

【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）本書において、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。）、カナダ・ドル、スイス・フラン、ユーロ、オーストラリア・ドル（以下「豪ドル」という。）、香港ドル、人民元、シンガポール・ドル、ニュージーランド・ドルおよび南アフリカ・ランドの円貨換算は、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中値（1米ドル＝151.41円、1英ポンド＝191.22円、1カナダ・ドル＝111.81円、1スイス・フラン＝167.92円、1ユーロ＝163.24円、1豪ドル＝98.61円、1香港ドル＝19.34円、1人民元＝20.83円、1シンガポール・ドル＝112.11円、1ニュージーランド・ドル＝90.50円および1南アフリカ・ランド＝7.99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、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドのクラスA無分配投資証券ならびにUSドル・ハイ・イールド・ポンド・ファンドのクラスA毎月分配型投資証券およびクラスA無分配投資証券（以下、個別にまたは総称して「ファンド証券」または「投資証券」ということがある。）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）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4）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5）ファンドは、2024年3月末日現在、106個のサブ・ファンドによって構成されているが、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドおよびUSドル・ハイ・イールド・ポンド・ファンド（以下、個別にまたは総称して、また他のサブ・ファンドと総称して「サブ・ファンド」ということがある。）のみが、本書において開示される。サブ・ファンドは、アンブレラ・ファンドであるブラックロック・グローバル・ファンズのサブ・ファンドであり、2024年3月末日現在、それぞれ合計38種類および43種類のクラス投資証券が存する。本書においては、そのうちネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドのクラスA無分配投資証券ならびにUSドル・ハイ・イールド・ポンド・ファンドのクラスA毎月分配型投資証券およびクラスA無分配投資証券について記載される。

1【外国投資法人の概況】

ブラックロック・グローバル・ファンズのサブ・ファンドであるネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドおよびUSドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドの概況は、以下のとおりである。

(1)【主要な経営指標等の推移】

()ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

	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)	2,064,326米ドル (312,560千円)	8,122,923米ドル (1,229,892千円)	3,749,485米ドル (567,710千円)	15,944,060米ドル (2,414,090千円)	3,363,937米ドル (509,334千円)
(b) 経常利益(損失)金額	-40,560,700米ドル (-6,141,296千円)	-59,621,166米ドル (-9,027,241千円)	-16,268,727米ドル (-2,463,248千円)	-25,202,562米ドル (-3,815,920千円)	-17,656,065米ドル (-2,673,305千円)
(c) 当期純利益(損失)金額	-383,667,165米ドル (-58,091,045千円)	-950,347,543米ドル (-143,892,121千円)	-419,491,547米ドル (-63,515,215千円)	-682,650,081米ドル (-103,360,049千円)	-11,648,620米ドル (-1,763,718千円)
(d) 出資総額(注2)	3,836,499,907米ドル (580,884,451千円)	2,755,606,835米ドル (417,226,431千円)	2,470,023,694米ドル (373,986,288千円)	2,565,516,420米ドル (388,444,841千円)	2,746,616,378米ドル (415,865,186千円)
(e) 発行済投資証券総数	□	□	□	□	□
クラスA毎年分配型投資証券 (注3)	607,810	775,682	877,924	1,041,763	1,243,083
クラスA毎年分配英国報告型 投資証券	500	5,029	6,879	11,277	33,414
クラスAトータル・リターン 分配型投資証券(注4)	-	-	500	500	500
クラスA無分配投資証券	57,332,779	54,506,693	50,548,786	48,077,137	43,970,828
クラスA豪ドル・ヘッジ無分 配投資証券(注5)	-	672	672	672	184,859
クラスAオフショア中国人民 元ヘッジ無分配投資証券	4,499	24,918	78,230	307,681	256,654
クラスAユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	8,666,694	8,373,960	8,179,571	7,477,850	6,661,841
クラスA香港ドル・ヘッジ無 分配投資証券	24,741	95,597	175,378	501,421	261,720
クラスAニュージーランド・ ドル・ヘッジ無分配投資証券 (注6)	-	731	731	731	731
クラスAシンガポール・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	3,160,150	2,988,012	2,999,358	3,081,869	3,041,792
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	152,843	163,496	161,899	166,160	194,038
クラスA英債券・ヘッジ無 分配英国報告型投資証券	51,322	64,473	134,029	352,092	259,178
クラスA I 無分配投資証券	3,585,509	3,282,648	2,939,210	2,552,890	1,993,934
クラスC 無分配投資証券(注 7)	-	-	-	445	445
クラスD 無分配投資証券	5,598,299	5,091,217	4,968,688	3,695,967	3,208,879
クラスD オフショア中国人民 元ヘッジ無分配投資証券	323	323	323	323	323
クラスDユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	1,152,133	8,321,507	11,889,773	666,710	626,282
クラスDシンガポール・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	451,563	671,444	794,869	925,752	1,060,530

	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)
クラスD無分配英国報告型投資証券	8,935,370	7,213,737	6,243,121	6,069,460	5,123,691
クラスD英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	3,826,315	3,667,724	3,034,610	2,690,522	2,372,093
クラスE無分配投資証券	29,200,804	29,836,221	30,569,088	30,635,884	28,566,941
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	17,061,157	17,469,125	17,870,412	17,584,426	16,189,471
クラスI毎年分配英国報告型投資証券	88,363	82,863	82,863	82,863	82,646
クラスI無分配投資証券	22,756,387	17,829,923	14,572,418	15,700,668	18,141,885
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,685,120	1,878,139	1,684,130	2,175,907	2,053,018
クラスI無分配英国報告型投資証券	3,248,300	1,430,023	943,010	769,343	844,466
クラスS無分配英国報告型投資証券	29,096,950	24,614,443	21,904,729	18,745,218	17,756,577
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	600,951	691,463	692,064	646,989	641,956
クラスSユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	4,098,097	3,619,404	2,882,504	2,687,612	2,440,946
クラスS英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	303,096	278,922	256,938	155,386	204,495
クラスSR毎年分配英国報告型投資証券	131,040	98,439	80,807	80,807	44,513
クラスSR無分配英国報告型投資証券	96,929	51,392	98,815	1,000	67,839
クラスSRユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	409	409	409	409	409
クラスX無分配投資証券	225,627	282,675	172,706	147,725	149,657
クラスZ無分配英国報告型投資証券	936,726	1,073,148	1,162,328	1,289,150	83,530
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	9,363	9,363	9,363	10,363	9,054
(f) 純資産額	3,836,499,907米ドル (580,884,451千円)	2,755,606,835米ドル (417,226,431千円)	2,470,023,694米ドル (373,986,288千円)	2,565,516,420米ドル (388,444,841千円)	2,746,616,378米ドル (415,865,186千円)
(g) 総資産額	3,974,808,409米ドル (601,825,741千円)	2,793,253,332米ドル (422,926,487千円)	2,528,228,671米ドル (382,799,103千円)	2,578,126,222米ドル (390,354,091千円)	2,759,623,331米ドル (417,834,569千円)
(h) 1口当たり純資産価格(注8)					
クラスA毎年分配型投資証券(注3)	7.33米ドル (1,110円)	5.59米ドル (846円)	5.17米ドル (783円)	5.87米ドル (889円)	6.74米ドル (1,021円)
クラスA毎年分配英国報告型投資証券	5.47英債券 (1,046円)	4.82英債券 (922円)	4.26英債券 (815円)	5.87米ドル (889円)	6.74米ドル (1,021円)
クラスAトータル・リターン分配型投資証券(注4)	-	-	10.19米ドル (1,543円)	11.15米ドル (1,688円)	12.27米ドル (1,858円)
クラスA無分配投資証券	19.64米ドル (2,974円)	14.99米ドル (2,270円)	13.84米ドル (2,096円)	15.73米ドル (2,382円)	18.05米ドル (2,733円)

	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)
クラスA豪ドル・ヘッジ無分 配投資証券(注5)	-	8.08豪ドル (797円)	7.30豪ドル (720円)	8.24豪ドル (813円)	9.36豪ドル (923円)
クラスAオフショア中国人民 元ヘッジ無分配投資証券	74.69人民元 (1,556円)	56.81人民元 (1,183円)	51.50人民元 (1,073円)	57.66人民元 (1,201円)	65.43人民元 (1,363円)
クラスAユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	18.21ユーロ (2,973円)	13.54ユーロ (2,210円)	12.19ユーロ (1,990円)	13.73ユーロ (2,241円)	15.57ユーロ (2,542円)
クラスA香港ドル・ヘッジ無 分配投資証券	72.94香港ドル (1,411円)	55.32香港ドル (1,070円)	50.84香港ドル (983円)	57.36香港ドル (1,109円)	65.54香港ドル (1,268円)
クラスAニュージーランド・ ドル・ヘッジ無分配投資証券 (注6)	-	8.15ニュージー ランド・ドル (738円)	7.40ニュージー ランド・ドル (670円)	8.40ニュージー ランド・ドル (760円)	9.60ニュージー ランド・ドル (869円)
クラスAシンガポール・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	19.06シンガ ポール・ドル (2,137円)	14.39シンガ ポール・ドル (1,613円)	13.15シンガ ポール・ドル (1,474円)	14.84シンガ ポール・ドル (1,664円)	16.86シンガ ポール・ドル (1,890円)
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	7.80スイス・ フラン (1,310円)	5.84スイス・ フラン (981円)	5.24スイス・ フラン (880円)	5.84スイス・ フラン (981円)	6.58スイス・ フラン (1,105円)
クラスA英ポンド・ヘッジ無 分配英国報告型投資証券	7.86英ポンド (1,503円)	5.88英ポンド (1,124円)	5.31英ポンド (1,015円)	6.02英ポンド (1,151円)	6.87英ポンド (1,314円)
クラスA I無分配投資証券	22.06米ドル (3,340円)	16.84米ドル (2,550円)	15.55米ドル (2,354円)	17.66米ドル (2,674円)	20.27米ドル (3,069円)
クラスC無分配投資証券(注 7)	-	-	-	10.87米ドル (1,646円)	12.40米ドル (1,877円)
クラスD無分配投資証券	20.23米ドル (3,063円)	15.50米ドル (2,347円)	14.37米ドル (2,176円)	16.39米ドル (2,482円)	18.89米ドル (2,860円)
クラスDオフショア中国人民 元ヘッジ無分配投資証券	75.30人民元 (1,568円)	57.51人民元 (1,198円)	52.35人民元 (1,090円)	58.86人民元 (1,226円)	67.06人民元 (1,397円)
クラスDユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	18.74ユーロ (3,059円)	13.99ユーロ (2,284円)	12.65ユーロ (2,065円)	14.31ユーロ (2,336円)	16.30ユーロ (2,661円)
クラスDシンガポール・ド ル・ヘッジ無分配投資証券	7.14シンガ ポール・ドル (800円)	5.42シンガ ポール・ドル (608円)	4.97シンガ ポール・ドル (557円)	5.63シンガ ポール・ドル (631円)	6.42シンガ ポール・ドル (720円)
クラスD無分配英国報告型投 資証券	15.08英ポンド (2,884円)	13.35英ポンド (2,553円)	11.84英ポンド (2,264円)	16.40米ドル (2,483円)	18.89米ドル (2,860円)
クラスD英ポンド・ヘッジ無 分配英国報告型投資証券	19.23英ポンド (3,677円)	14.43英ポンド (2,759円)	13.09英ポンド (2,503円)	14.89英ポンド (2,847円)	17.06英ポンド (3,262円)
クラスE無分配投資証券	26.27米ドル (3,978円)	20.00米ドル (3,028円)	18.42米ドル (2,789円)	20.87米ドル (3,160円)	23.90米ドル (3,619円)
クラスEユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	17.90ユーロ (2,922円)	13.28ユーロ (2,168円)	11.93ユーロ (1,947円)	13.40ユーロ (2,187円)	15.16ユーロ (2,475円)
クラスI 毎年分配英国報告型 投資証券	8.44英ポンド (1,614円)	7.49英ポンド (1,432円)	6.65英ポンド (1,272円)	9.21米ドル (1,394円)	10.63米ドル (1,609円)
クラスI無分配投資証券	20.41米ドル (3,090円)	15.66米ドル (2,371円)	14.54米ドル (2,202円)	16.61米ドル (2,515円)	19.16米ドル (2,901円)
クラスIユーロ・ヘッジ無分 配投資証券	22.74ユーロ (3,712円)	17.01ユーロ (2,777円)	15.39ユーロ (2,512円)	17.43ユーロ (2,845円)	19.88ユーロ (3,245円)
クラスI無分配英国報告型投 資証券	15.22英ポンド (2,910円)	13.49英ポンド (2,580円)	11.98英ポンド (2,291円)	16.61米ドル (2,515円)	19.16米ドル (2,901円)
クラスS無分配英国報告型投 資証券	5.88英ポンド (1,124円)	5.21英ポンド (996円)	4.62英ポンド (883円)	6.40米ドル (969円)	7.38米ドル (1,117円)

	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)
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	7.86スイス・フラン (1,320円)	5.91スイス・フラン (992円)	5.33スイス・フラン (895円)	5.97スイス・フラン (1,002円)	6.75スイス・フラン (1,133円)
クラスSユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	7.76ユーロ (1,267円)	5.80ユーロ (947円)	5.24ユーロ (855円)	5.93ユーロ (968円)	6.76ユーロ (1,104円)
クラスS英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	7.93英ポンド (1,516円)	5.96英ポンド (1,140円)	5.41英ポンド (1,035円)	6.15英ポンド (1,176円)	7.05英ポンド (1,348円)
クラスSR毎年分配英国報告型投資証券	5.97英ポンド (1,142円)	5.28英ポンド (1,010円)	4.69英ポンド (897円)	6.49米ドル (983円)	7.48米ドル (1,133円)
クラスSR無分配英国報告型投資証券	5.97英ポンド (1,142円)	5.29英ポンド (1,012円)	4.69英ポンド (897円)	6.50米ドル (984円)	7.49米ドル (1,134円)
クラスSRユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	7.76ユーロ (1,267円)	5.79ユーロ (945円)	5.24ユーロ (855円)	5.93ユーロ (968円)	6.76ユーロ (1,104円)
クラスX無分配投資証券	20.89米ドル (3,163円)	16.08米ドル (2,435円)	14.98米ドル (2,268円)	17.17米ドル (2,600円)	19.87米ドル (3,009円)
クラスZ無分配英国報告型投資証券	15.24英ポンド (2,914円)	13.52英ポンド (2,585円)	12.00英ポンド (2,295円)	16.64米ドル (2,519円)	19.21米ドル (2,909円)
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	7.88スイス・フラン (1,323円)	5.93スイス・フラン (996円)	5.35スイス・フラン (898円)	6.00スイス・フラン (1,008円)	6.80スイス・フラン (1,142円)
(i) 1口当たり当期純利益金額(注9)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	-	-	120米ドル (18千円)	317米ドル (48千円)	230米ドル (35千円)
(k) 1口当たり分配金額(注9)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	96.52%	98.65%	97.70%	99.51%	99.53%
(m) 自己資本利益率	-10.00%	-34.49%	-16.98%	-26.61%	-0.42%

(注1) 営業収益には投資収益を記載している。

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

(注3) クラスA毎年分配型投資証券は、2021年10月20日に運用を開始した。以下同じ。

(注4) クラスAトータル・リターン分配型投資証券 - 米ドル建は、2022年10月26日に運用を開始した。以下同じ。

(注5) クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券は、2022年4月13日に運用を開始した。以下同じ。

(注6) クラスAニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券は、2022年4月13日に運用を開始した。以下同じ。

(注7) クラスC無分配投資証券 - ユーロ建は、2023年7月26日に運用を開始した。以下同じ。

(注8) 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9) (i) および (k) は、ファンドの性格上、算定していない。

(注10) ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドは、2018年9月4日より運用を開始した。

() USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

	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)	85,553,171米ドル (12,953,606千円)	161,075,208米ドル (24,388,397千円)	67,527,827米ドル (10,224,388千円)	134,413,277米ドル (20,351,514千円)	63,184,059米ドル (9,566,698千円)
(b) 経常利益(損失)金額	66,751,910米ドル (10,106,907千円)	127,569,398米ドル (19,315,283千円)	55,723,573米ドル (8,437,106千円)	111,688,260米ドル (16,910,719千円)	53,477,894米ドル (8,097,088千円)
(c) 当期純利益(損失)金額	11,021,162米ドル (1,668,714千円)	- 83,260,514米ドル (- 12,606,474千円)	- 91,768,544米ドル (- 13,894,675千円)	- 162,461,559米ドル (- 24,598,305千円)	- 30,559,741米ドル (- 4,627,050千円)
(d) 出資総額(注2)	3,053,668,434米ドル (462,355,938千円)	2,357,372,193米ドル (356,929,724千円)	2,031,004,182米ドル (307,514,343千円)	1,885,887,744米ドル (285,542,263千円)	1,895,426,625米ドル (286,986,545千円)
(e) 発行済投資証券総数	□	□	□	□	□
クラスA英債券・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	102,535	104,359	107,327	107,135	102,997
クラスA毎日分配型投資証券	11,512,531	9,325,297	8,761,544	7,935,526	10,578,339
クラスA毎月分配型投資証券	22,158,627	17,098,452	14,499,790	13,275,536	13,532,790
クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,506,978	1,258,350	1,239,215	1,449,464	1,194,926
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	780,294	650,570	727,266	658,585	645,379
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	384,748	379,652	386,510	361,381	329,482
クラスA英債券・ヘッジ毎月分配型投資証券	709,105	617,092	532,584	486,117	470,845
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	314,900	308,379	308,186	307,054	365,191
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,320,276	1,271,914	1,262,834	1,182,505	1,113,210
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	9,102,627	8,638,823	8,092,379	7,680,427	7,394,176
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	1,716,347	1,717,156	1,754,214	1,519,401	1,547,728
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	34,957	45,215	51,636	101,898	56,681
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	174,996,860	165,208,335	147,256,653	129,979,206	98,850,855
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	15,740,095	15,535,128	6,660,793	5,873,525	6,328,798
クラスA日本円・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券(注3)	-	-	-	-	726

	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)
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	1,466,610	1,449,696	1,416,434	1,324,582	1,288,067
クラスAトータル・リターン分配型投資証券(注4)	-	-	-	-	500
クラスA無分配投資証券	11,471,641	8,990,579	7,924,368	7,729,114	7,069,087
クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	197,332	184,729	180,238	188,985	192,857
クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	115,196	107,476	152,689	70,484	60,018
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	83,505	69,136	59,438	50,218	37,647
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	146,462	90,200	83,224	78,610	56,867
クラスC毎日分配型投資証券	658,276	637,630	586,633	555,770	490,019
クラスC無分配投資証券	378,679	316,879	288,961	266,427	207,666
クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	1,535,282	1,436,709	1,369,540	294,551	291,561
クラスD毎月分配型投資証券	13,207,023	12,221,460	11,926,958	9,766,823	7,315,621
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	282,111	282,111	292,111	264,548	247,079
クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	107,352	107,352	116,801	71,080	60,830
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	341,091	306,408	276,709	253,047	292,897
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	241,887	246,794	115,278	73,241	55,537
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	16,662	16,662	16,662	14,468	14,468
クラスD無分配英国報告型投資証券	8,357,571	6,195,563	5,199,535	5,027,063	5,115,939
クラスE無分配投資証券	504,890	455,300	381,533	402,421	410,083
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	413	953	13,247	14,371	25,285
クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	32,540	872,712	1,000,369	992,358	1,027,343
クラスI毎月分配型投資証券	24,249,689	15,705,324	6,164,513	4,714,050	16,942,863
クラスI無分配投資証券	23,603,337	22,593,825	24,023,867	22,034,766	21,386,073
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	7,108,235	3,143,684	308,544	251,219	200,783

	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)
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	449	449	449	449	449
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	382	382	382	382	382
クラスSR英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	364	364	364	364	364
クラスSR毎月分配英国報告型投資証券	122,176	52,588	116,137	500	500
クラスSR無分配英国報告型投資証券	323,642	291,662	176,143	115,927	115,529
クラスSRユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	93,610	15,051	15,051	15,051	10,858
クラスX安定毎月総収益分配型投資証券	4,649,371	4,697,932	4,845,854	4,997,769	5,788,752
クラスX無分配投資証券	476,857	393,926	426,368	382,909	349,000
(f) 純資産額	3,053,668,434米ドル (462,355,938千円)	2,357,372,193米ドル (356,929,724千円)	2,031,004,182米ドル (307,514,343千円)	1,885,887,744米ドル (285,542,263千円)	1,895,426,625米ドル (286,986,545千円)
(g) 総資産額	3,106,507,693米ドル (470,356,330千円)	2,404,600,980米ドル (364,080,634千円)	2,060,404,463米ドル (311,965,840千円)	1,915,417,559米ドル (290,013,373千円)	1,920,812,635米ドル (290,830,241千円)
(h) 1口当たり純資産価格(注5)					
クラスA英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	10.32英ポンド (1,973円)	9.09英ポンド (1,738円)	9.14英ポンド (1,748円)	9.01英ポンド (1,723円)	9.52英ポンド (1,820円)
クラスA毎日分配型投資証券	5.72米ドル (866円)	5.18米ドル (784円)	5.13米ドル (777円)	5.21米ドル (789円)	5.37米ドル (813円)
クラスA毎月分配型投資証券	5.77米ドル (874円)	5.22米ドル (790円)	5.18米ドル (784円)	5.25米ドル (795円)	5.41米ドル (819円)
クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	10.93豪ドル (1,078円)	9.83豪ドル (969円)	9.65豪ドル (952円)	9.70豪ドル (957円)	9.93豪ドル (979円)
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.79カナダ・ドル (1,095円)	8.84カナダ・ドル (988円)	8.73カナダ・ドル (976円)	8.82カナダ・ドル (986円)	9.07カナダ・ドル (1,014円)
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	8.77ユーロ (1,432円)	7.84ユーロ (1,280円)	7.64ユーロ (1,247円)	7.66ユーロ (1,250円)	7.82ユーロ (1,277円)
クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.33英ポンド (1,784円)	8.39英ポンド (1,604円)	8.23英ポンド (1,574円)	8.32英ポンド (1,591円)	8.55英ポンド (1,635円)
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	10.74ニュージーランド・ドル (972円)	9.70ニュージーランド・ドル (878円)	9.55ニュージーランド・ドル (864円)	9.68ニュージーランド・ドル (876円)	9.96ニュージーランド・ドル (901円)
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	9.54シンガポール・ドル (1,070円)	8.62シンガポール・ドル (966円)	8.50シンガポール・ドル (953円)	8.55シンガポール・ドル (959円)	8.73シンガポール・ドル (979円)

