

【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7月31日
【計算期間】	第17期中（自 2023年11月1日 至 2024年4月30日）
【発行者名】	フォーカス・シキャブ （Focused SICAV）
【代表者の役職氏名】	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ ロバート・スティンガー（Robert Süttinger） メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ イオアナ・ナウム（Ioana Naum）
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL-1855、J.F.ケネディ通り33A （33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg）
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三 浦 健 弁護士 大 西 信 治
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三 浦 健 弁護士 大 西 信 治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03（6212）8316
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

- （注1）米ドルの円貨換算は、便宜上、2024年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝156.74円）による。以下、別段の記載がない限り、米ドルの円換算表示はすべてこれによるものとする。
- （注2）ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドル建てまたは円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドルまたは円貨をもって行う。
- （注3）本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してまたは切り捨てて記載してある。従って、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。従って、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。
- （注4）本書の中で計算期間（以下「会計年度」ともいう。）とは、別段の記載がない限り11月1日に始まり翌年10月31日に終わる1年を指す。

1【外国投資法人の概況】

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

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

（1）【主要な経営指標等の推移】

（フォーカス・シキャブ—グローバル・ボンド）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年10月末日 に終了する 会計年度末	2024年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	－75,031,015.23	－131,252,349.23	52,655,555.95	13,615,310.44	23,422,575.52
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	－75,031,015.23	－131,252,349.23	52,655,555.95	13,615,310.44	23,422,575.52
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	－75,031,015.23	－131,252,349.23	52,655,555.95	13,615,310.44	23,422,575.52
(d) 出資総額 ⁽²⁾	561,673,497.74	489,370,994.22	563,494,469.14	524,613,168.97	568,244,499.07
(e) 発行済投資口総数 (クラス米ドルF—acc投資証券)	1,525,890.076口	1,422,679.471口	1,461,804.292口	1,550,471.086口	1,664,888.765口
(e) 発行済投資口総数 (クラス円ヘッジF—acc投資証券)	543,409.208口	610,933.208口	889,515.500口	726,945.500口	650,758.500口
(f) 純資産額	561,673,497.74	489,370,994.22	563,494,469.14	524,613,168.97	568,244,499.07
(g) 資産総額	565,873,989.24	496,344,088.45	566,270,894.00	528,517,055.69	571,964,496.49
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス米ドルF—acc投資証券)	151.80	142.75	150.12	144.78	152.82
(h) 1口当たり純資産価格 (クラス円ヘッジF—acc投資証券)	10,244円	9,521円	9,771円	9,161円	9,388円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス米ドルF—acc投資証券)	－11.71	－22.08	7.18	1.52	7.58
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラス円ヘッジF—acc投資証券)	－17.18円	－29.64円	4.44円	－6.59円	－0.67円
(j) 分配総額	553,230.65	553,230.65	502,657.08	502,657.08	677,937.48
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	99.26%	98.60%	99.51%	99.26%	99.35%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス米ドルF—acc投資証券)	－6.69%	－12.57%	－1.11%	1.42%	1.80%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラス円ヘッジF—acc投資証券)	－7.02%	－13.79%	－4.62%	－3.78%	－3.92%

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

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

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

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

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

（フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年10月末日 に終了する 会計年度末	2024年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	－176,409,579.89	－308,641,886.92	166,076,473.45	111,987,790.09	58,264,561.26
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	－176,409,579.89	－308,641,886.92	166,076,473.45	111,987,790.09	58,264,561.26
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	－176,409,579.89	－308,641,886.92	166,076,473.45	111,987,790.09	58,264,561.26
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,757,025,004.99	2,769,676,669.98	1,974,834,530.78	1,914,151,319.53	1,935,953,985.83
(e) 発行済投資口総数					
（クラスF－acc投資証券）	4,228,885.081口	7,512,225.343口	4,943,631.818口	5,138,765.836口	5,278,490.494口
（クラス円ヘッジF－acc投資証券）	160,397.000口	156,900.000口	136,064.000口	121,464.000口	92,609.000口
(f) 純資産額	1,757,025,004.99	2,769,676,669.98	1,974,834,530.78	1,914,151,319.53	1,935,953,985.83
(g) 資産総額	1,814,445,503.63	2,778,839,418.74	1,994,227,084.33	1,930,136,686.34	1,981,578,528.57
(h) 1口当たり純資産価格					
（クラスF－acc投資証券）	150.23	146.46	151.82	150.64	154.44
（クラス円ヘッジF－acc投資証券）	9,810円	9,450円	9,552円	9,208円	9,171円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額					
（クラスF－acc投資証券）	－10.19	－8.83	5.36	4.13	4.11
（クラス円ヘッジF－acc投資証券）	－11.38円	－24.05円	7.86円	－1.09円	－1.87円
(j) 分配総額	1,495,530.58	－1,495,530.58	3,967,559.85	3,967,559.85	4,761,793.67
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	96.84%	99.67%	99.03%	99.17%	97.70%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾					
（クラスF－acc投資証券）	－5.00%	－6.91%	1.06%	2.85%	1.73%
（クラス円ヘッジF－acc投資証券）	－5.30%	－8.21%	－2.63%	－2.56%	－3.99%

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

（フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年10月末日 に終了する 会計年度末	2024年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	－499,403,795.46	－930,113,142.70	473,858,628.42	143,727,492.20	131,861,172.65
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	－499,403,795.46	－930,113,142.70	473,858,628.42	143,727,492.20	131,861,172.65
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	－499,403,795.46	－930,113,142.70	473,858,628.42	143,727,492.20	131,861,172.65
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,718,475,442.60	4,251,345,080.56	3,516,023,390.26	3,763,123,391.83	4,270,929,274.20
(e) 発行済投資口総数 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	7,631,786.057口 346,604.000口	9,898,397.723口 336,555.000口	6,957,467.703口 296,384.000口	8,240,445.712 270,815.000口	9,132,968.109口 213,646.000口
(f) 純資産額	3,718,475,442.60	4,251,345,080.56	3,516,023,390.26	3,763,123,391.83	4,270,929,274.20
(g) 資産総額	3,826,394,458.84	4,300,368,637.20	3,563,455,601.76	3,777,900,206.33	4,384,248,141.03
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	184.96 9,700円	173.57 8,978円	185.60 9,344円	173.31 8,473円	180.16 8,544円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	－18.63 －15.81円	－26.19 －31.05円	16.23 9.37円	2.95 －2.89円	5.84 －0.55
(j) 分配総額	5,681,392.75	5,681,392.75	8,552,600.33	8,552,600.33	14,900,522.20
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.18%	98.86%	98.67%	99.61%	97.42%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	－8.77% －9.18%	－14.75% －16.16%	0.35% －3.67%	－0.15% －5.62%	－2.93% －8.56%

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

（フォーカス・シキャブ－USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年10月末日 に終了する 会計年度末	2024年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	－245,867,590.97	－392,253,088.84	201,960,611.04	116,803,682.32	75,125,651.05
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	－245,867,590.97	－392,253,088.84	201,960,611.04	116,803,682.32	75,125,651.05
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	－245,867,590.97	－392,253,088.84	201,960,611.04	116,803,682.32	75,125,651.05
(d) 出資総額 ⁽²⁾	1,653,392,525.45	1,530,016,585.03	1,718,223,339.61	1,386,728,965.84	1,437,414,337.22
(e) 発行済投資口総数 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	4,858,129.171口 307,960.000口	4,430,677.383口 315,140.000口	4,444,732.866口 301,372.000口	3,413,013.935口 295,090.000口	3,293,774.342口 263,420.000口
(f) 純資産額	1,653,392,525.45	1,530,016,585.03	1,718,223,339.61	1,386,728,965.84	1,437,414,337.22
(g) 資産総額	1,698,018,554.47	1,558,427,225.54	1,805,470,467.57	1,392,733,491.74	1,440,599,483.17
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	111.83 9,090円	106.61 8,565円	113.35 8,868円	110.54 8,409円	116.63 8,614円
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	－9.87 －11.24円	－15.91 －23.24円	6.88 7.85円	5.67 －1.76円	6.30 －0.45円
(j) 分配総額	8,069,998.16	8,069,998.16	10,354,537.78	10,354,537.78	12,192,000.72
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.37%	98.18%	95.17%	99.57%	99.78%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF－acc投資証券) (クラス円ヘッジF－acc投資証券)	－7.36% －9.10%	－12.09% －13.44%	1.36% －2.44%	3.69% －1.82%	2.89% －2.86%

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

(フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2022年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2022年10月末日 に終了する 会計年度末	2023年4月末日 に終了する 中間会計年度末	2023年10月末日 に終了する 会計年度末	2024年4月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	-361,752,016.82	-573,331,727.97	238,090,901.60	37,512,336.88	72,730,345.16
(b) 経常利益金額または 経常損失金額	-361,752,016.82	-573,331,727.97	238,090,901.60	37,512,336.88	72,730,345.16
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	-361,752,016.82	-573,331,727.97	238,090,901.60	37,512,336.88	72,730,345.16
(d) 出資総額 ⁽²⁾	2,452,508,305.33	2,039,391,807.27	2,254,159,589.48	2,191,058,367.97	2,032,915,519.14
(e) 発行済投資口総数 (クラスF-acc投資証券)	7,153,999.415口	6,291,999.182口	6,305,616.293口	6,651,225.456口	6,114,161.086口
(f) 純資産額	2,452,508,305.33	2,039,391,807.27	2,254,159,589.48	2,191,058,367.97	2,032,915,519.14
(g) 資産総額	2,520,103,661.41	2,047,264,759.38	2,266,933,036.13	2,223,324,048.89	2,143,223,701.68
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF-acc投資証券)	106.35	99.73	106.18	99.09	102.71
(i) 1口当たり当期純利益金額 または当期純損失金額 (クラスF-acc投資証券)	-10.50	-18.49	6.50	-0.75	4.05
(j) 分配総額	435,081.97	435,081.97	448,615.55	448,615.55	975,967.17
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.32%	99.62%	99.44%	98.55%	94.85%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF-acc投資証券)	-8.76%	-14.88%	-0.16%	-0.64%	-3.27%

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

（２）【外国投資法人の出資総額】

2024年５月末日現在の出資総額および発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、原則として、発行可能投資口総口数には制限がない。

	出資総額		発行済投資証券総数（口）	
	千米ドル	百万円		
フォーカス・シキャブ ーグローバル・ボンド	589,245.53	92,358	クラス米ドル F-acc投資証券	1,704,456.717
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	662,741.500
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ボンド ・米ドル	1,976,243.29	309,756	クラス F-acc投資証券	5,276,047.999
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	92,045.000
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド ・米ドル	4,465,594.45	699,937	クラス F-acc投資証券	9,072,578.191
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	213,973.000
フォーカス・シキャブ ーUSコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	1,420,938.57	222,718	クラス F-acc投資証券	3,319,369.931
			クラス円ヘッジ F-acc投資証券	260,790.000
フォーカス・シキャブ ーワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	2,069,469.97	324,369	クラス F-acc投資証券	6,033,708.552

（３）【主要な投資主の状況】

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

（４）【役員の状況】

（2024年5月末日現在）

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

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

（５）【その他】

a. 定款の変更

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

b. 事業譲渡または事業譲受

本投資法人およびそのサブ・ファンドの解散

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

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

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

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

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

下記「本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会」の項の規定が投資主総会の決定のために適宜適用される。取締役会はまた、上記に記載される規定に従い一サブ・ファンドまたは投資証券クラスを解散または清算できる。

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

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

「合併」とは、以下の取引である。

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

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

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

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

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

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

本投資法人の総会または関係するサブ・ファンドの投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

半期報告書提出日前6か月以内において、訴訟事件その他本投資法人に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実はない。

2【外国投資法人の運用状況】

(1)【投資状況】

資産別および地域別の投資状況
(フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド)

(2024年5月末日現在)

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

債券	アメリカ合衆国	137,864,778.08	23.35
	中国	48,398,015.10	8.20
	イギリス	31,054,505.07	5.26
	フランス	27,710,154.20	4.69
	日本	25,691,894.31	4.35
	オーストラリア	18,576,021.73	3.15
	ニュージーランド	17,798,428.90	3.01
	スペイン	17,114,533.12	2.90
	カナダ	16,078,704.41	2.72
	ドイツ	15,664,772.73	2.65
	オランダ	13,811,693.15	2.34
	韓国	9,940,939.12	1.68
	イタリア	9,346,440.89	1.58
	アイルランド	8,285,264.67	1.40
	ベルギー	6,681,761.21	1.13
	ルクセンブルグ	6,560,532.57	1.11
	スイス	5,399,442.38	0.91
	国際機関	4,320,788.32	0.73
	インド	3,538,362.60	0.60
	スウェーデン	3,444,039.14	0.58
	スロベニア	2,655,850.46	0.45
	ケイマン諸島	2,362,813.54	0.40
	ノルウェー	2,151,847.97	0.36
	ポーランド	1,909,726.18	0.32
	チリ	1,664,090.62	0.28
	サウジアラビア	1,606,478.00	0.27
	シンガポール	1,168,519.76	0.20
	バミューダ	1,035,835.72	0.18
	デンマーク	986,608.64	0.17
	ラトビア	877,707.60	0.15
	ルーマニア	797,472.00	0.14
	フィンランド	631,100.03	0.11
	香港	629,577.87	0.11
	オーストリア	542,280.00	0.09
	メキシコ	305,827.50	0.05
	ペルー	253,125.00	0.04
	ガーンジー	103,674.80	0.02
	小計	446,963,607.39	75.70
不動産担保証券、 アセットバック証券 およびその他の ディスカウント債券	アメリカ合衆国	64,659,596.65	10.95

投資信託	ルクセンブルグ	3,889,245.64	0.66
株式	イギリス	959,955.48	0.16
ポートフォリオ合計		516,472,405.16	87.48
現金・その他資産		73,937,489.10	12.52
資産総額		590,409,894.26	100.00
負債総額		1,164,363.96	0.20
合計（純資産総額）		589,245,530.30 (約92,358百万円)	99.80

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

（フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル）

（2024年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（%）
債券	アメリカ合衆国	1,136,387,337.69	57.39
	国際機関	218,877,618.17	11.05
	カナダ	116,678,738.92	5.89
	フランス	65,431,946.91	3.30
	ドイツ	64,459,816.87	3.26
	オーストラリア	53,310,244.49	2.69
	韓国	45,987,570.00	2.32
	スウェーデン	38,096,890.11	1.92
	オランダ	32,134,018.60	1.62
	イギリス	25,837,927.10	1.30
	カタール	24,897,465.00	1.26
	ノルウェー	24,325,879.69	1.23
	アラブ首長国連邦	21,307,460.00	1.08
	シンガポール	16,305,264.36	0.82
	フィンランド	13,930,154.76	0.70
	イギリス領ヴァージン諸島	6,486,060.00	0.33
	ベルギー	6,397,906.69	0.32
	日本	6,295,597.98	0.32
	ルクセンブルグ	5,012,000.00	0.25
	ケイマン諸島	4,752,100.50	0.24
	ジャージー	3,904,553.00	0.20
	オーストリア	3,711,121.95	0.19
	香港	2,915,397.20	0.15
	小計	1,937,443,069.99	97.85
短期金融商品	アメリカ合衆国	14,780,535.45	0.75
ポートフォリオ合計		1,952,223,605.44	98.60
現金・その他資産		27,734,533.80	1.40
資産総額		1,979,958,139.24	100.00
負債総額		3,714,851.09	0.19
合計（純資産総額）		1,976,243,288.15 （約309,756百万円）	99.81

（フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

（2024年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率（%）
債券	アメリカ合衆国	2,874,525,672.51	64.33
	国際機関	571,418,468.15	12.79
	カナダ	191,595,457.55	4.29
	アラブ首長国連邦	114,458,039.00	2.56
	ドイツ	94,922,519.75	2.12
	フランス	88,138,553.76	1.97
	香港	59,888,801.99	1.34
	オランダ	58,812,693.65	1.32
	カタール	55,532,900.00	1.24
	韓国	54,939,305.00	1.23
	オーストラリア	48,164,434.83	1.08
	ノルウェー	45,300,400.48	1.01
	スウェーデン	25,090,485.00	0.56
	シンガポール	18,885,732.65	0.42
	イギリス領ヴァージン諸島	16,157,492.00	0.36
	フィンランド	16,054,600.00	0.36
	ベルギー	7,770,091.85	0.17
	ジャージー	7,544,345.87	0.17
	小計	4,349,199,994.04	97.33
投資信託	アイルランド	20,000,000.00	0.45
ポートフォリオ合計		4,369,199,994.04	97.78
現金・その他資産		99,163,885.97	2.22
資産総額		4,468,363,880.01	100.00
負債総額		2,769,427.32	0.06
合計（純資産総額）		4,465,594,452.69 (約699,937百万円)	99.94

（フォーカス・シキャブ－USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

（2024年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率 （%）
債券	アメリカ合衆国	963,803,537.04	67.53
	イギリス	109,120,794.88	7.65
	オーストラリア	63,583,876.26	4.45
	オランダ	42,009,382.26	2.94
	アイルランド	41,405,953.11	2.90
	カナダ	31,167,560.72	2.18
	スペイン	28,180,256.91	1.97
	フランス	27,243,514.02	1.91
	ノルウェー	14,060,127.26	0.99
	シンガポール	10,729,556.26	0.75
	バミューダ	8,788,340.00	0.62
	多国籍	8,421,524.06	0.59
	ドイツ	7,785,351.22	0.55
	デンマーク	5,513,385.40	0.39
	イタリア	3,973,502.80	0.28
	スウェーデン	3,030,649.38	0.21
	日本	2,523,908.92	0.18
	小計	1,371,341,220.50	96.08
投資信託	ルクセンブルグ	11,480,947.80	0.80
ポートフォリオ合計		1,382,822,168.30	96.88
現金・その他資産		44,476,138.17	3.12
資産総額		1,427,298,306.47	100.00
負債総額		6,359,737.60	0.45
合計 (純資産総額)		1,420,938,568.87 (約222,718百万円)	99.55

（フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

（2024年5月末日現在）

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率 （%）
債券	国際機関	2,039,101,106.97	98.45
ポートフォリオ合計		2,039,101,106.97	98.45
現金・その他資産		32,122,883.88	1.55
資産総額		2,071,223,990.85	100.00
負債総額		1,754,020.05	0.08
合計 （純資産総額）		2,069,469,970.80 （約324,369百万円）	99.92

（２）【運用実績】

①【純資産等の推移】

2024年５月末日までの１年間における各月末の資産総額および純資産の推移は以下のとおりである。

（フォーカス・シキャブ・グローバル・ボンド）

	資産総額		純資産総額		１口当たり 純資産価格 （クラス米ドル F－acc 投資証券）		１口当たり 純資産価格 （クラス円ヘッジ F－acc 投資証券）
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2023年６月末日	551,499.50	86,442	545,733.69	85,538	149.31	23,403	9,630
７月末日	563,625.42	88,343	555,366.04	87,048	149.57	23,444	9,603
８月末日	549,256.77	86,091	547,172.45	85,764	148.93	23,343	9,517
９月末日	534,262.41	83,740	533,716.65	83,655	145.75	22,845	9,271
10月末日	528,517.06	82,840	524,613.17	82,228	144.78	22,693	9,161
11月末日	552,651.22	86,623	550,211.72	86,240	150.31	23,560	9,467
12月末日	574,137.21	89,990	572,024.64	89,659	155.50	24,373	9,735
2024年１月末日	568,848.70	89,161	564,541.77	88,486	155.26	24,335	9,668
２月末日	576,361.76	90,339	571,092.25	89,513	153.99	24,136	9,552
３月末日	583,068.41	91,390	579,513.36	90,833	155.53	24,378	9,605
４月末日	571,964.50	89,650	568,244.50	89,067	152.82	23,953	9,388
５月末日	590,409.89	92,541	589,245.53	92,358	154.46	24,210	9,450

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

（フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル）

	資産総額		純資産総額		１口当たり 純資産価格 （クラスF－acc 投資証券）		１口当たり 純資産価格 （クラス円ヘッジ F－acc 投資証券）
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2023年６月末日	1,879,997.51	294,671	1,877,962.56	294,352	150.08	23,524	9,352
７月末日	1,870,220.47	293,138	1,866,182.95	292,506	150.60	23,605	9,343
８月末日	1,882,937.87	295,132	1,880,731.54	294,786	151.04	23,674	9,320
９月末日	1,831,098.30	287,006	1,828,212.60	286,554	150.51	23,591	9,254
10月末日	1,930,136.69	302,530	1,914,151.32	300,024	150.64	23,611	9,208
11月末日	1,956,420.21	306,649	1,951,293.42	305,846	153.10	23,997	9,313
12月末日	1,895,612.98	297,118	1,894,048.31	296,873	155.37	24,353	9,397
2024年１月末日	1,894,172.22	296,893	1,890,508.23	296,318	155.94	24,442	9,390
２月末日	1,960,037.98	307,216	1,957,634.15	306,840	154.96	24,288	9,288
３月末日	1,995,755.89	312,815	1,992,836.65	312,357	155.61	24,390	9,282
４月末日	1,981,578.53	310,593	1,935,953.99	303,441	154.44	24,207	9,171
５月末日	1,979,958.14	310,339	1,976,243.29	309,756	155.86	24,429	9,211

