.0011	0.1775	0.0010	0.0086
豪ドル	0.5150	0.6526	0.6016	97.5483	0.5736	4.7024
ブラジル・レアル	0.1587	0.2011	0.1853	30.0552	0.1767	1.4488
カナダ・ドル	0.5825	0.7382	0.6804	110.3335	0.6487	5.3187
スイス・フラン	0.8979	1.1379	1.0488	170.0723	1.0000	8.1985
チリ・ペソ	0.0008	0.0010	0.0010	0.1543	0.0009	0.0074
オフショア中国人民元	0.1095	0.1388	0.1279	20.7444	0.1220	1.0000
オンショア中国人民元	0.1097	0.1390	0.1281	20.7785	0.1222	1.0016
コロンビア・ペソ	0.0002	0.0003	0.0002	0.0380	0.0002	0.0018
チェコ・コルナ	0.0338	0.0428	0.0395	6.4043	0.0377	0.3087
デンマーク・クローネ	0.1149	0.1456	0.1342	21.7550	0.1279	1.0487
ドミニカ・ペソ	0.0134	0.0170	0.0157	2.5462	0.0150	0.1227
エジプト・ポンド	0.0255	0.0324	0.0298	4.8371	0.0284	0.2332
ユーロ	0.8561	1.0849	1.0000	162.1588	0.9535	7.8170
英ポンド	1.0000	1.2673	1.1681	189.4095	1.1137	9.1306
ガーナ・セディ	0.0625	0.0792	0.0730	11.8388	0.0696	0.5707
香港ドル	0.1008	0.1278	0.1178	19.0945	0.1123	0.9205
ハンガリー・フォリント	0.0022	0.0028	0.0025	0.4126	0.0024	0.0199

通貨	英ポンド	米ドル	ユーロ	日本円	スイス・フラン	オフショア 中国人民元
インドネシア・ルピア	0.0001	0.0001	0.0001	0.0095	0.0001	0.0005
イスラエル・シェケル	0.2218	0.2810	0.2590	42.0023	0.2470	2.0248
インド・ルピー	0.0095	0.0121	0.0111	1.8026	0.0106	0.0869
アイスランド・クローナ	0.0057	0.0073	0.0067	1.0861	0.0064	0.0524
日本円	0.0053	0.0067	0.0062	1.0000	0.0059	0.0482
ケニア・シリング	0.0054	0.0068	0.0063	1.0168	0.0060	0.0490
韓国ウォン	0.0006	0.0008	0.0007	0.1122	0.0007	0.0054
クウェート・ディナール	2.5657	3.2514	2.9969	485.9771	2.8575	23.4269
カザフスタン・テンゲ	0.0017	0.0022	0.0020	0.3313	0.0019	0.0160
スリランカ・ルピー	0.0025	0.0032	0.0030	0.4828	0.0028	0.0233
メキシコ・ペソ	0.0463	0.0586	0.0540	8.7606	0.0515	0.4223
マレーシア・リンギット	0.1663	0.2107	0.1942	31.4961	0.1852	1.5183
ナイジェリア・ナイラ	0.0005	0.0006	0.0006	0.0946	0.0006	0.0046
ノルウェー・クローネ	0.0746	0.0945	0.0871	14.1275	0.0831	0.6810
ニュージーランド・ドル	0.4820	0.6108	0.5630	91.2949	0.5368	4.4009
ペルー・新ソル	0.2087	0.2645	0.2438	39.5303	0.2324	1.9056
フィリピン・ペソ	0.0140	0.0178	0.0164	2.6588	0.0156	0.1282
ポーランド・ズロチ	0.1983	0.2513	0.2317	37.5664	0.2209	1.8109
パラグアイ・グアラニー	0.0001	0.0001	0.0001	0.0205	0.0001	0.0010
カタール・リヤル	0.2167	0.2747	0.2532	41.0506	0.2414	1.9789
ルーマニア・レイ	0.1722	0.2182	0.2011	32.6152	0.1918	1.5722
ロシア・ルーブル	0.0087	0.0110	0.0101	1.6416	0.0097	0.0791
サウジ・リアル	0.2104	0.2666	0.2458	39.8543	0.2343	1.9212
スウェーデン・クローネ	0.0765	0.0969	0.0893	14.4846	0.0852	0.6982
シンガポール・ドル	0.5875	0.7445	0.6862	111.2734	0.6543	5.3640
タイ・バーツ	0.0220	0.0279	0.0257	4.1674	0.0245	0.2009
新トルコ・リラ	0.0253	0.0320	0.0295	4.7869	0.0281	0.2308
台湾ドル	0.0250	0.0316	0.0292	4.7285	0.0278	0.2279
ウクライナ・フリヴニャ	0.0207	0.0263	0.0242	3.9281	0.0231	0.1894
米ドル	0.7891	1.0000	0.9217	149.4650	0.8788	7.2051
ウルグアイ・ペソ	0.0202	0.0255	0.0235	3.8182	0.0225	0.1841
ベトナム・ドン	0.0000	0.0000	0.0000	0.0061	0.0000	0.0003
南アフリカ・ランド	0.0411	0.0521	0.0480	7.7877	0.0458	0.3754
ザンビア・クワチャ	0.0336	0.0426	0.0393	6.3683	0.0374	0.3070