	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)
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	8.59豪ドル (847円)	7.67豪ドル (756円)	7.51豪ドル (741円)	7.60豪ドル (749円)	7.78豪ドル (767円)
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	86.00南アフリカ・ ランド (687円)	77.05南アフリカ・ ランド (616円)	75.58南アフリカ・ ランド (604円)	76.54南アフリカ・ ランド (612円)	78.56南アフリカ・ ランド (628円)
クラスAオフショア中国 人民元・ヘッジ金利差毎 月総収益分配英国報告型 投資証券	99.41人民元 (2,071円)	88.78人民元 (1,849円)	85.89人民元 (1,789円)	85.64人民元 (1,784円)	87.89人民元 (1,831円)
クラスA安定毎月総収益 分配型投資証券	4.74米ドル (718円)	4.25米ドル (643円)	4.17米ドル (631円)	4.21米ドル (637円)	4.31米ドル (653円)
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	35.29香港ドル (683円)	31.53香港ドル (610円)	30.84香港ドル (596円)	30.92香港ドル (598円)	31.53香港ドル (610円)
クラスA日本円・ヘッジ 安定毎月総収益分配型投 資証券(注3)	-	-	-	-	990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	8.67シンガ ポール・ドル (972円)	7.75シンガ ポール・ドル (869円)	7.59シンガ ポール・ドル (851円)	7.60シンガ ポール・ドル (852円)	7.72シンガ ポール・ドル (865円)
クラスAトータル・リ ターン分配型投資証券 (注4)	-	-	-	-	9.99米ドル (1,513円)
クラスA無分配投資証券	37.63米ドル (5,698円)	34.83米ドル (5,274円)	35.38米ドル (5,357円)	36.87米ドル (5,582円)	39.06米ドル (5,914円)
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	18.40豪ドル (1,814円)	16.91豪ドル (1,667円)	17.00豪ドル (1,676円)	17.58豪ドル (1,734円)	18.47豪ドル (1,821円)
クラスAスイス・フラ ン・ヘッジ無分配投資証 券	11.28スイス・ フラン (1,894円)	10.30スイス・ フラン (1,730円)	10.24スイス・ フラン (1,720円)	10.45スイス・ フラン (1,755円)	10.83スイス・ フラン (1,819円)
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	220.31ユーロ (35,963円)	201.30ユーロ (32,860円)	200.82ユーロ (32,782円)	206.88ユーロ (33,771円)	217.06ユーロ (35,433円)
クラスAシンガポール・ ドル・ヘッジ無分配投資 証券	16.04シンガ ポール・ドル (1,798円)	14.80シンガ ポール・ドル (1,659円)	14.96シンガ ポール・ドル (1,677円)	15.47シンガ ポール・ドル (1,734円)	16.23シンガ ポール・ドル (1,820円)
クラスC毎日分配型投資 証券	5.73米ドル (868円)	5.19米ドル (786円)	5.14米ドル (778円)	5.21米ドル (789円)	5.38米ドル (815円)
クラスC無分配投資証券	28.39米ドル (4,299円)	26.11米ドル (3,953円)	26.36米ドル (3,991円)	27.29米ドル (4,132円)	28.74米ドル (4,352円)
クラスD英ポンド・ヘッ ジ毎年分配英国報告型投 資証券	10.31英ポンド (1,971円)	9.04英ポンド (1,729円)	9.12英ポンド (1,744円)	8.97英ポンド (1,715円)	9.50英ポンド (1,817円)
クラスD毎月分配型投資 証券	9.88米ドル (1,496円)	8.95米ドル (1,355円)	8.87米ドル (1,343円)	9.00米ドル (1,363円)	9.28米ドル (1,405円)
クラスDシンガポール・ ドル・ヘッジ毎月分配型 投資証券	9.57シンガ ポール・ドル (1,073円)	8.64シンガ ポール・ドル (969円)	8.52シンガ ポール・ドル (955円)	8.58シンガ ポール・ドル (962円)	8.76シンガ ポール・ドル (982円)
クラスD豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	19.58豪ドル (1,931円)	18.05豪ドル (1,780円)	18.22豪ドル (1,797円)	18.90豪ドル (1,864円)	19.94豪ドル (1,966円)
クラスDスイス・フラ ン・ヘッジ無分配投資証 券	11.84スイス・ フラン (1,988円)	10.85スイス・ フラン (1,822円)	10.84スイス・ フラン (1,820円)	11.09スイス・ フラン (1,862円)	11.54スイス・ フラン (1,938円)
クラスDユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	236.91ユーロ (38,673円)	217.23ユーロ (35,461円)	217.48ユーロ (35,501円)	224.84ユーロ (36,703円)	236.73ユーロ (38,644円)

	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)
クラスDシンガポール・ ドル・ヘッジ無分配投資 証券	17.02シンガ ポール・ドル (1,908円)	15.76シンガ ポール・ドル (1,767円)	15.99シンガ ポール・ドル (1,793円)	16.59シンガ ポール・ドル (1,860円)	17.47シンガ ポール・ドル (1,959円)
クラスD無分配英国報告 型投資証券	30.17英ポンド (5,769円)	32.37英ポンド (6,190円)	31.56英ポンド (6,035円)	40.06米ドル (6,065円)	42.59米ドル (6,449円)
クラスE無分配投資証券	34.11米ドル (5,165円)	31.49米ドル (4,768円)	31.91米ドル (4,831円)	33.17米ドル (5,022円)	35.05米ドル (5,307円)
クラスEユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	9.74ユーロ (1,590円)	8.87ユーロ (1,448円)	8.83ユーロ (1,441円)	9.07ユーロ (1,481円)	9.50ユーロ (1,551円)
クラスI英ポンド・ヘッ ジ毎年分配英国報告型 投資証券	8.94英ポンド (1,710円)	7.84英ポンド (1,499円)	7.91英ポンド (1,513円)	7.77英ポンド (1,486円)	8.24英ポンド (1,576円)
クラスI毎月分配型投資 証券	9.31米ドル (1,410円)	8.43米ドル (1,276円)	8.36米ドル (1,266円)	8.48米ドル (1,284円)	8.74米ドル (1,323円)
クラスI無分配投資証券	16.47米ドル (2,494円)	15.31米ドル (2,318円)	15.62米ドル (2,365円)	16.34米ドル (2,474円)	17.39米ドル (2,633円)
クラスIユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	12.23ユーロ (1,996円)	11.22ユーロ (1,832円)	11.24ユーロ (1,835円)	11.63ユーロ (1,898円)	12.26ユーロ (2,001円)
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	9.75スイス・ フラン (1,637円)	8.94スイス・ フラン (1,501円)	8.94スイス・ フラン (1,501円)	9.16スイス・ フラン (1,538円)	9.54スイス・ フラン (1,602円)
クラスI英ポンド・ヘッ ジ無分配英国報告型投資 証券	10.53英ポンド (2,014円)	9.72英ポンド (1,859円)	9.82英ポンド (1,878円)	10.24英ポンド (1,958円)	10.86英ポンド (2,077円)
クラスSR英ポンド・ヘッ ジ毎年分配英国報告 型投資証券	9.76英ポンド (1,866円)	8.56英ポンド (1,637円)	8.64英ポンド (1,652円)	8.49英ポンド (1,623円)	9.00英ポンド (1,721円)
クラスSR毎月分配英国 報告型投資証券	7.13英ポンド (1,363円)	7.46英ポンド (1,427円)	7.08英ポンド (1,354円)	8.73米ドル (1,322円)	9.00米ドル (1,363円)
クラスSR無分配英国報 告型投資証券	7.41英ポンド (1,417円)	7.96英ポンド (1,522円)	7.76英ポンド (1,484円)	9.85米ドル (1,491円)	10.47米ドル (1,585円)
クラスSRユーロ・ヘッ ジ無分配英国報告型投資 証券	9.87ユーロ (1,611円)	9.05ユーロ (1,477円)	9.06ユーロ (1,479円)	9.37ユーロ (1,530円)	9.87ユーロ (1,611円)
クラスX安定毎月総収益 分配型投資証券	10.49米ドル (1,588円)	9.49米ドル (1,437円)	9.41米ドル (1,425円)	9.57米ドル (1,449円)	9.88米ドル (1,496円)
クラスX無分配投資証券	45.52米ドル (6,892円)	42.43米ドル (6,424円)	43.40米ドル (6,571円)	45.56米ドル (6,898円)	48.60米ドル (7,359円)
(i) 1口当たり当期純利益金 額(注6)	-	-	-	-	-
(j) 分配総額	44,465,524米ドル (6,732,525千円)	85,316,226米ドル (12,917,730千円)	34,197,742米ドル (5,177,880千円)	65,645,476米ドル (9,939,382千円)	28,366,845米ドル (4,295,024千円)
(k) 1口当たり分配金額(注 6)	-	-	-	-	-
(l) 自己資本比率	98.30%	98.04%	98.57%	98.46%	98.68%
(m) 自己資本利益率	0.36%	-3.53%	-4.52%	-8.61%	-1.61%

- (注1) 営業収益には投資収益を記載している。
- (注2) ファンドは、変動資本を有する会社型投資信託(以下「SICAV」という。)であり、純資産総額を記載している。以下同じ。
- (注3) クラスA日本円・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券は、2023年12月20日に運用を開始した。以下同じ。
- (注4) クラスAトータル・リターン分配型投資証券 - 米ドル建は、2023年12月20日に運用を開始した。以下同じ。
- (注5) 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6) (i) および(k) は、ファンドの性格上、算定していない。
- (注7) USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンドは、1993年10月29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ファンド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。

() ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

クラス投資証券	発行済投資証券 総口数(口)
クラスA 毎年分配型投資証券	1,302,631
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	36,017
クラスA トータル・リターン分配型投資証券	500
クラスA 無分配投資証券	44,119,587
クラスA 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	153,796
クラスA オフショア中国人民元ヘッジ無分配投資証券	275,059
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	6,600,427
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	324,499
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	731
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	3,004,686
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	192,715
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	390,366
クラスA I 無分配投資証券	1,954,064
クラスC 無分配投資証券	445
クラスD 無分配投資証券	3,169,795
クラスD オフショア中国人民元ヘッジ無分配投資証券	323
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	583,037
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	1,111,262
クラスD 無分配英国報告型投資証券	5,569,286
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,360,128
クラスE 無分配投資証券	27,998,454
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	16,020,114
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	82,646
クラスI 無分配投資証券	18,011,312
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,052,987
クラスI 無分配英国報告型投資証券	903,312
クラスS 無分配英国報告型投資証券	17,263,546
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	637,461
クラスS ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,381,859
クラスS 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	204,495
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	44,513
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	67,839
クラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	409

クラス投資証券	発行済投資証券 総口数(口)
クラスX無分配投資証券	348,347
クラスZ無分配英国報告型投資証券	81,730
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	9,054

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58会計年度末 (2019年8月末日)	95,062,669米ドル (14,393,439千円)	1,477,108口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	909,043,574米ドル (137,638,288千円)	12,965,753口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	6,005,476,165米ドル (909,289,146千円)	70,229,795口
第61会計年度末 (2022年8月末日)	2,755,606,835米ドル (417,226,431千円)	54,506,693口
第62会計年度末 (2023年8月末日)	2,565,516,420米ドル (388,444,841千円)	48,077,137口
2024年3月末日	2,756,876,409米ドル (417,418,657千円)	44,119,587口

() USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
クラスA英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	102,997
クラスA毎日分配型投資証券	10,524,546
クラスA毎月分配型投資証券	13,437,650
クラスA豪ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,181,766
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	645,379
クラスAユーロ・ヘッジ毎月分配型投資証券	324,259
クラスA英ポンド・ヘッジ毎月分配型投資証券	468,053
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	365,191
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	1,103,318
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	7,319,243
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	1,567,979
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	57,570
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	98,195,904
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	6,066,681
クラスA日本円・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券	726
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	1,295,348
クラスAトータル・リターン分配型投資証券	500
クラスA無分配投資証券	7,614,449
クラスA豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	190,738
クラスAスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	60,018
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	37,679
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	57,913
クラスC毎日分配型投資証券	490,399
クラスC無分配投資証券	206,802
クラスD英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	282,064
クラスD毎月分配型投資証券	7,419,153
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券	185,145
クラスD豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	60,830
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	256,913
クラスDユーロ・ヘッジ無分配投資証券	37,943
クラスDシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	14,468
クラスD無分配英国報告型投資証券	5,105,678
クラスE無分配投資証券	410,621
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	26,819
クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券	1,069,503
クラスI毎月分配型投資証券	16,951,569
クラスI無分配投資証券	21,698,328
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	183,951

クラス投資証券	発行済投資証券総口数(口)
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	449
クラスI 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	382
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	364
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	500
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	115,529
クラスS R ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	10,858
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	5,812,168
クラスX 無分配投資証券	345,696

会計年度	純資産総額	クラスA 毎月分配型投資証券 発行済投資証券総口数	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)	2,489,192,280米ドル (376,888,603千円)	20,569,525口	10,985,138口
第58会計年度末 (2019年8月末日)	2,106,616,767米ドル (318,962,845千円)	17,247,134口	9,669,599口
第59会計年度末 (2020年8月末日)	3,031,279,724米ドル (458,966,063千円)	16,062,099口	11,441,254口
第60会計年度末 (2021年8月末日)	3,591,197,714米ドル (543,743,246千円)	24,737,631口	13,589,691口
第61会計年度末 (2022年8月末日)	2,357,372,193米ドル (356,929,724千円)	17,098,452口	8,990,579口
第62会計年度末 (2023年8月末日)	1,885,887,744米ドル (285,542,263千円)	13,275,536口	7,729,114口
2024年3月末日	1,932,516,749米ドル (292,602,361千円)	13,437,650口	7,614,449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・マツゾッキ (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EMEA・ウェルス・ プロダクト・グループのヘッド	0
ダヴィーナ・セイント (Davina Saint)	独立非常勤取締役	ブラックロック・グローバル・ファン ズの独立非常勤取締役	0
ヴァシリキ・ パチャトゥリディ (Vasiliki Pachatouridi)	非常勤取締役	ブラックロックのマネージング・ディ レクターおよびiSharesフィクスト・イ ンカム・プロダクト・ストラテジーE MEAのヘッド	0

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

(5) 【その他】

a. 定款の変更

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

b. 事業譲渡または事業譲受

合併

ルクセンブルグ規制当局(ルクセンブルグ金融監督委員会(Commission de Surveillance du Sector Financier)) (以下「CSSF」という。)の事前承認を条件に、譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託(以下「UCITS」という。)同士の併合による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UCITSは、その資産および債務を相手方のUCITSに拠出し、清算を行わずに解散される。

変動資本を有する会社型投資信託(以下「SICAV」という。)間で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)

()ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

(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) (%)
社債	米国	1,553,179,993	56.15
	日本	204,371,202	7.39
	オランダ	172,494,534	6.24
	台湾	165,807,207	5.99
	連合王国	142,779,446	5.16
	韓国	94,674,572	3.42
	オーストラリア	79,172,343	2.86
	ケイマン諸島	75,756,629	2.74
	ルクセンブルグ	56,607,067	2.05
	カザフスタン	39,630,848	1.43
	イスラエル	38,146,232	1.38
	ニュージーランド	36,777,529	1.33
	中国	25,958,037	0.94
	ドイツ	20,721,918	0.75
	カナダ	19,668,833	0.71
	フランス	18,668,489	0.67
	スウェーデン	3,390,785	0.12
	小計	2,747,805,664	99.33
投資資産合計		2,747,805,664	99.33
現金・その他の資産(負債控除後)		18,533,929	0.67
資産総額		2,766,339,593	100.00
負債総額		9,463,184	0.34 ^(注2)
純資産総額		2,756,876,409 (約417,419百万円)	99.66 ^(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。

() USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

(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) (%)
社債	米国	1,368,544,884	68.74
	カナダ	82,594,357	4.15
	連合王国	50,406,952	2.53
	ケイマン諸島	41,768,599	2.10
	ルクセンブルグ	35,746,904	1.80
	フランス	32,725,164	1.64
	パナマ	28,361,795	1.42
	ドイツ	23,997,443	1.21
	イタリア	21,810,051	1.10
	オランダ	21,315,421	1.07
	バミューダ	19,079,127	0.96
	アイルランド	13,804,067	0.69
	スイス	10,626,654	0.53
	リベリア	9,152,149	0.46
	ジャージー	8,920,830	0.45
	スペイン	4,907,366	0.25
	モーリシャス	4,906,994	0.25
	ポルトガル	2,769,695	0.14
	ジャマイカ	2,096,835	0.11
	日本	2,074,882	0.10
	マルタ	1,668,071	0.08
	スウェーデン	1,049,266	0.05
	ポーランド	946,479	0.05
	フィンランド	307,473	0.02
	オーストリア	297,644	0.01
	ノルウェー	263,359	0.01
	ベルギー	231,541	0.01
	ルーマニア	206,523	0.01
	ギリシャ	190,216	0.01
	マーシャル諸島	187,523	0.01
オーストラリア	184,410	0.01	
フィンランド	184,000	0.01	
デンマーク	104,909	0.01	
キプロス	102,822	0.01	
	小計	1,791,534,405	89.99
政府機関債	ケイマン諸島	30,600,000	1.54
	アイルランド	29,553,296	1.48
		小計	60,153,296

投資信託	アイルランド	46,440,600	2.33
	小計	46,440,600	2.33
株式	フランス	5,717,242	0.29
	米国	5,547,942	0.28
	連合王国	1,861,784	0.09
	ルクセンブルグ	3,536	0.00
	小計	13,130,504	0.66
投資資産合計		1,911,258,805	96.01
現金・その他の資産(負債控除後)		79,503,545	3.99
資産総額		1,990,762,350	100.00
負債総額		58,245,601	2.93 (注2)
純資産総額		1,932,516,749 (約292,602百万円)	97.07 (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ファンド証券の1口当たり純資産価格の推移は、以下のとおりである。

() ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

	総資産額		純資産総額		クラスA 無分配投資証券 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	2,202,329	333,455	2,197,372	332,704	13.20	1,999
5月末日	2,392,821	362,297	2,378,853	360,182	14.60	2,211
6月末日	2,625,054	397,459	2,570,739	389,236	15.56	2,356
7月末日	2,703,672	409,363	2,696,114	408,219	16.31	2,469
8月末日	2,578,126	390,354	2,565,516	388,445	15.73	2,382
9月末日	2,374,997	359,598	2,366,937	358,378	14.80	2,241
10月末日	2,135,504	323,337	2,106,667	318,970	13.56	2,053
11月末日	2,426,433	367,386	2,419,957	366,406	15.69	2,376
12月末日	2,624,353	397,353	2,607,448	394,794	16.65	2,521
2024年1月末日	2,583,428	391,157	2,567,081	388,682	16.80	2,544
2月末日	2,759,623	417,835	2,746,616	415,865	18.05	2,733
3月末日	2,766,340	418,852	2,756,876	417,419	18.19	2,754

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。

() USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

	総資産額		純資産総額	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円
2023年4月末日	1,973,711	298,840	1,948,048	294,954
5月末日	1,924,325	291,362	1,906,595	288,678
6月末日	1,922,946	291,153	1,911,649	289,443
7月末日	1,948,984	295,096	1,928,472	291,990
8月末日	1,915,418	290,013	1,885,888	285,542
9月末日	1,860,077	281,634	1,839,079	278,455
10月末日	1,748,409	264,727	1,733,127	262,413
11月末日	1,843,433	279,114	1,810,853	274,181
12月末日	1,882,479	285,026	1,867,108	282,699
2024年1月末日	1,903,699	288,239	1,863,996	282,228
2月末日	1,920,813	290,830	1,895,427	286,987
3月末日	1,990,762	301,421	1,932,517	292,602

1口当たり純資産価格

	クラスA 毎月分配型投資証券		クラスA 無分配投資証券	
	米ドル	円	米ドル	円
2023年4月末日	5.24	793	36.12	5,469
5月末日	5.17	783	35.83	5,425
6月末日	5.22	790	36.30	5,496
7月末日	5.27	798	36.81	5,573
8月末日	5.25	795	36.87	5,582
9月末日	5.17	783	36.47	5,522
10月末日	5.07	768	35.95	5,443
11月末日	5.28	799	37.58	5,690
12月末日	5.44	824	38.88	5,887
2024年1月末日	5.42	821	38.96	5,899
2月末日	5.41	819	39.06	5,914
3月末日	5.46	827	39.57	5,991

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。

- () ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

総額446米ドル(約68千円)

- () USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

総額52,180,030米ドル(約7,900,578千円)

(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 毎月分配型投資証券につき、2024年3月末日前1年間における各月の1口当たり分配金は、以下のとおりである。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。

分配落ち日	分配支払日	1口当たり分配金
2023年4月28日	2023年5月8日	0.021277米ドル(3.22円)
2023年5月31日	2023年6月7日	0.025827米ドル(3.91円)
2023年6月30日	2023年7月7日	0.023168米ドル(3.51円)
2023年7月31日	2023年8月7日	0.023704米ドル(3.59円)
2023年8月31日	2023年9月7日	0.024339米ドル(3.69円)
2023年9月29日	2023年10月6日	0.022255米ドル(3.37円)
2023年10月31日	2023年11月8日	0.025317米ドル(3.83円)
2023年11月30日	2023年12月7日	0.025947米ドル(3.93円)
2023年12月29日	2024年1月8日	0.020035米ドル(3.03円)
2024年1月31日	2024年2月7日	0.026493米ドル(4.01円)
2024年2月29日	2024年3月7日	0.024134米ドル(3.65円)
2024年3月28日	2024年4月8日	0.023030米ドル(3.49円)

【自己資本利益率(収益率)の推移】

2024年3月末日前一年間におけるサブ・ファンドの自己資本利益率は、以下のとおりである。

	自己資本利益率(収益率)
()ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	-0.61%
()USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	5.72%

(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・グレグソン (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。
- (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、外国通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カナダ・ドル=111.81円、1スイス・フラン=167.92円、1ユーロ=163.24円、1豪ドル=98.61円、1香港ドル=19.34円、1人民元=20.83円、1シンガポール・ドル=112.11円、1ニュージーランド・ドル=90.50円および1南アフリカ・ランド=7.99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、ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンドおよびUSドル・ハイ・イールド・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)

	注記	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	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		1,914,112,717	289,815,806
未実現評価益		785,127,793	118,876,199
投資有価証券 - 時価	2 (a)	2,699,240,510	408,692,006
銀行預金	2 (a)	52,227,170	7,907,716
未収利息および未収配当金	2 (a)	542,446	82,132
販売投資証券未収金	2 (a)	3,843,664	581,969
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	3,709,788	561,699
その他の資産	2 (a, c)	59,753	9,047
資産合計		2,759,623,331	417,834,569
負債			
当座借越	2 (a)	632,431	95,756
未払収益分配金	2 (a)	49	7
購入投資有価証券未払金	2 (a)	1,059,623	160,438
買戻し投資証券未払金	2 (a)	7,478,022	1,132,247
その他の負債	4, 5, 6, 7, 8	3,836,828	580,934
負債合計		13,006,953	1,969,383
純資産合計		2,746,616,378	415,865,186

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

純資産計算書 2024年2月29日現在(未監査)(続き)

	注記	USドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
資産			
投資有価証券 - 取得原価		1,894,751,493	286,884,324
未実現評価損		(52,896,392)	(8,009,043)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,841,855,101	278,875,281
銀行預金	2 (a)	35,811,058	5,422,152
ブローカーに対する債権	14	2,476,000	374,891
未収利息および未収配当金	2 (a)	28,814,021	4,362,731
売却投資有価証券未収金	2 (a)	1,324,745	200,580
販売投資証券未収金	2 (a)	5,124,204	775,856
以下に係る未実現評価益：			
未決済先渡為替予約	2 (c)	1,277,090	193,364
スワップの時価 / 未実現評価益	2 (c)	4,113,321	622,798
買建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	7,930	1,201
その他の資産	2 (a, c)	9,165	1,388
資産合計		1,920,812,635	290,830,241
負債			
ブローカーに対する債務	14	4,531,068	686,049
未払収益分配金	2 (a)	4,904,323	742,564
購入投資有価証券未払金	2 (a)	12,666,324	1,917,808
買戻し投資証券未払金	2 (a)	1,480,725	224,197
売建オプション / スワップオプションの時価	2 (c)	670	101
その他の負債	4, 5, 6, 7, 8	1,802,900	272,977
負債合計		25,386,010	3,843,696
純資産合計		1,895,426,625	286,986,545