（フォーカス・シキャブ－ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF－acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F－acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2023年6月末日	3,782,632.00	592,890	3,779,271.27	592,363	181.38	28,430	9,042
7月末日	3,699,940.93	579,929	3,689,578.69	578,305	181.00	28,370	8,982
8月末日	3,741,563.15	586,453	3,736,444.00	585,650	180.19	28,243	8,892
9月末日	3,575,891.30	560,485	3,570,089.67	559,576	175.88	27,567	8,648
10月末日	3,777,900.21	592,148	3,763,123.39	589,832	173.31	27,165	8,473
11月末日	3,928,226.53	615,710	3,917,750.89	614,068	180.48	28,288	8,777
12月末日	4,032,122.22	631,995	4,026,147.97	631,058	186.55	29,240	9,018
2024年1月末日	4,014,989.46	629,309	4,008,202.10	628,246	186.62	29,251	8,978
2月末日	4,303,345.02	674,506	4,296,092.05	673,369	183.49	28,760	8,786
3月末日	4,488,735.11	703,564	4,460,646.81	699,162	184.87	28,977	8,808
4月末日	4,384,248.14	687,187	4,270,929.27	669,425	180.16	28,238	8,544
5月末日	4,468,363.88	700,371	4,465,594.45	699,937	183.19	28,713	8,646

（フォーカス・シキャブ－USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル）

	資産総額		純資産総額		1口当たり 純資産価格 (クラスF－acc 投資証券)		1口当たり 純資産価格 (クラス円ヘッジ F－acc 投資証券)
	千米ドル	百万円	米ドル	円	米ドル	円	円
2023年6月末日	1,690,374.65	264,949	1,687,340.14	264,474	112.38	17,614	8,705
7月末日	1,735,928.08	272,089	1,706,291.67	267,444	113.10	17,727	8,723
8月末日	1,500,913.08	235,253	1,499,097.92	234,969	112.93	17,701	8,669
9月末日	1,435,707.63	225,033	1,428,247.32	223,863	111.37	17,456	8,512
10月末日	1,392,733.49	218,297	1,386,728.97	217,356	110.54	17,326	8,409
11月末日	1,490,703.24	233,653	1,464,138.43	229,489	114.64	17,969	8,677
12月末日	1,513,452.84	237,219	1,512,408.67	237,055	117.79	18,462	8,865
2024年1月末日	1,498,436.61	234,865	1,496,611.36	234,579	118.20	18,527	8,852
2月末日	1,489,463.90	233,459	1,483,104.14	232,462	117.07	18,350	8,728
3月末日	1,490,486.38	233,619	1,489,144.44	233,408	118.18	18,524	8,768
4月末日	1,440,599.48	225,800	1,437,414.34	225,300	116.63	18,281	8,614
5月末日	1,427,298.31	223,715	1,420,938.57	222,718	118.30	18,542	8,696

（フォーカス・シキャブ・ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格 (クラスF－acc投資証券)	
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円
2023年6月末日	2,325,521.55	364,502	2,322,417.34	364,016	103.56	16,232
7月末日	2,280,650.55	357,469	2,276,631.02	356,839	103.36	16,201
8月末日	2,230,935.05	349,677	2,229,411.32	349,438	102.98	16,141
9月末日	2,115,954.22	331,655	2,108,352.38	330,463	100.66	15,777
10月末日	2,223,324.05	348,484	2,191,058.37	343,426	99.09	15,531
11月末日	2,298,086.36	360,202	2,288,608.29	358,716	103.01	16,146
12月末日	2,362,562.18	370,308	2,360,932.41	370,053	106.44	16,683
2024年1月末日	2,264,364.50	354,916	2,262,837.25	354,677	106.60	16,708
2月末日	2,231,261.78	349,728	2,227,679.86	349,167	104.68	16,408
3月末日	2,223,672.69	348,538	2,210,244.30	346,434	105.40	16,520
4月末日	2,143,223.70	335,929	2,032,915.52	318,639	102.71	16,099
5月末日	2,071,223.99	324,644	2,069,469.97	324,369	104.52	16,382

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

②【分配の推移】

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

③【自己資本利益率（収益率）の推移】

2023年6月1日から2024年5月末日までの1年間の自己資本利益率（収益率）は以下のとおりである。

	収益率（%）（注）	
フォーカス・シキャブ ーグローバル・ボンド	クラス米ドルF-acc投資証券	3.28%
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	－2.40%
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	3.14%
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	－2.61%
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	－0.16%
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	－5.89%
フォーカス・シキャブ ーUSコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	クラスF-acc投資証券	5.11%
	クラス円ヘッジF-acc投資証券	－0.75%
フォーカス・シキャブ ーワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	－0.40%

（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2024年5月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計金額を加えた額）

b＝2023年5月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（3）【投資リスク】

- ① 当中間計算期間において、2024年4月30日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 本投資法人が将来にわたって営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ（「管理会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年5月末日現在の株主資本総額は、13,738,000ユーロ（約23億円）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2024年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝169.78円）による。

② UBSアセット・マネジメント（UK）リミテッド（ロンドン）（「投資運用会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年5月末日現在の株主資本総額は、172,000,000英ポンド（約343億円）

（注）英ポンドの円貨換算は、便宜上、2024年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1英ポンド＝199.61円）による。

③ UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）（「投資運用会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年5月末日現在の株主資本総額は、500,000スイスフラン（約8,680万円）

（注）スイスフランの円貨換算は、便宜上、2024年5月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1スイスフラン＝173.60円）による。

④ UBSアセット・マネジメント（アメリカス）エルエルシー（「投資運用会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年5月末日現在の資本金額は、9,067,022米ドル（約14億円）

(2)【大株主の状況】

① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2024年5月末日現在）

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBSアセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,869	100

② UBSアセット・マネジメント（UK）リミテッド（ロンドン）

（2024年5月末日現在）

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBSアセット・ マネジメント・ホールディン グ・リミテッド (UBS Asset Management Holding Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、EC2M 2QS、英国	171,999,999	99.999
フィルドリュー・ ノミニーズ・リミテッド (Phildrew Nominees Ltd)	ブロードゲート 5、ロンドン、EC2M 2QS、英国	1	0.0001

③ UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

（2024年5月末日現在）

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

④ UBSアセット・マネジメント（アメリカス）エルエルシー

（2024年5月末日現在）

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

（３）【役員の状況】

① ＵＢＳファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2024年５月末日現在）

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン ディレクター／ ボード・メンバー	2022年１月１日	ＵＢＳアセット・マネ ジメント・スイス・エ イ・ジー、チューリッ ヒ、スイス ヘッド・オブ・プロダ クト	該当なし
フランチェスカ・ ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター／ ボード・メンバー	2019年12月５日	ＵＢＳファンド・マネ ジメント（ルクセンブ ルグ）エス・エイ、ル クセンブルグ、チー フ・エグゼクティブ・ オフィサー	該当なし
ウジェーヌ・ デル・シオッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年９月２日	ＵＢＳファンド・マネ ジメント（スイス）エ イ・ジー、バーゼル、 スイス チーフ・エグゼクティ ブ・オフィサー	該当なし
アン－シャルロット・ ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年１月１日	ルクセンブルグ大公 国、インディペンデ ント・ディレクター	該当なし

② ＵＢＳアセット・マネジメント（UK）リミテッド（ロンドン）

（2024年５月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有株式
イアン・アシュメント (Ian Ashment)	ディレクター／ ボード・メンバー	2019年10月30日就任	非公開
プリシラ・デイヴィス (Priscilla Davies)	チェアマン	2017年９月20日就任	非公開
キース・マーティン・ ジェックス (Keith Martin Jecks)	ノン・エグゼクティブ・ ディレクター	2018年10月１日就任	非公開
ナスリーン・カセナリー (Nasreen Kasenally)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年９月13日就任	非公開
ギャヴィン・バーンズ (Gavin Byrnes)	ディレクター／ ボード・メンバー	2024年２月12日就任	非公開

③ UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

（2024年5月末日現在）

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

④ UBSアセット・マネジメント（アメリカス）エルエルシー

（2024年5月末日現在）

氏名	役職名	略歴	所有株式
マイケル・ロンゲッティ (Michael Rongetti)	マネジャー	2024年3月1日就任	非公開
ジェームス・ポーチャー (James Poucher)	チェアマン／マネジャー	2024年3月1日就任	非公開
エミリー・クルバック (Emily Kulback)	マネジャー	2024年3月1日就任	非公開
ミーガン・ザベル (Meggan Zabel)	マネジャー	2024年3月1日就任	非公開

（４）【事業の内容及び営業の概況】

① ＵＢＳファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

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

2024年５月末日現在、管理会社は以下のとおり、405本のサブファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	405	431,138,219.44オーストラリア・ドル
			1,909,550,606.06カナダ・ドル
			17,897,965,754.44スイス・フラン
			2,387,718,513.28中国元
			2,953,983,880.21デンマーク・クローネ
			54,479,006,610.89ユーロ
			3,592,789,699.57英ポンド
			293,589,640.08香港ドル
			840,893,693,465.72日本円
			37,338,120.21シンガポール・ドル
			117,543,107,423.94米ドル

② UBSアセット・マネジメント（UK）リミテッド（ロンドン）

2024年5月末日現在、UBSアセット・マネジメント（UK）リミテッド（ロンドン）は100本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日 (年/月/日)	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI World Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2011年8月19日	5,129,592,833
2	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Emerging Markets UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2010年11月12日	3,964,408,617
3	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Japan UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2001年10月30日	3,763,587,608
4	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI United Kingdom UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2013年8月30日	3,597,625,433
5	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI EMU UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2002年9月19日	3,011,345,486
6	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Switzerland 20/35 UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2013年10月31日	2,353,594,711
7	UBS (Lux) Fund Solutions - Bloomberg US Liquid Corporates 1-5 Year UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2014年12月1日	1,898,995,215
8	UBS (Lux) Bond Fund - Euro High Yield (EUR)	契約型投資信託	1998年5月4日	1,821,915,837
9	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI USA Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2011年8月17日	1,563,548,305
10	UBS (Lux) Fund Solutions - MSCI Emerging Markets Socially Responsible UCITS ETF	変動資本を有する 投資法人	2014年9月4日	1,536,193,451

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

③ UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）

2024年5月末日現在、UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー（チューリッヒ）は133本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	4,844,257,863
2	Focused Sicav - High Grade Long Term Bond USD	変動資本を有する 投資法人	2006年10月26日	4,113,480,521
3	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月2日	4,041,657,356
4	UBS (Lux) Bond Sicav - Convert Global (EUR)	変動資本を有する 投資法人	2004年11月18日	3,788,045,386
5	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年8月21日	3,588,310,918
6	UBS (Lux) Money Market Fund - USD	契約型投資信託	1988年11月25日	3,097,835,766
7	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年4月13日	2,938,922,907
8	UBS (Lux) Money Market Fund - EUR	契約型投資信託	1989年10月9日	2,622,217,454
9	UBS (Lux) Institutional Fund - Equities Europe (ex UK ex Switzerland) Passive II	契約型投資信託	2020年5月13日	2,523,330,915
10	Multi Manager Access - Green, Social and Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2022年3月10日	2,057,121,119

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

④ UBSアセット・マネジメント（アメリカス）エルエルシー

2024年5月末日現在、UBSアセット・マネジメント（アメリカス）エルエルシーは59本のサブ・ファンドを運用しており、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは、以下のとおりである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Real Estate Funds Selection - Global	変動資本を有する 投資法人	2008年6月30日	6,208,552,723
2	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	5,054,472,570
3	Multi Manager Access II - US Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年11月27日	4,844,257,863
4	Multi Manager Access II - Emerging Markets Debt	変動資本を有する 投資法人	2013年12月2日	4,041,657,356
5	Multi Manager Access II - European Multi Credit Sustainable	変動資本を有する 投資法人	2007年8月21日	3,588,310,918
6	Multi Manager Access II - High Yield	変動資本を有する 投資法人	2016年4月13日	2,938,922,907
7	UBS (Lux) Equity Sicav - USA Growth (USD)	変動資本を有する 投資法人	2004年10月8日	2,222,902,310
8	Focused Fund - Corporate Bond Sustainable USD	契約型投資信託	2003年9月9日	1,934,563,462
9	Manager Opportunities Access - Risk Parity Strategies Fund	変動資本を有する 投資法人	2017年4月28日	1,806,268,593
10	UBS (Lux) Bond Sicav - USD Investment Grade Corporates Sustainable (USD)	変動資本を有する 投資法人	2017年1月30日	1,633,959,362

(注1) 一単位当たり純資産価格は開示していない。

(注2) 上記は管理会社から提供された情報に基づく。

4【外国投資法人の経理状況】

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第328条第5項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、フォーカス・シキャブおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンド（フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド、フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル、フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびフォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル）に関連する部分のみを翻訳している。なお、グローバル・ボンド、ハイ・グレード・ボンド・米ドル、ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル、USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドルおよびワールドバンク・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドルには以下に記載した投資証券以外の投資証券も存在するが、以下に記載した投資証券に関連する部分を抜粋して日本語に記載している。
- グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc投資証券
グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc投資証券
ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券
ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券
ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券
USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc投資証券
USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc投資証券
ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc投資証券
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2024年5月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝156.74円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

純資産計算書

	2024年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	584,478,485.81	91,611,158
投資有価証券、未実現評価（損）益	(73,005,368.96)	(11,442,862)
投資有価証券合計（注１）	511,473,116.85	80,168,296
現金預金、要求払預金および預託金勘定	53,006,148.48	8,308,184
その他の流動資産（マージン）	1,584,013.91	248,278
有価証券売却未収金（注１）	242,411.07	37,996
発行未収金	828,162.87	129,806
有価証券に係る未収利息	4,829,577.84	756,988
流動資産にかかる未収利息	1,065.47	167
資産合計	571,964,496.49	89,649,715
負 債		
TBAモーゲージ担保証券未実現損失（注１）	(101,446.47)	(15,901)
金融先物に係る未実現損失（注１）	(346,542.40)	(54,317)
先渡為替契約に係る未実現損失（注１）	(996,326.83)	(156,164)
有価証券購入未払金（注１）	(1,958,673.81)	(307,003)
買戻未払金	(212,634.09)	(33,328)
報酬引当金（注２）	(95,935.65)	(15,037)
年次税引当金（注３）	(4,652.22)	(729)
その他の手数料および報酬引当金（注２）	(3,785.95)	(593)
引当金合計	(104,373.82)	(16,360)
負債合計	(3,719,997.42)	(583,072)
期末現在純資産	568,244,499.07	89,066,643

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャプーハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産計算書

	2024年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,965,645,973.55	308,095,350
投資有価証券、未実現評価（損）益	(16,881,263.21)	(2,645,969)
投資有価証券合計（注1）	1,948,764,710.34	305,449,381
現金預金、要求払預金および預託金勘定	4,186,690.89	656,222
その他の流動資産（マージン）	486,839.17	76,307
有価証券売却未収金（注1）	14,691,149.54	2,302,691
発行未収金	3,808,856.37	597,000
有価証券に係る未収利息	9,640,282.26	1,511,018
資産合計	1,981,578,528.57	310,592,619
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	(270,413.92)	(42,385)
先渡為替契約に係る未実現損失（注1）	(12,649,205.26)	(1,982,636)
有価証券購入未払金（注1）	(3,059,193.75)	(479,498)
買戻未払金	(29,376,630.70)	(4,604,493)
報酬引当金（注2）	(176,461.41)	(27,659)
年次税引当金（注3）	(15,955.65)	(2,501)
その他の手数料および報酬引当金（注2）	(76,682.05)	(12,019)
引当金合計	(269,099.11)	(42,179)
負債合計	(45,624,542.74)	(7,151,191)
期末現在純資産	1,935,953,985.83	303,441,428

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

	2024年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,586,793,195.78	718,933,966
投資有価証券、未実現評価（損）益	(351,630,479.86)	(55,114,561)
投資有価証券合計（注1）	4,235,162,715.92	663,819,404
現金預金、要求払預金および預託金勘定	17,802,436.90	2,790,354
その他の流動資産（マージン）	1,976,713.81	309,830
有価証券売却未収金（注1）	76,782,544.63	12,034,896
発行未収金	14,197,389.23	2,225,299
有価証券に係る未収利息	38,326,340.54	6,007,271
資産合計	4,384,248,141.03	687,187,054
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	(1,123,093.32)	(176,034)
先渡為替契約に係る未実現損失（注1）	(31,027,081.48)	(4,863,185)
当座借越	(23,277.67)	(3,649)
買戻未払金	(80,475,142.79)	(12,613,674)
報酬引当金（注2）	(481,224.66)	(75,427)
年次税引当金（注3）	(35,199.98)	(5,517)
その他の手数料および報酬引当金（注2）	(153,846.93)	(24,114)
引当金合計	(670,271.57)	(105,058)
負債合計	(113,318,866.83)	(17,761,599)
期末現在純資産	4,270,929,274.20	669,425,454

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産計算書

2024年4月30日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	1,461,803,851.69	229,123,136
投資有価証券、未実現評価（損）益	(65,913,612.81)	(10,331,300)
投資有価証券合計（注1）	1,395,890,238.88	218,791,836
現金預金、要求払預金および預託金勘定	26,862,307.84	4,210,398
その他の流動資産（マージン）	675,836.56	105,931
発行未収金	1,202,949.39	188,550
有価証券に係る未収利息	15,968,150.50	2,502,848
資産合計	1,440,599,483.17	225,799,563
負 債		
金融先物に係る未実現損失（注1）	(166,593.61)	(26,112)
先渡為替契約に係る未実現損失（注1）	(418,697.39)	(65,627)
当座借越	(115,533.68)	(18,109)
買戻未払金	(2,170,229.21)	(340,162)
報酬引当金（注2）	(241,514.35)	(37,855)
年次税引当金（注3）	(11,753.37)	(1,842)
その他の手数料および報酬引当金（注2）	(60,824.34)	(9,534)
引当金合計	(314,092.06)	(49,231)
負債合計	(3,185,145.95)	(499,240)
期末現在純資産	1,437,414,337.22	225,300,323

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産計算書

	2024年4月30日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,253,625,795.19	353,233,307
投資有価証券、未実現評価（損）益	(231,800,625.76)	(36,332,430)
投資有価証券合計（注1）	2,021,825,169.43	316,900,877
現金預金、要求払預金および預託金勘定	31,845,945.25	4,991,533
有価証券売却未収金（注1）	72,228,648.42	11,321,118
発行未収金	635,366.87	99,587
有価証券に係る未収利息	16,688,571.71	2,615,767
資産合計	2,143,223,701.68	335,928,883
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失（注1）	(21,588,897.51)	(3,383,844)
買戻未払金	(88,499,301.65)	(13,871,381)
報酬引当金（注2）	(170,241.68)	(26,684)
年次税引当金（注3）	(16,754.79)	(2,626)
その他の手数料および報酬引当金（注2）	(32,986.91)	(5,170)
引当金合計	(219,983.38)	(34,480)
負債合計	(110,308,182.54)	(17,289,705)
期末現在純資産	2,032,915,519.14	318,639,178

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

運用計算書

自2023年11月1日 至2024年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	558,413.75	87,526
有価証券に係る利息	8,484,507.50	1,329,862
貸付証券に係る純収益（注11）	64,056.02	10,040
その他の収益（注4）	37,751.80	5,917
収益合計	9,144,729.07	1,433,345
費 用		
報酬（注2）	(574,565.38)	(90,057)
年次税（注3）	(28,544.73)	(4,474)
その他の手数料および報酬（注2）	(19,884.92)	(3,117)
現金資産および当座借越に係る利息	(5,608.88)	(879)
費用合計	(628,603.91)	(98,527)
投資純（損）益	8,516,125.16	1,334,817
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(4,517,960.40)	(708,145)
利回り評価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	78,422.33	12,292
金融先物に係る実現（損）益	(573,372.20)	(89,870)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(1,633,046.60)	(255,964)
スワップに係る実現（損）益	172,833.96	27,090
為替差（損）益	(1,079,579.97)	(169,213)
実現（損）益合計	(7,552,702.88)	(1,183,811)
当期実現純（損）益	963,422.28	151,007
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	23,745,531.45	3,721,875
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	(51,898.24)	(8,135)
TBAモーゲージ担保证券に係る未実現評価（損）益	(101,446.47)	(15,901)
金融先物に係る未実現評価（損）益	1,199,905.78	188,073
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(2,332,939.28)	(365,665)
未実現評価（損）益の変動合計	22,459,153.24	3,520,248
運用の結果による純資産の純増（減）	23,422,575.52	3,671,254

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル

運用計算書

自2023年11月1日 至2024年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	220,812.17	34,610
有価証券に係る利息	17,585,375.51	2,756,332
貸付証券に係る純収益（注11）	380,821.26	59,690
その他の収益（注4）	730,933.55	114,567
収益合計	18,917,942.49	2,965,198
費 用		
報酬（注2）	(1,073,200.21)	(168,213)
年次税（注3）	(95,908.62)	(15,033)
その他の手数料および報酬（注2）	(45,917.53)	(7,197)
現金資産および当座借越に係る利息	(242.06)	(38)
費用合計	(1,215,268.42)	(190,481)
投資純（損）益	17,702,674.07	2,774,717
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(1,315,422.00)	(206,179)
利回り評価証券および短期金融商品に係る実現（損）益	75,578.73	11,846
金融先物に係る実現（損）益	(528,677.33)	(82,865)
先渡為替契約に係る実現（損）益	25,121,431.31	3,937,533
為替差（損）益	(8,235,478.46)	(1,290,829)
実現（損）益合計	15,117,432.25	2,369,506
当期実現純（損）益	32,820,106.32	5,144,223
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	37,848,871.91	5,932,432
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	73,620.98	11,539
金融先物に係る未実現評価（損）益	(104,289.31)	(16,346)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(12,373,748.64)	(1,939,461)
未実現評価（損）益の変動合計	25,444,454.94	3,988,164
運用の結果による純資産の純増（減）	58,264,561.26	9,132,387