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

（g）希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引および仲介手

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

英文目論見書のアペンディクスBの17.3（訳注：原文の参照番号）に従い、2024年2月29日現在、かかる希薄化調整は、アジアン・タイガー・ボンド・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンドおよびワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンドに適用されていた。2024年2月29日に終了した期間において、かかる希薄化調整は、アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド、チャイナ・イノベーション・ファンド、チャイナ・マルチアセット・ファンド、チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ユーロ・リザーブ・ファンド、ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、インパクト・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド、USドル・リザーブ・ファンドおよびワールド・ヘルスサイエンス・ファンドを除くすべてのファンドに適用された。

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

（h）取引費用

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

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

（i）その他の取引に係る外国通貨

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

（ j ） 公正価値評価

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

2024年 2 月29日現在、以下のとおり公正価値調整が行われた。

ファンド	通貨	公正価値評価された証券の時価	純資産比率（ % ）
アジアン・ドラゴン・ファンド	米ドル	-	0.00
アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,082,600	0.13
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
ブラウン・トゥ・グリーン・マテリアルズ・ファンド	米ドル	82,529	0.13
チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	107,135,641	0.45
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	1,442,819	0.19
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド	ユーロ	19	0.00
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	2,942,665	0.11
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	7,759	0.00
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	-	0.00
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	米ドル	1,044	0.00
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	8,869,352	0.35
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	8,012,609	0.49

ファンド	通貨	公正価値評価された 証券の時価	純資産比率(%)
E S G グローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド	ユーロ	595,413	0.19
E S G グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	283,801	0.57
E S G マルチアセット・ファンド	ユーロ	14,274,919	0.26
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	ユーロ	10,352	0.00
フィンテック・ファンド	米ドル	21	0.00
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	67,054,360	1.02
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	385,833,384	2.58
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	米ドル	2,819,368	0.30
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	3,608,227	0.22
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	3,022,761	0.06
ナチュラル・リソース・ファンド ⁽⁴⁾	米ドル	252	0.00
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	米ドル	3,174	0.01
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	72,248,138	2.61
ニュートリション・ファンド	米ドル	1	0.00
サステナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド	米ドル	122,444	0.28
サステナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	420,105	0.08
サステナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	-	0.00
サステナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	1,557,505	0.26
サステナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	米ドル	412,390	0.21
サステナブル・グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド ⁽⁴⁾	米ドル	9,684,188	2.16
サステナブル・ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,851,800	0.29
システムティック・サステナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド	米ドル	-	0.00
ユナイテッド・キングダム・ファンド	英ポンド	-	0.00
U S ドル・ボンド・ファンド	米ドル	131,111	0.03
U S ドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	6,472,533	0.33
U S ドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	米ドル	52,807	0.00
ワールド・エネルギー・ファンド	米ドル	744	0.00
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	米ドル	1,908	0.00
ワールド・ゴールド・ファンド	米ドル	1,340,943	0.04
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	912,201	0.01
ワールド・マイニング・ファンド	米ドル	520	0.00
ワールド・テクノロジー・ファンド	米ドル	176,038,354	1.50

当該ファンドは時価がゼロで公正価値評価された証券を保有している。

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

(k) 特別買収目的会社に関するコミットメント

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

SPACに対する未履行のPIPEコミットメントは時価評価され、当該コミットメントから生じる利益/損失は、純資産計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)」、ならびに損益および純資産変動計算書の「SPACに対する未履行のPIPEコミットメントに係る未実現評価益(損)の純変動」に計上される。

(1) 表示の変更 - OTCデリバティブ: 差金決済取引契約(以下「CFD」という。)

表示変更の理由:

特定のOTCデリバティブ、すなわちCFDへの投資について、その性質と特徴がスワップの主要基準を満たしているため、スワップとして表示することがより適切と判断されたためである。

表示変更による影響:

この表示の変更による当ファンドの純資産価額への影響はない。これらのOTCデリバティブの未実現評価額は、純資産計算書の「スワップの時価/未実現評価益/評価損」のカテゴリーに含まれている。また、この変更は、実現額および未実現額が、関連する収益または費用とともに、現在では、損益および純資産変動計算書ならびに財務書類に対する注記の「スワップ取引」に分類されていることを意味する。

3. 運用会社

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

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

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

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

4．投資運用報酬

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

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

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

投資運用報酬の減額は、損益および純資産変動計算書の投資運用報酬から別掲で開示されている。当期において、いずれのファンドも投資運用報酬の減額の対象ではなかった。

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

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

アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、アジアン・タイガー・ボンド・ファンド、チャイナ・ボンド・ファンド、チャイナ・ファンド、チャイナ・マルチアセット・ファンド、クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド、ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド、ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・ファンド、ESGマルチアセット・ファンド、ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド、フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、グローバル・アロケーション・ファンド、グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド、グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、マルチテーマ・エクイティ・ファンド、サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド、スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド、システムティックESGマルチ・アロケーション・クレジット・ファンドおよびUSドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

2024年2月29日現在の未払投資運用報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

５．販売報酬

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

当社は、損益および純資産変動計算書において詳述されているとおり、販売報酬を支払う。2024年2月29日現在の未払販売報酬は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