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	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド (円換算額)	
2024年2月29日現在			
純資産合計	米ドル	2,746,616,378	415,865,186 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	6.74	1,021 円
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	6.74	1,021 円
クラスA トータル・リターン分配型投資証券	米ドル	12.27	1,858 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	18.05	2,733 円
クラスA 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	9.36	923 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア 中国人民元	65.43	1,363 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	15.57	2,542 円
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	香港ドル	65.54	1,268 円
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	ニュージーランド・ ドル	9.60	869 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ ドル	16.86	1,890 円
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	スイス・フラン	6.58	1,105 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	6.87	1,314 円
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	20.27	3,069 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	12.40	1,877 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	18.89	2,860 円
クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア 中国人民元	67.06	1,397 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	16.30	2,661 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ ドル	6.42	720 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	18.89	2,860 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	17.06	3,262 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	23.90	3,619 円
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	15.16	2,475 円
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	10.63	1,609 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	19.16	2,901 円
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	19.88	3,245 円
クラスI 無分配英国報告型投資証券	米ドル	19.16	2,901 円
クラスS 無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.38	1,117 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	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	
		(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S スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	スイス・フラン	6.75	1,133 円
クラスS ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	6.76	1,104 円
クラスS 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.05	1,348 円
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	7.48	1,133 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.49	1,134 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	6.76	1,104 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	19.87	3,009 円
クラスZ 無分配英国報告型投資証券	米ドル	19.21	2,909 円
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	スイス・フラン	6.80	1,142 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	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	
		(円換算額)	
2023年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	2,565,516,420	388,444,841 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	5.87	889 円
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	5.87	889 円
クラスA トータル・リターン分配型投資証券	米ドル	11.15	1,688 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	15.73	2,382 円
クラスA 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	8.24	813 円
クラスA オフショア中国人民幣元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア中国人民幣元	57.66	1,201 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	13.73	2,241 円
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	香港ドル	57.36	1,109 円
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	ニュージーランド・ドル	8.40	760 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	14.84	1,664 円
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	スイス・フラン	5.84	981 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	6.02	1,151 円
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	17.66	2,674 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	10.87	1,646 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	16.39	2,482 円
クラスD オフショア中国人民幣元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア中国人民幣元	58.86	1,226 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	14.31	2,336 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	5.63	631 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	16.40	2,483 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	14.89	2,847 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	20.87	3,160 円
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	13.40	2,187 円
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	9.21	1,394 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	16.61	2,515 円
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	17.43	2,845 円
クラスI 無分配英国報告型投資証券	米ドル	16.61	2,515 円
クラスS 無分配英国報告型投資証券	米ドル	6.40	969 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	ネクスト・ジェネレーション・ テクノロジー・ファンド	
		(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S スイス・フラン・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	スイス・フラン	5.97	1,002 円
クラスS ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	5.93	968 円
クラスS 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	6.15	1,176 円
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	6.49	983 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	6.50	984 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	5.93	968 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	17.17	2,600 円
クラスZ 無分配英国報告型投資証券	米ドル	16.64	2,519 円
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	スイス・フラン	6.00	1,008 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	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	
		(円換算額)	
2022年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	2,755,606,835	417,226,431 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎年分配型投資証券	米ドル	5.59	846 円
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	4.82	730 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	14.99	2,270 円
クラスA 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	8.08	797 円
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア 中国人民元	56.81	1,183 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	13.54	2,210 円
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	香港ドル	55.32	1,070 円
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	ニュージーランド・ ドル	8.15	738 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ ドル	14.39	1,613 円
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	スイス・フラン	5.84	981 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	5.88	1,124 円
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	16.84	2,550 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	15.50	2,347 円
クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア 中国人民元	57.51	1,198 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	13.99	2,284 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ ドル	5.42	608 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	13.35	2,021 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	14.43	2,759 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	20.00	3,028 円
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	13.28	2,168 円
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	7.49	1,134 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	15.66	2,371 円
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	17.01	2,777 円
クラスI 無分配英国報告型投資証券	米ドル	13.49	2,043 円
クラスS 無分配英国報告型投資証券	米ドル	5.21	789 円
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	スイス・フラン	5.91	992 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	ネクスト・ジェネレーション・ テクノロジー・ファンド	
		(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Sユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	5.80	947 円
クラスS英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	5.96	1,140 円
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	5.28	799 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	5.29	801 円
クラスS Rユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	5.79	945 円
クラスX無分配投資証券	米ドル	16.08	2,435 円
クラスZ無分配英国報告型投資証券	米ドル	13.52	2,047 円
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	スイス・フラン	5.93	996 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	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド	
		(円換算額)	
2021年8月31日現在			
純資産合計	米ドル	6,005,476,165	909,289,146 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	7.33	1,110 円
クラスA 無分配投資証券	米ドル	27.08	4,100 円
クラスA オフショア中国人民幣元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア中国人民幣元	101.91	2,123 円
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	25.39	4,145 円
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	香港ドル	100.71	1,948 円
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	26.40	2,960 円
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	スイス・フラン	10.84	1,820 円
クラスA 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英債券	10.87	2,079 円
クラスA I 無分配投資証券	米ドル	30.41	4,604 円
クラスD 無分配投資証券	米ドル	27.77	4,205 円
クラスD オフショア中国人民幣元・ヘッジ無分配投資証券	オフショア中国人民幣元	102.33	2,132 円
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	26.03	4,249 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	シンガポール・ドル	9.86	1,105 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	20.15	3,051 円
クラスD 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英債券	26.46	5,060 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	36.31	5,498 円
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	25.03	4,086 円
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	11.27	1,706 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	27.99	4,238 円
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	31.55	5,150 円
クラスI 無分配英国報告型投資証券	米ドル	20.31	3,075 円
クラスS 無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.86	1,190 円
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	スイス・フラン	10.88	1,827 円
クラスS ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	10.77	1,758 円
クラスS 英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英債券	10.91	2,086 円
クラスS R 毎年分配英国報告型投資証券	米ドル	7.97	1,207 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	ネクスト・ジェネレーション・ テクノロジー・ファンド	
		(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SR無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.97	1,207 円
クラスSRユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	10.77	1,758 円
クラスX無分配投資証券	米ドル	28.55	4,323 円
クラスZ無分配英国報告型投資証券	米ドル	20.33	3,078 円
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	スイス・フラン	10.89	1,829 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。

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	U S ドル・ハイ・イールド・ 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	1,895,426,625	286,986,545 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ボンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ボンド	9.52	1,820 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.37	813 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.41	819 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	9.93	979 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	9.07	1,014 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	7.82	1,277 円
クラスA英ボンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ボンド	8.55	1,635 円
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	ニュージー ランド・ドル	9.96	901 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.73	979 円
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	豪ドル	7.78	767 円
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	南アフリカ・ ランド	78.56	628 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英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	87.89	1,831 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.31	653 円
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	香港ドル	31.53	610 円
クラスA円ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	日本円	990	990 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	7.72	865 円
クラスAトータル・リターン分配型投資証券	米ドル	9.99	1,513 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	39.06	5,914 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.47	1,821 円
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	10.83	1,819 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	217.06	35,433 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	16.23	1,820 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	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(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C 毎日分配型投資証券	米ドル	5.38	815 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	28.74	4,352 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.50	1,817 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.28	1,405 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.76	982 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	19.94	1,966 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	11.54	1,938 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	236.73	38,644 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	17.47	1,959 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	42.59	6,449 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	35.05	5,307 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	9.50	1,551 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	8.24	1,576 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	8.74	1,323 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	17.39	2,633 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	12.26	2,001 円
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	スイス・フラン	9.54	1,602 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.86	2,077 円
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	英ポンド	9.00	1,721 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	米ドル	9.00	1,363 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	10.47	1,585 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	9.87	1,611 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	9.88	1,496 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	48.60	7,359 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	U S ドル・ハイ・イールド・ 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	1,885,887,744	285,542,263 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.01	1,723 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.21	789 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.25	795 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	9.70	957 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	8.82	986 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	7.66	1,250 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	8.32	1,591 円
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	ニュージー ランド・ドル	9.68	876 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.55	959 円
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	豪ドル	7.60	749 円
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	南アフリカ・ ランド	76.54	612 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英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	85.64	1,784 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.21	637 円
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	香港ドル	30.92	598 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	7.60	852 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	36.87	5,582 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	17.58	1,734 円
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	10.45	1,755 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	206.88	33,771 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	15.47	1,734 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	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(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C 毎日分配型投資証券	米ドル	5.21	789 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	27.29	4,132 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	8.97	1,715 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	9.00	1,363 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.58	962 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.90	1,864 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	11.09	1,862 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	224.84	36,703 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	16.59	1,860 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	40.06	6,065 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	33.17	5,022 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	9.07	1,481 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.77	1,486 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	8.48	1,284 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	16.34	2,474 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.63	1,898 円
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	スイス・フラン	9.16	1,538 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.24	1,958 円
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	英ポンド	8.49	1,623 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	米ドル	8.73	1,322 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	9.85	1,491 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	9.37	1,530 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	9.57	1,449 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	45.56	6,898 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	U S ドル・ハイ・イールド・ 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	2,357,372,193	356,929,724 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.09	1,738 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	5.18	784 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	5.22	790 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	9.83	969 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	8.84	988 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	7.84	1,280 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	8.39	1,604 円
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	ニュージー ランド・ドル	9.70	878 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.62	966 円
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	豪ドル	7.67	756 円
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	南アフリカ・ ランド	77.05	616 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英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	88.78	1,849 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	4.25	643 円
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	香港ドル	31.53	610 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	7.75	869 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	34.83	5,274 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	16.91	1,667 円
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	10.30	1,730 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シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	14.80	1,659 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	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(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C 毎日分配型投資証券	米ドル	5.19	786 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	26.11	3,953 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.04	1,729 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	8.95	1,355 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	8.64	969 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	18.05	1,780 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	10.85	1,822 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	217.23	35,461 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	15.76	1,767 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	32.37	4,901 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	31.49	4,768 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	8.87	1,448 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	7.84	1,499 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	8.43	1,276 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	15.31	2,318 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	11.22	1,832 円
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	スイス・フラン	8.94	1,501 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.72	1,859 円
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	英ポンド	8.56	1,637 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	米ドル	7.46	1,130 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.96	1,205 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	9.05	1,477 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	9.49	1,437 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	42.43	6,424 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	U S ドル・ハイ・イールド・ 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	3,591,197,714	543,743,246 千円
以下の1口当たり純資産価額:			
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.71	2,048 円
クラスA毎日分配型投資証券	米ドル	6.03	913 円
クラスA毎月分配型投資証券	米ドル	6.09	922 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	豪ドル	11.57	1,141 円
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	カナダ・ドル	10.34	1,156 円
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	ユーロ	9.31	1,520 円
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	英ポンド	9.85	1,884 円
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	ニュージー ランド・ドル	11.34	1,026 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	10.07	1,129 円
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	豪ドル	9.17	904 円
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	南アフリカ・ ランド	90.97	727 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英国報告型投資証券	オフショア 中国人民元	105.70	2,202 円
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	5.05	765 円
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	香港ドル	37.69	729 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	9.25	1,037 円
クラスA無分配投資証券	米ドル	39.04	5,911 円
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	19.12	1,885 円
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・フラン	11.76	1,975 円
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	229.57	37,475 円
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	16.64	1,866 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	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		(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C 毎日分配型投資証券	米ドル	6.04	915 円
クラスC 無分配投資証券	米ドル	29.63	4,486 円
クラスD 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.66	2,038 円
クラスD 毎月分配型投資証券	米ドル	10.43	1,579 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	シンガポール・ ドル	10.10	1,132 円
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	豪ドル	20.28	2,000 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	12.31	2,067 円
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	246.02	40,160 円
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	シンガポール・ ドル	17.60	1,973 円
クラスD 無分配英国報告型投資証券	米ドル	30.35	4,595 円
クラスE 無分配投資証券	米ドル	35.47	5,371 円
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	10.17	1,660 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	英ポンド	9.24	1,767 円
クラスI 毎月分配型投資証券	米ドル	9.82	1,487 円
クラスI 無分配投資証券	米ドル	17.01	2,575 円
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	12.69	2,072 円
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	スイス・フラン	10.13	1,701 円
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	10.88	2,080 円
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	英ポンド	10.09	1,929 円
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	米ドル	7.33	1,110 円
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	米ドル	7.45	1,128 円
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	10.24	1,672 円
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	米ドル	11.12	1,684 円
クラスX 無分配投資証券	米ドル	46.89	7,100 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	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	千円
期首純資産		2,565,516,420	388,444,841
収益			
現金および現金同等物に係る利息	2 (b)	624,852	94,609
配当金(源泉徴収税控除後)	2 (b)	2,298,743	348,053
有価証券貸付収益	2 (b)	436,496	66,090
その他の払戻し	11	3,846	582
収益合計	2 (b)	3,363,937	509,334
費用			
年次サービス料	6	2,649,714	401,193
ローン・コミットメント・フィー	16	7,619	1,154
保管および預託報酬	2 (h), 7	159,939	24,216
販売報酬	5	2,145,705	324,881
税金	8	561,106	84,957
投資運用報酬	4	15,495,919	2,346,237
費用合計		21,020,002	3,182,639
純損失		(17,656,065)	(2,673,305)
以下に係る実現純評価益/(損):			
投資有価証券	2 (a)	2,995,589	453,562
先渡為替予約	2 (c)	(14,642,376)	(2,217,002)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(1,833)	(278)
当期実現純評価損		(11,648,620)	(1,763,718)
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)	362,555,737	54,894,564
先渡為替予約	2 (c)	8,817,408	1,335,044
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(222)	(34)
当期末実現評価益/(損)の純変動		371,372,923	56,229,574
運用成績による純資産の増加		342,068,238	51,792,552
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		279,914,368	42,381,834
投資証券買戻しによる正味支払額		(440,882,418)	(66,754,007)
資本の変動による純資産の減少		(160,968,050)	(24,372,172)
配当金宣言額	15	(230)	(35)
期末純資産		2,746,616,378	415,865,186

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)(続き)

	注記	U S ドル・ハイ・イールド・ ボンド・ファンド	
		米ドル	千円
期首純資産		1,885,887,744	285,542,263
収益			
現金および現金同等物に係る利息	2 (b)	1,175,536	177,988
債券利息(源泉徴収税控除後)	2 (b)	60,459,564	9,154,183
スワップ利息	2 (c)	713,185	107,983
集団投資スキームによる収益(源泉徴収税控除後)	2 (b)	559,105	84,654
有価証券貸付収益	2 (b)	227,576	34,457
投資運用報酬リベート	4	47,806	7,238
その他の払戻し	11	1,287	195
収益合計	2 (b)	63,184,059	9,566,698
費用			
スワップ利息	2 (c)	5,763	873
年次サービス料	6	1,046,761	158,490
ローン・コミットメント・フィー	16	5,843	885
保管および預託報酬	2 (h), 7	(71,611)	(10,843)
販売報酬	5	89,046	13,482
税金	8	345,655	52,336
投資運用報酬	4	8,284,708	1,254,388
費用合計		9,706,165	1,469,610
純利益		53,477,894	8,097,088
以下に係る実現純評価益/(損):			
投資有価証券	2 (a)	(26,440,377)	(4,003,337)
上場先物取引	2 (c)	38,368	5,809
オプション/スワップション契約	2 (c)	(479,210)	(72,557)
スワップ取引	2 (c)	(2,087,662)	(316,093)
先渡為替予約	2 (c)	(2,370,119)	(358,860)
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	779,259	117,988
当期実現純評価損		(30,559,741)	(4,627,050)
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)	78,529,127	11,890,095
上場先物取引	2 (c)	880	133
オプション/スワップション契約	2 (c)	180,121	27,272
スワップ取引	2 (c)	2,710,086	410,334
先渡為替予約	2 (c)	1,325,714	200,726
その他の取引に係る外国通貨	2 (i)	(77,835)	(11,785)
当期末実現評価益/(損)の純変動		82,668,093	12,516,776
運用成績による純資産増加		105,586,246	15,986,814
資本の変動			
投資証券発行による正味受取額		426,786,411	64,619,730
投資証券買戻しによる正味支払額		(494,466,931)	(74,867,238)
資本の変動による純資産の減少		(67,680,520)	(10,247,508)
配当金宣言額	15	(28,366,845)	(4,295,024)
期末純資産		1,895,426,625	286,986,545

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)

	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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 毎年分配型投資証券	1,041,763	263,269	61,949	1,243,083
クラスA 毎年分配英国報告型投資証券	11,277	28,559	6,422	33,414
クラスA トータル・リターン分配型投資証券	500	-	-	500
クラスA 無分配投資証券	48,077,137	5,081,372	9,187,681	43,970,828
クラスA 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	672	243,368	59,181	184,859
クラスA オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	307,681	191,445	242,472	256,654
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	7,477,850	735,493	1,551,502	6,661,841
クラスA 香港ドル・ヘッジ無分配投資証券	501,421	328,200	567,901	261,720
クラスA ニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	731	-	-	731
クラスA シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	3,081,869	324,575	364,652	3,041,792
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	166,160	60,374	32,496	194,038
クラスA 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	352,092	293,329	386,243	259,178
クラスA I 無分配投資証券	2,552,890	113,606	672,562	1,993,934
クラスC 無分配投資証券	445	-	-	445
クラスD 無分配投資証券	3,695,967	448,724	935,812	3,208,879
クラスD オフショア中国人民元・ヘッジ無分配投資証券	323	-	-	323
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	666,710	74,092	114,520	626,282
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券	925,752	350,621	215,843	1,060,530
クラスD 無分配英国報告型投資証券	6,069,460	515,710	1,461,479	5,123,691
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,690,522	164,011	482,440	2,372,093
クラスE 無分配投資証券	30,635,884	1,744,362	3,813,305	28,566,941
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	17,584,426	817,334	2,212,289	16,189,471
クラスI 毎年分配英国報告型投資証券	82,863	-	217	82,646
クラスI 無分配投資証券	15,700,668	5,091,790	2,650,573	18,141,885
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,175,907	2,650	125,539	2,053,018
クラスI 無分配英国報告型投資証券	769,343	365,337	290,214	844,466
クラスS 無分配英国報告型投資証券	18,745,218	433,691	1,422,332	17,756,577
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	646,989	77,851	82,884	641,956
クラスS ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,687,612	201,334	448,000	2,440,946
クラスS 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	155,386	49,335	226	204,495

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)

	ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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SR毎年分配英国報告型投資証券	80,807	1	36,295	44,513
クラスSR無分配英国報告型投資証券	1,000	67,185	346	67,839
クラスSRユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	409	-	-	409
クラスX無分配投資証券	147,725	24,135	22,203	149,657
クラスZ無分配英国報告型投資証券	1,289,150	550	1,206,170	83,530
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	10,363	1,000	2,309	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。

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)

U S ドル・ハイ・イールド・
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英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	107,135	1,408	5,546	102,997
クラスA毎日分配型投資証券	7,935,526	4,083,019	1,440,206	10,578,339
クラスA毎月分配型投資証券	13,275,536	1,421,837	1,164,583	13,532,790
クラスA豪ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	1,449,464	357,321	611,859	1,194,926
クラスAカナダ・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	658,585	27,074	40,280	645,379
クラスAユーロ・ヘッジ 毎月分配型投資証券	361,381	31,380	63,279	329,482
クラスA英ポンド・ヘッジ 毎月分配型投資証券	486,117	2,953	18,225	470,845
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	307,054	110,276	52,139	365,191
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	1,182,505	25,131	94,426	1,113,210
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	7,680,427	168,442	454,693	7,394,176
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	1,519,401	183,503	155,176	1,547,728
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	101,898	8,974	54,191	56,681
クラスA安定毎月総収益分配型投資証券	129,979,206	7,776,440	38,904,791	98,850,855
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	5,873,525	1,330,938	875,665	6,328,798
クラスA円ヘッジ 安定毎月総収益分配型投資証券	-	726	-	726
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	1,324,582	11,301	47,816	1,288,067
クラスAトータル・リターン分配型投資証券	-	500	-	500
クラスA無分配投資証券	7,729,114	2,198,363	2,858,390	7,069,087
クラスA豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	188,985	19,401	15,529	192,857
クラスAスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	70,484	50	10,516	60,018
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	50,218	813	13,384	37,647
クラスAシンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	78,610	215,059	236,802	56,867

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)

	U S ドル・ハイ・イールド・ 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C 毎日分配型投資証券	555,770	11,083	76,834	490,019
クラスC 無分配投資証券	266,427	8,428	67,189	207,666
クラスD 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	294,551	13,126	16,116	291,561
クラスD 毎月分配型投資証券	9,766,823	1,113,311	3,564,513	7,315,621
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 毎月分配型投資証券	264,548	-	17,469	247,079
クラスD 豪ドル・ヘッジ 無分配投資証券	71,080	-	10,250	60,830
クラスD スイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	253,047	60,450	20,600	292,897
クラスD ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	73,241	137,525	155,229	55,537
クラスD シンガポール・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	14,468	-	-	14,468
クラスD 無分配英国報告型投資証券	5,027,063	1,597,963	1,509,087	5,115,939
クラスE 無分配投資証券	402,421	57,297	49,635	410,083
クラスE ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	14,371	10,914	-	25,285
クラスI 英ポンド・ヘッジ 毎年分配英国報告型投資証券	992,358	107,912	72,927	1,027,343
クラスI 毎月分配型投資証券	4,714,050	14,402,917	2,174,104	16,942,863
クラスI 無分配投資証券	22,034,766	1,033,808	1,682,501	21,386,073
クラスI ユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	251,219	4,494	54,930	200,783
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	449	-	-	449
クラスI 英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	382	-	-	382
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	364	-	-	364
クラスS R 毎月分配英国報告型投資証券	500	-	-	500
クラスS R 無分配英国報告型投資証券	115,927	-	398	115,529
クラスS R ユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	15,051	(1)	4,192	10,858
クラスX 安定毎月総収益分配型投資証券	4,997,769	1,655,101	864,118	5,788,752
クラスX 無分配投資証券	382,909	1,401	35,310	349,000

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】

ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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 (%)
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			
普通株式			
1,665,356	オーストラリア Altium	70,387,266	2.56
5,768,635	SiteMinder	20,292,801	0.74
		90,680,067	3.30
181,177	カナダ Kinaxis	18,924,630	0.69
281,000	ケイマン諸島 Alchip Technologies Credo	36,803,482	1.34
1,413,854	Technology	31,585,498	1.15
		68,388,980	2.49
616,938	中国 Shenzhen Transsion	13,588,736	0.50
537,734	Zhongji Innolight	11,579,981	0.42
		25,168,717	0.92
227,371	フランス SOITEC*	33,634,973	1.22
209,109	ドイツ Nemetschek	20,123,208	0.73
92,555	イスラエル Monday.com	20,434,293	0.74
1,037,100	日本 Appier*	13,003,212	0.47
77,100	Disco*	24,894,426	0.91
533,000	Freee*	12,338,539	0.45
421,300	Harmonic Drive Systems*	11,035,287	0.40
522,700	Kokusai Electric*	15,509,813	0.56
112,000	Lasertec*	29,936,101	1.09
313,000	Money Forward*	13,842,235	0.50
243,100	NEC	16,411,057	0.60
420,000	Nintendo	23,604,185	0.86
425,600	TDK*	22,170,549	0.81
		182,745,404	6.65
328,614	カザフスタン Kaspi.KZ JSC	34,307,302	1.25
66,508	ルクセンブルグ Globant	15,134,561	0.55
162,215	Spotify Technology	41,299,939	1.50
		56,434,500	2.05
112,954	オランダ ASM International	68,834,618	2.51
339,000	BE Semiconductor Industries	61,788,812	2.25
287,798	STMicroelectronics	13,135,100	0.48
300,162	Wolters Kluwer	47,480,370	1.73
		191,238,900	6.97
403,888	ニュージーランド Xero	33,558,585	1.22
542,757	韓国 Kakao	21,724,953	0.79
555,673	SK Hynix	65,181,826	2.37
		86,906,779	3.16
2,129,000	台湾 Accton Technology	34,956,285	1.27
201,000	ASPEED Technology	17,391,444	0.63
1,607,000	E Ink	12,506,427	0.46
167,000	eMemory Technology	14,317,527	0.52
5,123,000	King Yuan Electronics	14,391,948	0.53
457,191	Lotes	14,825,310	0.54
887,000	Phison Electronics	17,622,419	0.64