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2023年11月1日 至2024年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	374,338.86	58,674
有価証券に係る利息	63,932,610.10	10,020,797
分配金	612,024.68	95,929
貸付証券に係る純収益（注11）	985,890.57	154,528
その他の収益（注4）	526,931.44	82,591
収益合計	66,431,795.65	10,412,520
費 用		
報酬（注2）	(2,748,420.29)	(430,787)
年次税（注3）	(213,262.34)	(33,427)
その他の手数料および報酬（注2）	(81,771.11)	(12,817)
現金資産および当座借越に係る利息	(1,793.25)	(281)
費用合計	(3,045,246.99)	(477,312)
投資純（損）益	63,386,548.66	9,935,208
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(53,139,626.91)	(8,329,105)
金融先物に係る実現（損）益	(17,905.33)	(2,806)
先渡為替契約に係る実現（損）益	43,634,771.67	6,839,314
為替差（損）益	(19,425,953.48)	(3,044,824)
実現（損）益合計	(28,948,714.05)	(4,537,421)
当期実現純（損）益	34,437,834.61	5,397,786
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	130,475,504.31	20,450,731
金融先物に係る未実現評価（損）益	(374,156.23)	(58,645)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(32,678,010.04)	(5,121,951)
未実現評価（損）益の変動合計	97,423,338.04	15,270,134
運用の結果による純資産の純増（減）	131,861,172.65	20,667,920

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

運用計算書

自2023年11月1日 至2024年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	515,287.04	80,766
有価証券に係る利息	29,977,930.81	4,698,741
貸付証券に係る純収益（注11）	32,047.47	5,023
その他の収益（注4）	59,853.14	9,381
収益合計	30,585,118.46	4,793,911
費 用		
報酬（注2）	(1,486,136.42)	(232,937)
年次税（注3）	(73,927.48)	(11,587)
その他の手数料および報酬（注2）	(39,372.33)	(6,171)
現金資産および当座借越に係る利息	(39.94)	(6)
費用合計	(1,599,476.17)	(250,702)
投資純（損）益	28,985,642.29	4,543,210
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(21,540,448.22)	(3,376,250)
金融先物に係る実現（損）益	(428,328.78)	(67,136)
先渡為替契約に係る実現（損）益	1,300,043.36	203,769
為替差（損）益	(6,175,021.47)	(967,873)
実現（損）益合計	(26,843,755.11)	(4,207,490)
当期実現純（損）益	2,141,887.18	335,719
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	70,331,766.73	11,023,801
金融先物に係る未実現評価（損）益	(236,913.83)	(37,134)
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	2,888,910.97	452,808
未実現評価（損）益の変動合計	72,983,763.87	11,439,475
運用の結果による純資産の純増（減）	75,125,651.05	11,775,195

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

運用計算書

自2023年11月1日 至2024年4月30日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	307,715.06	48,231
有価証券に係る利息	28,482,577.93	4,464,359
貸付証券に係る純収益（注11）	162,913.11	25,535
その他の収益（注4）	130,897.77	20,517
収益合計	29,084,103.87	4,558,642
費 用		
報酬（注2）	(1,073,736.13)	(168,297)
年次税（注3）	(111,311.10)	(17,447)
その他の手数料および報酬（注2）	(49,375.04)	(7,739)
現金資産および当座借越に係る利息	(202.19)	(32)
費用合計	(1,234,624.46)	(193,515)
投資純（損）益	27,849,479.41	4,365,127
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(67,238,573.44)	(10,538,974)
金融先物に係る実現（損）益	(939,697.79)	(147,288)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(4,536,637.35)	(711,073)
為替差（損）益	3,523,389.19	552,256
実現（損）益合計	(69,191,519.39)	(10,845,079)
当期実現純（損）益	(41,342,039.98)	(6,479,951)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	121,321,116.09	19,015,872
利回り評価証券および短期金融商品に係る未実現評価（損）益	139,956.50	21,937
金融先物に係る未実現評価（損）益	2,340,102.93	366,788
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(9,728,790.38)	(1,524,891)
未実現評価（損）益の変動合計	114,072,385.14	17,879,706
運用の結果による純資産の純増（減）	72,730,345.16	11,399,754

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

純資産変動計算書

	自2023年11月1日 至2024年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	524,613,168.97	82,227,868
発行額	69,978,034.21	10,968,357
買戻額	(49,091,342.15)	(7,694,577)
純発行（買戻）合計	20,886,692.06	3,273,780
支払分配金	(677,937.48)	(106,260)
投資純（損）益	8,516,125.16	1,334,817
実現（損）益合計	(7,552,702.88)	(1,183,811)
未実現評価（損）益の変動合計	22,459,153.24	3,520,248
運用の結果による純資産の純増（減）	23,422,575.52	3,671,254
期末現在純資産	568,244,499.07	89,066,643

発行済投資証券数の変動表

	自2023年11月1日 至2024年4月30日
クラス米ドルF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	1,550,471.0860
期中発行投資証券数	228,647.5520
期中買戻投資証券数	(114,229.8730)
期末現在発行済投資証券数	1,664,888.7650
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	726,945.5000
期中発行投資証券数	76,493.0000
期中買戻投資証券数	(152,680.0000)
期末現在発行済投資証券数	650,758.5000

年次分配金¹

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

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

最重要数値

日付	ISIN	2024年4月30日	2023年10月31日	2022年10月31日
純資産額（米ドル）		568,244,499.07	524,613,168.97	489,370,994.22
クラス米ドルF-acc	LU0326808440			
発行済受益証券口数（口）		1,664,888.7650	1,550,471.0860	1,422,679.4710
1口当たり純資産価格（米ドル）		152.82	144.78	142.75
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		152.82	144.78	142.75
クラス円ヘッジF-acc	LU1490620330			
発行済投資証券数（口）		650,758.5000	726,945.5000	610,933.2080
1口当たり純資産価格（円）		9,388	9,161	9,521
1口当たり発行・買戻価格（円） ¹		9,388	9,161	9,521

¹ 注記1を参照

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	34.56
中国	8.50
日本	5.36
イギリス	4.89
フランス	4.55
オーストラリア	3.27
ニュージーランド	3.00
スペイン	2.89
ドイツ	2.82
カナダ	2.78
オランダ	2.62
イタリア	1.79
韓国	1.74
ルクセンブルグ	1.73
アイルランド	1.44
ベルギー	1.16
スイス	0.94
国際	0.75
インド	0.62
スウェーデン	0.60
チリ	0.53
スロベニア	0.46
ルーマニア	0.41
ケイマン諸島	0.40
ノルウェー	0.37
ポーランド	0.33
サウジアラビア	0.28
フィンランド	0.24
シンガポール	0.20
バミューダ	0.18
メキシコ	0.17
デンマーク	0.17
香港	0.11
オーストリア	0.09
ペルー	0.04
ガーンジー	0.02
合計	90.01

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	34.16
銀行および金融機関	18.28
モーゲージおよび貸付機関	11.07
金融および持株会社	8.58
エネルギー・水道	2.16
石油	1.60
保険	1.50
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.27
通信	1.15
国際機関	1.14
化学	0.94
不動産	0.82
交通・運輸	0.82
公共、非営利機関	0.79
自動車	0.74
投資信託	0.68
その他のサービス業	0.57
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.54
繊維・衣服・革製品	0.47
医薬品・化粧品・医療品	0.43
電気装置・部品	0.38
鉱業・石炭・鋼鉄	0.37
たばこ・アルコール	0.35
機械工学・産業機器	0.23
食品・清涼飲料	0.21
建築業・資材	0.18
小売り・百貨店	0.15
その他の非分類会社	0.14
航空宇宙産業	0.08
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.07
電子機器・半導体	0.05
バイオテクノロジー	0.05
写真・光学	0.04
合計	90.01

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2023年11月 1 日 至2024年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,914,151,319.53	300,024,078
発行額	859,871,410.74	134,776,245
買戻額	(891,571,512.03)	(139,744,919)
純発行（買戻）合計	(31,700,101.29)	(4,968,674)
支払分配金	(4,761,793.67)	(746,364)
投資純（損）益	17,702,674.07	2,774,717
実現（損）益合計	15,117,432.25	2,369,506
未実現評価（損）益の変動合計	25,444,454.94	3,988,164
運用の結果による純資産の純増（減）	58,264,561.26	9,132,387
期末現在純資産	1,935,953,985.83	303,441,428

発行済投資証券数の変動表

	自2023年11月 1 日 至2024年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	5,138,765.8360
期中発行投資証券数	2,397,566.5490
期中買戻投資証券数	(2,257,841.8910)
期末現在発行済投資証券数	5,278,490.4940
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	121,464.0000
期中発行投資証券数	302.0000
期中買戻投資証券数	(29,157.0000)
期末現在発行済投資証券数	92,609.0000

年次分配金¹

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

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2024年4月30日	2023年10月31日	2022年10月31日
純資産額（米ドル）		1,935,953,985.83	1,914,151,319.53	2,769,676,669.98
クラスF-acc	LU0224580786			
発行済受益証券口数（口）		5,278,490.4940	5,138,765.8360	7,512,225.3430
1口当たり純資産価格（米ドル）		154.44	150.64	146.46
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		154.41	150.76	146.42
クラス円ヘッジF-acc	LU1786948718			
発行済受益証券口数（口）		92,609.0000	121,464.0000	156,900.0000
1口当たり純資産価格（米ドル）		9,171	9,208	9,450
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		9,169	9,215	9,447

¹ 注記1を参照

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	60.31
国際	11.23
カナダ	5.98
ドイツ	3.69
フランス	3.05
オーストラリア	2.73
韓国	2.32
スウェーデン	1.96
オランダ	1.65
イギリス	1.33
ノルウェー	1.25
アラブ首長国連邦	1.09
シンガポール	0.84
フィンランド	0.72
カタール	0.49
英領ヴァージン諸島	0.33
ベルギー	0.33
日本	0.32
ルクセンブルグ	0.26
ケイマン諸島	0.24
ジャージー	0.20
オーストリア	0.19
香港	0.15
合計	100.66

業種別分布表	(純資産に対する百分率%)
国債および中央政府債	46.46
銀行および金融機関	19.16
国際機関	11.58
金融および持株会社	8.75
モーゲージおよび貸付機関	3.27
郡、連邦州	2.07
公共、非営利機関	1.12
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.01
バイオテクノロジー	0.91
小売り・百貨店	0.87
石油	0.83
食品・清涼飲料	0.60
その他の消費財	0.58
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	0.48
建築業・資材	0.43
エネルギー・水道	0.41
その他のサービス業	0.37
通信	0.37
機械工学・産業機器	0.36
電気装置・部品	0.31
投資信託	0.27
交通・運輸	0.25
都市・地方自治体	0.15
保険	0.05
合計	100.66

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2023年11月1日 至2024年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	3,763,123,391.83	589,831,960
発行額	982,785,892.70	154,041,861
買戻額	(591,940,660.78)	(92,780,779)
純発行（買戻）合計	390,845,231.92	61,261,082
支払分配金	(14,900,522.20)	(2,335,508)
投資純（損）益	63,386,548.66	9,935,208
実現（損）益合計	(28,948,714.05)	(4,537,421)
未実現評価（損）益の変動合計	97,423,338.04	15,270,134
運用の結果による純資産の純増（減）	131,861,172.65	20,667,920
期末現在純資産	4,270,929,274.20	669,425,454

発行済投資証券数の変動表

	自2023年11月1日 至2024年4月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	8,240,445.7120
期中発行投資証券数	2,076,155.5030
期中買戻投資証券数	(1,183,633.1060)
期末現在発行済投資証券数	9,132,968.1090
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	270,815.0000
期中発行投資証券数	12,278.0000
期中買戻投資証券数	(69,447.0000)
期末現在発行済投資証券数	213,646.0000

年次分配金¹

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

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2024年4月30日	2023年10月31日	2022年10月31日
純資産額（米ドル）		4,270,929,274.20	3,763,123,391.83	4,251,345,080.56
クラスF-acc	LU0270450066			
発行済受益証券口数（口）		9,132,968.1090	8,240,445.7120	9,898,397.7230
1口当たり純資産価格（米ドル）		180.16	173.31	173.57
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		180.09	173.31	173.57
クラス円ヘッジF-acc	LU1786951779			
発行済受益証券口数（口）		213,646.0000	270,815.0000	336,555.0000
1口当たり純資産価格（米ドル）		8,544	8,473	8,978
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		8,541	8,473	8,978

¹ 注記1を参照

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	65.36
国際	13.17
カナダ	4.18
アラブ首長国連邦	2.40
ドイツ	2.37
フランス	2.03
香港	1.38
オランダ	1.36
韓国	1.34
オーストラリア	1.11
ノルウェー	1.05
カタール	0.83
スウェーデン	0.58
アイルランド	0.47
シンガポール	0.43
英領ヴァージン諸島	0.38
フィンランド	0.37
ベルギー	0.18
ジャージー	0.17
合計	99.16

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
国債および中央政府債	51.67
国際機関	12.99
金融および持株会社	7.25
銀行および金融機関	5.84
郡、連邦州	4.12
モーゲージおよび貸付機関	3.93
小売り・百貨店	2.20
石油	1.74
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.47
公共、非営利機関	1.22
バイオテクノロジー	0.96
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.90
その他の消費財	0.79
都市・地方自治体	0.60
エネルギー・水道	0.56
投資信託	0.54
食品・清涼飲料	0.52
通信	0.49
医薬品・化粧品・医療品	0.49
その他のサービス業	0.38
交通・運輸	0.24
保険	0.15
その他の非分類会社	0.10
航空宇宙産業	0.01
合計	99.16

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

純資産変動計算書

	自2023年11月1日 至2024年4月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	1,386,728,965.84	217,355,898
発行額	126,762,681.85	19,868,783
買戻額	(139,010,960.80)	(21,788,578)
純発行（買戻）合計	(12,248,278.95)	(1,919,795)
支払分配金	(12,192,000.72)	(1,910,974)
投資純（損）益	28,985,642.29	4,543,210
実現（損）益合計	(26,843,755.11)	(4,207,490)
未実現評価（損）益の変動合計	72,983,763.87	11,439,475
運用の結果による純資産の純増（減）	75,125,651.05	11,775,195
期末現在純資産	1,437,414,337.22	225,300,323

発行済投資証券数の変動表

	自2023年11月1日 至2024年4月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	3,413,013.9350
期中発行投資証券数	271,664.5610
期中買戻投資証券数	(390,904.1540)
期末現在発行済投資証券数	3,293,774.3420
クラス円ヘッジF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	295,090.0000
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	(31,670.0000)
期末現在発行済投資証券数	263,420.0000

年次分配金¹

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

¹ 注記5を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2024年4月30日	2023年10月31日	2022年10月31日
純資産額（米ドル）		1,437,414,337.22	1,386,728,965.84	1,530,016,585.03
クラスF-acc	LU1484152423			
発行済受益証券口数（口）		3,293,774.3420	3,413,013.9350	4,430,677.3830
1口当たり純資産価格（米ドル）		116.63	110.54	106.61
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		116.54	110.54	106.61
クラス円ヘッジF-acc	LU2288920767			
発行済受益証券口数（口）		263,420.0000	295,090.0000	315,140.0000
1口当たり純資産価格（日本円）		8,614	8,409	8,565
1口当たり発行・買戻価格（日本円） ¹		8,607	8,409	8,565

¹ 注記1を参照

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

組入証券の構造

地域別分布表	(純資産に対する百分率 %)
アメリカ合衆国	69.58
イギリス	7.61
オーストラリア	4.15
オランダ	2.91
カナダ	2.15
アイルランド	1.85
スペイン	1.83
フランス	1.53
ノルウェー	0.97
ルクセンブルグ	0.79
シンガポール	0.74
スウェーデン	0.62
バミューダ	0.61
多国籍	0.58
ドイツ	0.54
デンマーク	0.38
日本	0.27
合計	97.11

業種別分布表	(純資産に対する百分率 %)
銀行および金融機関	28.48
金融および持株会社	27.79
エネルギー・水道	8.34
医薬品・化粧品・医療品	3.54
通信	2.83
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	2.73
不動産	2.54
交通・運輸	2.51
ヘルスケア・社会福祉	2.15
石油	2.14
小売り・百貨店	1.42
電子機器・半導体	1.42
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置供給業	1.29
機械工学・産業機器	1.20
化学	1.10
食品・清涼飲料	0.97
その他のサービス業	0.94
保険	0.90
たばこ・アルコール	0.89
投資信託	0.79
電気装置・部品	0.70
航空宇宙産業	0.56
繊維・衣服・革製品	0.44
鉱業・石炭・鋼鉄	0.42
自動車	0.39
バイオテクノロジー	0.35
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.28
合計	97.11

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

純資産変動計算書

	自2023年11月 1 日 至2024年 4 月30日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,191,058,367.97	343,426,489
発行額	217,106,984.63	34,029,349
買戻額	(447,004,211.45)	(70,063,440)
純発行（買戻）合計	(229,897,226.82)	(36,034,091)
支払分配金	(975,967.17)	(152,973)
投資純（損）益	27,849,479.41	4,365,127
実現（損）益合計	(69,191,519.39)	(10,845,079)
未実現評価（損）益の変動合計	114,072,385.14	17,879,706
運用の結果による純資産の純増（減）	72,730,345.16	11,399,754
期末現在純資産	2,032,915,519.14	318,639,178

発行済投資証券数の変動表

	自2023年11月 1 日 至2024年 4 月30日
クラスF-acc	(口)
期首現在発行済投資証券数	6,651,225.4560
期中発行投資証券数	266,111.2470
期中買戻投資証券数	(803,175.6170)
期末現在発行済投資証券数	6,114,161.0860

年次分配金¹

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

¹ 注記 5 を参照

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

最重要数値

日付	ISIN	2024年4月30日	2023年10月31日	2022年10月31日
純資産額（米ドル）		2,032,915,519.14	2,191,058,367.97	2,039,391,807.27
クラスF-acc	LU1739535000			
発行済受益証券口数（口）		6,114,161.0860	6,651,225.4560	6,291,999.1820
1口当たり純資産価格（米ドル）		102.71	99.09	99.73
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		102.67	99.09	99.73

¹ 注記1を参照

組入証券の構造

地域別分布表	（純資産に対する百分率 %）
国際	99.45
合計	99.45

業種別分布表	（純資産に対する百分率 %）
国際機関	99.45
合計	99.45

フォーカス・シキャブ
財務書類に対する注記
2024年4月30日現在

注1－重要な会計方針の要約

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

a) 純資産額の計算

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

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

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

b) 評価原則

- － 流動資産は、現金、預金、為替手形、要求払約束手形および売掛金、前払費用、現金配当金ならびに宣言済または発生済で未受領の利息、いずれの形においても全額で評価が行なわれる。ただし、かかる評価額が完全には支払われないまたは受領できない可能性のある場合には、その真正価額を表すために適切と思われる控除が考慮された上で、評価額が決定される。
- － 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。これらの証券、派生商品もしくはその他の資産が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の価格が適用される。

証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の資産で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、定期的に運営され、認知され、公開されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。
- － 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき本投資法人が評価する。
- － 証券取引所に上場されていない派生商品（OTC派生商品）は、独立の値付機関に基づき評価される。派生商品に利用可能である独立の値付機関が1社のみの場合、得られた評価の妥当性は、派生商品が由来する対象商品の市場価格に基づき本投資法人および本投資法人の監査人が認めた計算方法によって検証される。

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

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

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

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

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

投資証券は、通常、単一の価格である純資産価格に基づいて発行され、買い戻される。しかしながら、希薄化の影響を軽減するために、投資証券1口当たり純資産価格は、以下に記載するとおり評価日

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

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

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

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

スイング・プライシングの技法は、すべてのサブ・ファンドに適用される。

期末現在の純資産価額に対するスイング・プライシングの調整があった場合、サブ・ファンドの3年度比較数値の純資産価額の情報から参照することができる。1口当たり発行・買戻価格は調整済みの純資産価格を表す。

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

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

e) 証券売買実現純（損）益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 連結財務書類

連結財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2024年4月30日現在の連結純資産計算書、連結運用計算書および連結純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目をユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2024年4月30日現在の連結財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1 ユーロ	=	0.980663	スイスフラン
1 ユーロ	=	0.853931	英ポンド
1 ユーロ	=	1.069250	米ドル

i) 「モーゲージ担保証券」

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

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

j) モーゲージ関連証券—TBA証券

TBAポジションは、モーゲージ・プール（ジニー・メイ、ファニー・メイまたはフレディ・マック）からの証券が、将来日において定められた価格で取得される場合のモーゲージ・バック証券市場に係る一

一般的な取引慣行に関連する。かかる証券の正確な構成については購入時点では知ることは出来ないが、その主な特性についてはすでに定義されている。現時点で価格も設定されているものの、額面価格についてはまだ明確に設定されていない。

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

これらのTBAポジションは、「TBAモーゲージ担保证券に係る未実現（損）益」に含まれる。2024年4月30日現在のTBAポジションの評価額は、サブ・ファンドであるフォーカス・シキャブグローバル・ボンドの5,614,634.60米ドルについてである。

k) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外貨取引による未収金および未払金は、相殺される。

l) 収益の認識

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

m) スワップ

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

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

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

注2－報酬

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

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ボンド・米ドル

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

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

フォーカス・シキャブ	実効定率報酬	
	2023年10月31日	2024年4月30日
ーグローバル・ボンド クラス米ドルF-acc	0.20%	0.20%
ーグローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc	0.21%	0.21%
ーハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.12%	0.12%
ーハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.13%	0.13%
ーハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.14%	0.14%
ーハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.15%	0.15%
ーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc	0.20%	0.20%
ーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.21%	0.21%
ーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.11%	0.11%