６．年次サービス料

当社は年次サービス料を運用会社に支払っている。

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

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

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

アジア・マルチアセット・インカム・ファンド、アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ブラウン・トゥ・グリーン・マテリアルズ・ファンド、チャイナ・インパクト・ファンド、チャイナ・イノベーション・ファンド、チャイナ・マルチアセット・ファンド、サーキュラー・エコノミー・ファンド、クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド、ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、エマージング・ヨーロッパ・ファンド、エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド、ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド、ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド、ESGフレックス・チョイス・モデルート・ファンド、ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド、ヨーロッパ・フォーカス・ファンド、ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド、フィンテック・ファンド、フューチャー・コンシューマー・ファンド、フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド、グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド、グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド、ナチュラル・リソース・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド、ニュートリション・ファンド、サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド、サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド、サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド、サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド、システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド、システムティック・チャイナ・エンバイロメント・テック・ファンド、システムティックESGマルチ・アロケーショ

ン・クレジット・ファンド、システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド、システマティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド、U Sドル・ボンド・ファンドおよびU Sサステイナブル・エクイティ・ファンドの継続的経費（ongoing charge）は、損益および純資産変動計算書の年次サービス料と相殺される差額に上限が定められている。

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

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

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

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

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

ブラックロック・グループの従業員でない取締役は、遂行した役務の対価として報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員でない当社の取締役は、税込みで年間48,000ユーロから60,000ユーロの範囲の報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員である取締役は、取締役報酬を受ける権利を有していない。

特定の管轄地域に適用される税金も、ファンドに直接請求される（注記8参照）。

年次サービス料は、損益および純資産変動計算書において開示されている。

2024年2月29日現在の未払年次サービス料は、純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

7. 預託報酬

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

預託報酬はファンドに直接請求される。2024年2月29日現在の未払保管および預託報酬は純資産計算書においてその他の負債に含まれている。

８．税金

ルクセンブルグ

現在のルクセンブルグの法律および慣習に基づき、当社はルクセンブルグにおける所得税もしくはキャピタル・ゲイン税が課されず、また、当社が支払う配当金はルクセンブルグの源泉徴収税の対象となっていない。しかし、当社は、純資産価額に対して年率0.05%のルクセンブルグにおける税金、またはリザーブ・ファンド、クラスⅠ、クラスⅡおよびクラスⅢの投資証券の場合には純資産価額に対して年率0.01%の税金が課される。当該税金は、各ファンドの該当四半期末（暦年）の純資産価額に基づき、四半期毎に支払われる。ルクセンブルグにおいて、投資証券の発行に伴う印紙税またはその他の税金は支払われない。2024年２月29日に終了した期間において、ルクセンブルグの税金に関連して29,512,113米ドルが費用計上された。

ベルギー

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

英国

報告型ファンド (Reporting Funds)

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

その他の取引税

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

源泉徴収税

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

9．投資顧問会社

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

すべての投資顧問会社は、ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エーにより直接任命されている。すべての副投資顧問会社は関連する投資顧問会社により任命されている。これらのうちの数社は、投資顧問会社として以下の会社に業務の一部を再委託している。ブラックロック・ジャパン株式会社（以下「B L K J a p」という。）、ブラックロック・アセット・マネジメント・ノースアジア・リミテッド（以下「B A M N A」という。）およびブラックロック・インベストメント・マネジメント（オーストラリア）リミテッド（以下「B L K A u s」「B I M A L」という。）。

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
アジアン・ドラゴン・ファンド	B I M U K	B A M N A
アジアン・グロース・リーダーズ・ファンド	B I M U K	B A M N A
アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	B S L	-
アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド	B I M U K、B S L、 B I M L L C	B A M N A、 B L K A u s
アジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	B I M U K	B A M N A
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L	B A M N A
ブラウン・トゥ・グリーン・マテリアルズ・ファンド*	B I M U K	-
チャイナ・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L	B A M N A
チャイナ・ファンド	B I M U K	B A M N A
チャイナ・インパクト・ファンド*	B I M U K	B A M N A
チャイナ・イノベーション・ファンド	B I M U K、B I M L L C	B A M N A
チャイナ・マルチアセット・ファンド*	B S L、B F M	B A M N A、 B L K A u s
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	B S L	-
サーキュラー・エコノミー・ファンド	B I M U K	-
クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド*	B I M U K	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド*	B I M U K	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	B I M U K	-
ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ ファンド*	B I M U K	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	B I M U K、B F M、 B S L	B A M N A、 B I M A L
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	B I M U K	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L、B F M	-
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L、B F M	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	B I M U K、B I M L L C	B A M N A
エマージング・マーケット・ファンド	B I M U K、B I M L L C	B A M N A
エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド*	B I M U K、B I M L L C	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L、B F M	B A M N A
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	B I M U K	B A M N A
E S Gフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	B I M U K	B A M N A
E S Gフレックス・チョイス・グロース・ファンド	B I M U K	B A M N A
E S Gフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	B I M U K	B A M N A
E S Gグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド*	B F M、B I M U K	-
E S Gグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド*	B I M U K、B I M L L C、 B S L、B F M	B A M N A
E S Gマルチアセット・ファンド	B I M U K、B I M L L C、 B F M、B S L	B I M A L
ユーロ・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L	B I M A L
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	B I M U K	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	B I M U K	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	B I M U K、B S L	B I M A L
ユーロ・マーケット・ファンド	B I M U K	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	BIMUK	-
フィンテック・ファンド	BIMUK	-
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BLKAus
フューチャー・コンシューマー・ファンド*	BIMUK	-
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC、BSL	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
グローバル・ガバメント・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	BIMAL
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM	-
グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド(2)	BIMUK、BFM、BSL	BIMAL
グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BAMNA、BIMAL
インバクト・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
インドニア・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA、BLKJap
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	BLKJap
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
マルチテーマ・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ナチュラル・リソース・ファンド(4)	BIMUK、BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	BIMLLC	-
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-
ニュートリション・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	BSL	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド*	BIMUK、BSL、BFM	BLKAus