* 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。

ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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 (%)
4,493,000	Wistron	16,417,259	0.60
319,000	Wiwynn	23,514,127	0.86
1,063,000	Yageo	18,765,050	0.68
		184,707,796	6.73
	英国		
9,703,320	Alphawave IP	20,953,291	0.76
262,638	ARM*	35,994,538	1.31
209,571	Endava*	8,567,263	0.31
5,050,258	Informa	52,133,907	1.90
1,200,724	Sage	19,065,867	0.70
1,619,656	Wise	18,866,663	0.69
		155,581,529	5.67
	米国		
135,275	Altair Engineering*	11,545,721	0.42
542,503	Amkor Technology	16,774,193	0.61
70,674	Appfolio	17,244,456	0.63
236,030	Cloudflare	23,374,051	0.85
321,417	Cognex*	12,650,973	0.46
370,668	Coherent	22,132,586	0.81
454,783	Confluent	15,192,026	0.55
239,747	Datadog	31,397,267	1.14
187,719	Entegris*	25,230,372	0.92
93,297	Expedia	12,807,812	0.46
720,627	HashiCorp	19,320,010	0.70
572,743	Informatica	18,671,422	0.68
348,978	Jabil*	50,242,363	1.83
62,683	KLA	42,747,926	1.56
569,938	Klaviyo*	16,323,024	0.60
284,524	Lattice Semiconductor*	21,470,181	0.78
1,053,228	Legalzoom.com	12,649,268	0.46
115,829	Manhattan Associates	29,466,898	1.07
591,493	Marvell Technology	40,795,272	1.49
28,756	MercadoLibre	46,361,573	1.69
139,548	MongoDB*	61,610,442	2.24
59,608	Monolithic Power Systems	42,095,766	1.53
311,088	Nutanix	19,303,010	0.70
235,902	NVIDIA	187,494,910	6.83
183,987	Palo Alto Networks*	57,976,144	2.11
782,968	Pinterest	28,500,035	1.04
108,210	PTC	19,812,169	0.72
1,265,138	Pure Storage	63,560,533	2.31
267,365	Q2	12,413,757	0.45
554,416	Rambus	32,156,128	1.17
874,062	Samsara	29,665,664	1.08
377,096	Schrodinger*	10,034,525	0.37
702,916	SentinelOne	20,349,418	0.74
99,613	Silicon Laboratories	13,821,304	0.50
988,082	Snap	10,992,412	0.40
50,717	Super Micro Computer	43,704,360	1.59
166,832	Synopsys	96,060,197	3.50
268,135	Take-Two Interactive Software	39,273,733	1.43
158,653	Tesla	32,119,300	1.17
454,729	Western Digital	26,369,735	0.96
507,707	Wolfspeed*	13,479,621	0.49
75,684	Workday*	22,118,649	0.81
493,184	Zillow*	27,958,601	1.02
111,853	Zscaler	26,888,902	0.98
		1,424,156,709	51.85
	普通株式合計	2,626,992,372	95.64
	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	2,626,992,372	95.64

* 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。

ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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 (%)
その他の譲渡可能な有価証券			
普通株式			
	インド		
385	Byju 's **	29,740	0.00
363	Byju 's **	28,040	0.00
		57,780	0.00
	スウェーデン		
10,483	Klarna Bank **	2,833,267	0.10
	米国		
364,947	Astranis Space Technologies **	7,236,899	0.27
94,118	Automattic **	4,062,133	0.15
19,359	ByteDance **	3,119,142	0.11
27,939	Databricks **	2,307,482	0.09
57,237	Databricks **	4,727,204	0.17
143,769	Databricks **	11,873,882	0.43
114,138	Datarobot **	655,152	0.02
62,665	Datarobot **	289,512	0.01
30,250	Farmer 's Business Network **	109,203	0.00
81,731	Rapyd Financial Network (2016) **	5,261,025	0.19
18,800	SambaNova Systems **	1,271,444	0.05
84,195	SambaNova Systems **	5,694,108	0.21
332,896	Snorkel AI **	2,716,431	0.10
66,737	Snorkel AI **	544,574	0.02
1,088,252	SNYK **	11,861,947	0.43
168,509	SNYK **	1,836,748	0.07
153,445	Trax **	4,173,704	0.15
56,120	Unqork **	437,175	0.02
8,240	Unqork **	46,226	0.00
13,040	Unqork **	80,978	0.00
7,440	Unqork **	39,878	0.00
170,320	Unqork **	902,696	0.03
20,400	Unqork **	109,548	0.01
		69,357,091	2.53
普通株式合計		72,248,138	2.63
その他の譲渡可能な有価証券合計		72,248,138	2.63
投資有価証券合計		2,699,240,510	98.28
その他の純資産		47,375,868	1.72
純資産合計(米ドル)		2,746,616,378	100.00

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

** 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。

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)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	1,381,931	USD	2,109,212	BNY Mellon	15/3/2024	(4,856)
USD	403,272	AUD	261,655	BNY Mellon	15/3/2024	(1,634)
未実現純評価損						(6,490)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	7,072,817	USD	6,135,075	BNY Mellon	15/3/2024	(83,272)
USD	548,542	CHF	623,507	BNY Mellon	15/3/2024	(1,423)
未実現純評価損						(84,695)
ヘッジを使用したオフショア中国元建投資証券クラス						

CNY	2,544,519	USD	18,321,921	BNY Mellon	15/3/2024	311
USD	1,744,191	CNY	242,082	BNY Mellon	15/3/2024	(178)
未実現純評価益						133

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・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)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	482,131,809	USD	447,495,080	BNY Mellon	15/3/2024	3,586,784
USD	36,339,256	EUR	39,229,154	BNY Mellon	15/3/2024	(214,113)
未実現純評価益						3,372,671
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	58,921,546	USD	46,827,762	BNY Mellon	15/3/2024	425,097
USD	3,746,327	GBP	4,726,271	BNY Mellon	15/3/2024	(21,598)
未実現純評価益						403,499
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	2,456,235	USD	19,187,697	BNY Mellon	15/3/2024	(4,121)
USD	2,268,148	HKD	290,231	BNY Mellon	15/3/2024	369
未実現純評価損						(3,752)
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	4,506	USD	7,421	BNY Mellon	15/3/2024	26
USD	492	NZD	301	BNY Mellon	15/3/2024	1
未実現純評価益						27
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	46,269,784	USD	62,166,996	BNY Mellon	15/3/2024	35,778
USD	4,863,999	SGD	3,615,602	BNY Mellon	15/3/2024	(7,383)
未実現純評価益						28,395
未実現純評価益合計						3,709,788

業種別内訳 2024年2月29日現在

	純資産比率 (%)
半導体	33.00
ソフトウェア	27.31
インターネット	9.46
コンピュータ	8.76
電子機器	5.13
メディア	3.63
電気通信	2.92
商業サービス	1.62
自動車製造	1.17
アプリケーションソフトウェア	0.88
玩具、ゲーム、ホビー	0.86
各種機械産業	0.86
システムソフトウェア	0.76
各種金融サービス	0.50
流通卸売	0.42
ソフトウェア・サービス	0.27
保険	0.19
耐久消費財・アパレル	0.15
小売り	0.15
特別買収目的会社	0.12
データ処理・外部委託サービス	0.10
テクノロジー・ハードウェアおよび半導体	0.02
その他の純資産	1.72
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品			
ファンド			
493,000	アイルランド iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF~	45,858,860	2.42
ファンド合計		45,858,860	2.42
普通株式			
260,348	フランス Constellium	4,988,268	0.26
12,532	ルクセンブルグ ADLER	3,076	0.00
50,799	英国 Sensata Technologies	1,744,437	0.09
34,076	米国 Aramark	1,036,251	0.06
17,532	Crown	1,332,432	0.07
2,730	Nine Energy Service	5,979	0.00
普通株式合計		2,374,662	0.13
債券		9,110,443	0.48
USD 175,000	オーストラリア Mineral Resources 9.25% 1/10/2028	183,853	0.01
EUR 100,000	オーストリア ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	80,357	0.01
EUR 204,000	ams-OSRAM 10.5% 30/3/2029*	225,688	0.01
		306,045	0.02
EUR 200,000	ベルギー KBC 8% 5/9/2028*	229,354	0.01
USD 1,524,000	バミューダ Borr IHC / Borr Finance 10% 15/11/2028	1,579,603	0.08
USD 1,063,000	Borr IHC / Borr Finance 10.375% 15/11/2030	1,103,187	0.06
USD 283,000	Nabors Industries 7.25% 15/1/2026	278,282	0.01
USD 1,954,000	Nabors Industries 7.5% 15/1/2028	1,803,630	0.10
USD 2,084,000	NCL 5.875% 15/3/2026	2,041,382	0.11
USD 277,000	NCL 7.75% 15/2/2029	284,736	0.01
USD 678,000	NCL 8.125% 15/1/2029	714,497	0.04
USD 863,000	NCL 8.375% 1/2/2028	904,016	0.05
USD 1,328,000	NCL Finance 6.125% 15/3/2028	1,295,949	0.07
USD 1,373,000	Seadrill Finance 8.375% 1/8/2030	1,412,339	0.08
USD 4,530,000	Valaris 8.375% 30/4/2030 Weatherford International 6.5%	4,663,499	0.25
USD 1,031,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028*	1,052,046	0.05
USD 3,496,000	Weatherford International 8.625% 30/4/2030	3,623,940	0.19
		20,757,106	1.10

-関連会社ファンドに対する有価証券。詳細については注記10を参照のこと。

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
	カナダ		
USD 796,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	741,264	0.04
USD 1,931,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	1,698,395	0.09
USD 579,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	543,460	0.03
USD 1,251,000	1375209 BC 9% 30/1/2028	1,231,159	0.07
USD 1,553,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	1,473,423	0.07
USD 738,000	ATS 4.125% 15/12/2028	670,563	0.04
USD 7,827,000	Bausch + Lomb 8.375% 1/10/2028*	8,183,285	0.43
USD 944,000	Baytex Energy 8.5% 30/4/2030	981,687	0.05
USD 3,021,000	Bombardier 6% 15/2/2028	2,928,518	0.15
USD 3,514,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	3,541,019	0.19
USD 856,000	Bombardier 7.45% 1/5/2034	940,231	0.05
USD 2,213,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029*	2,246,635	0.12
USD 449,000	Bombardier 7.875% 15/4/2027	449,847	0.02
USD 2,473,000	Bombardier 8.75% 15/11/2030	2,593,307	0.14
USD 2,100,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 4.875% 15/2/2030	1,859,418	0.10
USD 1,469,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	1,315,889	0.07
USD 1,119,000	Enbridge 8.5% 15/1/2084	1,196,788	0.06
USD 1,798,000	Enerflex 9% 15/10/2027	1,818,731	0.10
USD 1,675,000	ERO Copper 6.5% 15/2/2030*	1,586,342	0.08
USD 3,222,000	First Quantum Minerals 9.375% 1/3/2029	3,346,853	0.18
USD 2,068,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	1,978,220	0.10
USD 239,000	Garda World Security 6% 1/6/2029	208,181	0.01
USD 3,729,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	3,789,105	0.20
USD 503,000	Garda World Security 9.5% 1/11/2027*	503,083	0.03
USD 311,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	281,865	0.02
USD 1,756,000	GFL Environmental 3.75% 1/8/2025	1,704,872	0.09
USD 1,331,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	1,219,124	0.06
USD 1,010,000	GFL Environmental 4.375% 15/8/2029	920,100	0.05
USD 1,280,000	GFL Environmental 4.75% 15/6/2029	1,198,690	0.06
USD 3,637,000	GFL Environmental 6.75% 15/1/2031	3,715,876	0.20
USD 2,487,000	Husky III 13% 15/2/2025*	2,490,238	0.13
USD 3,915,000	Husky Injection Molding Systems / Titan Co-Borrower 9% 15/2/2029	4,006,971	0.21
USD 3,197,000	Jones Deslauriers Insurance Management 8.5% 15/3/2030	3,326,483	0.18
USD 1,509,000	Jones Deslauriers Insurance Management 10.5% 15/12/2030	1,575,868	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。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 1,134,000	Masonite International 3.5% 15/2/2030	993,692	0.05
USD 1,343,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,207,034	0.06
USD 749,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	721,903	0.04
USD 5,080,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	5,031,189	0.27
	Precision Drilling 6.875% 15/1/2029*	397,322	0.02
USD 403,000	Titan Acquisition / Titan Co- Borrower 7.75% 15/4/2026	6,262,575	0.33
USD 6,274,000	TransAlta 7.75% 15/11/2029	615,861	0.03
USD 595,000	Vermilion Energy 6.875% 1/5/2030*	586,720	0.03
USD 609,000	Videotron 3.625% 15/6/2029	435,707	0.02
USD 484,000		82,517,493	4.35
	ケイマン諸島		
USD 153,000	GGAM Finance 7.75% 15/5/2026	155,559	0.01
USD 2,363,000	GGAM Finance 8% 15/2/2027	2,417,614	0.13
USD 655,000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	678,494	0.03
USD 1,975,615	Global Aircraft Leasing 6.5% 15/9/2024	1,876,951	0.10
USD 772,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	803,077	0.04
USD 1,200,000	Melco Resorts Finance 4.875% 6/6/2025*	1,172,250	0.06
USD 3,526,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	3,195,103	0.17
USD 400,000	Melco Resorts Finance 5.75% 21/7/2028*	376,018	0.02
USD 529,000	MGM China 4.75% 1/2/2027	499,537	0.03
USD 200,000	MGM China 5.25% 18/6/2025*	196,259	0.01
USD 200,000	MGM China 5.375% 15/5/2024	199,470	0.01
USD 400,000	MGM China 5.875% 15/5/2026*	393,900	0.02
USD 800,000	Sable International Finance 5.75% 7/9/2027	768,000	0.04
USD 2,874,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	3,078,485	0.17
USD 2,500,000	Seagate HDD Cayman 8.5% 15/7/2031	2,699,235	0.14
USD 3,213,000	Transocean 7.5% 15/1/2026	3,179,531	0.17
USD 1,977,000	Transocean 8% 1/2/2027	1,931,529	0.10
USD 5,693,400	Transocean 8.75% 15/2/2030	5,850,934	0.31
USD 3,181,000	Transocean 11.5% 30/1/2027	3,311,979	0.17
USD 726,000	Transocean Aquila 8% 30/9/2028	736,281	0.04
USD 174,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	178,710	0.01
USD 407,000	Wynn Macau 5.125% 15/12/2029	367,141	0.02
USD 644,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026*	626,290	0.03
USD 4,799,000	Wynn Macau 5.625% 26/8/2028*	4,525,457	0.24
		39,217,804	2.07
	キプロス		
EUR 100,000	Bank of Cyprus 2.5% 24/6/2027	101,669	0.00
	フィンランド		
EUR 100,000	Ahlstrom 3 Oy 3.625% 4/2/2028	101,795	0.01
USD 200,000	Ahlstrom 3 Oy 4.875% 4/2/2028	182,564	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 224,000	SBB Treasury 0.75% 14/12/2028	150,930	0.01
EUR 100,000	SBB Treasury 1.125% 26/11/2029	66,718	0.00
		502,007	0.03
	フランス		
EUR 100,000	Accor 2.625% 30/1/2025	106,667	0.00
EUR 100,000	Air France-KLM 1.875% 16/1/2025	106,011	0.00
EUR 100,000	Altice France 2.125% 15/2/2025*	105,509	0.01
EUR 100,000	Altice France 2.5% 15/1/2025	105,255	0.01
EUR 178,000	Altice France 4% 15/7/2029	151,719	0.01
EUR 100,000	Altice France 4.125% 15/1/2029	86,502	0.00
EUR 120,000	Altice France 4.25% 15/10/2029	102,366	0.00
USD 1,095,000	Altice France 5.125% 15/1/2029	827,031	0.04
USD 1,338,000	Altice France 5.125% 15/7/2029	1,014,256	0.05
USD 4,692,000	Altice France 5.5% 15/10/2029	3,559,421	0.19
EUR 112,000	Altice France 5.875% 1/2/2027	109,693	0.01
USD 3,594,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	3,297,195	0.17
EUR 100,000	Altice France 11.5% 1/2/2027	110,934	0.01
EUR 100,000	Atos 1.75% 7/5/2025*	29,037	0.00
EUR 150,000	AXA 6.375% 16/7/2033	166,693	0.01
EUR 158,000	Banijay Entertainment 7% 1/5/2029	179,943	0.01
USD 519,000	Banijay Entertainment 8.125% 1/5/2029*	537,482	0.03
EUR 200,000	BNP Paribas 7.375% 11/6/2030	228,377	0.01
GBP 300,000	Clariane 4.125% 2/4/2024	197,729	0.01
USD 3,235,000	Constellium 3.75% 15/4/2029	2,882,135	0.15
EUR 1,017,000	Constellium 4.25% 15/2/2026	1,103,868	0.06
USD 1,639,000	Constellium 5.625% 15/6/2028	1,582,369	0.08
USD 1,417,000	Constellium 5.875% 15/2/2026	1,407,088	0.08
USD 2,075,000	Credit Agricole 4.75% 23/3/2029	1,788,937	0.09
EUR 111,000	Crown European 3.375% 15/5/2025	119,803	0.01
EUR 100,000	Crown European 5% 15/5/2028	111,266	0.00
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/9/2027	201,091	0.01
EUR 600,000	Electricite de France 3.375% 15/6/2030	579,189	0.03
EUR 200,000	Electricite de France 4% 4/7/2024	215,901	0.01
USD 577,000	Electricite de France 9.125% 15/3/2033	641,098	0.04
EUR 200,000	Elior 3.75% 15/7/2026*	202,804	0.01
EUR 300,000	Eutelsat 1.5% 13/10/2028*	212,829	0.01
EUR 200,000	Forvia 2.75% 15/2/2027	205,975	0.01
EUR 110,000	Forvia 7.25% 15/6/2026	125,982	0.01
EUR 172,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026*	189,030	0.01
EUR 100,000	Goldstory 6.75% 1/2/2030	109,070	0.01
EUR 100,000	Goldstory 7.922% 1/2/2030	109,304	0.01
EUR 100,000	iliad 1.875% 11/2/2028*	98,873	0.00
EUR 200,000	iliad 5.375% 14/6/2027	220,455	0.01
EUR 300,000	iliad 5.375% 15/2/2029	330,365	0.02
EUR 100,000	iliad 5.625% 15/2/2030*	111,358	0.01
USD 6,307,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	6,231,681	0.33

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 899,000	Iliad 7% 15/10/2028	891,737	0.05
EUR 200,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	169,507	0.01
EUR 115,000	Loxam 6.375% 15/5/2028*	129,561	0.00
EUR 165,000	Loxam 6.375% 31/5/2029	185,987	0.01
EUR 100,000	Novafives 5% 15/6/2025	107,388	0.00
EUR 100,000	Paprec 6.5% 17/11/2027	114,437	0.01
EUR 100,000	Paprec 7.25% 17/11/2029	115,494	0.01
EUR 168,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	178,181	0.01
EUR 900,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	959,347	0.05
EUR 100,000	Societe Generale 7.875% 18/1/2029	111,677	0.01
EUR 150,000	Tereos Finance Groupe I 7.25% 15/4/2028	172,730	0.01
EUR 200,000	Vallourec SACA 8.5% 30/6/2026	218,288	0.01
EUR 2,239	Worldline 0% 30/7/2026	218,496	0.01
		33,375,121	1.76
	ドイツ		
EUR 200,000	Bayer 4.5% 25/3/2082*	203,218	0.01
EUR 100,000	Bayer 6.625% 25/9/2083	107,280	0.01
EUR 200,000	Bayer 7% 25/9/2083	218,287	0.01
EUR 232,000	Cheplapharm Arzneimittel 7.5% 15/5/2030*	266,521	0.01
EUR 100,000	Commerzbank 4.625% 17/1/2031	109,170	0.00
EUR 400,000	Commerzbank 6.125% 9/10/2025	420,192	0.02
EUR 100,000	Commerzbank 6.5% 6/12/2032*	112,838	0.01
EUR 300,000	Commerzbank 6.75% 5/10/2033	342,885	0.02
EUR 200,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024	141,909	0.01
EUR 200,000	Deutsche Bank 6.75% 30/10/2028	199,627	0.01
EUR 100,000	EnBW Energie Baden- Wuerttemberg 5.25% 23/1/2084	109,573	0.01
EUR 100,000	Gruenenthal 6.75% 15/5/2030	115,805	0.01
EUR 177,000	HT Troplast 9.375% 15/7/2028	198,974	0.01
EUR 152,000	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027*	160,986	0.01
EUR 100,000	IHO Verwaltungs 8.75% 15/5/2028	117,942	0.01
EUR 100,000	INEOS Styrolution Ludwigshafen 2.25% 16/1/2027	100,006	0.01
EUR 1,700,000	Novelis Sheet Ingot 3.375% 15/4/2029	1,744,172	0.09
EUR 229,000	PCF 4.75% 15/4/2026*	194,916	0.01
EUR 100,000	Schaeffler 4.5% 14/8/2026	109,507	0.00
EUR 100,000	Schaeffler 4.75% 14/8/2029*	110,019	0.00
EUR 175,839	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	191,161	0.01
EUR 250,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	267,790	0.01
EUR 366,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025	247,586	0.01
EUR 737,100	TK Elevator Holdco 6.625% 15/7/2028	772,191	0.04
USD 5,113,000	TK Elevator Holdco 7.625% 15/7/2028	4,968,381	0.26