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

上限定率報酬は、下記のように使用される。

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

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

当該報酬は、運用計算書において「報酬」として開示される。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

その投資方針の条項に従ってその他のUCIまたはUCITS（以下「ターゲット・ファンド」という。）に投資することができるサブ・ファンドの場合、サブ・ファンドだけでなく、関係するターゲット・ファンドのレベルでも費用が発生する。サブ・ファンドの資産が投資されるターゲット・ファンドの管理報酬（成功報酬を除く）は、あらゆる付随的な報酬も含めて最大で3%とする。

サブ・ファンドが、管理会社により、または共同運用もしくは支配を通じて、または実質的な直接保有もしくは間接保有することにより管理会社と関係する別の会社によって、直接的もしくは間接的に運用されるファンドの受益証券に投資を行う場合、投資を行うサブ・ファンドは、ターゲット・ファンドの発行または買戻手数料を請求されないことがある。

本投資法人の現行の費用（または現行の手数料）の詳細は、KIDsに記載されている。

注3－年次税

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

注4－その他の収益

その他の収益は、主にスイング・プライシングから生じた収益で構成される。

注5－収益の分配

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

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

収入調整金は、分配金と実際に収入を受け取る権利が一致するように計算される。

注6－ソフト・コミッション協定

2023年11月1日から2024年4月30日までの期間において、フォーカス・シキャブのために締結された「ソフト・コミッション協定」はなく、「ソフト・コミッション協定」の金額はゼロである。

注7－金融先物契約

2024年4月30日現在、サブ・ファンドごとの金融先物契約および関連する通貨は、以下のように要約される。

金融先物

フォーカス・シキャブ	債券に係る金融先物 (購入)	債券に係る金融先物 (売却)
－グローバル・ボンド	58,436,311.50米ドル	49,001,093.97米ドル
－ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	44,584,375.00米ドル	－米ドル
－ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	99,505,078.60米ドル	22,043,750.00米ドル
－USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	43,491,211.00米ドル	26,859,375.00米ドル
－ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし
フォーカス・シキャブ	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (売却)
－グローバル・ボンド	該当なし	該当なし
－ハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	該当なし	該当なし
－ハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし
－USコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	該当なし	該当なし
－ワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	該当なし	該当なし

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

注8－総費用比率（TER）

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

過去12ヶ月のTERは、以下のとおりである。

フォーカス・シキャブ	総費用比率（TER）
－グローバル・ボンド クラス米ドルF-acc	0.22%
－グローバル・ボンド クラス円ヘッジF-acc	0.23%
－ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.13%
－ハイ・グレード・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.14%
－ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.15%
－ハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.16%
－USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラスF-acc	0.22%
－USコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル クラス円ヘッジF-acc	0.23%
－ワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル クラスF-acc	0.13%

運用が12ヶ月未満の投資証券クラスのTERは、年率換算されている。

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

定率報酬は、当会計年度中に変更される場合がある（注2を参照のこと。）。

注9－後発事象

期末以降、財務書類の修正または開示を必要とする事象は無かった。

注10－適用法、業務地および公認言語

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

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

注11－貸付証券

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

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店は、証券の貸付機関として行為する。

2024年4月30日現在の貸付有価証券からの 取引相手方エクスポージャー*			2024年4月30日現在の 担保の内訳（%）		
フォーカス・シキャブ	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・スイス・ エイ・ジー)	株式	債券	現金
ーグローバル・ボンド	78,542,001.10 米ドル	81,702,497.71 米ドル	52.66	47.34	0.00
ーハイ・グレード・ボンド・ 米ドル	763,314,247.69 米ドル	791,817,352.40 米ドル	52.66	47.34	0.00
ーハイ・グレード・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	1,787,704,646.33 米ドル	1,855,792,166.63 米ドル	52.66	47.34	0.00
ーUSコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	52,466,628.81 米ドル	54,979,208.15 米ドル	59.43	40.57	0.00
ーワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	142,284,983.89 米ドル	148,975,849.45 米ドル	59.43	40.57	0.00

*取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2024年4月30日に証券貸付業者から直接入手されるため、2024年4月30日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

フォーカス・シキャブ			
	ーグローバル・ボンド	ーハイ・グレード・ ボンド・米ドル	ーハイ・グレード・ ロング・ターム・ ボンド・米ドル
貸付証券収益	106,760.03 米ドル	634,702.10 米ドル	1,643,150.95 米ドル
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	32,028.01 米ドル	190,410.63 米ドル	492,945.29 米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	10,676.00 米ドル	63,470.21 米ドル	164,315.09 米ドル
純貸付証券収益	64,056.02 米ドル	380,821.26 米ドル	985,890.57 米ドル
	ーUSコーポレート・ ボンド・サステナブル・ 米ドル	ーワールドバンク・ ロング・ターム・ ボンド・米ドル	
貸付証券収益	53,412.45 米ドル	271,521.85 米ドル	
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	16,023.74 米ドル	81,456.56 米ドル	
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	5,341.24 米ドル	27,152.18 米ドル	
純貸付証券収益	32,047.47 米ドル	162,913.11 米ドル	

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

（２）【投資有価証券明細表等】

フォーカス・シキャブーグローバル・ボンド

2024年４月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注１)	純資産 比率 (%)
株式			
イギリス			
EUR BARCLAYS BANK PLC 4.75%-FRN T1 PERP EUR10000	930 000.00	942 952.11	0.17
イギリス合計		942 952.11	0.17
株式合計		942 952.11	0.17
ノート、固定利付債			
ユーロ			
EUR CELANESE US HOLDINGS LLC 4.77700% 22-19.07.26	250 000.00	270 093.62	0.05
EUR CHINA, PEOPLE ' S REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 19-12.11.39	1 160 000.00	856 125.38	0.15
EUR CORP ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.25000% 21-04.02.26	1 340 000.00	1 340 379.72	0.23
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	565 000.00	519 850.64	0.09
EUR HEIDELBERG MATERIALS AG-REG-S 3.75000% 23-31.05.32	455 000.00	481 737.07	0.08
EUR MACIF-REG-S-SUB 0.62500% 21-21.06.27	300 000.00	288 425.78	0.05
EUR PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-REG-S 3.75000% 24-27.09.29	1 725 000.00	1 815 553.62	0.32
EUR PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE-REG-S 4.12500% 24-27.09.32	1 655 000.00	1 756 354.37	0.31
EUR REWE INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.87500% 23-13.09.30	400 000.00	445 699.79	0.08
EUR SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 23-14.09.32	600 000.00	660 577.67	0.12
EUR SOLVAY SA-REG-S 3.87500% 24-03.04.28	1 100 000.00	1 171 693.77	0.21
EUR TAPESTRY INC 5.35000% 23-27.11.25	570 000.00	616 588.82	0.11
EUR TAPESTRY INC 5.37500% 23-27.11.27	445 000.00	485 217.43	0.08
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	340 000.00	333 855.73	0.06
ユーロ合計		11 042 153.41	1.94
米ドル			
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	200 000.00	192 730.93	0.03
USD ABBVIE INC 4.40000% 13-06.11.42	310 000.00	267 180.80	0.05
USD ABBVIE INC 4.87500% 18-14.11.48	170 000.00	153 700.60	0.03
USD AEP TEXAS INC 5.40000% 23-01.06.33	250 000.00	240 935.71	0.04
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	160 000.00	161 146.37	0.03
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	1 625 000.00	1 501 389.27	0.26
USD AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC 2.05000% 20-15.05.30	210 000.00	175 542.41	0.03
USD ALBEMARLE CORPORATION 5.45000% 14-01.12.44	200 000.00	175 740.38	0.03
USD ALTRIA GROUP INC 4.40000% 19-14.02.26	102 000.00	99 971.56	0.02
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.30	195 000.00	193 280.50	0.03
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33	565 000.00	552 669.05	0.10
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	380 000.00	373 667.35	0.07
USD APPLE INC 3.85000% 16-04.08.46	420 000.00	334 050.49	0.06
USD APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25	1 220 000.00	1 200 463.48	0.21
USD ARES CAPITAL CORP 7.00000% 23-15.01.27	1 425 000.00	1 450 407.82	0.26
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	510 000.00	486 616.53	0.09
USD AT&T INC 4.75000% 15-15.05.46	550 000.00	466 549.70	0.08
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 5.38100% 24-13.03.29	800 000.00	791 758.96	0.14
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.05000% 22-15.03.25	205 000.00	205 027.25	0.04
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.16500% 22-15.07.27	605 000.00	608 550.72	0.11
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.35000% 23-15.11.28	210 000.00	213 283.23	0.04
USD CIGNA GROUP/THE 4.37500% 19-15.10.28	370 000.00	353 849.97	0.06
USD CITIGROUP INC 4.65000% 18-23.07.48	425 000.00	362 924.54	0.06
USD COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 5.83700% 24-13.03.34	545 000.00	531 611.77	0.09
USD CONCENTRIX CORP 6.60000% 23-02.08.28	2 200 000.00	2 193 442.37	0.39
USD CONCENTRIX CORP 6.85000% 23-02.08.33	2 350 000.00	2 264 937.78	0.40

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 5.90000% 23-15.11.53	330 000.00	331 684.99	0.06
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.62500% 17-01.08.27	620 000.00	577 568.75	0.10
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.30000% 23-08.09.53	445 000.00	421 220.31	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.44000% 24-26.01.36	980 000.00	976 018.75	0.17
USD COSTCO WHOLESALE CORP 1.60000% 20-20.04.30	120 000.00	98 555.65	0.02
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 7.95000% 23-09.01.25	1 065 000.00	1 079 334.83	0.19
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	115 000.00	98 094.47	0.02
USD CVS HEALTH CORP 5.12500% 15-20.07.45	635 000.00	552 547.66	0.10
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	600 000.00	593 961.37	0.10
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 5.30000% 19-15.05.49	290 000.00	228 146.67	0.04
USD ENBRIDGE INC 5.90000% 23-15.11.26	580 000.00	583 743.98	0.10
USD ENERGY TRANSFER LP 6.00000% 18-15.06.48	210 000.00	199 172.97	0.04
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	590 000.00	556 488.83	0.10
USD EQT CORP 5.75000% 24-01.02.34	275 000.00	267 036.64	0.05
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	890 000.00	825 934.75	0.15
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.00000% 23-11.01.28	715 000.00	711 882.60	0.13
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	415 000.00	395 274.91	0.07
USD FLOWSERVE CORP 3.50000% 20-01.10.30	450 000.00	390 790.07	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.79800% 23-07.11.28	505 000.00	516 310.09	0.09
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	425 000.00	426 429.45	0.07
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 4.35000% 18-09.04.25	420 000.00	414 331.72	0.07
USD GILEAD SCIENCES INC 4.80000% 14-01.04.44	350 000.00	307 550.54	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	955 000.00	935 964.55	0.16
USD HANWHA Q CELLS AMERICAS HOLDINGS-REG-S 5.00000% 23-27.07.28	340 000.00	334 393.40	0.06
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC 4.40000% 18-15.03.48	220 000.00	179 900.14	0.03
USD ILLINOIS TOOL WORKS INC 2.65000% 16-15.11.26	410 000.00	386 931.48	0.07
USD INTEL CORP 5.70000% 23-10.02.53	325 000.00	310 339.15	0.05
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	360 000.00	345 915.63	0.06
USD J M SMUCKER CO/THE 5.90000% 23-15.11.28	855 000.00	871 291.08	0.15
USD J M SMUCKER CO/THE 6.50000% 23-15.11.53	305 000.00	320 574.96	0.06
USD KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 4.75000% 23-03.04.26	670 000.00	659 581.50	0.12
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	235 000.00	231 708.22	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.45000% 23-15.03.53	390 000.00	369 429.96	0.06
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	1 600 000.00	1 354 592.00	0.24
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	890 000.00	674 731.25	0.12
USD MICROSOFT CORP 2.92100% 21-17.03.52	650 000.00	428 421.25	0.08
USD MPLX LP 5.20000% 17-01.03.47	200 000.00	174 944.87	0.03
USD NASDAQ INC 5.55000% 23-15.02.34	770 000.00	753 104.74	0.13
USD NASDAQ INC 5.95000% 23-15.08.53	225 000.00	222 041.74	0.04
USD NIKE INC 2.40000% 20-27.03.25	325 000.00	316 420.00	0.06
USD NORDSON CORP 5.60000% 23-15.09.28	540 000.00	540 095.40	0.09
USD ONEOK INC 6.62500% 23-01.09.53	450 000.00	469 354.79	0.08
USD ORACLE CORP 2.50000% 20-01.04.25	235 000.00	228 135.11	0.04
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.30000% 23-19.05.53	490 000.00	456 943.39	0.08
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 5.34000% 23-19.05.63	745 000.00	683 434.43	0.12
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 5.62500% 22-17.11.29	190 000.00	191 605.16	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.80000% 20-15.09.30	255 000.00	228 525.39	0.04
USD QUALCOMM INC 4.30000% 17-20.05.47	160 000.00	133 023.59	0.02
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 9.75000% 24-15.04.29	600 000.00	594 199.00	0.10
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 750 000.00	1 189 282.50	0.21
USD REYNOLDS AMERICAN INC 5.70000% 15-15.08.35	680 000.00	652 951.38	0.11
USD ROMANIA-REG-S 6.37500% 24-30.01.34	800 000.00	781 000.00	0.14
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 3.64900% 21-29.04.31	720 000.00	610 877.02	0.11
USD SANTOS FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 23-19.09.33	755 000.00	775 952.00	0.14
USD SGSP AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S 3.25000% 16-29.07.26	530 000.00	501 961.83	0.09
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.60000% 20-13.07.30	200 000.00	5 000.00	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	340 000.00	8 500.00	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	505 000.00	12 625.00	0.00
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA-REG-S 6.50000% 23-07.11.33	1 050 000.00	1 055 250.00	0.19
USD SOUTHERN CO 4.40000% 16-01.07.46	120 000.00	97 697.63	0.02
USD SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 5.95000% 23-17.07.26	250 000.00	248 865.00	0.04
USD T-MOBILE USA INC 5.75000% 23-15.01.34	345 000.00	347 452.72	0.06
USD TAPESTRY INC 7.70000% 23-27.11.30	650 000.00	674 547.16	0.12
USD TAPESTRY INC 7.85000% 23-27.11.33	540 000.00	564 081.02	0.10

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD TARGA RESOURCES CORP 6.15000% 23-01.03.29	370 000.00	376 346.63	0.07
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 0.75000% 20-15.05.25	1 210 000.00	1 154 489.55	0.20
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 5.05000% 23-18.05.63	605 000.00	548 064.40	0.10
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	413 000.00	405 680.65	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	1 440 000.00	1 275 039.68	0.22
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.00000% 16-15.11.46	195 000.00	147 945.11	0.03
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	100 000.00	94 357.16	0.02
USD VISA INC 1.90000% 20-15.04.27	330 000.00	301 852.35	0.05
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.12500% 22-13.05.25	735 000.00	723 977.28	0.13
USD VMWARE LLC 1.00000% 21-15.08.24	480 000.00	473 188.28	0.08
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.27900% 23-15.03.32	960 000.00	826 931.08	0.15
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	1 260 000.00	1 260 354.49	0.22
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING 6.35000% 23-15.01.29	695 000.00	709 588.24	0.12
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.42100% 19-24.07.39	395 000.00	337 348.09	0.06
USD XL GROUP LTD 5.25000% 13-15.12.43	605 000.00	543 211.35	0.10
米ドル合計		55 203 529.32	9.72
ノート、固定利付債合計		66 245 682.73	11.66
ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR BPCE SA-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-13.01.42	800 000.00	781 762.04	0.14
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S -SUB 3.750%/VAR 21-PRP	520 000.00	506 887.63	0.09
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	1 110 000.00	1 181 028.11	0.21
EUR RAKUTEN GROUP INC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	200 000.00	162 190.97	0.03
EUR UBS GROUP AG-REG-S 2.125%/VAR 22-13.10.26	655 000.00	680 422.33	0.12
EUR UBS GROUP AG-REG-S 2.875%/VAR 22-02.04.32	405 000.00	400 011.75	0.07
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S-SUB 7.250%/VAR 23-PRP	200 000.00	223 020.74	0.04
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S-SUB 7.862%/VAR 23-15.11.83	1 005 000.00	1 149 817.99	0.20
EUR VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-29.10.28	490 000.00	533 601.15	0.09
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 2.498%/VAR 21-PRP	500 000.00	492 217.47	0.09
ユーロ合計		6 110 960.18	1.08
英ポンド			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S 5.851%/VAR 24-21.03.35	1 400 000.00	1 719 299.62	0.30
GBP BARCLAYS PLC-REG-S 7.090%/VAR 23-06.11.29	850 000.00	1 113 429.18	0.20
英ポンド合計		2 832 728.80	0.50
米ドル			
USD ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.500%/VAR 20-PRP	400 000.00	365 009.64	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 5.015%/VAR 22-22.07.33	1 000 000.00	954 673.22	0.17
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 6.450%/VAR 24-PRP	288 000.00	290 557.67	0.05
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB 8.000%/VAR 24-PRP	1 495 000.00	1 493 770.53	0.26
USD JPMORGAN CHASE & CO 5.299%/VAR 23-24.07.29	1 680 000.00	1 662 069.01	0.29
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	610 000.00	522 032.12	0.09
USD MORGAN STANLEY 5.123%/VAR 23-01.02.29	925 000.00	910 348.13	0.16
USD PRUDENTIAL FUNDING PLC-REG-S-SUB 2.950%/VAR 21-03.11.33	945 000.00	826 852.32	0.15
USD SUMITOMO MITSUI FINANCL GROUP INC-SUB COCO 6.600%/VAR 24-PRP	1 260 000.00	1 211 675.22	0.21
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 7.750%/VAR 24-PRP	1 000 000.00	980 000.00	0.17
USD SWISS RE SUB FINANCE PLC-144A-SUB 5.698%/VAR 24-05.04.35	400 000.00	386 400.80	0.07
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	455 000.00	499 356.59	0.09
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	600 000.00	640 337.40	0.11
USD US BANCORP 5.836%/VAR 23-12.06.34	1 345 000.00	1 329 455.15	0.23
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	550 000.00	500 754.55	0.09
米ドル合計		12 573 292.35	2.21
ノート、変動利付債合計		21 516 981.33	3.79
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD AURIZON NETWORK PTY LTD-REG-S 4.00000% 17-21.06.24	210 000.00	136 123.50	0.03
AUD CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 4.50000% 15-05.06.25	1 890 000.00	1 210 801.51	0.21
AUD NEW ZEALAND LOC GOV FUNDING AGENCY 4.70000% 23-01.08.28	1 260 000.00	814 605.55	0.14
豪ドル合計		2 161 530.56	0.38