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド*	BIMUK、BIMLLC、 BSL	-
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	BIMUK、BFM	-
サステイナブル・グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド(4)	BIMLLC	-
サステイナブル・グローバル・インフラストラクチャー・ ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BLKAUS
サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BIMAL
スイス・スモール・アンド・ミッドキャップ・ オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	-
システマティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ ファンド	BIMLLC	-
システマティック・チャイナ・エンバイロメント・テック・ ファンド*	BIMLLC、BFM	-
システマティックESGマルチ・アロケーション・クレジット・ファンド (4) *	BIMLLC、BIMUK、 BFM	-
システマティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ ファンド	BIMUK	-
システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グ ロース・ファンド	BIMUK、BFM	-
システマティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファ ンド	BIMLLC	-
ユナイテッド・キングダム・ファンド	BIMUK	-
USベーシック・バリュー・ファンド	BIMLLC	-
USDollar・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
USDollar・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BFM	-
USDollar・リザーブ・ファンド	BFM	-
USDollar・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BFM	-
USフレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMLLC	-
USガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	BFM	-
USグロース・ファンド	BIMLLC	-
USミッドキャップ・バリュー・ファンド	BIMLLC	-
USサステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMLLC	-
ワールド・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ゴールド・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	BIMLLC	-
ワールド・マイニング・ファンド	BIMUK	-
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BIMAL
ワールド・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-

* 当該ファンドは香港では認可されておらず、2024年2月29日現在、香港では一般に公開されていない。

(2) 当期において設定されたファンド。詳細については注記1を参照のこと。

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

10．関連当事者との取引

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

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

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

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

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

ファンド	投資証券クラス	投資証券口数	金額
チャイナ・ボンド・ファンド	クラスD英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	493	4,264英ポンド
チャイナ・ファンド	クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	593	6,962ユーロ
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	クラスD英ボンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	644	8,243英ポンド
ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	クラスD無分配投資証券	1,228	23,197米ドル
サステナブル・エネルギー・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	409	6,998米ドル
ワールド・マイニング・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	82	4,016米ドル

他の取締役による当ファンドの投資証券の保有はなかった。

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

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

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

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

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

2024年2月29日現在、以下のファンドは、当ファンドの投資有価証券明細表において「∞」と示されているとあり、クロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.12%に相当する。

ファンド	クロス・アンブレラ型投資有価証券	通貨	時価	純資産比率 (%)
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	米ドル	15,912,260	0.71
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	米ドル	5,337,636	0.23
チャイナ・マルチアセット・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・インバクト・ファンド	米ドル	1,447,095	7.74
チャイナ・マルチアセット・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	米ドル	3,261,529	17.45
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	49,264,800	4.43
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - U Sドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	42,494,621	0.91
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サークュラー・エコノミー・ファンド	米ドル	32,690,462	17.91
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フィンテック・ファンド	米ドル	3,696,306	2.03
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - フューチャー・コンシューマー・ファンド	米ドル	2,708,149	1.48
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ネクスト・ジェネレーション・ヘルスケア・ファンド	米ドル	3,695,507	2.02
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	米ドル	1,840,969	1.01
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - ニュートリション・ファンド	米ドル	5,397,099	2.96
マルチテーマ・エクイティ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エネルギー・ファンド	米ドル	25,563,281	14.01
サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	米ドル	642,515	0.58
サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	ブラックロック・グローバル・ファンズ - サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	ユーロ	2,048,984	0.62

2024年2月29日に終了した期間において、預託銀行の関連当事者である、ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌビイは、外国為替取引および通貨管理／ヘッジ・プログラムにおける当ファンドの保管銀行であった。これらの取引に関連して支払った手数料合計は5,830,387米ドルであり、平均手数料率は0.19bpsであった。預託銀行の関連当事者との総取引価額は3,100億米ドルであり、当ファンドが行ったこれら取引の合計価額の70%を占める。預託銀行の関連当事者との取引はすべて、通常の業務過程において標準的な取引条件に基づいて行われた。

その他の払戻し

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

11. コミッションの使用

適用される規制により認められている場合（疑義を避けるために明記すると、M i F I D の対象ファンドを除く。）、ファンドの投資顧問会社を務めているブラックロック・グループの一部の会社は、一定の管轄区域の特定のブローカーと株式を取引するときに発生するコミッションを受け取ることができる。コミッションは適