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 1,570,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	1,654,281	0.09
EUR 122,000	TUI Cruises 6.5% 15/5/2026	133,392	0.01
EUR 100,000	WEPA Hygieneprodukte 5.625% 15/1/2031	109,442	0.01
EUR 300,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	301,193	0.02
EUR 300,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	307,740	0.02
EUR 100,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	111,234	0.00
		14,148,218	0.75
	ギリシャ		
EUR 175,000	Alpha Bank 5% 12/5/2030	189,576	0.01
	アイルランド		
EUR 328,000	AIB 5.25% 9/10/2024	351,141	0.02
EUR 183,000	Aqueduct European CLO 2-2017 8.342% 15/10/2030	197,968	0.01
EUR 100,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	98,121	0.00
EUR 1,487,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026*	1,458,235	0.08
USD 2,903,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.125% 15/8/2026	2,670,702	0.14
GBP 200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027*	182,925	0.01
USD 2,818,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 30/4/2025	2,788,667	0.15
USD 769,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 15/8/2027	558,548	0.03
USD 200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 15/8/2027	145,266	0.01
EUR 5,880,000	Aurium CLO II 6.066% 22/6/2034	6,271,976	0.33
EUR 5,100,000	Aurium CLO II 7.016% 22/6/2034	5,405,738	0.28
EUR 440,000	Avoca CLO XV 8.072% 15/4/2031	465,496	0.02
EUR 227,000	Bank of Ireland 7.5% 19/5/2025	248,239	0.01
EUR 200,000	Bridgepoint CLO 1 8.192% 15/1/2034	218,655	0.01
EUR 2,700,000	Contego CLO V 5.742% 15/1/2031	2,880,039	0.15
EUR 1,920,000	Contego CLO V 6.592% 15/1/2031	2,041,750	0.11
USD 646,000	James Hardie International Finance 5% 15/1/2028	623,796	0.03
USD 1,239,000	Jazz 4.375% 15/1/2029	1,139,160	0.06
USD 3,008,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	2,840,110	0.15
EUR 2,810,000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 5.751% 15/2/2031	3,006,257	0.16
EUR 6,000,000	Madison Park Euro Funding XI Designated Activity 6.701% 15/2/2031	6,414,955	0.34
EUR 100,000	Margay CLO I 10.342% 15/7/2036	109,769	0.01
USD 1,006,000	Motion Bondco 6.625% 15/11/2027*	961,842	0.05
EUR 298,000	OCP Euro CLO 2017-2 8.942% 15/1/2032	323,351	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 200,000	OCP Euro CLO 2017-2 10.342% 15/1/2032	216,628	0.01
EUR 100,000	Palmer Square European CLO 2023-1 10.142% 15/7/2036	110,249	0.01
USD 2,094,000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV 5% 15/7/2028	1,936,682	0.10
		43,666,265	2.30
	イタリア		
EUR 411,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	442,936	0.02
EUR 125,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6.75% 2/3/2026	138,238	0.01
EUR 150,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	155,619	0.01
EUR 150,000	Banco BPM 4.875% 17/1/2030	164,816	0.01
EUR 250,000	Banco BPM 6% 14/6/2028	283,646	0.01
EUR 125,000	Cedacri Mergeco 8.526% 15/5/2028	136,124	0.01
EUR 100,000	Cedacri Mergeco 9.401% 15/5/2028	109,129	0.00
EUR 238,000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11.125% 15/5/2028*	278,610	0.01
USD 3,268,000	F-Brasile / F-Brasile US 7.375% 15/8/2026*	3,254,330	0.17
EUR 100,000	Fiber Bidco 7.97% 15/1/2030	109,793	0.01
EUR 203,000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027*	240,690	0.01
EUR 249,000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5.625% 1/8/2027*	261,332	0.02
EUR 140,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	145,346	0.01
EUR 347,000	Infrastrutture Wireless Italiane 1.625% 21/10/2028	343,359	0.02
EUR 230,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	243,315	0.01
USD 1,585,000	Intesa Sanpaolo 4.198% 1/6/2032*	1,304,097	0.07
USD 1,160,000	Intesa Sanpaolo 4.95% 1/6/2042	840,970	0.04
GBP 150,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030*	174,158	0.01
USD 400,000	Intesa Sanpaolo 5.71% 15/1/2026	396,193	0.02
EUR 123,000	Lottomatica 7.937% 15/12/2030	135,586	0.01
EUR 100,000	Lottomatica 8.067% 1/6/2028	110,204	0.00
EUR 113,000	Lottomatica 9.75% 30/9/2027	132,081	0.01
EUR 400,000	Nexi 0% 24/2/2028	377,862	0.02
EUR 154,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026*	151,216	0.01
EUR 146,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029*	137,443	0.01
EUR 100,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	106,055	0.01
USD 985,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	982,240	0.05
EUR 200,000	Telecom Italia 6.875% 15/2/2028	230,737	0.01
EUR 4,252,000	Telecom Italia 7.875% 31/7/2028	5,092,185	0.27
EUR 200,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032	205,865	0.01
		16,684,175	0.88
	ジャマイカ		
USD 2,128,589	Digicel Intermediate / Digicel International Finance / Difl US 12% 25/5/2027	2,080,675	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
	日本		
USD 1,156,000	Rakuten 11.25% 15/2/2027	1,234,923	0.06
EUR 224,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	240,372	0.01
EUR 100,000	SoftBank 3.375% 6/7/2029	100,781	0.00
EUR 300,000	SoftBank 3.875% 6/7/2032	293,564	0.02
EUR 100,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025	108,790	0.01
EUR 100,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025*	109,556	0.01
		2,087,986	0.11
	ジャージー		
USD 3,365,000	Ardonagh Finance 8.875% 15/2/2032	3,309,208	0.18
EUR 245,000	Ardonagh Finco 6.875% 15/2/2031	263,897	0.01
USD 3,762,000	Ardonagh Finco 7.75% 15/2/2031	3,736,533	0.20
GBP 200,000	CPUK Finance 4.875% 28/8/2025	249,881	0.01
GBP 205,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	258,129	0.01
		7,817,648	0.41
	リベリア		
USD 554,000	Royal Caribbean Cruises 4.25% 1/7/2026	533,304	0.03
USD 1,042,000	Royal Caribbean Cruises 5.375% 15/7/2027	1,021,086	0.05
USD 1,080,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	1,059,523	0.06
USD 1,826,000	Royal Caribbean Cruises 6.25% 15/3/2032	1,829,415	0.10
USD 1,918,000	Royal Caribbean Cruises 7.25% 15/1/2030	1,992,267	0.11
USD 1,380,000	Royal Caribbean Cruises 8.25% 15/1/2029	1,464,904	0.08
USD 1,369,000	Royal Caribbean Cruises 9.25% 15/1/2029	1,473,250	0.08
USD 125,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	135,263	0.01
		9,509,012	0.52
	ルクセンブルグ		
EUR 100,000	ADLER 21% 31/7/2025	108,131	0.01
EUR 100,000	Adler Financing 12.5% 30/6/2025*	122,097	0.01
USD 1,721,000	Albion Financing 1 / Aggreko 6.125% 15/10/2026*	1,696,654	0.09
EUR 150,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	147,491	0.01
USD 4,631,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	4,126,451	0.22
USD 2,594,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	2,301,835	0.12
GBP 214,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028	239,375	0.01
EUR 573,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029*	548,326	0.03
USD 379,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	336,027	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 6,181,000	Altice Financing 5.75% 15/8/2029	5,337,500	0.28
USD 1,934,000	Altice Financing 9.625% 15/7/2027	1,938,444	0.10
EUR 2,880,000	Aramark International Finance 3.125% 1/4/2025*	3,083,691	0.16
EUR 100,000	Aroundtown 0% 16/7/2026*	93,460	0.00
EUR 100,000	Aroundtown 3.375% 23/9/2024	54,328	0.00
GBP 281,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2024	186,061	0.01
USD 1,816,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	1,736,227	0.09
GBP 190,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028	233,554	0.01
EUR 100,000	Cirsa Finance International 6.5% 15/3/2029	109,849	0.00
EUR 100,000	Cirsa Finance International 8.412% 31/7/2028*	110,842	0.01
EUR 100,000	Cirsa Finance International 8.412% 31/7/2028*	110,526	0.01
GBP 200,000	CK Hutchison Telecom Finance 2.625% 17/10/2034	179,649	0.01
EUR 180,675	Codere Finance 2 Luxembourg 11% 30/9/2026	108,138	0.00
USD 5,631,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	5,527,457	0.29
EUR 166,000	Cullinan Holdco Scsp 4.625% 15/10/2026*	162,043	0.01
EUR 100,000	Dana Financing Luxembourg 8.5% 15/7/2031	119,583	0.01
EUR 159,000	Ephios Subco 3 7.875% 31/1/2031	184,467	0.01
EUR 300,000	European TopSoho 4% 21/9/2021***	148,093	0.01
EUR 187,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025*	160,594	0.01
USD 2,902,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	2,538,133	0.13
EUR 158,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029*	122,278	0.01
USD 2,192,000	ION Trading Technologies 5.75% 15/5/2028	1,964,093	0.10
EUR 186,000	Kleopatra Finco 4.25% 1/3/2026*	178,469	0.01
EUR 100,000	Monitchem HoldCo 3 8.75% 1/5/2028	113,903	0.00
EUR 137,000	Motion Finco 7.375% 15/6/2030	154,955	0.01
EUR 302,000	Rossini 6.75% 30/10/2025	328,467	0.02
USD 4,864,000	SK Invictus Intermediate II 5% 30/10/2029*	4,153,637	0.22
USD 225,000	Stena International 7.25% 15/1/2031	223,671	0.01
USD 450,000	Stena International 7.625% 15/2/2031	451,256	0.03
EUR 300,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026	322,682	0.02
USD 2,706,000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	2,509,005	0.13
USD 463,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	444,936	0.02
USD 507,000	Telecom Italia Capital 7.2% 18/7/2036	504,103	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。

*** 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 1,936,000	Telecom Italia Capital 7.721% 4/6/2038	1,977,384	0.11
USD 400,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028*	377,125	0.02
EUR 100,000	Vivion Investments 3% 8/8/2024*	103,872	0.00
		45,678,862	2.41
	マルタ		
USD 1,489,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6.375% 1/2/2030	1,092,718	0.06
USD 668,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 7.875% 1/5/2027*	565,814	0.03
		1,658,532	0.09
	マーシャル諸島		
USD 183,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	187,619	0.01
	モーリシャス		
USD 5,103,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	4,884,617	0.26
	オランダ		
EUR 100,000	Abertis Infraestructuras Finance 2.625% 26/1/2027*	100,041	0.00
EUR 200,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/11/2025	208,469	0.01
EUR 200,000	ABN AMRO Bank 6.875% 22/9/2031	217,219	0.01
USD 1,462,000	Axalta Coating Systems Dutch B 7.25% 15/2/2031	1,518,623	0.08
EUR 151,000	Boels Topholding 6.25% 15/2/2029	170,877	0.01
EUR 100,000	Citycon Treasury 2.375% 15/1/2027	98,956	0.01
USD 3,698,000	Clear Channel International 6.625% 1/8/2025	3,700,418	0.19
EUR 200,000	Cooperatieve Rabobank 4.375% 29/6/2027*	203,424	0.01
EUR 542,000	Darling Global Finance 3.625% 15/5/2026	584,467	0.03
EUR 100,000	Davide Campari-Milano 2.375% 17/1/2029	112,104	0.01
USD 2,769,000	Elastic 4.125% 15/7/2029	2,493,322	0.13
EUR 166,000	Global Switch Finance 1.375% 7/10/2030	164,439	0.01
USD 200,000	ING Groep 5.75% 16/11/2026*	188,401	0.01
USD 200,000	ING Groep 8% 16/5/2030	202,000	0.01
EUR 400,000	Naturgy Finance 2.374% 23/11/2026	404,027	0.02
EUR 126,000	Nobian Finance 3.625% 15/7/2026*	131,769	0.01
EUR 680,000	OI European 6.25% 15/5/2028	769,231	0.04
EUR 130,000	OI European 6.25% 15/5/2028*	146,923	0.01
EUR 130,000	Q-Park I 5.125% 1/3/2029	142,100	0.01
EUR 242,000	Repsol International Finance 4.247% 11/9/2028*	254,742	0.01
USD 858,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	779,953	0.04
USD 459,000	Sensata Technologies 5.875% 1/9/2030	448,336	0.02
EUR 100,000	Summer BidCo 10% 15/2/2029	111,378	0.01
USD 1,709,000	Sunrise FinCo I 4.875% 15/7/2031	1,512,123	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。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 500,000	Telefonica Europe 6.135% 3/2/2030	550,991	0.03
EUR 100,000	Telefonica Europe 6.75% 7/6/2031	115,475	0.01
EUR 100,000	Telefonica Europe 7.125% 23/8/2028	116,456	0.01
EUR 176,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	184,339	0.01
EUR 295,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029	351,080	0.02
EUR 100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.875% 15/9/2031*	124,516	0.00
USD 2,838,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	2,631,294	0.14
USD 1,089,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 4.75% 9/5/2027	1,038,715	0.05
USD 200,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 6.75% 1/3/2028	202,187	0.01
USD 432,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7.125% 31/1/2025	435,329	0.02
USD 1,875,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 7.875% 15/9/2029	1,999,753	0.11
USD 1,418,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8.125% 15/9/2031	1,533,999	0.08
EUR 138,000	Titan II 5.125% 15/7/2029	131,834	0.01
EUR 102,000	Trivium Packaging Finance 7.651% 15/8/2026	110,959	0.01
USD 400,000	Trivium Packaging Finance 8.5% 15/8/2027*	389,918	0.02
EUR 100,000	United 3.125% 15/2/2026	105,539	0.00
EUR 100,000	United 4% 15/11/2027	103,713	0.00
EUR 100,000	United 8.134% 15/2/2031*	108,764	0.01
EUR 200,000	Volkswagen International Finance 3.875% 17/6/2029	196,962	0.01
EUR 170,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032*	165,072	0.01
EUR 100,000	VZ Vendor Financing II 2.875% 15/1/2029	94,470	0.00
EUR 156,000	Wp/ap Telecom III 5.5% 15/1/2030	157,286	0.01
EUR 100,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027	101,283	0.00
EUR 100,000	ZF Europe Finance 4.75% 31/1/2029	108,243	0.01
USD 1,007,000	Ziggo 4.875% 15/1/2030	898,208	0.05
USD 732,000	Ziggo Bond 5.125% 28/2/2030*	626,228	0.03
USD 680,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	665,076	0.03
		27,911,031	1.46
	ノルウェー		
EUR 100,000	Var Energi 7.862% 15/11/2083	114,324	0.01
	パナマ		
USD 2,012,000	Carnival 4% 1/8/2028	1,856,070	0.10
USD 3,550,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	3,511,019	0.19
USD 5,520,000	Carnival 6% 1/5/2029*	5,391,906	0.28

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 964,000	Carnival 7% 15/8/2029	1,001,355	0.05
USD 1,268,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	1,284,243	0.07
EUR 329,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	364,740	0.02
		13,409,333	0.71
	ポーランド		
USD 983,000	Canpack / Canpack US 3.125% 1/11/2025	939,810	0.05
	ポルトガル		
EUR 3,100,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017 ^{***}	975,350	0.05
EUR 4,400,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018 ^{***}	1,384,368	0.08
EUR 100,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	104,180	0.00
EUR 200,000	EDP - Energias de Portugal 1.875% 2/8/2081	203,261	0.01
EUR 100,000	EDP - Energias de Portugal 5.943% 23/4/2083 [*]	112,453	0.01
		2,779,612	0.15
	ルーマニア		
EUR 100,000	RCS & RDS 2.5% 5/2/2025	106,686	0.01
EUR 100,000	RCS & RDS 3.25% 5/2/2028	100,206	0.00
		206,892	0.01
	スペイン		
EUR 200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024	217,461	0.01
EUR 200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 8.375% 21/6/2028	232,750	0.01
EUR 300,000	Banco de Credito Social Cooperativo 7.5% 14/9/2029	356,773	0.02
EUR 400,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031	413,403	0.02
EUR 100,000	Banco de Sabadell 6% 16/8/2033	111,534	0.01
USD 1,200,000	Banco Santander 6.921% 8/8/2033	1,249,916	0.07
EUR 200,000	Bankinter 7.375% 15/8/2028	220,572	0.01
EUR 200,000	CaixaBank 5.875% 9/10/2027 [*]	211,572	0.01
EUR 100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	98,220	0.01
EUR 200,000	Cellnex Finance 1.5% 8/6/2028	196,739	0.01
EUR 100,000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	92,109	0.00
EUR 300,000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	275,562	0.01
EUR 200,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	180,620	0.01
EUR 200,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030	189,384	0.01
EUR 300,000	Cellnex Telecom 2.125% 11/8/2030	331,013	0.02
EUR 100,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029 [*]	105,721	0.01
EUR 124,000	Kaixo Bondco Telecom 5.125% 30/9/2029 [*]	133,186	0.01
EUR 338,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	361,663	0.02
		4,978,198	0.27

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 100,000	スウェーデン Fastighets Balder 1.125% 29/1/2027*	96,133	0.00
EUR 100,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	98,929	0.01
EUR 100,000	Heimstaden Bostad 1.125% 21/1/2026	98,181	0.00
EUR 850,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/2/2027	501,901	0.03
EUR 169,000	Intrum 3.5% 15/7/2026	125,895	0.01
EUR 100,000	Verisure 9.25% 15/10/2027	116,348	0.00
		1,037,387	0.05
	スイス		
USD 1,820,000	UBS 4.375% 10/2/2031*	1,458,458	0.08
USD 200,000	UBS 7% 19/2/2025	200,040	0.01
USD 2,765,000	UBS 7.75% 12/4/2031	2,773,840	0.15
USD 2,576,000	UBS 9.25% 13/11/2028*	2,755,545	0.14
USD 2,713,000	UBS 9.25% 13/11/2033*	3,001,991	0.16
		10,189,874	0.54
	英国		
EUR 100,000	Agps Bondco 5% 14/1/2029	43,431	0.00
EUR 400,000	Agps Bondco 5.5% 13/11/2026	177,308	0.01
EUR 311,000	Allwyn Entertainment Financing UK 7.25% 30/4/2030	357,657	0.02
USD 1,000,000	Allwyn Entertainment Financing UK 7.875% 30/4/2029	1,027,725	0.05
USD 627,254	Ardonagh Midco 2 11.5% 15/1/2027*	645,287	0.04
USD 4,605,000	Barclays 4.375% 15/3/2028*	3,628,604	0.19
USD 252,000	Barclays 8% 15/6/2024	251,774	0.01
USD 1,345,000	Barclays 8% 15/3/2029	1,326,827	0.07
USD 3,515,000	Barclays 9.625% 15/12/2029	3,647,762	0.19
GBP 300,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	354,764	0.02
GBP 400,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	480,615	0.02
GBP 350,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026*	428,420	0.02
GBP 100,000	Boparan Finance 7.625% 30/11/2025	120,600	0.01
USD 200,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	187,476	0.01
GBP 150,000	British Telecommunications 8.375% 20/12/2083*	200,366	0.01
GBP 200,000	BUPA Finance 4% 24/9/2031	176,541	0.01
EUR 100,000	Carnival 1% 28/10/2029	84,961	0.00
EUR 107,710	Codere New Topco 7.5% 30/11/2027	1,214	0.00
GBP 149,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027*	159,064	0.01
USD 1,882,000	eG Global Finance 12% 30/11/2028	1,980,899	0.10
USD 252,000	EnQuest 11.625% 1/11/2027*	247,398	0.01
GBP 100,000	Greene King Finance 7.14% 15/12/2034	105,193	0.01
GBP 100,000	Greene King Finance 7.387% 15/3/2036	101,837	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 773,000	Harbour Energy 5.5% 15/10/2026*	751,474	0.04
GBP 186,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	222,278	0.01
GBP 120,000	Heathrow Finance 4.75% 1/3/2024	152,041	0.01
USD 9,209,000	Howden UK Refinance PLC / Howden UK Refinance 2 / Howden US Refinance 7.25% 15/2/2031	9,239,252	0.49
USD 4,894,000	Howden UK Refinance PLC / Howden UK Refinance 2 / Howden US Refinance 8.125% 15/2/2032	4,934,239	0.26
USD 965,000	HSBC 4.6% 17/12/2030*	802,022	0.04
EUR 200,000	HSBC 4.75% 4/7/2029*	199,856	0.01
EUR 173,000	INEOS Finance 6.375% 15/4/2029	188,322	0.01
EUR 100,000	INEOS Quattro Finance 2 8.5% 15/3/2029*	113,858	0.00
USD 200,000	International Game Technology 5.25% 15/1/2029	193,349	0.01
GBP 120,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025	148,157	0.01
GBP 165,000	Kier 9% 15/2/2029	212,032	0.01
USD 1,535,000	Lloyds Banking 8% 27/9/2029	1,514,268	0.08
USD 912,000	Macquarie Airfinance 8.125% 30/3/2029	945,061	0.05
GBP 110,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	127,062	0.01
USD 1,983,000	Merlin Entertainments 5.75% 15/6/2026	1,957,651	0.10
GBP 250,000	Mobico 4.25% 26/11/2025*	290,042	0.02
GBP 200,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/6/2027*	234,952	0.01
USD 600,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	597,722	0.03
USD 434,000	Odeon Finco 12.75% 1/11/2027	443,754	0.02
GBP 100,000	Pinewood Finance 3.625% 15/11/2027	117,958	0.01
EUR 100,000	Pinnacle Bidco 8.25% 11/10/2028*	113,786	0.01
GBP 100,000	Pinnacle Bidco 10% 11/10/2028*	133,539	0.01
GBP 190,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	229,956	0.01
GBP 200,000	Santander UK 6.75% 24/6/2024	253,271	0.01
EUR 192,000	Stonegate Pub Financing 2019 9.651% 31/7/2025	204,411	0.01
EUR 107,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025*	114,618	0.01
EUR 100,000	Thames Water Utilities Finance 4% 18/4/2027	103,231	0.01
GBP 142,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	177,636	0.01
GBP 117,000	Virgin Media Secured Finance 4.125% 15/8/2030	123,215	0.01
USD 669,000	Virgin Media Secured Finance 4.5% 15/8/2030	585,375	0.03
GBP 200,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029*	233,024	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
GBP 200,000	Vmed 02 UK Financing I 4% 31/1/2029	220,702	0.01
GBP 469,000	Vmed 02 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	492,405	0.03
USD 1,271,000	Vmed 02 UK Financing I 4.75% 15/7/2031	1,104,600	0.06
EUR 300,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	311,021	0.02
EUR 100,000	Vodafone 3% 27/8/2080*	96,661	0.00
EUR 100,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078*	106,103	0.01
GBP 189,000	Vodafone 4.875% 3/10/2078*	234,986	0.01
EUR 100,000	Vodafone 6.5% 30/8/2084	115,427	0.01
		44,075,040	2.32
	米国		
USD 498,000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	471,013	0.02
USD 778,000	Acadia Healthcare 5.5% 1/7/2028	752,836	0.04
USD 4,238,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	3,815,622	0.20
USD 487,000	Acushnet 7.375% 15/10/2028	502,187	0.03
USD 846,000	ADT Security 4.875% 15/7/2032	764,877	0.04
USD 1,538,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	1,487,507	0.08
USD 2,089,000	Advanced Drainage Systems 6.375% 15/6/2030	2,098,213	0.11
USD 3,260,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	3,272,502	0.17
USD 1,356,000	Ahead DB 6.625% 1/5/2028	1,210,306	0.06
USD 3,436,000	AHP Health Partners 5.75% 15/7/2029	3,105,207	0.16
USD 867,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.25% 15/3/2026	823,938	0.04
USD 2,633,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	2,346,525	0.12
USD 1,924,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	1,856,252	0.10
USD 751,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	703,255	0.04
USD 560,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	552,203	0.03
USD 976,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028*	981,925	0.05
USD 1,000,000	Alexander Funding Trust II 7.467% 31/7/2028	1,048,565	0.05
USD 7,045,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 4.25% 15/10/2027	6,525,305	0.34
USD 5,970,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 5.875% 1/11/2029	5,455,841	0.29
USD 11,818,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 6.75% 15/10/2027	11,464,237	0.61
USD 2,510,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 6.75% 15/4/2028	2,493,118	0.13
USD 5,865,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 7% 15/1/2031	5,839,810	0.31