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
ユーロ			
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 1.25000% 18-10.01.33	900 000.00	822 310.57	0.14
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY AB-REG-S 1.75000% 17-07.02.25	260 000.00	271 980.08	0.05
EUR ASTRAZENECA PLC-REG-S 0.37500% 21-03.06.29	455 000.00	420 678.27	0.07
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S-SUB 4.37500% 24-11.01.34	800 000.00	836 168.90	0.15
EUR BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 24-12.04.32	2 100 000.00	2 193 286.23	0.39
EUR BP CAPITAL MARKETS BV-REG-S 4.32300% 23-12.05.35	380 000.00	419 436.54	0.07
EUR BPCE SA-REG-S 3.87500% 24-11.01.29	900 000.00	956 981.47	0.17
EUR CADENT FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 23-05.07.29	960 000.00	1 045 456.13	0.18
EUR CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMME-REG-S 0.37500% 22-10.03.26	1 230 000.00	1 240 935.73	0.22
EUR CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25	300 000.00	315 212.12	0.06
EUR CEPESA FINANCE SA-REG-S 4.12500% 24-11.04.31	2 400 000.00	2 511 873.55	0.44
EUR CHORUS LTD 3.62500% 22-07.09.29	270 000.00	285 410.54	0.05
EUR CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 18-19.01.26	550 000.00	568 704.14	0.10
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 4.00000% 23-10.01.30	1 800 000.00	1 950 332.53	0.34
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	310 000.00	302 477.35	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.25000% 16-14.04.26	200 000.00	204 387.15	0.04
EUR CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 3.39000% 22-05.12.25	2 005 000.00	2 137 946.39	0.38
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	1 280 000.00	1 287 895.72	0.23
EUR CTP NV-REG-S 4.75000% 24-05.02.30	875 000.00	938 475.37	0.16
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.50000% 20-02.09.30	200 000.00	205 310.37	0.04
EUR DEXIA SA-REG-S 0.50000% 18-17.01.25	800 000.00	835 872.93	0.15
EUR EASYJET PLC-REG-S 3.75000% 24-20.03.31	700 000.00	732 243.57	0.13
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 3.87500% 22-11.03.30	245 000.00	263 818.88	0.05
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S 2.00000% 19-09.12.49	200 000.00	137 505.55	0.02
EUR ELENIA VERKKO OYJ-REG-S 0.37500% 20-06.02.27	170 000.00	163 702.40	0.03
EUR ELLEVIO AB-REG-S 4.12500% 24-07.03.34	1 050 000.00	1 140 339.08	0.20
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.30000% 23-23.05.34	605 000.00	665 524.27	0.12
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.50000% 17-11.07.25	1 300 000.00	1 343 703.81	0.24
EUR EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.80000% 17-10.07.48	1 090 000.00	875 398.57	0.15
EUR GAS NETWORKS IRELAND-REG-S 0.12500% 19-04.12.24	580 000.00	606 180.28	0.11
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMEN-REG-S 6.25000% 24-31.03.29	100 000.00	99 712.91	0.02
EUR LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 4.62500% 24-25.07.28	350 000.00	373 921.64	0.07
EUR LONZA FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 24-24.04.36	1 100 000.00	1 157 614.96	0.20
EUR LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.25000% 21-06.04.28	700 000.00	659 562.16	0.12
EUR NATIONAL GAS TRANSMISSION PLC-REG-S 4.25000% 23-05.04.30	455 000.00	492 234.96	0.09
EUR NATIONAL GRID ELECTRICITY DISTRIB-REG-S 3.94900% 22-20.09.32	235 000.00	250 683.26	0.04
EUR NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 4.50000% 23-01.11.26	700 000.00	760 836.81	0.13
EUR NBN CO LTD-REG-S 4.12500% 23-15.03.29	995 000.00	1 091 761.82	0.19
EUR NESTE OYJ-REG-S 3.87500% 23-21.05.31	430 000.00	461 833.63	0.08
EUR NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.25000% 20-23.01.27	790 000.00	774 537.65	0.14
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 0.87500% 22-26.01.26	465 000.00	468 791.18	0.08
EUR P3 GROUP SARL-REG-S 4.62500% 24-13.02.30	680 000.00	724 694.97	0.13
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	2 195 000.00	1 609 669.06	0.28
EUR RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG-REG-S 4.12500% 22-08.09.25	500 000.00	533 697.96	0.09
EUR REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27	600 000.00	605 402.82	0.11
EUR ROMANIA-REG-S 5.62500% 24-22.02.36	1 450 000.00	1 524 830.69	0.27
EUR ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.62500% 22-23.03.26	1 200 000.00	1 216 250.49	0.21
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 4.75000% 24-14.08.29	200 000.00	216 255.81	0.04
EUR SELP FINANCE SARL-REG-S 3.75000% 22-10.08.27	290 000.00	305 433.12	0.05
EUR SEVERN TRENT UTILITIES FINANCE PL-REG-S 4.00000% 24-05.03.34	840 000.00	884 368.90	0.16
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.62500% 23-02.06.33	1 000 000.00	1 126 230.33	0.20
EUR TELEPERFORMANCE SE-REG-S 5.25000% 23-22.11.28	600 000.00	642 839.51	0.11
EUR TELEPERFORMANCE SE-REG-S 5.75000% 23-22.11.31	500 000.00	539 791.61	0.09
EUR TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD-REG-S 3.97400% 24-12.03.36	450 000.00	475 870.44	0.08
EUR VAR ENERGI ASA-REG-S 5.50000% 23-04.05.29	310 000.00	348 714.42	0.06
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 2.50000% 19-24.05.39	320 000.00	286 123.77	0.05
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.62500% 21-01.09.51	400 000.00	235 574.58	0.04
EUR WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.01000% 21-22.09.28	2 395 000.00	2 206 754.27	0.39
ユーロ合計		45 753 542.22	8.05
英ポンド			
GBP LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 2.25000% 17-16.10.24	165 000.00	203 566.84	0.04
GBP VICINITY CENTRES TRUST-REG-S 3.37500% 16-07.04.26	480 000.00	575 504.39	0.10
英ポンド合計		779 071.23	0.14

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
米ドル			
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 5.37500% 24-05.04.34	635 000.00	606 528.64	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25	1 180 000.00	1 156 179.94	0.20
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 4.62500% 23-06.03.26	1 250 000.00	1 238 000.00	0.22
USD EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA/THE-REG-S 3.87500% 23-16.05.26	1 225 000.00	1 195 428.50	0.21
USD JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 1.00000% 20-21.05.25	1 940 000.00	1 847 754.46	0.32
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	1 400 000.00	1 361 866.53	0.24
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 120 000.00	1 028 854.40	0.18
USD ROYAL BANK OF CANADA 5.20000% 23-20.07.26	1 350 000.00	1 344 295.71	0.24
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	1 730 000.00	1 591 059.38	0.28
USD SHRIRAM FINANCE LTD-REG-S 6.62500% 24-22.04.27	1 300 000.00	1 287 650.00	0.23
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 4.37500% 23-13.02.26	1 040 000.00	1 023 154.69	0.18
米ドル合計		13 680 772.25	2.41
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		62 374 916.26	10.98
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SO-REG-S 0.00000% 20-25.02.28	2 800 000.00	2 662 726.76	0.47
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.00000% 21-16.11.26	240 000.00	233 028.92	0.04
ユーロ合計		2 895 755.68	0.51
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		2 895 755.68	0.51
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
ユーロ			
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S-SUB 8.375%/VAR 23-23.09.33	1 000 000.00	1 177 671.95	0.21
EUR ABANCA CORP BANCARIA SA-REG-S 5.875%/VAR 23-02.04.30	1 300 000.00	1 478 444.49	0.26
EUR ACHMEA BV-REG-S-SUB 5.625%/VAR 24-02.11.44	620 000.00	664 047.40	0.12
EUR APA INFRASTRUCTURE LTD-REG-S-SUB 7.125%/VAR 23-09.11.83	305 000.00	347 405.55	0.06
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	350 000.00	354 362.49	0.06
EUR AXA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	435 000.00	476 294.16	0.08
EUR BANCO BPM SPA-REG-S 4.875%/VAR 24-17.01.30	720 000.00	782 501.10	0.14
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 24-18.06.34	950 000.00	999 624.29	0.17
EUR BANCO DE CREDITO SOCIAL CO SA-REG-S 7.500%/VAR 23-14.09.29	1 200 000.00	1 408 068.81	0.25
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-13.11.29	400 000.00	436 650.05	0.08
EUR COMMONWEALTH BK OF AUSTRLIA-REG-S-SUB 1.936%/VAR 17-03.10.29	290 000.00	306 029.72	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 1.000%/VAR 20-22.04.26	700 000.00	726 926.41	0.13
EUR DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.625%/VAR 24-14.05.34	715 000.00	760 071.93	0.13
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.000%/VAR 20-19.11.25	100 000.00	105 125.67	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.750%/VAR 20-19.11.30	300 000.00	278 631.58	0.05
EUR KBC GROUP NV-REG-S 4.375%/VAR 22-23.11.27	400 000.00	433 086.20	0.08
EUR TOTAL SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 100 000.00	2 206 130.07	0.39
ユーロ合計		12 941 071.87	2.28
英ポンド			
GBP VIRGIN MONEY UK PLC-REG-S 7.625%/VAR 23-23.08.29	835 000.00	1 119 377.47	0.20
英ポンド合計		1 119 377.47	0.20
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26	675 000.00	659 642.65	0.12
USD MORGAN STANLEY 2.239%/VAR 21-21.07.32	1 040 000.00	827 012.94	0.14
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.867%/VAR 23-08.06.34	190 000.00	186 429.45	0.03
米ドル合計		1 673 085.04	0.29
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		15 733 534.38	2.77
債券、固定利付債			
豪ドル			
AUD AUSTRALIA-REG-S 1.50000% 19-21.06.31	8 090 000.00	4 361 030.96	0.77
AUD AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 16-21.05.28	3 610 000.00	2 187 212.43	0.39
AUD AUSTRALIA-REG-S 3.00000% 16-21.03.47	270 000.00	132 661.03	0.02
豪ドル合計		6 680 904.42	1.18

注記は当財務書類の一部である。

銘柄		数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
カナダ・ドル				
CAD	CANADA, GOVERNMENT 1.50000% 15-01.06.26	4 030 000.00	2 772 224.05	0.49
CAD	CANADA, GOVERNMENT 1.00000% 16-01.06.27	2 260 000.00	1 503 995.17	0.26
CAD	CANADA, GOVERNMENT 3.50000% 11-01.12.45	3 740 000.00	2 625 606.04	0.46
CAD	CANADA, GOVERNMENT 4.00000% 08-01.06.41	1 040 000.00	779 085.17	0.14
カナダ・ドル合計			7 680 910.43	1.35
中国元				
CNY	AGRICULTURAL DEVELOPMENT BANK OF CHINA 3.45000% 20-23.09.25	96 000 000.00	13 520 366.92	2.38
CNY	CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.80000% 16-25.01.36	59 000 000.00	9 208 224.15	1.62
CNY	CHINA DEVELOPMENT BANK 4.04000% 17-10.04.27	39 800 000.00	5 786 403.64	1.02
CNY	CHINA DEVELOPMENT BANK CORP 3.45000% 19-20.09.29	121 500 000.00	17 729 253.33	3.12
中国元合計			46 244 248.04	8.14
ユーロ				
EUR	ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 1.50000% 20-23.06.26	300 000.00	280 742.28	0.05
EUR	ATHORA HOLDING LTD-REG-S 6.62500% 23-16.06.28	550 000.00	617 256.64	0.11
EUR	BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 0.50000% 17-03.07.24	1 900 000.00	2 020 015.34	0.35
EUR	CHUBB INA HOLDINGS INC 2.50000% 18-15.03.38	305 000.00	283 513.50	0.05
EUR	COENTREPRISE DE TRANSPORT D' ELECT-REG-S 3.75000% 24-17.01.36	600 000.00	628 976.90	0.11
EUR	EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	1 310 000.00	843 568.11	0.15
EUR	FINNAIR OYJ-REG-S 4.25000% 21-19.05.25	720 000.00	764 086.05	0.13
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 0.75000% 17-25.05.28	4 760 000.00	4 670 834.89	0.82
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.50000% 19-25.05.50	1 800 000.00	1 292 017.54	0.23
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 0.50000% 20-25.05.40	3 630 000.00	2 533 173.26	0.45
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.25000% 18-15.08.28	900 000.00	871 246.71	0.15
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.20000% 24-15.02.34	4 080 000.00	4 217 712.40	0.74
EUR	IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 15-18.02.45	3 910 000.00	3 449 133.19	0.61
EUR	IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 16-15.05.26	1 990 000.00	2 041 861.10	0.36
EUR	ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 4.00000% 05-01.02.37	2 310 000.00	2 477 871.39	0.44
EUR	ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46	3 690 000.00	3 387 792.03	0.60
EUR	JAPAN BANK FOR INTL COOPERATION 3.12500% 23-15.02.28	960 000.00	1 020 468.74	0.18
EUR	LONZA FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 23-25.05.33	240 000.00	257 010.10	0.04
EUR	MAPFRE SA-REG-S-SUB 2.87500% 22-13.04.30	500 000.00	490 534.48	0.09
EUR	MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	520 000.00	522 538.20	0.09
EUR	PLUXEE NV-REG-S 3.75000% 24-04.09.32	900 000.00	945 436.19	0.17
EUR	RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26	200 000.00	199 747.02	0.03
EUR	SARTORIUS FINANCE BV-REG-S 4.37500% 23-14.09.29	400 000.00	435 697.99	0.08
EUR	SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-07.08.45	2 630 000.00	2 637 169.51	0.46
EUR	SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.90000% 16-31.10.46	920 000.00	852 451.60	0.15
EUR	SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 4.20000% 05-31.01.37	1 350 000.00	1 545 111.90	0.27
EUR	SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.40000% 18-30.04.28	1 790 000.00	1 797 106.57	0.32
EUR	SPAIN, KINGDOM OF-REG-S 1.60000% 15-30.04.25	3 440 000.00	3 612 269.52	0.64
EUR	TAURON POLSKA ENERGIA SA-REG-S 2.37500% 17-05.07.27	250 000.00	249 766.10	0.04
EUR	TSB BANK PLC-REG-S 3.31900% 24-05.03.29	375 000.00	399 951.89	0.07
EUR	UBS SWITZERLAND AG-REG-S 3.30400% 24-05.03.29	905 000.00	966 761.64	0.17
EUR	UMG GROUPE VYV 1.62500% 19-02.07.29	200 000.00	188 620.18	0.03
ユーロ合計			46 500 442.96	8.18
英ポンド				
GBP	BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	185 000.00	175 745.67	0.03
GBP	ROTHESAY LIFE PLC-REG-S-SUB 3.37500% 19-12.07.26	655 000.00	778 314.81	0.14
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 3.25000% 12-22.01.44	1 190 000.00	1 203 892.77	0.21
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.47	3 890 000.00	2 647 918.30	0.47
GBP	UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 0.87500% 19-22.10.29	3 350 000.00	3 519 103.71	0.62
英ポンド合計			8 324 975.26	1.47
日本円				
JPY	JAPAN 0.10000% 19-20.12.28	957 000 000.00	5 986 958.92	1.05
JPY	JAPAN 0.50000% 19-20.03.59	800 950 000.00	3 205 326.93	0.56
JPY	JAPAN 0.80000% 17-20.03.47	346 000 000.00	1 806 262.25	0.32
JPY	JAPAN 0.80000% 18-20.03.58	146 000 000.00	662 972.58	0.12
JPY	JAPAN 2.00000% 11-20.09.41	209 000 000.00	1 428 448.89	0.25
JPY	JAPAN 2.30000% 05-20.06.35	839 600 000.00	6 067 485.86	1.07
日本円合計			19 157 455.43	3.37

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
韓国ウォン			
KRW KOREA, REPUBLIC OF 1.37500% 20-10.06.30	13 450 000 000.00	8 522 738.26	1.50
韓国ウォン合計		8 522 738.26	1.50
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 1.50000% 19-15.05.31	2 150 000.00	1 023 827.80	0.18
NZD NEW ZEALAND 1.75000% 20-15.05.41	2 510 000.00	913 766.80	0.16
NZD NEW ZEALAND 3.00000% 18-20.04.29	7 020 000.00	3 839 745.39	0.68
NZD NEW ZEALAND-REG-S 2.75000% 16-15.04.37	5 580 000.00	2 585 966.91	0.45
ニュージーランド・ドル合計		8 363 306.90	1.47
米ドル			
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 3.50000% 16-15.08.46	170 000.00	121 123.32	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELEC 4.95000% 23-01.04.33	405 000.00	388 456.32	0.07
USD CONSUMERS ENERGY COMPANY 3.25000% 16-15.08.46	100 000.00	70 257.73	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLD-REG-S *DEFAULTED* 2.70000% 21-12.07.26	340 000.00	19 975.00	0.00
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.00000% 12-30.09.42	250 000.00	198 287.96	0.04
USD DUKE ENERGY OHIO INC 5.25000% 23-01.04.33	160 000.00	156 107.81	0.03
USD DUKE ENERGY PROGRESS LLC 5.25000% 23-15.03.33	425 000.00	417 018.15	0.07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.87500% 23-15.03.28	880 000.00	848 928.29	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.15000% 15-22.05.45	420 000.00	384 657.43	0.07
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	363 000.00	297 319.69	0.05
USD PACIFICORP 6.00000% 09-15.01.39	340 000.00	338 295.22	0.06
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	300 000.00	249 750.00	0.04
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	180 000.00	177 097.39	0.03
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.00000% 17-01.04.47	170 000.00	127 233.52	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	235 000.00	229 365.69	0.04
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 2.85000% 19-01.08.29	155 000.00	136 802.27	0.03
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.00000% 23-30.09.25	21 146.00	2 220.33	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.25000% 23-30.09.26	21 171.00	1 905.39	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.50000% 23-30.09.27	42 395.00	3 567.54	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.75000% 23-30.09.28	63 671.00	4 746.67	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S PIK 7.00000% 23-30.09.29	63 748.00	3 984.25	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 7.25000% 23-30.09.30	29 986.00	1 506.79	0.00
米ドル合計		4 178 606.76	0.73
債券、固定利付債合計		155 653 588.46	27.39
債券、ゼロ・クーポン			
ユーロ			
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 0.00000% 20-22.10.27	3 490 000.00	3 374 597.80	0.59
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-15.08.26	1 880 000.00	1 881 939.88	0.33
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.05.35	4 350 000.00	3 493 786.35	0.62
ユーロ合計		8 750 324.03	1.54
債券、ゼロ・クーポン合計		8 750 324.03	1.54
債券、変動利付債			
ユーロ			
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 3.250%/VAR 20-PRP	250 000.00	259 819.73	0.05
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S-SUB 3.625%/VAR 20-PRP	200 000.00	203 116.87	0.04
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	400 000.00	425 026.88	0.07
EUR IBERCAJA BANCO SA-REG-S 4.375%/VAR 24-30.07.28	400 000.00	429 202.81	0.08
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	600 000.00	587 559.72	0.10
EUR SES SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	600 000.00	593 343.93	0.10
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	100 000.00	100 791.78	0.02
ユーロ合計		2 598 861.72	0.46
英ポンド			
GBP M&G PLC-REG-S-SUB 5.625%/VAR 18-20.10.51	430 000.00	505 551.53	0.09
GBP YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 7.375%/VAR 23-12.09.27	420 000.00	541 063.73	0.09
英ポンド合計		1 046 615.26	0.18

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
日本円			
JPY JAPAN 0.100%/CPI LINKED 19-10.03.29	898 000 000.00	6 439 708.74	1.13
日本円合計		6 439 708.74	1.13

米ドル			
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	1 210 000.00	1 211 046.65	0.21
USD SCOR SE-REG-S-SUB 5.250%/VAR 18-PRP	400 000.00	334 000.00	0.06
米ドル合計		1 545 046.65	0.27
債券、変動利付債合計		11 630 232.37	2.04

財務省証券（T-note）、固定利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 13-15.05.43	3 780 000.00	2 828 946.11	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45	2 230 000.00	1 630 339.07	0.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46	17 340 000.00	11 117 242.92	1.95
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 17-15.08.47	2 160 000.00	1 513 434.37	0.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-30.11.26	8 990 000.00	8 277 121.05	1.46
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	50 000.00	38 988.28	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31	13 770 000.00	11 268 808.66	1.98
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-30.09.27	11 150 000.00	10 902 173.85	1.92
USD AMERICA, UNITES STATES OF 4.00000% 24-31.01.29	26 400 000.00	25 580 156.19	4.50
米ドル合計		73 157 210.50	12.87
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		73 157 210.50	12.87

財務省証券（T-note）、変動利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 15-15.02.45	1 390 000.00	1 325 981.50	0.23
米ドル合計		1 325 981.50	0.23
財務省証券（T-note）、変動利付債合計		1 325 981.50	0.23

転換債券、固定利付債

米ドル			
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) STEP UP 23-30.09.32	71 399.00	4 162.56	0.00
米ドル合計		4 162.56	0.00
転換債券、固定利付債		4 162.56	0.00

転換債券、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 0.00000% 23-30.09.28	421 475.00	90 242.01	0.02
米ドル合計		90 242.01	0.02
転換債券、ゼロ・クーポン合計		90 242.01	0.02
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		420 321 563.92	73.97

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

アセット・バック証券、固定利付債

米ドル			
USD PSNH FUNDING LLC 3.81400% 18-01.02.35	600 000.00	550 441.38	0.10
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.60000% 18-25.02.48	1 500 000.00	277 859.96	0.05
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.34000% 18-25.08.47	1 890 000.00	230 460.45	0.04
米ドル合計		1 058 761.79	0.19
アセット・バック証券、固定利付債合計		1 058 761.79	0.19

アセット・バック証券、変動利付債

米ドル			
USD SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM-144A 3.560%/VAR 17-25.07.40	150 000.00	125 823.23	0.02
米ドル合計		125 823.23	0.02
アセット・バック証券、変動利付債合計		125 823.23	0.02