格なりサーチ・サービスを購入するために再配分することができる。リサーチに資金提供した人だけでなく広範な顧客もリサーチの利用が可能のため、かかる取り決めにより1つのファンドだけでなく他のファンドも恩恵を受けることができる。ブラックロック・グループは、適格なサービスのみを購入し、過度のコミッションは適格なサービス提供者に再配分する（該当があれば）ようにするため、コミッションの使用に関する方針を設定している。当期に締結したソフト・ダラー契約はなかった。

12．デリバティブ商品

当ファンドは、英文目論見書に詳述されているとおり、デリバティブ商品を売買することがある。2024年2月29日現在において保有しているデリバティブ商品についてはファンドの投資有価証券明細表を参照のこと。

投資有価証券明細表で開示されているとおり、基礎となるエクスポージャーはE S M A が公表したガイドラインに従って算定されており、各金融商品の基礎となる資産における同等ポジションの市場価額を表している。債券先物の基礎となるエクスポージャーおよび差金決済取引契約は、譲渡有価証券の最安値ではなく債券の市場価額に基づいて算定されている。

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

当ファンドが担保として差入れた、または保証として引渡した有価証券は当ファンドの投資有価証券明細表において開示されている。当該有価証券はファンドの投資有価証券明細表において「†」と示されており、2024年2月29日現在、その評価額は712,251,524米ドルである。

システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンドについて、売建コール・オプションの担保は、ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド、メリルリンチ・インターナショナルおよびバンク・オブ・ニューヨーク・メロン（インターナショナル）リミテッドの三者間契約に基づき差入れられる。担保はファンドの投資有価証券明細表において「^」と示されており、2024年2月29日現在、その評価額は246,196,022米ドルである。

ファンドが保証として受取った有価証券の詳細は、以下の表のとおりである。2024年2月29日現在、これらの有価証券の評価額は1,980,311米ドルである。

ファンド	額面 金額	銘柄	通貨	評価額 (単位：米ドル)
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	505,000	United States Treasury Note/Bond 0.375% 31/7/2027	米ドル	330,727
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	496,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031	米ドル	428,311
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	357,000	United States Treasury Note/Bond 0.5% 31/3/2025	米ドル	388,284
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	278,000	United States Treasury Note/Bond 5% 30/9/2025	米ドル	276,160
グローバル・インフレーション・リンクド・ ボンド・ファンド	2,505,978	United States Treasury Note/Bond 2.125% 15/2/2041	米ドル	278,141
サステイナブル・エマージング・マーケッ ツ・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	356,000	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031	米ドル	278,688

14．現金担保

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

2024年2月29日現在のスワップ契約および店頭オプション取引に関連するブローカーからの／（に対する）現
金担保残高は、以下の表のとおりである。先物取引現金残高は、ブローカーが保有する現金に関連しており、
2024年2月29日現在、証拠金要件を満たすために一部使用されている。

ファンド	通貨	ブローカー からのスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
アジア・ハイ・イールド・ボンド・ファン ド	米ドル	2,485,341	(300,000)	2,857,629	(283,121)
アジア・マルチアセット・インカム・ ファンド	米ドル	32,298	(5,165)	79,000	-

ファンド	通貨	ブローカー からのスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
アジア・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	11	-
アジア・タイガー・ボンド・ファンド	米ドル	14,598,742	(430,000)	1,294,558	(954,729)
チャイナ・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	14,144,964	(1,657,171)	14,436,524	(3,292,183)
チャイナ・ファンド	米ドル	-	(340,000)	-	-
チャイナ・マルチアセット・ファンド	米ドル	71,000	(48,872)	100,398	-
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	オフショア 中国人民元	-	-	793,382	(119,628)
クライメイト・アクション・ マルチアセット・ファンド	ユーロ	-	-	164,077	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・ フレキシブル・ファンド	ユーロ	-	(1,110,000)	9,285,000	(264,573)
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	(350,000)	19,345,527	(2,292,272)
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	-	-	1,423,564	(552,356)
エマージング・マーケット・ボンド・ ファンド	米ドル	5,859,235	(1,337,105)	664,344	(229,409)
エマージング・マーケット・コーポレート・ ボンド・ファンド	米ドル	-	-	407,000	(71,107)
エマージング・マーケット・ファンド	米ドル	1,250,000	(1,400,000)	919,002	(720,309)
エマージング・マーケット・ローカル・ カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	5,212,000	(7,220,198)	1	-
エマージング・マーケット・ サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	846,371	-
E S Gグローバル・コンサバティブ・ インカム・ファンド	ユーロ	-	-	2,922,832	(841)
E S Gグローバル・マルチアセット・ インカム・ファンド	米ドル	-	-	208,341	(11,877)
E S Gマルチアセット・ファンド	ユーロ	280,000	(10,590,000)	66,263,591	(12,709,395)
ユーロ・ボンド・ファンド	ユーロ	8,746,867	(1,237,436)	12,033,880	(93,131)
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	ユーロ	21,417,203	(926,207)	3,450,247	(62,974)
ユーロ・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	ユーロ	15,758,954	(1,026,393)	15,966,581	(167,758)
ヨーロッパ・ファンド	ユーロ	-	(280,000)	-	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	ユーロ	374,000	(4,000)	-	(1)
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーション・ ファンド	ユーロ	-	(310,000)	-	-
フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	204,019,944	(28,758,123)	83,655,926	(178,492)
グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	32,369,596	(16,754,395)	213,529,575	(283,701,019)
グローバル・コーポレート・ボンド・ ファンド	米ドル	4,786,715	(388,826)	5,288,000	(2,146,634)
グローバル・ガバメント・ボンド・ ファンド	米ドル	2,080,694	(616,207)	6,508,926	(1,253,258)