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 4,584,000	Allied Universal Holdco 7.875% 15/2/2031	4,549,391	0.24
USD 5,434,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6% 1/6/2029*	4,494,388	0.24
USD 2,588,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	2,584,292	0.14
USD 4,048,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9.75% 15/7/2027	4,034,206	0.21
USD 1,598,000	Amer Sports 6.75% 16/2/2031	1,593,006	0.08
USD 2,595,000	American Airlines 8.5% 15/5/2029	2,723,385	0.14
USD 2,939,412	American Airlines/AAAdvantage Loyalty IP 5.75% 20/4/2029	2,874,658	0.15
USD 857,000	American Builders & Contractors Supply 3.875% 15/11/2029	765,451	0.04
USD 1,760,000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9.375% 1/6/2028	1,784,170	0.09
USD 740,000	AMN Healthcare 4% 15/4/2029	649,788	0.03
USD 2,632,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	2,430,478	0.13
USD 760,000	AmWINS 6.375% 15/2/2029	762,844	0.04
USD 1,224,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	1,050,459	0.06
USD 1,789,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.375% 15/6/2029	1,707,283	0.09
USD 734,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.75% 1/3/2027	719,127	0.04
USD 1,575,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 6.625% 1/2/2032	1,570,889	0.08
USD 573,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	589,292	0.03
USD 2,120,000	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	1,909,099	0.10
USD 501,523	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	451,631	0.02
USD 275,000	Apache 5.35% 1/7/2049*	219,972	0.01
USD 1,237,000	APi DE 4.125% 15/7/2029	1,118,969	0.06
USD 997,000	APi DE 4.75% 15/10/2029	927,115	0.05
USD 1,873,000	APX 5.75% 15/7/2029	1,782,754	0.09
USD 985,000	APX 6.75% 15/2/2027*	985,905	0.05
USD 2,784,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	2,673,575	0.14
USD 5,927,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	5,784,908	0.31
USD 2,476,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	2,465,647	0.13
USD 2,594,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	2,382,878	0.13
EUR 568,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029*	488,844	0.03
USD 716,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	620,915	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 6,400,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	5,174,330	0.27
USD 1,945,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	1,910,732	0.10
USD 680,000	Ares Capital 5.875% 1/3/2029	665,490	0.04
USD 510,000	Aretec 10% 15/8/2030	555,377	0.03
USD 1,144,000	Arko 5.125% 15/11/2029	982,067	0.05
USD 1,056,000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	1,100,654	0.06
USD 4,549,000	Arsenal AIC Parent 11.5% 1/10/2031	5,009,776	0.26
USD 31,000	Asbury Automotive 4.75% 1/3/2030	28,282	0.00
USD 1,034,000	Asbury Automotive 5% 15/2/2032	918,301	0.05
USD 1,288,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	1,196,654	0.06
USD 3,080,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	3,909,198	0.21
USD 843,000	Ashland 3.375% 1/9/2031	705,994	0.04
USD 839,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	762,678	0.04
USD 1,135,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,021,353	0.05
USD 2,060,000	AssuredPartners 7.5% 15/2/2032	2,035,537	0.11
USD 13,864,000	AthenaHealth 6.5% 15/2/2030	12,382,824	0.65
USD 2,749,000	ATI 5.125% 1/10/2031	2,515,108	0.13
USD 1,072,000	ATI 5.875% 1/12/2027	1,049,266	0.06
USD 2,563,000	ATI 7.25% 15/8/2030	2,628,109	0.14
EUR 300,000	Avantor Funding 2.625% 1/11/2025	318,223	0.02
EUR 165,000	Avantor Funding 3.875% 15/7/2028	175,102	0.01
USD 528,000	Avantor Funding 3.875% 1/11/2029	473,709	0.02
USD 2,514,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	2,370,730	0.13
USD 466,000	Avient 7.125% 1/8/2030	476,038	0.02
USD 1,261,000	Avis Budget Car Rental / Avis Budget Finance 8% 15/2/2031	1,221,446	0.06
USD 2,003,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	1,777,311	0.09
USD 937,000	Axalta Coating Systems / Axalta Coating Systems Dutch B 4.75% 15/6/2027	903,611	0.05
USD 641,000	B&G Foods 8% 15/9/2028	667,663	0.04
USD 44,000	Ball 3.125% 15/9/2031	37,070	0.00
USD 919,000	Ball 6% 15/6/2029	923,000	0.05
EUR 200,000	Banff Merger Sub 8.375% 1/9/2026	217,663	0.01
USD 2,964,000	BCPE Empire 7.625% 1/5/2027	2,816,054	0.15
USD 938,000	Beacon Roofing Supply 4.125% 15/5/2029	845,033	0.04
USD 1,749,000	Beacon Roofing Supply 6.5% 1/8/2030	1,761,958	0.09
USD 6,689,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	6,731,695	0.36

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 504,000	Blackstone Private Credit Fund 3.25% 15/3/2027	461,281	0.02
USD 905,000	Blackstone Private Credit Fund 6.25% 25/1/2031	898,128	0.05
USD 3,590,000	Block 2.75% 1/6/2026	3,344,236	0.18
USD 6,187,000	Block 3.5% 1/6/2031	5,283,904	0.28
USD 105,000	Blue Owl Capital 3.4% 15/7/2026	97,830	0.01
USD 1,199,000	Blue Owl Capital 3.75% 22/7/2025	1,155,859	0.06
USD 799,000	Blue Owl Capital II 8.45% 15/11/2026	819,760	0.04
USD 49,000	Blue Owl Credit Income 3.125% 23/9/2026	44,648	0.00
USD 1,182,000	Blue Owl Credit Income 5.5% 21/3/2025	1,170,652	0.06
USD 1,585,000	Blue Owl Credit Income 6.65% 15/3/2031	1,538,318	0.08
USD 2,191,000	Blue Owl Credit Income 7.75% 16/9/2027	2,244,582	0.12
EUR 2,843,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	3,066,869	0.16
USD 1,220,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	1,222,208	0.07
USD 3,873,000	Boxer Parent 9.125% 1/3/2026	3,872,516	0.20
USD 934,000	Boyd Gaming 4.75% 1/12/2027	899,439	0.05
USD 1,536,000	Boyd Gaming 4.75% 15/6/2031	1,397,572	0.07
USD 2,095,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	1,921,631	0.10
USD 8,716,000	Brand Industrial Services 10.375% 1/8/2030	9,264,556	0.49
USD 746,000	Bread Financial 9.75% 15/3/2029	763,609	0.04
USD 1,335,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGS1 Sellco LL 4.5% 1/4/2027	1,175,283	0.06
USD 388,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	380,984	0.02
USD 663,000	Buckeye Partners 5.6% 15/10/2044	515,060	0.03
USD 602,000	Buckeye Partners 5.85% 15/11/2043	495,599	0.03
USD 1,066,000	Builders FirstSource 6.375% 1/3/2034	1,063,497	0.06
USD 569,000	Cable One 0% 15/3/2026	488,337	0.03
USD 2,259,000	Cable One 1.125% 15/3/2028	1,683,623	0.09
USD 2,266,000	Cable One 4% 15/11/2030*	1,707,204	0.09
USD 1,000,000	Cablevision Lightpath 3.875% 15/9/2027	906,641	0.05
USD 1,109,000	Cablevision Lightpath 5.625% 15/9/2028	922,067	0.05
USD 1,344,000	Caesars Entertainment 4.625% 15/10/2029	1,227,952	0.06
USD 3,628,000	Caesars Entertainment 6.5% 15/2/2032	3,655,362	0.19
USD 8,318,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	8,521,134	0.45
USD 4,709,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027	4,832,785	0.25
USD 3,910,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030*	4,123,165	0.22
USD 236,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	217,077	0.01
USD 750,000	Calpine 5% 1/2/2031	669,770	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 2,198,000	Calpine 5.125% 15/3/2028*	2,090,623	0.11
USD 1,565,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028*	1,601,547	0.08
USD 1,841,000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	1,904,533	0.10
USD 13,624,000	Carnival Bermuda 10.375% 1/5/2028	14,865,261	0.78
USD 870,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	862,792	0.05
USD 1,468,000	Carpenter Technology 7.625% 15/3/2030	1,514,879	0.08
USD 503,000	Carvana 12% 1/12/2028	485,204	0.03
USD 618,100	Carvana 14% 1/6/2031	606,557	0.03
EUR 129,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	134,945	0.01
USD 1,826,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	1,765,989	0.09
USD 927,000	Catalent Pharma Solutions 3.5% 1/4/2030	895,134	0.05
USD 2,109,000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	2,077,723	0.11
USD 797,000	CCM Merger 6.375% 1/5/2026	789,608	0.04
USD 3,046,000	CCO / CCO Capital 4.25% 1/2/2031	2,454,753	0.13
USD 1,098,000	CCO / CCO Capital 4.25% 15/1/2034*	819,175	0.04
USD 568,000	CCO / CCO Capital 4.5% 15/8/2030	472,354	0.02
USD 1,648,000	CCO / CCO Capital 4.75% 1/3/2030	1,403,379	0.07
USD 1,370,000	CCO / CCO Capital 4.75% 1/2/2032	1,109,899	0.06
USD 1,131,000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	1,044,233	0.06
USD 1,214,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	1,148,364	0.06
USD 1,158,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	1,046,521	0.06
USD 4,466,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	4,195,314	0.22
USD 9,383,000	CCO / CCO Capital 7.375% 1/3/2031*	9,085,985	0.48
USD 538,000	Cedar Fair 5.25% 15/7/2029*	508,505	0.03
USD 990,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	986,288	0.05
USD 476,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 6.5% 1/10/2028	477,204	0.03
USD 434,000	Central Garden & Pet 4.125% 15/10/2030	386,157	0.02
USD 1,592,000	Central Garden & Pet 4.125% 30/4/2031	1,391,614	0.07
USD 2,975,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	3,002,739	0.16
USD 2,424,000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	2,486,756	0.13

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 1,856,000	Champions Financing 8.75% 15/2/2029	1,892,427	0.10
USD 730,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	683,651	0.04
USD 4,290,000	Chart Industries 7.5% 1/1/2030	4,428,880	0.23
USD 835,000	Chart Industries 9.5% 1/1/2031	895,954	0.05
USD 516,000	Chemours 4.625% 15/11/2029	431,061	0.02
USD 1,291,000	Chemours 5.75% 15/11/2028	1,147,458	0.06
USD 3,727,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	3,745,099	0.20
USD 5,664,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	5,242,321	0.28
USD 6,273,000	Chobani / Chobani Finance 7.625% 1/7/2029	6,316,227	0.33
USD 3,244,000	CHS/Community Health Systems 4.75% 15/2/2031	2,460,011	0.13
USD 3,333,000	CHS/Community Health Systems 5.25% 15/5/2030	2,652,360	0.14
USD 2,014,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	1,843,494	0.10
USD 3,191,000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	2,731,119	0.14
USD 1,889,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	1,785,204	0.09
USD 765,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	750,837	0.04
USD 6,127,000	Churchill Downs 5.75% 1/4/2030	5,891,935	0.31
USD 2,395,000	Churchill Downs 6.75% 1/5/2031	2,399,863	0.13
USD 758,000	Citigroup 6.174% 25/5/2034	764,286	0.04
USD 547,000	Citigroup 7.625% 15/11/2028	564,647	0.03
USD 4,140,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	4,335,830	0.23
USD 2,289,000	Civitas Resources 8.625% 1/11/2030	2,451,366	0.13
USD 3,703,000	Civitas Resources 8.75% 1/7/2031	3,940,325	0.21
EUR 1,586,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	1,715,396	0.09
USD 1,455,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026*	1,452,797	0.08
USD 5,314,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.75% 15/5/2028*	5,380,234	0.28
USD 13,106,000	Clarios Global / Clarios US Finance 8.5% 15/5/2027	13,186,091	0.70
USD 6,482,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	5,901,598	0.31
USD 4,954,000	Clarivate Science 4.875% 1/7/2029	4,500,884	0.24
USD 356,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	343,970	0.02
USD 895,000	Clean Harbors 5.125% 15/7/2029	862,342	0.05
USD 708,000	Clean Harbors 6.375% 1/2/2031	704,349	0.04
USD 2,176,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	2,043,121	0.11
USD 4,200,000	Clear Channel Outdoor 7.5% 1/6/2029	3,491,292	0.18
USD 1,178,000	Clear Channel Outdoor 7.75% 15/4/2028*	1,026,536	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 7,860,000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028*	8,213,268	0.43
USD 1,667,000	Clearway Energy Operating 3.75% 15/1/2032	1,389,690	0.07
USD 458,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	428,315	0.02
USD 24,461,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	22,752,406	1.20
USD 9,075,000	Cloud Software 9% 30/9/2029	8,461,699	0.45
USD 2,058,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	2,048,698	0.11
USD 3,693,000	Clydesdale Acquisition 8.75% 15/4/2030	3,522,099	0.19
USD 1,858,000	CMG Media 8.875% 15/12/2027	1,261,004	0.07
USD 1,061,000	CNX Midstream Partners 4.75% 15/4/2030	928,783	0.05
USD 464,000	CNX Resources 7.375% 15/1/2031	468,988	0.02
USD 2,342,000	Coherent 5% 15/12/2029*	2,195,028	0.12
USD 1,360,000	CommScope 4.75% 1/9/2029	946,594	0.05
USD 2,191,000	CommScope 6% 1/3/2026	1,985,473	0.10
USD 2,192,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025*	1,711,908	0.09
USD 1,594,000	Compass Diversified 5.25% 15/4/2029	1,500,904	0.08
USD 7,697,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	6,829,664	0.36
USD 127,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	119,340	0.01
USD 1,503,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	1,522,141	0.08
USD 1,379,000	Covanta 4.875% 1/12/2029*	1,209,925	0.06
USD 497,000	Covanta 5% 1/9/2030	427,303	0.02
USD 5,461,000	CQP Holdco / BIP-V Chinook Holdco 5.5% 15/6/2031	5,090,609	0.27
USD 6,572,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	6,546,999	0.35
USD 2,731,000	Crescent Energy Finance 9.25% 15/2/2028	2,850,434	0.15
USD 1,243,000	Crocs 4.125% 15/8/2031	1,061,933	0.06
USD 129,000	Crocs 4.25% 15/3/2029	115,972	0.01
USD 260,000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	229,549	0.01
USD 318,000	Crown Americas 5.25% 1/4/2030	306,310	0.02
USD 474,000	Crown Americas / Crown Americas Capital V 4.25% 30/9/2026	454,487	0.02
USD 2,389,000	CSC 4.125% 1/12/2030	1,790,041	0.10
USD 759,000	CSC 4.5% 15/11/2031	564,039	0.03
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	173,342	0.01
USD 3,044,000	CSC 5.5% 15/4/2027	2,735,414	0.14
USD 9,040,000	CSC 11.25% 15/5/2028*	9,328,150	0.49
USD 5,231,000	CSC 11.75% 31/1/2029	5,466,438	0.29
USD 2,170,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028*	2,136,213	0.11
USD 854,000	Cushman & Wakefield US Borrower 8.875% 1/9/2031	888,664	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 2,675,000	Darling Ingredients 6% 15/6/2030*	2,636,365	0.14
USD 1,022,000	Dealer Tire / DT Issuer 8% 1/2/2028*	1,016,015	0.05
USD 5,420,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	5,116,141	0.27
USD 261,000	Drawbridge Special Opportunities Fund / Drawbridge Special Opportunities Fin 3.875% 15/2/2026	242,238	0.01
USD 660,000	Dream Finders Homes 8.25% 15/8/2028	688,630	0.04
USD 1,676,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	1,529,253	0.08
USD 1,523,000	DT Midstream 4.375% 15/6/2031	1,370,311	0.07
USD 2,590,000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029*	2,383,977	0.13
USD 1,019,000	Dycom Industries 4.5% 15/4/2029	939,061	0.05
USD 9,266,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	8,409,707	0.44
EUR 935,000	EMRLD Borrower / Emerald Co- Issuer 6.375% 15/12/2030	1,070,352	0.06
EUR 100,000	EMRLD Borrower / Emerald Co- Issuer 6.375% 15/12/2030*	114,351	0.01
EUR 100,000	EMRLD Borrower / Emerald Co- Issuer 6.375% 15/12/2030	114,267	0.01
USD 16,634,000	EMRLD Borrower / Emerald Co- Issuer 6.625% 15/12/2030	16,704,861	0.88
USD 2,723,000	Enact 6.5% 15/8/2025	2,721,516	0.14
USD 281,000	Encompass Health 4.5% 1/2/2028	266,072	0.01
USD 1,728,000	Encompass Health 4.625% 1/4/2031	1,564,159	0.08
GBP 100,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026*	121,216	0.01
USD 290,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	281,374	0.02
USD 2,537,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	2,504,473	0.13
USD 946,000	EnLink Midstream 6.5% 1/9/2030	969,074	0.05
USD 1,433,000	EnLink Midstream Partners 5.6% 1/4/2044	1,290,686	0.07
USD 8,231,000	Entegris 4.75% 15/4/2029	7,775,144	0.41
USD 150,000	EQM Midstream Partners 4.5% 15/1/2029	140,313	0.01
USD 1,018,000	EQM Midstream Partners 4.75% 15/1/2031	948,306	0.05
USD 1,874,000	EQM Midstream Partners 6.375% 1/4/2029	1,881,458	0.10
USD 677,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	719,958	0.04
USD 2,346,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	2,180,244	0.12
USD 938,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	848,580	0.04
USD 512,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 6.75% 15/1/2030*	452,324	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 790,000	Fiesta Purchaser 7.875% 1/3/2031*	815,218	0.04
USD 6,125,000	First-Citizens Bank & Trust 6% 1/4/2036	5,927,799	0.31
USD 1,217,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	1,214,161	0.06
GBP 174,000	Ford Motor Credit 6.86% 5/6/2026*	226,089	0.01
USD 1,472,000	Ford Motor Credit 7.2% 10/6/2030*	1,551,262	0.08
USD 3,096,000	Ford Motor Credit 7.35% 6/3/2030	3,285,857	0.17
USD 1,035,000	Fortrea 7.5% 1/7/2030	1,058,205	0.06
USD 228,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5.5% 1/5/2028	218,361	0.01
USD 7,423,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 7.875% 1/12/2030	7,778,601	0.41
USD 1,186,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9.75% 1/8/2027	1,225,238	0.06
USD 813,000	Foundation Building Materials 6% 1/3/2029	710,161	0.04
USD 321,000	Freedom Mortgage 9.25% 1/2/2029	325,931	0.02
USD 2,923,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2,706,859	0.14
USD 986,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	953,905	0.05
USD 1,625,000	Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	1,641,963	0.09
USD 7,347,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	7,479,349	0.39
USD 1,321,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	1,316,133	0.07
USD 1,707,000	GCI 4.75% 15/10/2028	1,535,361	0.08
USD 615,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7.75% 1/2/2028	614,862	0.03
USD 974,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.25% 15/1/2029	990,062	0.05
USD 490,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.875% 15/4/2030	508,437	0.03
USD 2,967,000	Global Payments 1.5% 1/3/2031	3,025,441	0.16
USD 1,097,000	GLP Capital / GLP Financing II 3.25% 15/1/2032	910,174	0.05
USD 548,000	GLP Capital / GLP Financing II 6.75% 1/12/2033	569,031	0.03
USD 1,956,000	GN Bondco 9.5% 15/10/2031*	1,925,027	0.10
USD 880,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	783,887	0.04
USD 641,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	619,190	0.03
USD 837,000	Goodyear Tire & Rubber 5% 15/7/2029	770,214	0.04
USD 327,000	Goodyear Tire & Rubber 5.625% 30/4/2033	293,122	0.02
USD 738,000	GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028*	589,478	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 596,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029	602,350	0.03
USD 417,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	382,189	0.02
USD 620,000	Graphic Packaging International 4.75% 15/7/2027	600,573	0.03
USD 914,000	Gray Television 5.875% 15/7/2026	863,264	0.05
USD 950,000	Gray Television 7% 15/5/2027*	850,208	0.04
USD 6,319,000	GTCR W-2 Merger Sub 7.5% 15/1/2031	6,582,376	0.35
USD 311,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	315,520	0.02
USD 1,974,000	GYP III 4.625% 1/5/2029	1,831,166	0.10
USD 285,000	H&E Equipment Services 3.875% 15/12/2028	256,925	0.01
USD 1,019,000	Hanesbrands 4.875% 15/5/2026	984,097	0.05
USD 1,809,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026*	1,686,437	0.09
USD 1,097,000	HAT I / HAT II 8% 15/6/2027	1,139,445	0.06
USD 798,000	HB Fuller 4.25% 15/10/2028	740,244	0.04
USD 3,990,000	HealthEquity 4.5% 1/10/2029	3,665,374	0.19
USD 1,065,000	Helios Software / ION Corporate Solutions Finance 4.625% 1/5/2028	959,638	0.05
USD 2,888,000	Herc 5.5% 15/7/2027	2,829,407	0.15
USD 1,413,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	1,367,486	0.07
USD 126,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6% 15/4/2030	122,405	0.01
USD 716,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	711,248	0.04
USD 3,123,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 8.375% 1/11/2033	3,348,965	0.18
USD 631,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	573,064	0.03
USD 97,000	Hilton Domestic Operating 4% 1/5/2031	86,210	0.00
USD 1,100,000	Hilton Domestic Operating 4.875% 15/1/2030	1,041,496	0.05
USD 881,000	Hilton Domestic Operating 5.75% 1/5/2028	881,103	0.05
USD 1,255,000	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow / Hilton Grand Vacations Borrower Esc 6.625% 15/1/2032	1,255,967	0.07
USD 1,475,000	Howard Hughes 4.125% 1/2/2029	1,304,103	0.07
USD 216,000	Howard Hughes 4.375% 1/2/2031	184,605	0.01
USD 245,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	230,523	0.01
USD 1,421,000	Howard Midstream Energy Partners 8.875% 15/7/2028	1,500,700	0.08
USD 1,035,000	HPS Corporate Lending Fund 6.75% 30/1/2029	1,025,696	0.05
USD 18,092,000	HUB International 7.25% 15/6/2030	18,443,600	0.97
USD 21,714,000	HUB International 7.375% 31/1/2032	21,867,475	1.15
USD 651,000	Hughes Satellite Systems 5.25% 1/8/2026	558,874	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 4,429,000	Illuminate Buyer / Illuminate IV 9% 1/7/2028*	4,395,096	0.23
USD 1,562,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	1,448,333	0.08
USD 664,000	Ingevity 3.875% 1/11/2028	590,127	0.03
USD 613,000	Installed Building Products 5.75% 1/2/2028	600,716	0.03
EUR 336,000	IQVIA 1.75% 15/3/2026	347,519	0.02
EUR 100,000	IQVIA 2.25% 15/3/2029	97,728	0.01
USD 799,000	IQVIA 5% 15/5/2027	777,294	0.04
USD 632,000	IQVIA 6.25% 1/2/2029	650,029	0.03
USD 600,000	IQVIA 6.5% 15/5/2030	608,207	0.03
USD 1,466,000	IRB 7% 15/6/2025	1,468,067	0.08
USD 211,000	Iron Mountain 5.625% 15/7/2032	197,092	0.01
USD 4,123,000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	4,191,081	0.22
USD 926,000	Iron Mountain Information Management Services 5% 15/7/2032	828,870	0.04
USD 3,297,000	ITT 6.5% 1/8/2029	2,929,364	0.15
USD 2,269,000	Jefferies Finance / JFIN Co- Issuer 5% 15/8/2028	2,039,812	0.11
USD 2,937,000	Kaiser Aluminum 4.5% 1/6/2031*	2,511,644	0.13
USD 740,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	682,186	0.04
USD 533,000	KB Home 7.25% 15/7/2030	550,706	0.03
USD 943,000	Ken Garff Automotive 4.875% 15/9/2028	871,036	0.05
USD 1,236,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	1,204,298	0.06
USD 492,000	Kinetik 6.625% 15/12/2028	496,784	0.03
USD 2,550,450	Kobe US Midco 2 9.25% 1/11/2026	2,183,185	0.11
USD 872,000	Kontoor Brands 4.125% 15/11/2029	785,949	0.04
EUR 113,000	Kronos International 9.5% 15/3/2029	129,965	0.01
USD 1,317,000	LABL 5.875% 1/11/2028	1,182,540	0.06
USD 65,000	LABL 6.75% 15/7/2026	63,093	0.00
USD 2,682,000	LABL 9.5% 1/11/2028	2,686,691	0.14
USD 920,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	847,828	0.05
USD 480,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4.75% 15/6/2029	430,919	0.02
USD 273,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5.25% 1/10/2025	268,855	0.01
USD 956,000	Lamb Weston 4.375% 31/1/2032	853,168	0.04
USD 1,856,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	1,795,512	0.09
USD 2,804,000	LCM Investments II 4.875% 1/5/2029	2,521,987	0.13
USD 2,075,000	LCM Investments II 8.25% 1/8/2031	2,119,058	0.11
USD 1,430,000	Legacy LifePoint Health 4.375% 15/2/2027	1,328,477	0.07
EUR 7,947,137	Lehman Brothers 0% 5/2/2014***	43,110	0.00
USD 1,610,000	Lehman Brothers 0% 1/3/2015***	2,013	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。