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
米ドル			
USD BANK BNK-SUB 4.40700% 18-01.11.61	300 000.00	284 574.90	0.05
USD BBCMS TRUST-144A-SUB 4.49800% 15-06.08.35	407 000.00	353 620.24	0.06
USD BENCHMARK MORTGAGE TRUST 3.94360% 18-01.07.51	200 000.00	186 561.26	0.03
USD BWAY 2013-1515 MORTGAGE TRUST-144A 3.45430% 13-10.03.33	200 000.00	187 508.16	0.03
USD CD MORTGAGE TRUST 3.45600% 17-01.11.50	400 000.00	368 424.60	0.06
USD CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 4.22800% 18-01.06.51	375 000.00	352 919.85	0.06
USD COMM 2015-PC1 MORTGAGE TRUST 3.62000% 15-01.07.50	250 000.00	63 454.08	0.01
USD FANNIE MAE 1.00000% 22-01.04.51	950 000.00	537 087.54	0.09
USD FANNIE MAE 1.50000% 21-01.03.51	550 000.00	324 010.59	0.06
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.03.51	1 650 000.00	977 107.80	0.17
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.04.51	3 025 000.00	1 883 791.20	0.33
USD FANNIE MAE 2.00000% 20-01.09.50	1 750 000.00	882 534.96	0.16
USD FANNIE MAE 2.00000% 20-01.01.51	500 000.00	283 626.46	0.05
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.02.51	1 775 000.00	1 021 333.60	0.18
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.03.51	2 200 000.00	1 288 142.31	0.23
USD FANNIE MAE 2.00000% 21-01.05.51	600 000.00	368 442.83	0.06
USD FANNIE MAE 2.50000% 21-01.10.51	1 575 000.00	1 055 575.82	0.19
USD FANNIE MAE 2.50000% 22-01.03.52	450 000.00	313 512.89	0.05
USD FANNIE MAE 2.50000% 21-01.08.51	1 100 000.00	718 709.34	0.13
USD FANNIE MAE 2.50000% 21-01.08.51	1 346 000.00	842 759.73	0.15
USD FANNIE MAE 3.00000% 13-01.08.43	136 385.00	25 746.76	0.00
USD FANNIE MAE 3.00000% 16-01.07.46	1 500 000.00	380 401.21	0.07
USD FANNIE MAE 3.00000% 21-01.10.51	375 000.00	253 529.88	0.04
USD FANNIE MAE 3.00000% 22-01.04.52	1 800 000.00	1 300 159.65	0.23
USD FANNIE MAE 3.00000% 22-01.12.48	1 975 000.00	1 360 690.32	0.24
USD FANNIE MAE 3.00000% 20-01.06.50	2 250 000.00	639 557.04	0.11
USD FANNIE MAE 3.00000% 20-01.08.50	600 000.00	187 872.61	0.03
USD FANNIE MAE 3.50000% 16-01.08.46	450 000.00	97 074.13	0.02
USD FANNIE MAE 3.50000% 15-01.04.45	200 000.00	56 488.06	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 16-01.01.46	175 000.00	47 030.91	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 16-01.12.46	600 000.00	231 586.97	0.04
USD FANNIE MAE 3.50000% 18-01.03.48	250 000.00	36 165.28	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 17-01.10.47	5 800 000.00	1 810 215.38	0.32
USD FANNIE MAE 3.50000% 18-01.07.48	350 000.00	62 546.65	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 17-01.08.47	650 000.00	79 330.13	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 18-01.05.48	8 975 000.00	1 127 941.88	0.20
USD FANNIE MAE 4.00000% 10-01.01.41	1 357 002.00	71 170.77	0.01
USD FANNIE MAE 4.00000% 11-01.01.41	1 584 763.00	89 115.99	0.02
USD FANNIE MAE 4.00000% 15-01.11.45	1 250 000.00	292 437.74	0.05
USD FANNIE MAE 4.00000% 16-01.02.46	1 025 000.00	84 656.42	0.01
USD FANNIE MAE 4.00000% 15-01.08.45	1 575 000.00	411 664.97	0.07
USD FANNIE MAE 4.00000% 23-01.08.52	325 000.00	272 437.19	0.05
USD FANNIE MAE 4.00000% 14-01.11.44	400 000.00	80 288.45	0.01
USD FANNIE MAE 4.00000% 11-01.02.41	938 348.00	52 704.33	0.01
USD FANNIE MAE 4.00000% 11-01.02.41	2 969 225.00	167 087.74	0.03
USD FANNIE MAE 4.50000% 15-01.06.44	465 000.00	68 134.33	0.01
USD FANNIE MAE 4.50000% 16-01.07.44	350 000.00	50 061.82	0.01
USD FANNIE MAE 4.50000% 11-01.04.41	1 629 000.00	61 828.05	0.01
USD FANNIE MAE 5.00000% 11-01.01.41	589 000.00	31 083.83	0.01
USD FANNIE MAE 5.00000% 23-01.04.53	576 790.00	508 261.28	0.09
USD FANNIE MAE 5.00000% 10-01.08.40	50 000.00	2 265.71	0.00
USD FANNIE MAE 5.50000% 15-01.01.39	425 000.00	63 824.84	0.01
USD FANNIE MAE 5.50000% 23-01.06.53	875 000.00	811 495.59	0.14
USD FANNIE MAE 5.50000% 07-01.04.37	1 242 395.00	38 825.53	0.01
USD FANNIE MAE 6.50000% 23-01.07.53	1 625 000.00	1 537 635.32	0.27
USD FANNIE MAE POOL 2.00000% 22-01.11.51	1 600 000.00	1 055 514.12	0.19
USD FANNIE MAE POOL 2.50000% 21-01.11.51	1 050 000.00	696 856.64	0.12
USD FREDDIE MAC 1.50000% 21-01.10.51	2 496 884.00	1 572 944.82	0.28
USD FREDDIE MAC 2.00000% 21-01.02.51	3 550 000.00	2 033 948.73	0.36
USD FREDDIE MAC 2.50000% 20-01.10.50	625 000.00	332 641.19	0.06
USD FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.09.46	975 000.00	163 372.84	0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FREDDIE MAC 3.00000% 20-01.09.50	923 000.00	304 160.00	0.05
USD FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.10.46	1 200 000.00	329 991.15	0.06
USD FREDDIE MAC 3.00000% 18-01.04.47	2 125 000.00	455 839.83	0.08
USD FREDDIE MAC 3.00000% 22-01.02.52	1 825 000.00	1 284 294.34	0.23
USD FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.08.46	600 000.00	76 733.74	0.01
USD FREDDIE MAC 3.50000% 22-01.05.51	2 650 000.00	1 924 530.93	0.34
USD FREDDIE MAC 3.50000% 23-01.02.53	1 125 000.00	910 246.83	0.16
USD FREDDIE MAC 3.50000% 23-01.08.45	1 275 000.00	1 084 757.69	0.19
USD FREDDIE MAC 3.50000% 15-01.06.45	350 000.00	101 003.32	0.02
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.11.47	325 000.00	41 648.64	0.01
USD FREDDIE MAC 4.00000% 23-01.03.53	625 000.00	524 637.98	0.09
USD FREDDIE MAC 4.00000% 23-01.06.53	1 675 000.00	1 424 833.49	0.25
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.08.47	450 000.00	60 392.39	0.01
USD FREDDIE MAC 4.00000% 17-01.11.47	475 000.00	59 607.31	0.01
USD FREDDIE MAC 4.00000% 22-01.04.52	1 900 000.00	1 389 315.05	0.24
USD FREDDIE MAC 4.50000% 11-01.03.41	2 647 244.00	90 696.89	0.02
USD FREDDIE MAC 4.50000% 23-01.03.53	1 225 000.00	1 071 527.87	0.19
USD FREDDIE MAC 4.50000% 11-01.09.41	1 120 431.00	34 872.14	0.01
USD FREDDIE MAC 5.00000% 05-01.05.35	11 775 000.00	97 646.52	0.02
USD FREDDIE MAC 5.00000% 23-01.03.53	1 500 000.00	1 353 865.05	0.24
USD FREDDIE MAC 5.00000% 23-01.03.53	2 300 000.00	2 035 656.75	0.36
USD FREDDIE MAC 5.00000% 23-01.05.53	1 325 000.00	1 192 464.94	0.21
USD FREDDIE MAC 5.50000% 14-01.06.41	575 000.00	53 496.74	0.01
USD FREDDIE MAC 5.50000% 23-01.03.53	1 150 000.00	1 027 676.90	0.18
USD FREDDIE MAC 5.50000% 23-01.07.53	700 000.00	639 515.29	0.11
USD FREDDIE MAC 6.00000% 23-01.06.53	975 000.00	912 849.03	0.16
USD FREDDIE MAC 6.00000% 23-01.05.53	600 000.00	555 966.83	0.10
USD FREDDIE MAC POOL 2.50000% 21-01.10.51	3 000 000.00	2 000 339.91	0.35
USD GINNIE MAE 2.00000% 20-01.02.51	1 350 000.00	738 372.25	0.13
USD GINNIE MAE 2.00000% 21-01.11.51	2 425 000.00	1 588 774.71	0.28
USD GINNIE MAE 3.00000% 16-01.08.46	1 925 000.00	259 870.17	0.05
USD GINNIE MAE 3.00000% 19-01.10.49	5 425 000.00	932 088.78	0.16
USD GINNIE MAE 3.50000% 12-01.08.42	1 300 000.00	201 870.22	0.04
USD GINNIE MAE 3.50000% 18-01.01.48	525 000.00	68 854.47	0.01
USD GINNIE MAE 4.50000% 11-01.05.41	1 141 511.00	41 667.12	0.01
USD GINNIE MAE 5.50000% 22-01.12.52	600 000.00	529 835.63	0.09
USD GINNIE MAE 5.50000% 11-01.06.41	1 219 909.00	9 508.72	0.00
USD GINNIE MAE 5.50000% 08-01.12.38	1 706 205.00	22 035.14	0.00
USD GINNIE MAE 5.50000% 10-01.03.40	1 357 167.00	26 124.11	0.00
USD GINNIE MAE 5.50000% 08-01.01.38	1 053 419.00	50 673.00	0.01
USD GINNIE MAE 6.00000% 23-01.08.53	400 000.00	387 765.50	0.07
USD GINNIE MAE 6.50000% 23-01.10.53	325 000.00	323 728.11	0.06
USD GINNIE MAE 6.50000% 07-01.06.37	8 288 862.00	314 792.78	0.06
USD GINNIE MAE 6.50000% 08-01.10.38	8 474 348.00	20 738.88	0.00
USD GINNIE MAE II 2.50000% 21-01.12.51	3 550 000.00	2 416 407.85	0.43
USD HILTON USA TRUST-144A-SUB 3.32284% 16-01.11.35	400 000.00	301 000.00	0.05
USD MORGAN STANLEY BOA MERR LYH TRT 15-C24 3.73200% 15-01.05.48	170 000.00	164 801.77	0.03
米ドル合計		59 977 770.02	10.55
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		59 977 770.02	10.55

モーゲージ・バック証券、変動利付債

米ドル

USD BX TRUST-144A 1M LIBOR+80BP 18-15.05.35	350 000.00	348 687.50	0.06
USD FREMF MORTGAGE TRUST-144A-SUB VAR 17-01.05.50	200 000.00	189 908.34	0.04
USD MORGAN STANLEY BOA ML TRT 2015-C24-SUB VAR 15-01.05.48	500 000.00	466 175.75	0.08
米ドル合計		1 004 771.59	0.18
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		1 004 771.59	0.18

ノート、固定利付債

米ドル

USD AKER BP ASA-144A 3.10000% 21-15.07.31	200 000.00	166 430.05	0.03
USD AKER BP ASA-144A 3.75000% 20-15.01.30	490 000.00	441 920.57	0.08

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	400 000.00	351 443.87	0.06
USD BROADCOM INC-144A 2.60000% 21-15.02.33	1 630 000.00	1 284 836.35	0.23
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	506 000.00	424 934.71	0.07
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.14400% 23-28.04.25	735 000.00	731 323.71	0.13
USD CARRIER GLOBAL CORP 5.90000% 24-15.03.34	470 000.00	480 191.10	0.08
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 5.12500% 20-01.04.25	285 000.00	283 728.20	0.05
USD COMCAST CORP 2.93700% 22-01.11.56	332 000.00	193 742.68	0.03
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.85000% 21-15.07.25	200 000.00	200 340.09	0.04
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	565 000.00	574 472.46	0.10
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	180 000.00	170 466.77	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 7.20000% 23-28.11.33	800 000.00	836 022.05	0.15
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 7.80000% 23-28.11.53	1 585 000.00	1 702 291.02	0.30
USD MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	105 000.00	100 588.19	0.02
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	80 000.00	74 756.03	0.01
USD PHILLIPS 66 COMPANY 4.68000% 23-15.02.45	400 000.00	336 225.26	0.06
USD RWE FINANCE US LLC-144A 5.87500% 24-16.04.34	1 190 000.00	1 167 392.26	0.21
USD SOCIETE GENERALE SA-SUB-144A 7.36700% 23-10.01.53	1 250 000.00	1 237 763.96	0.22
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 6.20000% 10-15.03.40	320 000.00	324 389.36	0.06
USD TEACHERS INSURANCE&ANNUITY ASS-144A-SUB 4.90000% 14-15.09.44	1 090 000.00	945 396.65	0.17
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	115 000.00	103 869.20	0.02
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 2.05000% 21-15.04.26	285 000.00	261 641.40	0.05
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	145 000.00	143 805.20	0.02
USD XCEL ENERGY INC 4.80000% 11-15.09.41	290 000.00	244 380.60	0.04
米ドル合計		12 782 351.74	2.26
ノート、固定利付債合計		12 782 351.74	2.26
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 7.132%/VAR 24-19.01.55	350 000.00	334 174.22	0.06
米ドル合計		334 174.22	0.06
ノート、変動利付債合計		334 174.22	0.06
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
豪ドル			
AUD AURIZON FINANCE PTY LTD 3.00000% 21-09.03.28	1 020 000.00	594 361.35	0.10
豪ドル合計		594 361.35	0.10
英ポンド			
GBP NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSM-REG-S 4.00000% 12-08.06.27	330 000.00	395 995.19	0.07
英ポンド合計		395 995.19	0.07
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		990 356.54	0.17
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
豪ドル			
AUD NATIONAL AUSTRALIA BANK-SUB 6.322%/VAR 22-03.08.32	750 000.00	494 137.50	0.09
豪ドル合計		494 137.50	0.09
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		494 137.50	0.09
債券、変動利付債			
ニュージーランド・ドル			
NZD NEW ZEALAND 2.500%/CPI LINKED 17-20.09.40	1 560 000.00	1 101 266.39	0.19
NZD NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30	5 590 000.00	4 450 226.64	0.78
ニュージーランド・ドル合計		5 551 493.03	0.97
債券、変動利付債合計		5 551 493.03	0.97
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品		82 319 639.66	14.49

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
カナダ・ドル			
CAD PSP CAPITAL INC 0.90000% 20-15.06.26	4 300 000.00	2 902 654.15	0.51
カナダ・ドル合計		2 902 654.15	0.51
ノート、固定利付債合計		2 902 654.15	0.51
公認の証券取引所に上場されておらずまた他の規制ある市場で取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		2 902 654.15	0.51

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル			
USD BOEING CO/THE-144A 6.85800% 24-01.05.54	440 000.00	441 192.18	0.08
USD ENGIE SA-144A 5.62500% 24-10.04.34	915 000.00	897 341.93	0.16
USD ENGIE SA-144A 5.87500% 24-10.04.54	410 000.00	389 542.45	0.07
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 6.50000% 23-16.01.29	415 000.00	427 507.63	0.07
米ドル合計		2 155 584.19	0.38
ノート、固定利付債合計		2 155 584.19	0.38
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		2 155 584.19	0.38

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

投資信託、オープン・エンド型

ルクセンブルグ			
EUR UBS (LUX) BOND FUND - EURO HIGH YIELD (EUR) I-X-ACC	250.00	41 032.47	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - USD HIGH YIELD U-X-ACC	2.00	45 632.46	0.01
USD UBS (LUX) BOND SICAV - ASIAN HIGH YIELD (USD) I-X-DIST	67 000.00	3 687 010.00	0.64
ルクセンブルグ合計		3 773 674.93	0.66
投資信託、オープン・エンド型合計		3 773 674.93	0.66
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計			
		3 773 674.93	0.66
投資有価証券合計		511 473 116.85	90.01

To Be Announced（"TBA"）モーゲージ担保証券（注1）

TBAモーゲージ担保証券

USD FANNIE MAE 6.50000% MAY 08 01.08.35	700 000.00	-8 725.72	0.00
USD FANNIE MAE 3.50000% MAY 24 13.05.24	1 100 000.00	-21 940.05	0.00
USD FANNIE MAE 2.00000% MAY 24 13.05.24	800 000.00	-17 755.70	0.00
USD FANNIE MAE 2.50000% MAY 24 13.05.24	1 600 000.00	-35 081.41	-0.02
USD FANNIE MAE 7.00000% MAY 24 13.05.24	2 050 000.00	-17 943.59	0.00
TBAモーゲージ担保証券合計		-101 446.47	-0.02
To Be Announced（"TBA"）モーゲージ担保証券（注1）合計			
		-101 446.47	-0.02

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 06.06.24	154.00	-247 980.46	-0.04
EUR EURO-BOBL FUTURE 06.06.24	5.00	-1 999.50	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 06.06.24	3.00	-1 347.26	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 06.06.24	-25.00	82 866.88	0.01
GBP LONG GILT FUTURE 26.06.24	80.00	-160 400.42	-0.03
CAD CAN 5YR BOND FUTURE 19.06.24	157.00	-170 273.32	-0.03
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	11.00	-4 000.00	0.00

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
AUD AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 17.06.24	-272.00	253 422.50	0.04
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 17.06.24	72.00	-193 757.42	-0.03
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 18.06.24	68.00	-273 289.04	-0.05
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.24	-16.00	106 758.17	0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	-46.00	101 343.70	0.02
CAD CAN 10YR BOND FUTURE 19.06.24	-87.00	162 113.77	0.03
債券関連金融先物合計		-346 542.40	-0.06
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-346 542.40	-0.06
金融派生商品合計		-447 988.87	-0.08

先渡為替契約

購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日

USD	8 075 861.45	KRW	10 884 000 000.00	7.5.2024	204 894.96	0.04
USD	46 252 637.50	CNY	328 810 000.00	6.5.2024	706 355.01	0.12
USD	10 131 089.55	AUD	15 560 000.00	6.5.2024	26 850.92	0.00
JPY	6 057 046 600.00	USD	40 129 309.86	7.5.2024	-1 625 586.17	-0.29
USD	11 240 906.04	CAD	15 240 000.00	6.5.2024	147 782.03	0.02
USD	27 686 824.45	JPY	4 179 000 000.00	7.5.2024	1 121 557.26	0.20
CHF	112 150 800.00	USD	123 965 355.38	6.5.2024	-1 667 591.44	-0.29
USD	13 832 595.18	NZD	23 220 000.00	6.5.2024	92 175.66	0.02
EUR	120 299 400.00	USD	129 373 138.63	6.5.2024	-737 151.93	-0.13
USD	141 757 317.73	EUR	131 815 000.00	6.5.2024	807 715.43	0.14
GBP	12 099 100.00	USD	15 203 572.98	7.5.2024	-53 515.53	-0.01
USD	15 801 582.78	GBP	12 575 000.00	7.5.2024	55 620.49	0.01
USD	1 101 103.34	CNH	7 990 000.00	6.5.2024	-578.14	0.00
JPY	32 693 200.00	USD	216 717.79	7.5.2024	-8 892.09	0.00
CHF	677 000.00	USD	750 139.67	6.5.2024	-11 887.37	0.00
GBP	156 400.00	USD	196 142.74	7.5.2024	-304.29	0.00
GBP	172 800.00	USD	216 641.09	7.5.2024	-267.15	0.00
USD	3 021 557.22	EUR	2 840 000.00	6.5.2024	-15 250.96	0.00
USD	552 829.99	JPY	84 381 100.00	7.5.2024	16 432.18	0.00
JPY	31 517 400.00	USD	204 425.42	7.5.2024	-4 074.10	0.00
USD	981 748.75	CHF	893 400.00	6.5.2024	7 517.43	0.00
USD	1 789 089.51	EUR	1 679 400.00	6.5.2024	-6 690.65	0.00
USD	46 182 477.04	CNY	328 810 000.00	6.6.2024	-48 785.15	-0.01
CNY	328 810 000.00	USD	46 278 676.99	6.5.2024	-732 394.50	-0.13
USD	7 926 589.47	KRW	10 884 000 000.00	7.6.2024	51 381.79	0.01
KRW	10 884 000 000.00	USD	7 913 621.99	7.5.2024	-42 655.50	-0.01
USD	1 102 978.73	CNH	7 990 000.00	6.6.2024	-581.82	0.00
USD	46 268 257.68	CNY	328 810 000.00	6.5.2024	721 975.19	0.13
GBP	110 500.00	USD	138 742.51	7.5.2024	-378.39	0.00
先渡為替契約合計					-996 326.83	-0.18

現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産	54 590 162.39	9.61
その他の資産および負債	3 625 535.53	0.64
純資産総額	568 244 499.07	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブ・ハイ・グレード・ボンド・米ドル