ファンド	通貨	ブローカー からのスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	2,565,000	(2,342,623)	96,980	(11,652)
グローバル・インフレーション・リンクド・ボンド・ファンド	米ドル	622,127	(235,972)	631,255	(57,728)
グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	73,000	(908,012)	27,724,878	(130,797)
インバクト・ボンド・ファンド	ユーロ	74,941	-	91,007	(27,839)
インドシア・ファンド	米ドル	-	-	9	-
サステイナブル・アジア・ボンド・ファンド	米ドル	1,566,645	-	637,153	(80,242)
サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンデッド・ボンド・ファンド	米ドル	184,897	(52,383)	60,406	(844)
サステイナブル・エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	米ドル	1,107,083	(350,644)	142,982	(48,055)
サステイナブル・エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	米ドル	-	-	33,000	(5,731)
サステイナブル・エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	米ドル	1,438,000	(2,415,205)	-	-
サステイナブル・フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	ユーロ	9,311,322	(450,560)	3,244,520	(39,687)
サステイナブル・グローバル・アロケーション・ファンド	米ドル	267,765	(66,810)	1,726,653	(213,583)
サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	米ドル	451,337	(7,600)	759,442	(9,294)
サステイナブル・グローバル・ダイナミック・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	1,520,493	(73,220)
サステイナブル・ワールド・ボンド・ファンド	米ドル	8,786,687	(936,448)	3,490,024	(983,920)
システマティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	-	-	300,219	-
システマティック・チャイナ・エンバイロメント・テック・ファンド	米ドル	-	-	10,105	-
システマティック E S G マルチ・アロケーション・クレジット・ファンド	米ドル	-	-	133,568	(10,757)
システマティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	227,983,119	(14,948,699)
システマティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	米ドル	-	-	1,633,141	(88,754)
システマティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド	米ドル	-	-	234,000	(114,656)
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	1,088,939	(583,640)	463,701	(206,327)

ファンド	通貨	ブローカー からのスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカーに 対するスワップ契約 および店頭 オプション取引 現金担保残高	ブローカー からの 先物取引	ブローカーに 対する 先物取引
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ ファンド	米ドル	2,476,000	(4,531,068)	79,953	-
USドル・ショート・デュレーション・ ボンド・ファンド	米ドル	1,045,438	-	5,336,719	(319,343)
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	米ドル	4,750,000	-	-	-

15．配当金

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

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

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

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

16．信用供与

当社はJPモルガン・チェース銀行・エヌ・エー（以下「JPモルガン」という。）との間で信用契約（2024年4月19日付の改訂・修正版）を締結し、JPモルガンは他のシンジケート・レンダーとともに、12.25億米ドルの信用供与枠の一部をルクセンブルグのファンドに提供する。

当ファンドは、この信用供与枠を一時的な資金調達目的で利用し、その目的には、例えば、投資家からの買戻しの資金を含むがこれに限定されない。かかる信用供与枠からの引出に関連する利息や未使用枠の手数料は、関連するファンドの資産により支払われる。新規設定ファンドには自動的に信用枠が供与されないため、併合プロセスにより合算しなければならない。かかるプロセスにおいては、新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するため、特に信用供与者が必要なデューデリジェンスを行う。当期において新規設定ファンドは信用枠を供与されず、引出すこともなかった。さらに、信用供与者が必ずしも新規設定ファンドの信用枠の合算を承認するとは限らず、また、信用枠は当ファンドと信用契約に参加しているその他のブラックロックのファンドとの間で（公正な配分で）使用可能かどうかにかかっているため、ファンドがかかる信用枠を使用することができるとは限らない。したがって、一部のファンドはかかる信用供与を受けない場合があり、それに関連する費用も発生しない。

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

2023年9月1日から2024年2月29日までの期間において使用した信用供与枠はなかった。

17．下引受けに係る収益

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

18．後発事象

2024年3月7日付で、米ドル建てのグローバル・アンコンストレインド・エクイティ・ファンドが設定された。

2024年3月18日付で、取締役はエマージング・ヨーロッパ・ファンドの投資主に対し、同ファンドの資産のうち流動性があり取引可能な部分を、当社内に新設されたサブファンドに移管する決定を通知した。2024年5月13日付で、同ファンドの資産のうち流動性があり取引可能な部分はエマージング・ヨーロッパ・ファンドに移管される予定である。投資主はこの新設されたファンドの従前と同等の投資証券クラスの投資証券を従前と同数受け取る。

2024年3月23日付で、英文目論見書の補遺が発行された。

2024年3月31日付で、ポール・フリーマンは取締役会を退任した。

2024年4月4日付で、ユーロ建てのユーロ・インベストメント・グレード・フィクスト・マチュリティ・ボンド・ファンド2027（1）が設定された。

[次へ](#)