*** 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 3,724,306	Lehman Brothers 4.75% 16/1/2014 ^{***}	20,203	0.00
EUR 639,362	Lehman Brothers 5.375% 17/10/2012 ^{***}	3,468	0.00
USD 5,760,000	Lehman Brothers 5.75% 17/5/2013 ^{***}	7,200	0.00
USD 5,060,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	5,186,500	0.27
USD 531,000	Level 3 Financing 3.625% 15/1/2029	318,600	0.02
USD 5,799,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	3,769,350	0.20
USD 1,054,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	1,089,573	0.06
USD 5,477,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	5,661,849	0.30
USD 1,428,000	Levi Strauss 3.5% 1/3/2031	1,235,251	0.07
USD 475,000	LGI Homes 8.75% 15/12/2028	495,385	0.03
EUR 193,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	208,836	0.01
USD 1,009,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	1,001,004	0.05
USD 2,178,000	Life Time 8% 15/4/2026 [*]	2,196,515	0.12
USD 993,000	LifePoint Health 9.875% 15/8/2030	1,031,169	0.05
USD 2,953,000	LifePoint Health 11% 15/10/2030	3,126,484	0.16
USD 1,067,000	Light & Wonder International 7% 15/5/2028	1,072,468	0.06
USD 132,000	Light & Wonder International 7.25% 15/11/2029	135,047	0.01
USD 1,188,000	Light & Wonder International 7.5% 1/9/2031	1,236,116	0.07
USD 2,410,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027 [*]	2,421,980	0.13
USD 1,500,000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	1,587,079	0.08
USD 1,720,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029 [*]	1,290,519	0.07
USD 583,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	533,418	0.03
USD 1,528,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	1,452,937	0.07
USD 1,265,000	LSF11 A5 HoldCo 6.625% 15/10/2029 [*]	1,101,710	0.06
USD 2,535,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	1,538,973	0.08
USD 878,000	Lyft 0.625% 1/3/2029	903,076	0.05
USD 2,904,000	Madison IAQ 5.875% 30/6/2029	2,574,121	0.14
USD 248,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	243,566	0.01
USD 335,000	MasTec 4.5% 15/8/2028	313,869	0.02
USD 1,818,000	Matador Resources 6.875% 15/4/2028	1,851,177	0.10
USD 1,022,000	Match II 3.625% 1/10/2031	860,636	0.05
USD 1,037,000	Match II 4.625% 1/6/2028	968,043	0.05
USD 39,000	Match II 5.625% 15/2/2029	37,326	0.00
USD 1,382,000	Mattel 6.2% 1/10/2040	1,355,003	0.07
USD 16,129,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	16,331,838	0.86

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 385,000	Mauser Packaging Solutions 9.25% 15/4/2027*	375,154	0.02
USD 1,547,000	Mavis Tire Express Services Topco 6.5% 15/5/2029*	1,455,453	0.08
USD 4,259,000	McAfee 7.375% 15/2/2030	3,767,783	0.20
USD 2,211,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	1,975,243	0.10
USD 9,771,000	Medline Borrower 5.25% 1/10/2029*	9,044,604	0.48
USD 1,989,000	Merlin Entertainments US 7.375% 15/2/2031	1,993,151	0.11
USD 1,225,000	MGIC Investment 5.25% 15/8/2028	1,187,417	0.06
USD 3,373,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	3,248,453	0.17
USD 897,000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance 5.375% 15/8/2027	850,764	0.04
USD 1,181,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,083,965	0.06
USD 2,802,000	Minerals Technologies 5% 1/7/2028	2,661,031	0.14
USD 2,438,000	ModivCare 5.875% 15/11/2025*	2,369,846	0.12
USD 404,000	Molina Healthcare 3.875% 15/11/2030	354,164	0.02
USD 534,000	Molina Healthcare 3.875% 15/5/2032	458,221	0.02
USD 462,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	430,912	0.02
GBP 1,336,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2.5% 24/3/2026	1,393,741	0.07
USD 1,851,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3.5% 15/3/2031	1,235,816	0.07
USD 2,989,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029*	2,222,680	0.12
USD 298,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026*	265,875	0.01
USD 653,000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	590,403	0.03
USD 452,000	Murphy Oil 5.875% 1/12/2027	448,720	0.02
USD 196,000	Murphy Oil 5.875% 1/12/2042	173,302	0.01
USD 651,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	646,736	0.03
USD 1,000,000	Nabors Industries 9.125% 31/1/2030	1,025,990	0.05
USD 7,891,000	Nationstar Mortgage 5% 1/2/2026	7,670,507	0.41
USD 693,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	619,602	0.03
USD 906,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031*	831,372	0.05
USD 88,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	86,541	0.00
USD 4,068,000	Nationstar Mortgage 7.125% 1/2/2032	4,014,906	0.21
USD 518,000	Navient 5.5% 15/3/2029	469,113	0.03
USD 994,000	Navient 9.375% 25/7/2030	1,041,910	0.06
USD 1,530,000	Neogen Food Safety 8.625% 20/7/2030	1,623,766	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 2,309,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	2,169,444	0.12
USD 2,151,000	NESCO II 5.5% 15/4/2029	2,002,387	0.11
USD 812,000	New Enterprise Stone & Lime 5.25% 15/7/2028	774,173	0.04
USD 1,108,000	New Enterprise Stone & Lime 9.75% 15/7/2028	1,120,324	0.06
USD 3,071,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	3,022,303	0.16
USD 664,000	Newfold Digital 11.75% 15/10/2028	721,778	0.04
USD 443,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	420,858	0.02
USD 122,000	NextEra Energy Operating Partners 3.875% 15/10/2026	114,248	0.01
USD 65,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/9/2024	63,050	0.00
USD 898,000	NextEra Energy Operating Partners 7.25% 15/1/2029	912,270	0.05
USD 1,104,000	NextEra Energy Partners 0% 15/11/2025	981,023	0.05
USD 1,104,000	NextEra Energy Partners 2.5% 15/6/2026	1,000,774	0.05
USD 1,485,000	NFP 4.875% 15/8/2028	1,479,416	0.08
USD 9,943,000	NFP 6.875% 15/8/2028	10,121,278	0.53
USD 119,000	NFP 8.5% 1/10/2031	131,223	0.01
USD 2,747,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 8.125% 15/2/2029*	2,776,006	0.15
USD 5,558,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 8.375% 15/2/2032	5,642,287	0.30
USD 546,000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	455,547	0.02
USD 1,655,000	Noble Finance II 8% 15/4/2030	1,700,461	0.09
USD 986,000	Northern Trust 6.125% 2/11/2032	1,039,780	0.06
USD 1,509,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	1,449,719	0.08
USD 5,606,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	5,207,750	0.27
USD 2,671,000	Novelis 3.875% 15/8/2031	2,256,106	0.12
USD 3,288,000	Novelis 4.75% 30/1/2030	3,003,614	0.16
USD 1,145,000	NRG Energy 7% 15/3/2033	1,199,112	0.06
USD 604,000	NuStar Logistics 6% 1/6/2026	597,595	0.03
USD 228,000	NuStar Logistics 6.375% 1/10/2030	227,640	0.01
USD 400,000	Oceaneering International 6% 1/2/2028	388,834	0.02
EUR 100,000	Olympus Water US 5.375% 1/10/2029	96,101	0.00
EUR 260,000	Olympus Water US 9.625% 15/11/2028	303,940	0.02
USD 6,328,000	Olympus Water US 9.75% 15/11/2028	6,724,683	0.35
USD 797,000	OneMain Finance 3.5% 15/1/2027	733,526	0.04
USD 561,000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	472,859	0.03
USD 435,000	OneMain Finance 5.375% 15/11/2029	404,269	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 576,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	572,694	0.03
USD 807,000	OneMain Finance 6.875% 15/3/2025	815,724	0.04
USD 1,180,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	1,199,717	0.06
USD 2,144,000	OneMain Finance 7.875% 15/3/2030	2,180,795	0.12
USD 1,524,000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	1,605,058	0.08
USD 1,210,000	Option Care Health 4.375% 31/10/2029	1,095,638	0.06
USD 1,467,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	1,344,947	0.07
USD 581,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5.125% 30/4/2031	499,349	0.03
USD 1,144,000	OT Merger 7.875% 15/10/2029	707,659	0.04
USD 1,797,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	1,601,538	0.08
USD 452,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	399,455	0.02
USD 2,779,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	2,663,051	0.14
USD 1,582,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 7.375% 15/2/2031	1,643,583	0.09
USD 231,000	Owens-Brockway Glass Container 6.625% 13/5/2027	230,179	0.01
USD 919,000	Owens-Brockway Glass Container 7.25% 15/5/2031	928,785	0.05
USD 800,000	Pacific Gas and Electric 6.95% 15/3/2034	867,127	0.05
USD 585,000	Patterson-UTI Energy 7.15% 1/10/2033	620,490	0.03
USD 736,000	PBF / PBF Finance 7.875% 15/9/2030	753,734	0.04
USD 1,502,000	PennyMac Financial Services 7.875% 15/12/2029	1,540,540	0.08
USD 1,483,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	1,440,868	0.08
USD 3,328,000	Permian Resources Operating 5.875% 1/7/2029	3,252,976	0.17
USD 1,818,000	Permian Resources Operating 7% 15/1/2032	1,868,884	0.10
USD 1,505,000	Permian Resources Operating 7.75% 15/2/2026	1,524,393	0.08
USD 708,000	PetSmart / PetSmart Finance 4.75% 15/2/2028	664,510	0.03
USD 4,573,000	PetSmart / PetSmart Finance 7.75% 15/2/2029	4,525,394	0.24
USD 4,641,000	PG&E 4.25% 1/12/2027	4,658,954	0.25
USD 480,000	Pike 8.625% 31/1/2031	507,491	0.03
USD 445,000	Playtika 4.25% 15/3/2029	375,955	0.02
USD 178,000	Post 4.5% 15/9/2031	158,655	0.01
USD 328,000	Post 4.625% 15/4/2030	298,843	0.02
USD 1,461,000	Post 6.25% 15/2/2032	1,470,548	0.08
USD 1,047,000	Prairie Acquiror 9% 1/8/2029	1,054,789	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 1,047,000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5.625% 1/9/2029	752,034	0.04
USD 1,268,000	Premier Entertainment Sub / Premier Entertainment Finance 5.875% 1/9/2031	898,613	0.05
USD 990,000	Prestige Brands 3.75% 1/4/2031	852,339	0.04
USD 2,170,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	2,149,933	0.11
USD 1,235,000	PTC 3.625% 15/2/2025	1,208,420	0.06
USD 2,546,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	1,990,941	0.11
USD 2,428,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 6.5% 15/9/2028	1,131,752	0.06
USD 754,000	Raising Cane 's Restaurants 9.375% 1/5/2029	803,377	0.04
USD 1,628,000	Raptor Acquisition / Raptor Co- Issuer 4.875% 1/11/2026	1,563,227	0.08
USD 508,000	RegionalCare Hospital Partners / LifePoint Health 9.75% 1/12/2026*	507,621	0.03
USD 445,000	Resideo Funding 4% 1/9/2029	390,950	0.02
USD 1,489,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	1,381,353	0.07
USD 1,969,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	1,882,157	0.10
USD 1,929,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7.25% 15/7/2028	1,979,951	0.10
USD 485,000	Ritchie Bros 6.75% 15/3/2028	495,211	0.03
USD 1,250,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	1,176,031	0.06
USD 167,000	RLJ Lodging Trust 4% 15/9/2029	145,756	0.01
USD 2,870,000	Rockcliff Energy II 5.5% 15/10/2029	2,640,925	0.14
USD 6,007,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	5,533,198	0.29
USD 745,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.875% 1/3/2031	638,495	0.03
USD 459,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 4% 15/10/2033	381,450	0.02
USD 380,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	355,447	0.02
USD 595,000	RXO 7.5% 15/11/2027	614,961	0.03
USD 1,090,000	Ryan Specialty 4.375% 1/2/2030	1,011,096	0.05
USD 2,084,000	Sabre GBL 8.625% 1/6/2027	1,844,350	0.10
USD 138,000	Sabre GBL 11.25% 15/12/2027	129,979	0.01
USD 2,676,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	2,370,176	0.13
USD 4,378,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	4,130,540	0.22
USD 2,501,000	Science Applications International 4.875% 1/4/2028	2,364,060	0.13
USD 1,129,000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6.625% 1/3/2030	1,056,349	0.06

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
EUR 100,000	SCIL IV / SCIL USA 8.272% 1/11/2026*	109,049	0.01
EUR 104,000	SCIL IV / SCIL USA 9.5% 15/7/2028*	122,992	0.01
USD 882,000	Scotts Miracle-Gro 4% 1/4/2031	740,900	0.04
USD 268,000	Scotts Miracle-Gro 4.375% 1/2/2032	224,370	0.01
USD 174,000	Scotts Miracle-Gro 4.5% 15/10/2029	154,843	0.01
USD 796,000	Sealed Air 4% 1/12/2027	739,742	0.04
USD 341,000	Sealed Air 5% 15/4/2029	322,891	0.02
USD 941,000	Sealed Air Corp/Sealed Air US 6.125% 1/2/2028	939,058	0.05
USD 108,000	Sensata Technologies 3.75% 15/2/2031	92,665	0.00
USD 2,777,000	Sensata Technologies 4.375% 15/2/2030	2,530,957	0.13
USD 426,000	Service International 3.375% 15/8/2030	364,795	0.02
USD 2,048,000	Service International 4% 15/5/2031	1,794,335	0.09
USD 578,000	Service International 5.125% 1/6/2029	557,770	0.03
USD 2,868,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	2,751,316	0.15
USD 1,296,000	Simmons Foods/Simmons Prepared Foods/Simmons Pet Food 4.625% 1/3/2029	1,135,468	0.06
USD 2,449,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	2,286,068	0.12
USD 519,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	467,933	0.02
USD 4,687,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	4,472,664	0.24
USD 4,996,000	Six Flags Entertainment 7.25% 15/5/2031*	5,027,096	0.27
USD 1,548,000	SLM 3.125% 2/11/2026	1,423,581	0.08
USD 1,074,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	1,077,866	0.06
USD 187,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	186,011	0.01
USD 719,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	715,370	0.04
USD 2,394,000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	2,325,505	0.12
USD 3,724,000	Smyrna Ready Mix Concrete 8.875% 15/11/2031	3,947,410	0.21
USD 3,900,000	Sotheby ' s 7.375% 15/10/2027* Sotheby ' s/Bidfair 5.875% 1/6/2029	3,755,059	0.20
USD 2,495,000	Southwestern Energy 4.75% 1/2/2032	2,193,205	0.12
USD 5,000	Southwestern Energy 5.375% 1/2/2029	4,549	0.00
USD 1,391,000	Southwestern Energy 5.7% 23/1/2025	140,226	0.01
USD 1,972,000	Spectrum Brands 5% 1/10/2029	1,917,139	0.10
USD 3,355,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	3,108,336	0.16
USD 3,494,000	SRS Distribution 6% 1/12/2029 SRS Distribution 6.125% 1/7/2029	3,254,312	0.17
USD 4,178,000		3,910,023	0.21

* 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 4,700,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	4,578,522	0.24
USD 546,000	Stagwell Global 5.625% 15/8/2029	483,429	0.03
EUR 660,000	Standard Industries 2.25% 21/11/2026	671,782	0.04
USD 742,000	Standard Industries 3.375% 15/1/2031	616,323	0.03
USD 1,520,000	Standard Industries 4.375% 15/7/2030	1,356,574	0.08
USD 309,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	292,688	0.01
USD 1,774,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	1,709,595	0.09
USD 5,480,000	Star Parent 9% 1/10/2030	5,779,959	0.30
USD 355,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	332,679	0.02
USD 1,247,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	1,160,921	0.06
USD 410,000	Station Casinos 4.625% 1/12/2031	364,238	0.02
USD 161,000	Stericycle 3.875% 15/1/2029	145,604	0.01
USD 645,000	STL 8.75% 15/2/2029	660,517	0.03
USD 686,000	Suburban Propane Partners/Suburban Energy Finance 5% 1/6/2031	613,761	0.03
USD 386,000	Summit Materials / Summit Materials Finance 5.25% 15/1/2029	371,995	0.02
USD 2,502,000	Summit Materials / Summit Materials Finance 7.25% 15/1/2031	2,597,038	0.14
USD 1,096,000	Sunoco / Sunoco Finance 7% 15/9/2028	1,122,309	0.06
USD 2,564,000	Surgery Center 6.75% 1/7/2025	2,566,218	0.14
USD 1,442,000	Surgery Center 10% 15/4/2027	1,464,243	0.08
USD 921,000	SWF Escrow Issuer 6.5% 1/10/2029*	649,006	0.03
USD 1,455,000	Synaptics 4% 15/6/2029*	1,284,059	0.07
USD 686,000	Talen Energy Supply 8.625% 1/6/2030	724,390	0.04
USD 222,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5.5% 15/1/2028	210,602	0.01
USD 368,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	361,863	0.02
USD 49,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 31/12/2030	45,611	0.00
USD 280,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/9/2031	257,585	0.01
USD 2,554,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7.375% 15/2/2029	2,546,501	0.13
USD 985,000	Talos Production 9% 1/2/2029	1,006,162	0.05
USD 822,000	Talos Production 9.375% 1/2/2031	849,115	0.04
USD 305,000	Taylor Morrison Communities 5.125% 1/8/2030	288,774	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 744,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	694,679	0.04
USD 308,000	Teleflex 4.625% 15/11/2027	294,378	0.02
USD 177,000	Tempur Sealy International 3.875% 15/10/2031	147,279	0.01
USD 196,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029*	174,729	0.01
USD 566,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	537,623	0.03
USD 1,405,000	Tenet Healthcare 6.125% 1/10/2028	1,384,473	0.07
USD 529,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	524,145	0.03
USD 6,866,000	Tenet Healthcare 6.75% 15/5/2031	6,917,495	0.36
USD 1,189,000	Tenneco 8% 17/11/2028	1,079,712	0.06
USD 1,825,000	Terex 5% 15/5/2029	1,704,179	0.09
USD 614,000	Titan International 7% 30/4/2028	611,263	0.03
USD 9,414,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	9,052,096	0.48
USD 561,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	547,595	0.03
USD 461,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	454,989	0.02
USD 627,000	Trident TPI 12.75% 31/12/2028	669,983	0.03
USD 5,364,000	Triumph 9% 15/3/2028	5,613,855	0.30
USD 1,076,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	1,107,043	0.06
USD 869,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	773,455	0.04
USD 2,204,000	Twilio 3.875% 15/3/2031	1,919,419	0.10
USD 777,000	Uber Technologies 0% 15/12/2025	884,650	0.05
USD 2,482,000	Uber Technologies 0.875% 1/12/2028	3,104,842	0.16
USD 5,327,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	4,978,777	0.26
USD 800,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	801,992	0.04
EUR 137,000	UGI International 2.5% 1/12/2029*	132,413	0.01
USD 15,661,000	UKG 6.875% 1/2/2031	15,828,808	0.84
USD 2,494,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	2,297,835	0.12
USD 637,000	United Natural Foods 6.75% 15/10/2028	531,357	0.03
USD 6,902,000	United Rentals North America 6% 15/12/2029	6,917,882	0.36
USD 7,238,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	7,516,663	0.40
USD 366,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	354,933	0.02
USD 613,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030*	592,454	0.03
USD 4,875,000	Univision Communications 8% 15/8/2028	4,876,312	0.26
USD 306,000	US Foods 4.625% 1/6/2030	280,687	0.01
USD 570,000	US Foods 4.75% 15/2/2029	534,570	0.03
USD 1,107,000	US Foods 6.875% 15/9/2028	1,125,371	0.06
USD 1,333,000	US Foods 7.25% 15/1/2032	1,377,406	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 2,891,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	2,885,012	0.15
USD 2,657,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/9/2027	2,643,081	0.14
USD 1,037,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	1,037,753	0.05
USD 4,828,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	4,318,466	0.23
USD 1,069,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 1/11/2033	897,289	0.05
USD 2,581,000	Venture Global Calcasieu Pass 4.125% 15/8/2031	2,268,007	0.12
USD 4,868,000	Venture Global LNG 8.125% 1/6/2028	4,948,195	0.26
USD 7,082,000	Venture Global LNG 8.375% 1/6/2031	7,165,461	0.38
USD 11,682,000	Venture Global LNG 9.5% 1/2/2029	12,461,808	0.66
USD 6,971,000	Venture Global LNG 9.875% 1/2/2032	7,347,399	0.39
USD 1,900,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	1,740,965	0.09
USD 13,913,000	Verscend Escrow 9.75% 15/8/2026	13,947,922	0.74
USD 3,550,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	3,271,733	0.17
USD 1,422,000	Viavi Solutions 3.75% 1/10/2029	1,224,398	0.06
USD 839,000	VICI Properties 5.625% 15/5/2052	755,511	0.04
USD 1,156,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	1,033,971	0.05
USD 1,454,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,351,597	0.07
USD 1,825,000	Vital Energy 9.75% 15/10/2030	1,954,998	0.10
USD 1,535,000	Vital Energy 10.125% 15/1/2028	1,607,371	0.08
USD 1,785,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	1,634,756	0.09
USD 163,000	Walgreens Boots Alliance 3.2% 15/4/2030	141,200	0.01
USD 782,000	Walgreens Boots Alliance 4.1% 15/4/2050	572,154	0.03
USD 522,000	Walgreens Boots Alliance 4.8% 18/11/2044	437,270	0.02
USD 3,296,000	Wand NewCo 3 7.625% 30/1/2032	3,380,687	0.18
USD 7,554,000	Waste Pro USA 5.5% 15/2/2026	7,406,543	0.39
USD 1,218,000	WESCO Distribution 6.375% 15/3/2029	1,219,148	0.06
USD 1,224,000	WESCO Distribution 6.625% 15/3/2032	1,226,892	0.06
USD 2,068,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	2,112,257	0.11
USD 1,035,000	Western Midstream Operating 5.25% 1/2/2050	914,923	0.05
USD 9,809,000	White Cap Buyer 6.875% 15/10/2028*	9,566,966	0.50
USD 2,289,000	White Cap Parent 8.25% 15/3/2026*	2,285,285	0.12
USD 895,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	882,347	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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
USD 844,000	Williams Scotsman 4.625% 15/8/2028	790,013	0.04
USD 1,719,000	Williams Scotsman 7.375% 1/10/2031	1,783,019	0.09
USD 562,000	Windstream Escrow / Windstream Escrow Finance 7.75% 15/8/2028	524,558	0.03
USD 812,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	772,197	0.04
USD 6,455,000	WR Grace 5.625% 15/8/2029	5,660,606	0.30
USD 1,234,000	WR Grace 7.375% 1/3/2031	1,245,823	0.07
USD 1,059,000	Wyndham Hotels & Resorts 4.375% 15/8/2028	984,951	0.05
USD 2,100,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027 Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	2,048,711	0.11
USD 3,429,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.125% 15/2/2031	3,238,308	0.17
USD 2,770,000	Zayo 4% 1/3/2027*	2,862,168	0.15
USD 19,438,000	Zayo 6.125% 1/3/2028	16,191,660	0.85
USD 3,933,000	ZoomInfo Technologies/ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029*	2,993,794	0.16
USD 4,228,000		3,790,421	0.20
		1,348,988,127	71.16
		1,780,413,265	93.94
債券合計			
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			
		1,835,382,568	96.84
その他の譲渡可能な有価証券			
普通株式 / 優先株式およびワラント			
	バミューダ 22,200 Loral Space & Communications (Wts 26/12/2006) **, ***	-	0.00
	ルクセンブルグ 5,660 ADLER**	1,351	0.00
	英国 3,743 New Topco**	-	0.00
	米国 315,073 AMP PIPE**	1,030,289	0.05
	974 Archibald Candy**	-	0.00
	8,000 Australis Media (Wts 15/5/2003) **, ***	-	0.00
	65,370 Critical Care Systems International**	-	0.00
	26 IssuerCo-U**	-	0.00
	240,000 Southern Energy Homes **, ***	-	0.00
	1,368 Verscend Intermediate**	1,926,202	0.10
		2,956,491	0.15
		2,957,842	0.15
普通株式 / 優先株式およびワラント合計			