アペンディクス - 投資証券クラス

投資証券クラスの設定および再開

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

設定日	ファンド	種類
2023年9月6日	ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	クラスAスイス・フラン・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月6日	ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月6日	エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年9月6日	エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド	クラスI英ボンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年9月6日	グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	クラスAスイス・フラン・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月6日	グローバル・マルチアセット・インカム・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月6日	システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	クラスAスイス・フラン・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月6日	システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月13日	グローバル・ロング・ホライズン・エクイティ・ファンド	クラスX円無分配投資証券
2023年9月13日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年9月13日	システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	クラスA英ボンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年10月4日	エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスXユーロ無分配投資証券
2023年10月4日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスI英ボンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
2023年10月4日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年10月11日	サーキュラー・エコノミー・ファンド	クラスAシンガポール・ドル毎四半期総収益分配型投資証券
2023年10月11日	USドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年10月18日	デベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド	クラスXユーロ無分配投資証券
2023年10月25日	ワールド・マイニング・ファンド	クラスX英ボンド無分配投資証券
2023年11月8日	チャイナ・マルチアセット・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2023年11月8日	グローバル・アロケーション・ファンド	クラスX米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月8日	システムティック・チャイナ・エンパイロメンタル・テック・ファンド	クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
2023年11月8日	USドル・ボンド・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
2023年11月8日	USフレキシブル・エクイティ・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
2023年11月15日	アジア・タイガー・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	チャイナ・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券

設定日	ファンド	種類
2023年11月15日	グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	U S ドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	U S ドル・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年11月15日	ワールド・エネルギー・ファンド	クラスIユーロ無分配投資証券
2023年12月6日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスX米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2023年12月6日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスX米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスS Rユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスS R米ドル無分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスS Rユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスS R英ボンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	U S ガバメント・モーゲージ・インバクト・ファンド	クラスS R米ドル毎四半期分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	ワールド・ゴールド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券
2023年12月6日	ワールド・ゴールド・ファンド	クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	ブラウン・トゥ・グリーン・マテリアルズ・ファンド	クラスZ英ボンド無分配英国報告型投資証券
2023年12月20日	グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年12月20日	グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2023年12月20日	サステイナブル・エマージング・マーケット・ブレンディッド・ボンド・ファンド	クラスZ I 英ボンド無分配英国報告型投資証券
2023年12月20日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	U S ドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスA米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2023年12月20日	U S ドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	クラスA円ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2024年1月10日	コンチネンタル・ヨーロピアン・フレキシブル・ファンド	クラスI米ドル毎年分配型投資証券
2024年1月10日	エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2024年1月10日	エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスA米ドル安定毎月総収益分配型投資証券
2024年1月10日	エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
2024年1月10日	ヨーロピアン・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2024年1月10日	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスXシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

設定日	ファンド	種類
2024年 1月10日	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスXシンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月10日	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスXシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
2024年 1月10日	ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月10日	ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月10日	ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	クラスA香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月10日	ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	クラスA米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月10日	サステイナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	クラスX香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 1月24日	フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	クラスX米ドル・トータル・リターン分配型投資証券
2024年 2月 6日	グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド	クラスA米ドル無分配投資証券
2024年 2月 6日	グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド	クラスD米ドル無分配投資証券
2024年 2月 6日	グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド	クラスI米ドル無分配投資証券
2024年 2月 6日	グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド	クラスX米ドル無分配投資証券
2024年 2月 6日	グローバル・リステッド・インフラストラクチャー・ファンド	クラスZ米ドル無分配投資証券

発行済投資証券クラス

2024年 2月29日現在、当社は以下の投資証券クラスを発行している。二つ以上の取引通貨があるファンドの場合、追加の取引通貨価格は、評価時における直物為替レートで価格を換算し、算定されている。

クラスA

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

クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・毎月分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスA香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスA毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスAスイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスA毎四半期分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAカナダ・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA香港ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ金利差毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスA安定毎月総収益分配型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスAカナダ・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスAスイス・フラン・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスAトータル・リターン分配型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスAカナダ・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスA香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券

クラスA基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA無分配投資証券

クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスAカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスAオフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券

クラスAチェコ・コルナ・ヘッジ無分配投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスA香港ドル無分配投資証券

クラスA香港ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスA円ヘッジ無分配投資証券

クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスAポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券

クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券

クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスA南アフリカ・ランド・ヘッジ無分配投資証券

クラスA無分配英国報告型投資証券

クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスAユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスA I

クラスA I 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA I ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスA I 毎四半期分配型投資証券

クラスA I ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスA I 無分配投資証券

クラスA I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC

クラスC 毎日分配型投資証券

クラスC ユーロ・ヘッジ毎日分配型投資証券

クラスC 毎月分配型投資証券

クラスC 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスC 毎四半期分配型投資証券

クラスC 安定毎月総収益分配型投資証券

クラスC 無分配投資証券

クラスC ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスC 米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスC 無分配英国報告型投資証券

クラスD

クラスD 毎年総収益分配型投資証券

クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎年総収益分配型投資証券

クラスD 毎年総収益分配英国報告型投資証券

クラスD 毎年分配型投資証券

クラスD カナダ・ドル・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券

クラスD 毎年分配英国報告型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券

クラスD 毎月総収益分配型投資証券

クラスD 毎月分配型投資証券

クラスD 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD 香港ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券

クラスD 毎月分配英国報告型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券

クラスD 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスD 毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券

クラスD 毎四半期分配型投資証券

クラスD スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスD 毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券

クラスD 安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券

クラスD 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスD 無分配投資証券

クラスD 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスD 香港ドル無分配投資証券

クラスD ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券

クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスD 米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスD 無分配英国報告型投資証券

クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスD 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスE

クラスE 毎四半期総収益分配型投資証券

クラスE ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券

クラスE 毎四半期分配型投資証券

クラスE ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券

クラスE ユーロ・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券

クラスE 安定毎月総収益分配型投資証券

クラスE 無分配投資証券

クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券

クラスE 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券

クラスE ポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券

クラスE 米ドル・ヘッジ無分配投資証券

クラスE 無分配英国報告型投資証券

クラス E 基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券	クラス E ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス E ユーロ・ヘッジ基準額以上毎四半期総収益分配型投資証券	
クラス I *	
クラス I 毎年総収益分配型投資証券	クラス I 安定毎月総収益分配型投資証券
クラス I 毎年分配型投資証券	クラス I ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラス I シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラス I 毎年分配英国報告型投資証券	クラス I 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
クラス I ユーロ・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラス I 無分配投資証券
クラス I 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラス I 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラス I ブラジル・レアル・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 毎月総収益分配型投資証券	クラス I カナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 毎月分配型投資証券	クラス I スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラス I カナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラス I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラス I 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 毎四半期総収益分配型投資証券	クラス I 円ヘッジ無分配投資証券
クラス I ユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	クラス I ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 毎四半期分配型投資証券	クラス I スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラス I ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラス I シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラス I 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス I 円ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラス I 無分配英国報告型投資証券
クラス I 毎四半期分配英国報告型投資証券	クラス I スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス I スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラス I ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス I ユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラス I 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス I 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラス I 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス J *	
クラス J 毎月分配型投資証券	クラス J 無分配投資証券
クラス S	
クラス S 毎年分配型投資証券	クラス S ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラス S ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラス S 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラス S 毎月総収益分配英国報告型投資証券	クラス S シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス S 英ポンド・ヘッジ毎月総収益分配英国報告型投資証券	クラス S 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス S 毎月分配型投資証券	クラス S 無分配英国報告型投資証券
クラス S 毎四半期総収益分配型投資証券	クラス S スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス S 毎四半期分配型投資証券	クラス S ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス S 無分配投資証券	クラス S 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラス S スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	
クラス S I	
クラス S I 無分配投資証券	クラス S I 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラス S R	
クラス S R 毎年総収益分配英国報告型投資証券	クラス S R 安定毎月総収益分配型投資証券
クラス S R 毎年分配英国報告型投資証券	クラス S R 安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラス S R 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラス S R ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券

クラスS R 米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスS R 香港ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R 毎月分配型投資証券	クラスS R シンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	クラスS R 米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配英国報告型投資証券
クラスS R 英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券	クラスS R 無分配投資証券
クラスS R 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスS R 無分配英国報告型投資証券
クラスS R 毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS R ユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	クラスS R 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスS R 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券	
クラスX *	
クラスX 毎年分配型投資証券	クラスX 香港ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券	クラスX シンガポール・ドル・ヘッジ・トータル・リターン分配型投資証券
クラスX 毎年分配英国報告型投資証券	クラスX 無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	クラスX 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎月分配型投資証券	クラスX カナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスX スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスX デンマーク・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX シンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券	
クラスX 毎四半期総収益分配英国報告型投資証券	クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 毎四半期分配型投資証券	クラスX 円ヘッジ無分配投資証券
クラスX スイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX ノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券	クラスX スウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 豪ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスX シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	クラスX 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスX ユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	クラスX 無分配英国報告型投資証券
クラスX トータル・リターン分配型投資証券	クラスX 米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスZ	
クラスZ 無分配投資証券	クラスZ 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	クラスZ 無分配英国報告型投資証券
クラスZ ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	クラスZ スイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスZ I	
クラスZ I 米ドル・ヘッジ金利差毎月総収益分配型投資証券	クラスZ I 米ドル・ヘッジ無分配投資証券
クラスZ I 安定毎月総収益分配型投資証券	クラスZ I 無分配英国報告型投資証券
クラスZ I 無分配投資証券	クラスZ I ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
クラスZ I ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	

* 機関投資家が購入可能

5【販売及び買戻しの実績】

2024年3月末日前1年間におけるサブ・ファンドのファンド証券の販売および買戻しの実績ならびに2024年3月末日現在の発行済口数は、以下のとおりである。

クラスA無分配投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2023年4月1日～ 2024年3月31日	154,229 (154,229)	216,935 (215,985)	801,827 (788,677)

（注1）（ ）内の数は、本邦外における販売、買戻しおよび発行済口数である。

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