* 当該有価証券の全額または一部は貸付有価証券である。

** 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。

*** 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。

USドル・ハイ・イールド・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 (%)
債券			
USD 197,801	米国 Archibald Candy 10% 1/11/2007 **	-	0.00
USD 4,000,000	Consolidated Hydro 0% 31/12/2049 **	-	0.00
USD 850,000	Erscrew Adelpia 0% 31/12/2049 **	-	0.00
USD 3,514,691	Level 3 11% 15/11/2029 **	3,514,691	0.18
USD 290,000	Mirant Escrow 0% 15/7/2049 **	-	0.00
USD 115,000	Tropicana Entertainment / Tropicana Finance 9.625% 15/12/2014 ** ****	-	0.00
USD 4,000,000	Wheeling Pittsburgh Steel Escrow 0% 31/12/2049 **	-	0.00
		3,514,691	0.18
債券合計		3,514,691	0.18
その他の譲渡可能な有価証券合計		6,472,533	0.33
投資有価証券合計		1,841,855,101	97.17
その他の純資産		53,571,524	2.83
純資産合計(米ドル)		1,895,426,625	100.00

** 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。

*** 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。

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	6,770,000	GBP	8,580,481	State Street	20/3/2024	317
USD	81,108,000	EUR	89,001,025	UBS	20/3/2024	946,605
USD	159,000	EUR	174,294	BNP Paribas	20/3/2024	1,677
USD	285,000	EUR	311,031	Morgan Stanley	20/3/2024	1,622
USD	73,000	EUR	80,298	Deutsche Bank	20/3/2024	1,046
USD	790,529	GBP	1,002,498	HSBC Bank	20/3/2024	597
USD	5,547,595	EUR	6,020,305	JP Morgan	20/3/2024	(2,408)
未実現純評価益						949,456

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

USドル・ハイ・イールド・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)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	48,819,682	USD	74,983,060	BNY Mellon	15/3/2024	135,585
USD	649,705	AUD	425,793	BNY Mellon	15/3/2024	1,612
未実現純評価益						137,197
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	4,371,471	USD	5,893,752	BNY Mellon	15/3/2024	(20,014)
USD	22,801	CAD	16,902	BNY Mellon	15/3/2024	68
未実現純評価損						(19,946)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	4,873,836	USD	4,222,721	BNY Mellon	15/3/2024	(62,983)
USD	191,858	CHF	220,178	BNY Mellon	15/3/2024	1,599
未実現純評価損						(61,384)
ヘッジを使用したオンショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	693,434	USD	4,992,235	BNY Mellon	15/3/2024	(36)
未実現純評価損						(36)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	40,886,546	USD	37,959,531	BNY Mellon	15/3/2024	315,354
USD	11,246,591	EUR	12,095,255	BNY Mellon	15/3/2024	(111,971)
未実現純評価益						203,383
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	20,539,411	USD	16,331,116	BNY Mellon	15/3/2024	157,646
USD	79,547	GBP	100,186	BNY Mellon	15/3/2024	(627)
未実現純評価益						157,019
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	26,711,820	USD	208,642,231	BNY Mellon	15/3/2024	(48,138)
USD	7,787,074	HKD	996,302	BNY Mellon	15/3/2024	1,143
未実現純評価損						(46,995)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	4,927	USD	727,284	BNY Mellon	15/3/2024	(52)
USD	4,856	JPY	33	BNY Mellon	15/3/2024	-
未実現純評価損						(52)
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	2,283,833	USD	3,765,874	BNY Mellon	15/3/2024	16,401
USD	116,762	NZD	72,013	BNY Mellon	15/3/2024	693
未実現純評価益						17,094
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	17,772,798	USD	23,878,793	BNY Mellon	15/3/2024	13,503
USD	748,513	SGD	555,508	BNY Mellon	15/3/2024	(2,026)
未実現純評価益						11,477
ヘッジを使用した南アフリカ・ランド建投資証券クラス						
USD	177,099	ZAR	9,368	BNY Mellon	15/3/2024	150
ZAR	6,459,634	USD	122,745,757	BNY Mellon	15/3/2024	(70,273)
未実現純評価損						(70,123)
未実現純評価益合計						1,277,090

USドル・ハイ・イールド・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)
CDS	EUR (40,611)	ファンドはAdler Real Estate 500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	Barclays	20/12/2027	6,877	(3,094)
CDS	EUR (114,152)	ファンドはAdler Real Estate 500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	Barclays	20/12/2027	19,330	(8,697)
CDS	EUR (110,000)	ファンドはForvia SE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	Barclays	20/12/2028	(222)	13,308
CDS	EUR (24,893)	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	362	2,189
CDS	EUR (67,564)	ファンドはAdler Real Estate 500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	20/12/2027	11,672	(5,147)
CDS	USD (30,766,499)	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	1,924,886	1,979,927
CDS	EUR (145,000)	ファンドはUPC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	7,443	22,400
CDS	EUR (35,847)	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	439	3,151
CDS	EUR (33,123)	ファンドはAdler Real Estate 500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	Citibank	20/12/2027	5,848	(2,523)
CDS	EUR (14,000)	ファンドはLadbrokes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	20/6/2027	1,499	(83)
CDS	EUR (100,000)	ファンドはLadbrokes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	20/6/2027	14,442	(595)
CDS	EUR (120,000)	ファンドはVirgin Media Finance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	20/12/2025	(6,764)	8,985
CDS	EUR (190,000)	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	Morgan Stanley	20/6/2027	(11,958)	23,004
CDS	EUR (50,260)	ファンドはAdler Real Estate 500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	Morgan Stanley	20/12/2027	8,559	(3,829)
TRS	USD 2,275,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	JP Morgan	20/3/2024	174,132	172,343
TRS	USD 8,198,000	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	20/9/2024	244,281	175,614
TRS	USD 525,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	43,639	43,395
TRS	USD 2,099,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	206,919	205,610
TRS	USD 7,609,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	584,282	578,300
TRS	USD 11,528,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + Obpsを受け取り、USD 1日SOFR + Obpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	924,121	914,907
TRS	USD 1,049,000	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	Morgan Stanley	20/9/2024	4,854	(5,844)
合計					4,164,641	4,113,321

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

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 評価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
35	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 109	22/3/2024	(3,609)	7,930
合計						(3,609)	7,930

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)
(35)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 106	22/3/2024	370	(670)
合計						370	(670)

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「CS SF」という。)により、2010年12月17日付の法律(随時、改正される)パートの規定に準拠した譲渡可能な有価証券への集団投資事業(以下「UCITS」という。)として認可され、当該法律によって規制されている。

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

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システムティック・マルチ・アローケーション・クレジット・ファンドはシステムティック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、当該債券の次回の繰上償還可能日である。投資有価証券明細表の銘柄の欄に開示されている利率は期末における適用利率であるが、これらの債券は変動利付債であるため、情報提供の目的のみで表示されている。

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

(c) デリバティブ商品

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

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

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

当期において、当ファンドはスワップ取引を開始した。スワップ取引によって、買い手は一定期間内に予め設定された利率で金利スワップ取引を行う権利(義務ではない)を得る。スワップ取引の買い手は当該権利について売りにプレミアムを支払う。売建スワップ取引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。買建スワップ取引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取引を売る、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)を受け取ることになる。

事後通告証券(To Be Announced Securities)(以下「TBA」という。)は、米国政府系機関が発行するモーゲージ担保証券に関連するものである。これらの機関は通常、モーゲージ・ローンをプールし、組成されたプールの持分を販売する。TBAは、将来の決済に関して購入または売却される、これ

らの機関の将来のプールに関連しており、金利または償還日のいずれかが確定していない。T B A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。T B Aの売却による手取金は、契約上の決済日まで受領しない。T B A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)T B A購入契約を保有する。二者の取引相手が同一のT B A契約に対して相殺対象となる取引を行っている場合、これらの取引は相殺される。決済日において売り手は、約定日の2日前に指定された有価証券を引渡し、約定日に指定された現金を受け取る。ただし実務上は、ほとんどのT B A取引において、最終的に不動産担保証券現物の引渡しは行われぬ。売り手は、現物を決済するのではなく、満期前に残存取引を解消または「ロール」する。

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

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

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

(d) 為替換算

各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券の取得原価は、購入時の為替レートで換算されている。各ファンドの基準通貨以外の通貨建の投資有価証券およびその他の資産は、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 中国人民幣
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
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

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
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「CNH」という。）に関連するものであり、オンショア中国人民元（以下「CNY」という。）に関連するものではない。CNHの価値は、中国政府により随時適用される外国為替管理政策および還流制限ならびにその他外部の市場原理を含むがこれらに限定されない複数の要因により、CNYの価値と大幅に異なる可能性もある。CNHとCNYの相違は、投資家に悪影響を与える可能性がある。

(g) 希薄化

取締役は、ファンドの投資証券1口当たり純資産価額を調整して当該ファンドが受ける「希薄化」の影響を軽減することがある。希薄化は、ファンドの原資産を購入または売却する実際のコストが、取引および仲介手数料、税金および関税、市場の動き、原資産の購入価格と売却価格間のスプレッド等の要因により、当該ファンドにおける原資産の帳簿価額を逸脱している場合に生じる。希薄化は、ファンドの価値に悪影響を及ぼし、その結果投資主に影響を与える可能性がある。投資証券1口当たり純資産価額を調整することにより、この影響を軽減または回避して、投資主を希薄化による影響から保護することができる。いずれかの取引日において、当該ファンドの全投資証券クラスの総取引の価値によって、当該ファンドに対して取締役が設定する1つ以上の基準値を超える投資証券の純増減が生じた場合、取締役は当該ファンドの純資産価額を調整することがある。ある取引日にファンドの純資産価額を調整できる金額は、当該ファンドの市場取引の予想コストに関連している。このような状況において、関連するファンドの純資産価額は、純資産価額の1.50%（債券ファンドの場合は3%）を超えない金額で調整

されることがある。例外的な状況において取締役は、投資主の利益のため、上記の最大変動要因を一時的に引き上げ、その旨を投資家に通知する場合がある。純変動により当ファンドの全投資証券の価値が増加した場合は加算調整となり、価値が減少した場合には減算調整となる。特定の株式市場および管轄区域においては、特に関税および税金に関して、買い手側と売り手側で課金構造が異なる場合があるため、結果として生じる調整は、販売純額（流入）と買戻し純額（流出）で異なることがある。さらに、取締役は、調整額に特別な財務上の費用を含めることに同意することもある。これらの特別な財務上の費用は市場ごとに異なり、現時点ではその純資産価額の2.5%を超えないものと予想されている。ファンドが主に国債や短期金融証券などの特定の資産タイプに投資する場合、取締役はそのような調整を行うことが適切でないと判断する可能性がある。

英文目論見書のアペンディクスBの17.3（訳注：原文の参照番号）に従い、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・マーケッツ・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・マーケッツ・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が有価証券を取得、発行または処分しなかった場合には発生していなかったであろうコストである。有価証券の当初認識時に、有価証券は、その取得または発行に直接帰属する取引費用を加えた時価で測定される。

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

(i) その他の取引に係る外国通貨

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

(j) 公正価値評価

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 中国人民幣	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 中国人民幣	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
ESG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
ESG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
ESG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

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 (%)
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
USドル・ボンド・ファンド	米ドル	131,111	0.03
USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	米ドル	6,472,533	0.33
US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。

(l) 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

論見書のアペンドイクスBの17.3項(訳注:原文の参照番号)に記載されているとおり、該当ファンドの純資産価額への調整を反映している)、毎日発生し、毎月支払われる。

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

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

アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド、アジアン・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・モデレート・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、ヨーロピアン・フォーカス・ファンド、ヨーロピアン・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・アジアン・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、システムティック・グローバル・サステイナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド、システムティック・サステイナブル・グローバル・スモールキャップ・ファンド、USドル・ボンド・ファンドおよびUSサステイナブル・エクイティ・ファンドの継続的経費(ongoing charge)は、損益および純資産変動計算書の年次サービス料と相殺される差額に上限が定められている。

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

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

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

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

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

ブラックロック・グループの従業員でない取締役は、遂行した役務の対価として報酬を受領する。ブラックロック・グループの従業員でない当社の取締役は、税込みで年間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/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JおよびクラスXの投資証券の場合には純資産価額に対して年率0.01%の税金が課される。当該税金は、各ファンドの該当四半期末(暦年)の純資産価額に基づき、四半期毎に支払われる。ルクセンブルグにおいて、投資証券の発行に伴う印紙税またはその他の税金は支払われない。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「FTT」という。)またはその他の取引税といった税金が課される場合がある(例えば、英国の印紙税、フランスのFTT)。

源泉徴収税

当社が受け取る投資に係るキャピタル・ゲイン、配当金および利息は、その支払元の国において源泉徴収税が課せられる場合がある。当社が所得税を免除されているため、かかる源泉徴収税は通常、回収でき

ない。しかしながら、最近の欧州連合における判例法によって、欧州連合諸国においてそのような回収不能の税金が減額される可能性が出てきた。市民権を有する国、居住国、または住所を登録している国の法律に基づいて、投資証券の販売、購入、保有、買戻し、転換、売却において課せられる可能性がある税金について、投資家は熟知するとともに、専門家に適時に相談すべきである。投資家は、課税の水準および課税の標準ならびに課税の軽減が変更される可能性があることに留意する必要がある。源泉徴収税の負担の可能性については、英文目論見書においてさらに説明されている。

9. 投資顧問会社

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

すべての投資顧問会社は、ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エーにより直接任命されている。すべての副投資顧問会社は関連する投資顧問会社により任命されている。これらのうちの数社は、投資顧問会社として以下の会社に業務の一部を再委託している。ブラックロック・ジャパン株式会社(以下「BLKJap」という。)、ブラックロック・アセット・マネジメント・ノースアジア・リミテッド(以下「BAMNA」という。)およびブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(以下「BLKAus」「BIMAL」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	BIMUK	BAMNA
アジアン・グロース・リーダーズ・ファンド	BIMUK	BAMNA
アジアン・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BSL	-
アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド	BIMUK、BSL、 BIMLLC	BAMNA、 BLKAus
アジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
アジアン・タイガー・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
ブラウン・トゥ・グリーン・マテリアルズ・ファンド*	BIMUK	-
チャイナ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
チャイナ・ファンド	BIMUK	BAMNA
チャイナ・インパクト・ファンド*	BIMUK	BAMNA
チャイナ・イノベーション・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
チャイナ・マルチアセット・ファンド*	BSL、BFM	BAMNA、 BLKAus
チャイナ・オンショア・ボンド・ファンド	BSL	-
サーキュラー・エコノミー・ファンド	BIMUK	-
クライメイト・アクション・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
クライメイト・アクション・マルチアセット・ファンド*	BIMUK	-
コンチネンタル・ヨーロッパ・フレキシブル・ファンド	BIMUK	-
ディベロップド・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ダイナミック・ハイ・インカム・ファンド	BIMUK、BFM、 BSL	BAMNA、 BIMAL
エマージング・ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
エマージング・マーケット・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
エマージング・マーケット・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
エマージング・マーケット・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・ファンド	BIMUK、BIMLLC	BAMNA
エマージング・マーケット・インパクト・ボンド・ファンド*	BIMUK、BIMLLC	-
エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	BAMNA
エマージング・マーケット・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・コーシャス・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・グロース・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGフレックス・チョイス・モデレート・ファンド	BIMUK	BAMNA
ESGグローバル・コンサバティブ・インカム・ファンド*	BFM、BIMUK	-
ESGグローバル・マルチアセット・インカム・ファンド*	BIMUK、BIMLLC、 BSL、BFM	BAMNA
ESGマルチアセット・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BFM、BSL	BIMAL
ユーロ・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・リザーブ・ファンド	BIMUK	-
ユーロ・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL	BIMAL
ユーロ・マーケット・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・エクイティ・インカム・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・フォーカス・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・ハイ・イールド・ボンド・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・スペシャル・シチュエーションズ・ファンド	BIMUK	-
ヨーロッパ・サステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMUK	-
ヨーロッパ・バリュー・ファンド	BIMUK	-
フィンテック・ファンド	BIMUK	-
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK、BFM、BSL	BLKAus
フューチャー・コンシューマー・ファンド*	BIMUK	-
フューチャー・オブ・トランスポート・ファンド	BIMUK	-
グローバル・アロケーション・ファンド	BIMLLC、BSL	-
グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド	BIMUK、BSL、BFM	-
グローバル・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
インパクト・ボンド・ファンド*	BIMUK、BFM	-
インド・ファンド	BIMUK、BSL	BAMNA
ジャパン・フレキシブル・エクイティ・ファンド	BIMUK	BAMNA、 BLKJap
ジャパン・スモール・アンド・ミッドキャップ・オポチュニティーズ・ファンド	BIMUK	BLKJap

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
ラテン・アメリカン・ファンド	BIMUK、BIMLLC	-
マルチテマ・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	-
サステナブル・アジア・ボンド・ファンド	BSL	-
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*	BIMUK、BFM	-
サステナブル・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	-
サステナブル・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
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*	BIMUK、BSL、BFM	BLKAus
サステナブル・グローバル・アロケーション・ファンド*	BIMUK、BIMLLC、BSL	-
サステナブル・グローバル・ボンド・インカム・ファンド	BIMUK、BFM	-
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⁾	BIMLLC	-
サステナブル・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	-
システムティック・チャイナ・A株式・オポチュニティーズ・ファンド	BIMLLC	-
システムティック・チャイナ・エンパイロメント・テック・ファンド*	BIMLLC、BFM	-
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 ⁽⁴⁾ *	BIMLLC、BIMUK、BFM	-
システムティック・グローバル・エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	BIMUK	-
システムティック・グローバル・サステナブル・インカム・アンド・グロース・ファンド	BIMUK、BFM	-
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	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・インパクト・ファンド	BFM	-
USグロース・ファンド	BIMLLC	-

ファンド	投資顧問会社	副投資顧問会社
USミッドキャップ・バリュウ・ファンド	BIMLLC	-
USサステイナブル・エクイティ・ファンド*	BIMLLC	-
ワールド・エネルギー・ファンド	BIMUK	-
ワールド・フィナンシャルズ・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ゴールド・ファンド	BIMUK	-
ワールド・ヘルスサイエンス・ファンド	BIMLLC	-
ワールド・マイニング・ファンド	BIMUK	-
ワールド・リアル・エステート・セキュリティーズ・ファンド	BIMUK、BIMLLC、 BSL	BIMAL
ワールド・テクノロジー・ファンド	BIMLLC	-

* 当該ファンドは香港では認可されておらず、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英ポンド・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英ポンド・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
サステイナブル・エネルギー・ファンド	クラスD毎年分配英国報告型投資証券	409	6,998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(チャンネル・アイランズ)リミテッドに一部の管理事務代行を任命した。

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

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

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「 」と示されているとおり、クロス・アンブレラ型投資有価証券を保有しており、その時価は結合純資産総額の0.12%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 (%)
アジアン・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
アジアン・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・アジアン・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・インパクト・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 - US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・アジアン・ 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/エヌブイは、外国為替取引および通貨管理/ヘッジ・プログラムにおける当ファンドの保管銀行であった。これらの取引に関連して支払った手数料合計は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リサーチ・サービスを購入するために再配分することができる。リサーチに資金提供した人だけでなく広範な顧客もリサーチの利用が可能のため、かかる取り決めにより1つのファンドだけでなく他のファンドも恩恵を受けることができる。ブラックロック・グループは、適格なサービスのみを購入し、過度のコミッションは適格なサービス提供者に再配分する(該当があれば)ようにするため、コミッションの使用に関する方針を設定している。当期に締結したソフト・ダラー契約はなかった。

12. デリバティブ商品

当ファンドは、英文目論見書に詳述されているとおり、デリバティブ商品を売買することがある。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 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・マーケット・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)およびスワップシジョンに係る担保/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
アジアン・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)
アジアン・マルチアセット・インカム・ファンド	米ドル	32,298	(5,165)	79,000	-
アジアン・サステイナブル・エクイティ・ファンド	米ドル	-	-	11	-
アジアン・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	-

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
ESG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)
ESG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)
ESG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 ションズ・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)
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)
インパクト・ボンド・ファンド	ユーロ	74,941	-	91,007	(27,839)
インド・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)

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
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)
システムティック・チャイナ・A株式・ オポチュニティーズ・ファンド	米ドル	-	-	300,219	-
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	米ドル	-	-	10,105	-
システムティック E S G マルチ・アロー ケーション・クレジット・ファンド	米ドル	-	-	133,568	(10,757)
システムティック・グローバル・ エクイティ・ハイ・インカム・ファンド	米ドル	-	-	227,983,119	(14,948,699)
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	米ドル	-	-	1,633,141	(88,754)
システムティック・サステイナブル・ グローバル・スモールキャップ・ファンド	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)
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分配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。

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英ポンド・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英ポンド・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英ポンド・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英ポ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・エンバイロメンタル・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	アジアン・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سد・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
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

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	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	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	USガバメント・モーゲージ・インパクト・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	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスSRユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスSR米ドル無分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスSR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	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスSR英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
2023年12月6日	USガバメント・モーゲージ・インパクト・ファンド	クラスSR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英ポ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ZI英ポ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	US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	US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
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

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

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

クラスE無分配投資証券
 クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスE英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
 クラスEポーランド・ズロチ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスE米ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスE無分配英国報告型投資証券
 クラスEユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラス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 毎年分配型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券
 クラスI 毎年分配英国報告型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスI米ドル・ヘッジ毎年分配英国報告型投資証券
 クラスI 毎月総収益分配型投資証券
 クラスI 毎月分配型投資証券
 クラスIカナダ・ドル・ヘッジ毎月分配型投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ毎月分配英国報告型投資証券
 クラスI 毎四半期総収益分配型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期総収益分配型投資証券
 クラスI 毎四半期分配型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスI円ヘッジ毎四半期分配型投資証券
 クラスI 毎四半期分配英国報告型投資証券
 クラスIスイス・フラン・ヘッジ毎四半期分配
 英国報告型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ毎四半期分配英国報告型投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ毎四半期分配英国報告型
 投資証券

クラスI 安定毎月総収益分配型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
 クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ安定毎月
 総収益分配型投資証券
 クラスI米ドル・ヘッジ安定毎月総収益分配型投資証券
 クラスI無分配投資証券
 クラスI豪ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIブラジル・レアル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIカナダ・ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
 クラスI円ヘッジ無分配投資証券
 クラスIノルウェー・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスIシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスI米ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスI無分配英国報告型投資証券
 クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスI米ドル・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラスJ *

クラスJ 毎月分配型投資証券

クラスJ 無分配投資証券

クラスS

クラスS 毎年分配型投資証券
 クラスSユーロ・ヘッジ毎年分配型投資証券
 クラスS 毎月総収益分配英国報告型投資証券
 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 毎月分配型投資証券
 クラスS 毎四半期総収益分配型投資証券
 クラスS 毎四半期分配型投資証券
 クラスS 無分配投資証券
 クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券

クラスSユーロ・ヘッジ無分配投資証券
 クラスS英ポンド・ヘッジ無分配投資証券
 クラスSシンガポール・ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスS米ドル・ヘッジ無分配投資証券
 クラスS 無分配英国報告型投資証券
 クラスSスイス・フラン・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスSユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券
 クラスS英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券

クラス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 毎年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 安定毎月総収益分配型投資証券
 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。

()ネクスト・ジェネレーション・テクノロジー・ファンド

クラスA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～	7,008,585	15,266,291	38,502,034
2024年3月31日	(7,001,472)	(15,046,358)	(38,041,778)

(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。

()USドル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド

クラスA毎月分配型投資証券

	販売口数	買戻口数	発行済口数
2023年4月1日～	6,947,019	7,117,258	7,607,767
2024年3月31日	(6,599,815)	(6,288,071)	(6,880,315)

(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。

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～	2,265,238	3,406,878	13,435,801
2024年3月31日	(2,265,238)	(3,350,470)	(13,394,456)