2024年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 17-11.10.27	10 000 000.00	9 365 625.00	0.48
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.75000% 23-12.01.28	2 927 000.00	2 889 621.36	0.15
USD AMAZON.COM INC 1.00000% 21-12.05.26	5 000 000.00	4 599 571.95	0.24
USD AMAZON.COM INC 3.15000% 18-22.08.27	5 000 000.00	4 708 009.91	0.24
USD AMAZON.COM INC 3.30000% 22-13.04.27	8 000 000.00	7 606 754.72	0.39
USD APPLE INC 1.20000% 21-08.02.28	5 000 000.00	4 352 240.20	0.23
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	5 000 000.00	4 831 335.21	0.25
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK/THE 0.50000% 20-28.05.25	10 000 000.00	9 481 992.60	0.49
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.70000% 21-15.05.28	2 500 000.00	2 202 563.50	0.11
USD BANK OF ENGLAND EURO NOTE-REG-S 4.50000% 24-05.03.27	7 000 000.00	6 912 234.00	0.36
USD BANK OF ENGLAND-REG-S 2.00000% 22-21.03.25	5 000 000.00	4 851 960.00	0.25
USD BANQUE FEDERATIVE DU CRT MUT SA-REG-S 1.60400% 21-04.10.26	4 000 000.00	3 642 915.48	0.19
USD BLACKROCK FUNDING INC 4.70000% 24-14.03.29	1 905 000.00	1 868 695.28	0.10
USD BNG BANK NV-144A 4.25000% 24-25.01.29	4 000 000.00	3 891 104.00	0.20
USD CAISSE D ' AMORTISSEMENT DE LA-REG-S 0.62500% 21-18.02.26	6 000 000.00	5 528 549.52	0.29
USD CANADA, GOVERNMENT 0.75000% 21-19.05.26	2 000 000.00	1 833 029.36	0.10
USD CENTRAL AMERICAN BANK ECONOMIC IN-REG-S 5.00000% 24-25.01.27	3 600 000.00	3 541 138.81	0.18
USD CHEVRON CORP 2.95400% 16-16.05.26	2 000 000.00	1 912 842.24	0.10
USD CHEVRON USA INC 1.01800% 20-12.08.27	5 000 000.00	4 383 767.30	0.23
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.12500% 21-15.06.26	3 500 000.00	3 207 634.81	0.17
USD CORP ANDINA DE FOMENTO 2.25000% 22-08.02.27	13 000 000.00	11 885 120.00	0.61
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 20-04.03.25	5 500 000.00	5 311 877.35	0.27
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.37500% 19-22.01.25	1 077 000.00	1 051 726.87	0.05
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 5.30100% 23-12.07.28	2 200 000.00	2 183 812.45	0.11
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 1.19400% 21-15.03.27	3 000 000.00	2 676 262.23	0.14
USD DEXIA SA-REG-S 1.12500% 21-09.04.26	7 000 000.00	6 460 842.29	0.33
USD EQUINOR ASA 1.75000% 20-22.01.26	7 000 000.00	6 592 892.46	0.34
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-19.05.25	5 000 000.00	4 750 468.25	0.25
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.62500% 20-25.07.25	2 500 000.00	2 361 027.03	0.12
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.37500% 21-26.03.26	5 000 000.00	4 574 341.60	0.24
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 4.37500% 23-29.06.26	5 000 000.00	4 925 437.60	0.25
USD EXPORT DEVELOPMENT CANADA 4.12500% 24-13.02.29	5 000 000.00	4 847 775.50	0.25
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 3.25000% 15-10.11.25	1 500 000.00	1 451 700.00	0.08
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.37500% 16-21.04.27	5 000 000.00	4 621 950.00	0.24
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.37500% 17-07.07.27	10 000 000.00	9 243 953.50	0.48
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.00000% 19-23.07.26	5 450 000.00	5 097 732.77	0.26
USD INTER-AMERICAN INVESTMENT CORP 2.62500% 22-22.04.25	2 000 000.00	1 944 307.68	0.10
USD INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000% 23-12.07.28	5 554 000.00	5 271 615.03	0.27
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.87500% 21-15.07.26	5 000 000.00	4 567 620.65	0.24
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-24.11.27	2 000 000.00	1 730 228.02	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.62500% 23-01.08.28	10 000 000.00	9 911 476.79	0.51
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 0.87500% 20-12.03.25	7 000 000.00	6 727 351.61	0.35
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 2.25000% 22-24.02.27	4 450 000.00	4 113 535.50	0.21
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 4.00000% 22-08.09.25	5 000 000.00	4 901 900.00	0.25
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 5.37500% 23-23.10.26	2 000 000.00	2 004 180.00	0.10
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 1.12500% 21-17.05.26	7 000 000.00	6 416 200.00	0.33
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 3.62500% 22-18.05.25	2 000 000.00	1 959 860.00	0.10
USD KREDITANSTALT FUER 3.87500% 23-15.06.28	15 000 000.00	14 447 252.85	0.75
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 5.12500% 23-29.09.25	10 000 000.00	9 978 919.60	0.52
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.50000% 20-27.05.25	5 000 000.00	4 746 496.10	0.25
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 21-30.03.26	5 000 000.00	4 616 080.65	0.24
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 3.87500% 22-28.09.27	3 000 000.00	2 899 486.17	0.15
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 5.05000% 23-14.06.28	7 000 000.00	6 899 448.71	0.36

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	7 500 000.00	7 183 902.45	0.37
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 22-24.08.27	5 000 000.00	4 734 406.60	0.24
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 2.50000% 16-12.07.26	5 000 000.00	4 706 674.55	0.24
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.75000% 20-15.01.25	5 000 000.00	4 870 085.56	0.25
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 4.37500% 24-28.02.29	5 000 000.00	4 887 967.70	0.25
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.12500% 22-01.10.27	2 000 000.00	1 932 750.06	0.10
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.00000% 18-10.01.28	2 079 000.00	1 916 031.12	0.10
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 4.75000% 22-22.09.25	2 000 000.00	1 978 616.48	0.10
USD NORDIC INVESTMENT BANK 2.62500% 22-04.04.25	3 000 000.00	2 924 593.47	0.15
USD NORTHWESTERN MUTUL GLOBAL FUNDING-REG-S 5.07000% 24-25.03.27	4 000 000.00	3 971 517.68	0.21
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 3.10000% 17-17.05.27	5 000 000.00	4 730 108.41	0.24
USD OMERS FINANCE TRUST CP-REG-S 1.10000% 21-26.03.26	1 640 000.00	1 515 674.25	0.08
USD ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-REG-S 4.62500% 24-10.04.29	4 900 000.00	4 803 126.80	0.25
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.05000% 20-21.05.27	5 000 000.00	4 439 074.85	0.23
USD ONTARIO, PROVINCE OF 0.62500% 21-21.01.26	2 000 000.00	1 849 217.30	0.10
USD PROCTER & GAMBLE CO 2.85000% 17-11.08.27	6 780 000.00	6 343 630.93	0.33
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.35000% 24-29.01.29	5 000 000.00	4 887 002.60	0.25
USD PROVINCE OF BRITISH COLUMBIA CANADA 0.90000% 21-20.07.26	3 500 000.00	3 189 918.41	0.17
USD PSP CAPITAL INC-REG-S 1.00000% 21-29.06.26	2 000 000.00	1 830 297.44	0.09
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	2 000 000.00	1 963 125.01	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.40000% 20-16.04.25	4 500 000.00	4 417 031.25	0.23
USD QATARENERGY-REG-S 1.37500% 21-12.09.26	3 500 000.00	3 188 281.25	0.17
USD QUEBEC, PROVINCE OF 3.62500% 23-13.04.28	7 000 000.00	6 651 419.53	0.34
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.31400% 22-10.03.27	5 000 000.00	4 620 058.05	0.24
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 4.79000% 24-08.03.29	4 800 000.00	4 732 946.92	0.24
USD SASKATCHEWAN, PROVINCE OF 3.25000% 22-08.06.27	7 000 000.00	6 628 013.63	0.34
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.87500% 16-10.05.26	7 500 000.00	7 162 111.57	0.37
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 4.87500% 24-23.01.27	6 995 000.00	6 864 823.05	0.35
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 3.95000% 22-10.06.27	3 809 000.00	3 647 201.57	0.19
USD SWEDBANK AB-REG-S 3.35600% 22-04.04.25	5 777 000.00	5 651 910.21	0.29
USD TSMC ARIZONA CORP 1.75000% 21-25.10.26	2 000 000.00	1 832 640.00	0.10
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.25000% 21-23.04.26	7 000 000.00	6 449 520.00	0.33
USD VISA INC 2.75000% 17-15.09.27	3 000 000.00	2 780 266.32	0.14
USD VISA INC 3.15000% 15-14.12.25	500 000.00	484 382.37	0.03
USD WESTPAC BANKING CORP 1.15000% 21-03.06.26	6 000 000.00	5 507 528.40	0.28
USD WESTPAC BANKING CORP 1.95300% 21-20.11.28	10 000 000.00	8 668 243.10	0.45
米ドル合計		416 728 563.40	21.53
ノート、固定利付債合計		416 728 563.40	21.53

ノート、変動利付債

米ドル

USD DNB BANK ASA-REG-S 0.856%/VAR 21-30.09.25	7 000 000.00	6 851 726.08	0.35
米ドル合計		6 851 726.08	0.35
ノート、変動利付債合計		6 851 726.08	0.35

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル

USD AAREAL BANK AG-REG-S 0.62500% 21-14.02.25	6 000 000.00	5 741 701.56	0.30
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-22.07.26	3 000 000.00	2 735 886.00	0.14
USD AFRICAN DEVELOPMENT BANK 4.37500% 22-03.11.27	5 625 000.00	5 520 245.33	0.28
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.62500% 21-22.01.26	2 000 000.00	1 847 175.00	0.09
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 3.12500% 22-30.06.24	1 000 000.00	995 873.99	0.05
USD AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPE EPIC-REG-S 5.37500% 23-24.10.25	3 000 000.00	2 995 494.00	0.15
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.46000% 20-30.06.25	500 000.00	475 030.00	0.02
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 1.26000% 21-10.02.26	800 000.00	740 228.80	0.04
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75000% 18-19.01.28	5 000 000.00	4 635 623.65	0.24
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.50000% 21-04.02.26	10 000 000.00	9 219 467.11	0.48
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.25000% 21-09.06.28	5 000 000.00	4 329 780.80	0.22
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 22-20.01.27	5 000 000.00	4 559 690.94	0.24
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.50000% 23-25.08.28	7 500 000.00	7 395 053.48	0.38
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.37500% 24-06.03.29	4 500 000.00	4 413 066.83	0.23

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BANK 3.37500% 22-29.06.25	4 000 000.00	3 905 933.72	0.20
USD BNG BANK NV-REG-S 0.87500% 21-18.05.26	5 000 000.00	4 586 707.46	0.24
USD CAISSE D ' AMORT DE LA DS-REG-S 0.37500% 20-23.09.25	11 000 000.00	10 276 314.84	0.53
USD CDP FINANCIAL INC-REG-S 1.75000% 22-01.02.27	8 000 000.00	7 312 213.36	0.38
USD CLIFFORD CAPITAL PTE LTD-REG-S 1.73300% 19-10.09.24	3 350 000.00	3 302 597.50	0.17
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 2.01500% 22-11.01.27	8 000 000.00	7 331 844.08	0.38
USD DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S 1.87500% 22-14.02.25	4 000 000.00	3 862 842.88	0.20
USD EUROCLEAR BANK-REG-S 1.26100% 21-03.08.26	7 000 000.00	6 368 716.20	0.33
USD EUROFIMA EUROPAEISCHE GESELLSCHAFT-REG-S 3.12500% 22-16.05.25	5 900 000.00	5 749 318.18	0.30
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 0.50000% 20-25.11.25	3 000 000.00	2 787 303.81	0.14
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 4.37500% 23-09.03.28	10 000 000.00	9 811 997.29	0.51
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 1.75000% 21-19.10.28	5 000 000.00	4 338 950.00	0.22
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 5.12500% 22-13.10.27	3 000 000.00	2 962 500.00	0.15
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 4.37500% 23-24.04.28	2 368 000.00	2 284 380.00	0.12
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.87500% 21-20.04.26	7 000 000.00	6 449 004.73	0.33
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 1.37500% 21-20.04.28	5 000 000.00	4 373 936.35	0.23
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.37500% 20-16.07.25	3 000 000.00	2 826 657.84	0.15
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 21-08.10.26	4 000 000.00	3 612 704.44	0.19
USD INTL FINANCE FACILITY FOR IMMUN-REG-S 1.00000% 21-21.04.26	7 500 000.00	6 904 314.30	0.36
USD ISDB TRUST SERVICES NO 2 SARL-REG-S 4.90600% 23-03.10.28	5 000 000.00	4 965 750.00	0.26
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 4.00000% 23-19.01.28	4 166 000.00	4 025 704.33	0.21
USD KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.62500% 21-15.09.25	5 000 000.00	4 687 239.07	0.24
USD LANDESKREDITBANK B-WUERTT FOERDER-REG-S 1.37500% 21-12.10.28	7 500 000.00	6 443 280.00	0.33
USD LANDESKREDITBANK BADEN-REG-S 1.37500% 22-27.01.25	7 500 000.00	7 277 046.08	0.38
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.50000% 20-21.05.26	7 000 000.00	6 571 368.29	0.34
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	5 050 000.00	4 729 601.58	0.24
USD MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.87500% 21-02.09.26	2 000 000.00	1 814 828.82	0.09
USD NBN CO LTD-REG-S 5.75000% 23-06.10.28	7 000 000.00	7 094 167.22	0.37
USD NEW DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 1.12500% 21-27.04.26	4 000 000.00	3 649 680.00	0.19
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.70000% 23-02.04.26	5 000 000.00	4 932 004.55	0.25
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.45000% 23-18.09.26	5 000 000.00	4 999 237.65	0.26
USD NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 2.25000% 15-16.04.25	1 800 000.00	1 744 678.80	0.09
USD NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FNDING-REG-S 4.71000% 24-10.01.29	7 000 000.00	6 810 788.88	0.35
USD OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 0.50000% 21-02.02.26	4 000 000.00	3 686 272.72	0.19
USD OPEC FUND INTERNATIONAL DEVELOP-REG-S 4.50000% 23-26.01.26	1 500 000.00	1 471 802.91	0.08
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.50000% 16-12.04.26	3 850 000.00	3 647 926.59	0.19
USD SFIL SA-REG-S 0.62500% 21-09.02.26	5 000 000.00	4 604 950.00	0.24
USD SP POWERASSETS LTD-REG-S 3.25000% 15-24.11.25	4 100 000.00	3 964 140.02	0.21
USD SUMITOMO MITSUI BANKING CORP-REG-S 2.44000% 19-18.06.24	6 305 000.00	6 273 007.99	0.32
USD SVENSK EXPORTKREDIT AB 2.25000% 22-22.03.27	7 500 000.00	6 929 728.28	0.36
USD SWEDISH EXPORT CREDIT CORP 4.00000% 23-15.07.25	5 000 000.00	4 912 526.00	0.25
米ドル合計		259 888 284.25	13.43
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		259 888 284.25	13.43

債券、固定利付債

米ドル

USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.82000% 98-16.06.28	1 354 000.00	1 393 070.09	0.07
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BNK 0.50000% 21-27.01.26	5 000 000.00	4 610 560.16	0.24
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BANK/TH 4.12500% 24-18.01.29	7 800 000.00	7 564 793.65	0.39
USD BANK OF MONTREAL-REG-S 3.750000% 22-25.07.25	6 500 000.00	6 357 202.15	0.33
USD BANK OF NOVA SCOTIA-REG-S 2.17000% 22-09.03.27	4 000 000.00	3 672 730.48	0.19
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 1.18800% 21-13.10.26	2 500 000.00	2 264 607.88	0.12
USD BNG BANK NV-REG-S 2.37500% 16-16.03.26	3 540 000.00	3 361 839.91	0.17
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 4.80000% 23-15.11.28	6 000 000.00	5 954 966.10	0.31
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF-REG-S 1.15000% 21-08.07.26	7 000 000.00	6 391 850.99	0.33
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 4.92800% 22-09.12.25	4 500 000.00	4 462 379.82	0.23
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 3.00000% 22-16.06.25	7 500 000.00	7 298 792.63	0.38
USD DBS BANK LTD-REG-S 2.37500% 22-17.03.27	2 850 000.00	2 626 896.30	0.14
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 21-26.10.26	7 500 000.00	6 761 883.22	0.35
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75000% 22-15.08.25	5 000 000.00	4 841 863.80	0.25
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.00000% 24-15.02.29	7 500 000.00	7 239 597.23	0.37
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.05000% 23-01.04.28	8 000 000.00	7 955 678.32	0.41

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD IDB TRUST SERVICES LTD-REG-S 0.90800% 20-25.06.25	4 100 000.00	3 886 636.00	0.20
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 4.00000% 23-12.01.28	5 000 000.00	4 844 104.15	0.25
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	8 000 000.00	6 836 664.08	0.35
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 0.80000% 21-19.07.26	10 000 000.00	9 076 600.00	0.47
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.37500% 20-18.07.25	5 000 000.00	4 711 698.90	0.24
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.12500% 22-10.06.25	5 000 000.00	4 884 443.30	0.25
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	4 000 000.00	3 768 853.84	0.19
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 5.13400% 23-28.11.28	10 500 000.00	10 424 356.95	0.54
USD NATIONAL BANK OF CANADA-REG-S 2.90000% 22-06.04.27	7 500 000.00	7 005 895.43	0.36
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 5.26400% 23-10.11.26	6 000 000.00	5 985 810.07	0.31
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.50000% 16-27.04.26	350 000.00	332 300.62	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA REG-S 1.05000% 21-14.09.26	6 250 000.00	5 658 743.87	0.29
USD SK ON CO LTD-REG-S 5.37500% 23-11.05.26	6 000 000.00	5 959 920.00	0.31
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 5.12500% 24-05.03.27	1 000 000.00	989 562.42	0.05
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE-REG-S 4.70100% 23-05.06.26	5 000 000.00	4 932 229.95	0.26
USD WESTPAC BANKING CORP-REG-S 4.18400 23-22.05.28	6 895 000.00	6 622 309.03	0.34
米ドル合計		168 678 841.34	8.71
債券、固定利付債合計		168 678 841.34	8.71

財務省証券（T-note）、固定利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-30.04.27	23 000 000.00	20 223 828.24	1.04
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.05.27	29 000 000.00	25 412 382.74	1.31
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.05.25	24 000 000.00	22 749 374.88	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.06.25	10 000 000.00	9 443 750.00	0.49
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.07.25	44 000 000.00	41 387 500.00	2.14
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.07.27	19 000 000.00	16 465 429.65	0.85
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.08.27	27 000 000.00	23 426 718.75	1.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-31.08.25	35 000 000.00	32 797 460.85	1.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-30.09.27	45 000 000.00	38 747 461.05	2.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.25000% 20-30.09.25	37 000 000.00	34 534 297.06	1.78
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.25000% 20-31.10.25	35 000 000.00	32 547 265.80	1.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.50000% 20-31.10.27	25 000 000.00	21 545 898.50	1.11
USD AMERICA, UNITED STATE OF TB 0.62500% 20-31.12.27	25 000 000.00	21 506 835.99	1.11
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 20-31.12.25	25 000 000.00	23 123 047.00	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.37500% 21-31.01.26	37 000 000.00	34 093 476.47	1.76
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.01.28	40 000 000.00	34 476 562.40	1.78
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-29.02.28	4 000 000.00	3 489 687.52	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TIGER STRIP 0.50000% 21-28.02.26	52 000 000.00	47 868 437.76	2.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.03.28	20 000 000.00	17 489 843.80	0.90
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-30.04.26	35 000 000.00	32 174 023.35	1.66
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.05.26	9 000 000.00	8 245 898.46	0.43
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.06.28	28 000 000.00	24 300 937.35	1.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 21-31.07.26	40 000 000.00	36 324 999.99	1.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.00000% 21-31.07.28	20 000 000.00	17 126 562.40	0.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-31.08.28	20 000 000.00	17 178 125.01	0.89
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.08.26	40 000 000.00	36 318 750.00	1.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.2500% 21-30.09.28	9 000 000.00	7 753 007.79	0.40
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 21-30.09.26	10 000 000.00	9 081 640.60	0.47
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 21-15.10.24	10 000 000.00	9 787 500.00	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.10.28	27 000 000.00	23 340 234.24	1.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-30.11.26	33 500 000.00	30 537 343.75	1.58
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.500000% 21-30.11.28	35 000 000.00	30 363 867.10	1.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-31.12.28	35 000 000.00	30 109 570.40	1.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-31.12.26	15 000 000.00	13 642 382.86	0.70
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.25000% 24-28.02.29	50 000 000.00	48 980 469.00	2.53
米ドル合計		876 594 570.76	45.28
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		876 594 570.76	45.28
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 728 741 985.83	89.30

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン			
米ドル			
USD UNITED STATES TREASURY BILL TB 0.00000% 14.03.24-12.09.24	15 000 000.00	14 709 480.60	0.76
米ドル合計		14 709 480.60	0.76
財務省証券（T-bill）、ゼロ・クーポン合計		14 709 480.60	0.76

ノート、固定利付債

米ドル			
USD BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-REG-S 2.37500% 19-21.11.24	1 000 000.00	981 689.34	0.05
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT ML SA-REG-S 4.93500% 23-26.01.26	2 355 000.00	2 327 050.69	0.12
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA/NEW YORK 5.31600% 23-13.03.26	969 000.00	969 520.00	0.05
USD FANNIE MAE 0.50000% 20-07.11.25	20 000 000.00	18 653 349.60	0.96
USD FREDDIE MAC 0.37500% 20-23.09.25	25 000 000.00	23 398 808.75	1.21
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.73700% 23-02.10.28	5 000 000.00	5 078 965.95	0.26
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.73700% 23-02.10.28	2 625 000.00	2 666 457.13	0.14
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.50000% 23-10.04.26	3 000 000.00	2 946 689.31	0.15
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 4.15000% 22-26.08.25	1 400 000.00	1 375 151.19	0.07
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.00000% 17-19.09.27	3 000 000.00	2 771 375.01	0.14
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.05000% 22-25.08.25	2 310 000.00	2 263 948.23	0.12
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND I-REG-S 5.00000% 23-06.01.26	6 000 000.00	5 952 757.92	0.31
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 0.62500% 20-15.01.26	3 000 000.00	2 775 851.88	0.14
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 1.00000% 20-15.09.27	8 000 000.00	6 978 387.61	0.36
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.00000% 18-10.01.28	2 500 000.00	2 304 029.72	0.12
USD NORDEA BANK ABP -REG-S 3.60000% 22-06.06.25	1 400 000.00	1 370 506.48	0.07
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 5.00000% 24-19.03.27	4 000 000.00	3 955 868.72	0.21
USD NUVEEN LLC-144A 4.00000% 18-01.11.28	1 000 000.00	950 322.91	0.05
USD ONTARIO TEACHERS' FINANCE TRUST-REG-S 4.25000% 23-25.04.28	10 000 000.00	9 690 303.00	0.50
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 5.50000% 23-18.07.28	5 000 000.00	4 990 373.25	0.26
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-144A 0.80000% 20-01.09.25	5 000 000.00	4 694 463.15	0.24
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.46700% 23-08.12.28	2 000 000.00	1 993 905.02	0.10
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 0.99100% 21-05.03.26	5 000 000.00	4 625 140.25	0.24
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.31400% 22-10.03.27	2 000 000.00	1 848 023.22	0.10
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 1.70000% 21-11.03.28	3 600 000.00	3 167 646.91	0.16
USD SKANDINAVISKA ENSK BANK-REG-S 1.20000% 21-09.09.26	6 000 000.00	5 417 372.52	0.28
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 0.85000% 20-02.09.25	6 000 000.00	5 637 035.40	0.29
米ドル合計		129 784 993.16	6.70
ノート、固定利付債合計		129 784 993.16	6.70

メディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 5.10000% 24-09.04.27	5 000 000.00	4 967 434.00	0.26
USD MET TOWER GLOBAL FUNDING-REG-S 4.85000% 24-16.01.27	2 593 000.00	2 561 874.28	0.13
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.25000% 22-07.04.27	5 750 000.00	5 421 811.39	0.28
米ドル合計		12 951 119.67	0.67
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		12 951 119.67	0.67

債券、固定利付債

米ドル			
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S 4.67500% 23-15.06.26	6 000 000.00	5 913 932.16	0.31
USD FANNIE MAE 1.87500% 16-24.09.26	15 300 000.00	14 218 405.82	0.74
USD FEDERAL FARM CREDIT BANK 5.00000% 23-30.07.26	20 000 000.00	19 965 296.00	1.03
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 1.20000% 21-14.10.26	6 000 000.00	5 433 993.66	0.28
USD FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS-REG-S 5.14700% 23-27.11.28	3 000 000.00	2 984 239.59	0.15
USD PRICOA GLOBAL FUNDING I-REG-S 5.10000% 23-30.05.28	2 380 000.00	2 347 639.66	0.12
米ドル合計		50 863 506.89	2.63
債券、固定利付債合計		50 863 506.89	2.63

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、変動利付債			
米ドル			
USD BNP PARIBAS SA-REG-S 5.335%/VAR 23-12.06.29	10 000 000.00	9 904 459.80	0.51
米ドル合計		9 904 459.80	0.51
債券、変動利付債合計		9 904 459.80	0.51
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		218 213 560.12	11.27

最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル			
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 5.33800% 23-13.11.28	1 800 000.00	1 809 164.39	0.09
米ドル合計		1 809 164.39	0.09
ノート、固定利付債合計		1 809 164.39	0.09
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 809 164.39	0.09
投資有価証券合計		1 948 764 710.34	100.66

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	220.00	-270 413.92	-0.01
債券関連金融先物合計		-270 413.92	-0.01
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-270 413.92	-0.01
金融派生商品合計		-270 413.92	-0.01

注記は当財務書類の一部である。

銘柄			数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約					
購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日					
GBP	54 769 400.00	USD	69 186 223.19	2.5.2024	-606 718.98 -0.03
SGD	7 328 200.00	USD	5 447 605.03	2.5.2024	-74 039.49 0.00
JPY	851 129 400.00	USD	5 655 081.82	7.5.2024	-244 581.72 -0.01
EUR	500 525 400.00	USD	542 742 214.86	2.5.2024	-7 555 430.86 -0.39
CHF	224 792 700.00	USD	249 212 814.48	2.5.2024	-4 113 648.59 -0.21
CHF	440 400.00	USD	488 172.03	2.5.2024	-7 988.85 0.00
EUR	844 900.00	USD	913 697.76	2.5.2024	-10 288.43 0.00
USD	391 280.65	CHF	351 400.00	2.5.2024	8 137.22 0.00
USD	176 469.42	GBP	140 300.00	2.5.2024	792.77 0.00
CHF	670 900.00	USD	742 449.07	2.5.2024	-10 943.86 0.00
JPY	1 981 300.00	USD	13 129.04	7.5.2024	-534.22 0.00
USD	106 041.84	GBP	83 800.00	2.5.2024	1 111.67 0.00
USD	425 116.95	SGD	571 300.00	2.5.2024	6 198.53 0.00
USD	76 293.12	JPY	11 645 300.00	7.5.2024	2 265.72 0.00
SGD	20 300.00	USD	14 913.13	2.5.2024	-27.70 0.00
USD	194 664.26	GBP	156 600.00	2.5.2024	-1 422.43 0.00
USD	425 849.61	CHF	387 700.00	2.5.2024	3 127.05 0.00
SGD	72 800.00	USD	53 504.08	2.5.2024	-121.86 0.00
GBP	82 900.00	USD	102 776.87	2.5.2024	1 026.37 0.00
USD	1 039 858.31	EUR	969 900.00	2.5.2024	2 792.73 0.00
USD	12 423.59	SGD	16 900.00	2.5.2024	31.29 0.00
SGD	6 833 100.00	USD	5 028 980.06	3.6.2024	-11 120.77 0.00
USD	5 404 306.26	JPY	841 465 400.00	7.5.2024	55 238.74 0.00
JPY	841 465 400.00	USD	5 426 336.02	3.6.2024	-53 309.42 0.00
USD	5 021 384.48	SGD	6 833 100.00	2.5.2024	10 862.02 0.00
USD	68 180 113.51	GBP	54 471 600.00	2.5.2024	-26 500.43 0.00
EUR	500 400 400.00	USD	536 060 934.11	3.6.2024	-346 777.46 -0.02
USD	535 378 387.96	EUR	500 400 400.00	2.5.2024	325 260.21 0.01
USD	246 891 337.72	CHF	225 164 900.00	2.5.2024	1 386 349.44 0.07
CHF	225 164 900.00	USD	247 777 031.93	3.6.2024	-1 416 773.48 -0.07
GBP	54 471 600.00	USD	68 190 114.49	3.6.2024	27 829.53 0.00
先渡為替契約合計					-12 649 205.26 -0.65
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					4 673 530.06 0.24
その他の資産および負債					-4 564 635.39 -0.24
純資産総額					1 935 953 985.83 100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーハイ・グレード・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2024年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABBOTT LABORATORIES 1.40000% 20-30.06.30	4 000 000.00	3 242 256.07	0.08
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	2 000 000.00	1 840 000.00	0.04
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.87500% 23-12.01.30	8 214 000.00	8 097 550.78	0.19
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 4.87500% 23-12.01.33	5 000 000.00	4 918 005.79	0.12
USD AIRPORT AUTHORITY-REG-S 1.62500% 21-04.02.31	10 000 000.00	8 024 491.10	0.19
USD ALBERTA, PROVINCE OF 4.50000% 24-24.01.34	8 462 000.00	8 083 381.01	0.19
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	20 000 000.00	15 958 775.60	0.37
USD AMAZON.COM INC 1.50000% 20-03.06.30	15 000 000.00	12 237 313.50	0.29
USD AMAZON.COM INC 2.10000% 21-12.05.31	12 500 000.00	10 287 180.25	0.24
USD AMAZON.COM INC 3.60000% 22-13.04.32	15 000 000.00	13 525 883.55	0.32
USD AMAZON.COM INC 4.65000% 22-01.12.29	10 000 000.00	9 841 240.80	0.23
USD AMAZON.COM INC 4.70000% 22-01.12.32	20 000 000.00	19 423 898.40	0.46
USD APPLE INC 1.25000% 20-20.08.30	15 000 000.00	11 975 875.19	0.28
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	10 000 000.00	8 248 340.60	0.19
USD APPLE INC 1.65000% 21-08.02.31	15 000 000.00	12 131 311.05	0.28
USD APPLE INC 1.70000% 21-05.08.31	10 000 000.00	7 979 909.40	0.19
USD APPLE INC 2.20000% 19-11.09.29	12 800 000.00	11 122 414.85	0.26
USD APPLE INC 3.35000% 22-08.08.32	12 500 000.00	11 102 060.37	0.26
USD ASIAN INFRASTRUCTURE INVESTMENT BANK 4.25000% 24-13.03.34	15 000 000.00	14 285 745.60	0.34
USD AUTOMATIC DATA PROCESSING INC 1.25000% 20-01.09.30	4 000 000.00	3 175 106.48	0.07
USD BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 2.87500% 22-15.03.32	13 000 000.00	11 110 056.23	0.26
USD BLACKROCK INC 1.90000% 20-28.01.31	4 000 000.00	3 245 558.49	0.08
USD BLACKROCK INC 2.40000% 20-30.04.30	10 000 000.00	8 578 890.30	0.20
USD BLACKROCK INC 4.75000% 23-25.05.33	7 000 000.00	6 736 881.13	0.16
USD BLACKROCK INC/NEW YORK 2.10000% 21-25.02.32	12 000 000.00	9 565 756.68	0.22
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 1.30000% 21-29.01.31	7 500 000.00	5 944 972.28	0.14
USD BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 4.20000% 23-06.07.33	20 000 000.00	18 720 612.20	0.44
USD CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A-1.37500% 21-20.01.31	10 000 000.00	7 978 832.70	0.19
USD CHEVRON CORP 2.23600% 20-11.05.30	9 539 000.00	8 120 343.80	0.19
USD CME GROUP INC 2.65000% 22-15.03.32	8 500 000.00	7 153 841.83	0.17
USD COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	11 730 000.00	9 349 495.49	0.22
USD CPPIB CAPITAL INC-144A 1.25000% 21-28.01.31	3 500 000.00	2 762 172.35	0.07
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 2.00000% 19-01.11.29	2 500 000.00	2 144 713.40	0.05
USD CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.25000% 21-28.01.31	5 000 000.00	3 945 960.50	0.09
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 5.30100% 23-12.07.28	7 000 000.00	6 948 494.14	0.16
USD EQUINOR ASA 2.37500% 20-22.05.30	12 635 000.00	10 814 506.75	0.25
USD EQUINOR ASA 3.12500% 20-06.04.30	20 000 000.00	17 998 039.20	0.42
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	5 000 000.00	3 975 303.16	0.09
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 21-13.05.31	3 000 000.00	2 442 634.84	0.06
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.12500% 22-18.01.32	7 000 000.00	5 623 170.00	0.13
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 4.62500% 23-07.06.33	7 000 000.00	6 666 800.00	0.16
USD EXXON MOBIL CORP 2.44000% 19-16.08.29	7 500 000.00	6 606 753.52	0.16
USD EXXON MOBIL CORP 2.61000% 20-15.10.30	12 000 000.00	10 388 426.04	0.24
USD EXXON MOBIL CORP 3.48200% 20-19.03.30	15 000 000.00	13 791 133.95	0.32
USD FANNIE MAE 7.12500% 00-15.01.30	8 000 000.00	8 930 564.16	0.21
USD FINLAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.87500% 20-20.05.30	20 000 000.00	15 798 000.00	0.37
USD FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32	20 000 000.00	21 972 293.60	0.52
USD FREDDIE MAC 6.75000% 00-15.03.31	30 000 000.00	33 400 662.60	0.78
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.16000% 21-31.03.34	11 000 000.00	7 461 352.80	0.18
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY-REG-S 2.50000% 22-12.01.32	5 550 000.00	4 640 780.52	0.11
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNAL BD-REG-S 4.00000% 23-07.06.33	5 000 000.00	4 702 936.05	0.11
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.12500% 18-18.09.28	2 500 000.00	2 328 869.88	0.06
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.25000% 19-18.06.29	15 000 000.00	13 251 942.90	0.31
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 4.75000% 23-14.11.33	22 500 000.00	22 380 513.97	0.52

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECON&DEVELOP 4.00000% 24-10.01.31	25 000 000.00	23 808 297.74	0.56
USD INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000% 22-29.03.32	27 500 000.00	23 325 759.87	0.55
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	30 000 000.00	23 998 203.30	0.56
USD INTERNATIONAL DVPT ASSOCIATION-REG-S 1.00000% 20-03.12.30	15 000 000.00	11 753 926.95	0.28
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	10 000 000.00	8 519 613.40	0.20
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 5.67000% 24-01.02.34	12 500 000.00	12 041 818.88	0.28
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	7 500 000.00	6 042 323.92	0.14
USD JOHNSON & JOHNSON 4.37500% 13-05.12.33	9 500 000.00	9 147 168.77	0.21
USD KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 1.12500% 20-14.06.30	20 000 000.00	15 945 640.00	0.37
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 2.00000% 21-25.10.31	5 000 000.00	4 002 500.00	0.09
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 4.25000% 22-08.09.32	5 000 000.00	4 658 650.00	0.11
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 4.37500% 23-15.02.33	5 000 000.00	4 681 350.00	0.11
USD KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 5.62500% 23-23.10.33	2 500 000.00	2 561 700.00	0.06
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 4.62500% 23-24.02.33	7 200 000.00	6 789 672.00	0.16
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.75000% 21-15.10.31	10 000 000.00	8 063 700.00	0.19
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	2 000 000.00	1 713 275.18	0.04
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.12500% 23-15.07.33	50 000 000.00	47 413 903.50	1.11
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.37500% 24-28.02.34	7 500 000.00	7 256 295.15	0.17
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.87500% 20-03.09.30	25 000 000.00	19 634 956.50	0.46
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.50000% 22-28.04.33	2 500 000.00	2 508 593.75	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 5.15000% 23-28.03.33	3 000 000.00	2 905 905.18	0.07
USD MICROSOFT CORP 3.50000% 15-12.02.35	3 750 000.00	3 314 750.96	0.08
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 4.95100% 24-10.01.34	5 000 000.00	4 823 799.95	0.11
USD NEDERLANDSE WATERCHAPSBANK NV-144A 1.00000% 20-28.05.30	200 000.00	159 002.79	0.00
USD NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	1 200 000.00	954 016.72	0.02
USD NESTLE CAPITAL CORP-REG-S 4.87500% 24-12.03.34	10 000 000.00	9 682 721.80	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.85000% 23-14.03.33	10 000 000.00	9 804 204.40	0.23
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-24.09.28	10 000 000.00	9 399 182.20	0.22
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.25000% 20-15.09.30	7 150 000.00	5 643 215.72	0.13
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 1.87500% 21-14.09.31	750 000.00	601 412.67	0.01
USD NOVARTIS CAPITAL CORP 2.20000% 20-14.08.30	15 000 000.00	12 688 142.85	0.30
USD OMERS FINANCE TRUST-REG-S 3.50000% 22-19.04.32	5 000 000.00	4 450 625.15	0.10
USD OMERS FINANCE TRUST-REG-S 4.75000% 24-26.03.31	7 500 000.00	7 312 948.13	0.17
USD ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-144A 1.25000% 20-27.09.30	4 000 000.00	3 160 398.32	0.07
USD ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-REG-S 2.00000% 21-16.04.31	15 000 000.00	12 264 871.35	0.29
USD ONTARIO, PROVINCE OF 5.05000% 24-24.04.34	10 000 000.00	9 969 278.80	0.23
USD ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 19-02.10.29	3 000 000.00	2 576 809.29	0.06
USD ONTARIO, PROVINCE OF TB 1.60000% 21-25.02.31	5 000 000.00	4 026 262.25	0.09
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.80000% 21-14.10.31	15 000 000.00	12 030 244.95	0.28
USD PROCTER & GAMBLE CO 3.00000% 20-25.03.30	10 000 000.00	9 014 173.10	0.21
USD PROCTER & GAMBLE CO 1.20000% 20-29.10.30	8 900 000.00	7 051 974.36	0.17
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.95000% 21-23.04.31	5 000 000.00	4 136 332.25	0.10
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 2.30000% 22-01.02.32	2 500 000.00	2 088 442.17	0.05
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.05000% 23-26.01.33	2 000 000.00	1 873 220.94	0.04
USD PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.55000% 24-29.01.34	10 000 000.00	9 573 393.30	0.22
USD PROVINCE OF ONTARIO CANADA 2.12500% 22-21.01.32	10 000 000.00	8 166 523.60	0.19
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	5 000 000.00	4 771 125.00	0.11
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.75000% 20-16.04.30	25 000 000.00	23 366 250.00	0.55
USD QATARENERGY-REG-S 2.25000% 21-12.07.31	6 000 000.00	4 882 500.00	0.11
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.35000% 20-28.05.30	10 000 000.00	8 104 789.70	0.19
USD QUEBEC, PROVINCE OF 4.50000% 23-08.09.33	25 000 000.00	23 913 379.75	0.56
USD QUEBEC, PROVINCE OF 1.90000% 21-21.04.31	10 000 000.00	8 176 149.60	0.19
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 3.62500% 18-17.09.28	5 000 000.00	4 698 733.00	0.11
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 4.98500% 24-08.03.34	13 200 000.00	12 804 413.16	0.30
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.37500% 19-07.11.29	20 000 000.00	17 369 976.60	0.41
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.75000% 20-06.04.30	12 500 000.00	10 978 424.62	0.26
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-REG-S 2.15000% 21-11.03.31	13 937 000.00	11 503 986.83	0.27
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	8 000 000.00	6 680 080.00	0.16
USD TSMC ARIZONA CORP 4.12500% 22-22.04.29	10 000 000.00	9 572 000.00	0.22
USD TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32	7 000 000.00	6 636 018.20	0.16
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.37500% 20-28.09.30	3 650 000.00	2 890 898.92	0.07
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	10 000 000.00	8 292 600.00	0.19
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 4.62500% 22-22.07.32	5 000 000.00	4 859 850.00	0.11
USD UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 4.91700% 23-25.09.33	8 800 000.00	8 717 280.00	0.20

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VISA INC 1.10000% 20-15.02.31	10 000 000.00	7 746 315.40	0.18
USD VISA INC 2.05000% 20-15.04.30	9 825 000.00	8 278 320.79	0.19
USD WAL-MART STORES INC 1.80000% 21-22.09.31	15 000 000.00	12 088 081.65	0.28
USD WALMART INC 2.37500% 19-24.09.29	3 000 000.00	2 641 623.24	0.06
USD WALMART INC 4.10000% 23-15.04.33	10 000 000.00	9 347 027.60	0.22
USD WALMART INC 4.15000% 22-09.09.32	5 000 000.00	4 721 782.15	0.11
USD WESTPAC BANKING CORP 2.65000% 20-16.01.30	11 468 000.00	10 027 894.20	0.24
USD WESTPAC BANKING CORP 2.15000% 21-03.06.31	2 500 000.00	2 044 955.17	0.05
米ドル合計		1 157 635 663.54	27.11
ノート、固定利付債合計		1 157 635 663.54	27.11

ノート、変動利付債

米ドル			
USD BNP PARIBAS SA-REG-S 5.894%/VAR 23-05.12.34	30 000 000.00	30 302 554.50	0.71
米ドル合計		30 302 554.50	0.71
ノート、変動利付債合計		30 302 554.50	0.71

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD ABU DHABI GOVERNMENT INTL-REG-S 1.87500% 21-15.09.31	10 000 000.00	8 040 625.00	0.19
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 3.12500% 20-16.04.30	17 500 000.00	15 662 500.00	0.37
USD ABU DHABI, EMIRATE OF-REG-S 1.70000% 20-02.03.31	15 000 000.00	12 089 062.50	0.28
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 20-24.01.30	2 500 000.00	2 129 435.78	0.05
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.75000% 20-08.10.30	10 000 000.00	7 754 338.70	0.18
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.50000% 21-04.03.31	10 000 000.00	8 082 161.70	0.19
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 22-28.09.32	20 000 000.00	18 679 181.60	0.44
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.00000% 23-12.01.33	18 000 000.00	16 929 744.30	0.40
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 4.12500% 24-12.01.34	25 000 000.00	23 622 369.50	0.55
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.87500% 23-14.06.33	30 000 000.00	27 878 273.10	0.65
USD BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.00000% 20-28.05.30	9 630 000.00	7 662 275.91	0.18
USD BNG BANK NV-REG-S 1.00000% 20-03.06.30	20 000 000.00	15 853 677.20	0.37
USD CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOCI-REG-S 1.37500% 21-20.01.31	5 000 000.00	3 989 416.35	0.09
USD CAISSE D ' AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.12500% 22-26.01.32	35 000 000.00	28 763 639.59	0.67
USD EUROPEAN BANK FOR RECONSTR & DEVT 4.25000% 24-13.03.34	35 000 000.00	33 359 484.90	0.78
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 1.75000% 21-19.10.28	5 000 000.00	4 338 950.00	0.10
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 1.75000% 21-24.11.31	13 000 000.00	10 564 512.52	0.25
USD HONG KONG GOVERNMENT INTER BOND-REG-S 1.37500% 21-02.02.31	5 000 000.00	4 012 266.00	0.09
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 23-11.01.33	4 000 000.00	3 946 002.44	0.09
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 1.12500% 21-13.01.31	28 300 000.00	22 341 524.42	0.52
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 22-14.09.29	15 000 000.00	14 050 593.89	0.33
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 23-12.04.33	20 000 000.00	18 049 877.60	0.42
USD INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 4.50000% 23-13.09.33	10 000 000.00	9 743 533.00	0.23
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 5.55000% 23-05.05.33	5 000 000.00	4 816 952.15	0.11
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 0.75000% 20-27.08.30	4 750 000.00	3 704 370.48	0.09
USD LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 5.00000% 23-24.10.33	25 000 000.00	25 282 356.25	0.59
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	9 000 000.00	7 931 250.00	0.19
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 20-21.05.30	8 800 000.00	7 656 000.00	0.18
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 4.37500% 23-22.11.33	5 000 000.00	4 601 562.49	0.11
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	12 500 000.00	10 135 014.50	0.24
USD NBN CO LTD-REG-S 6.00000% 23-06.10.33	11 765 000.00	12 119 947.11	0.28
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.55000% 23-28.01.33	8 000 000.00	7 478 150.72	0.18
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.25000% 20-30.04.30	3 737 000.00	3 169 854.79	0.07
USD QUEBEC, PROVINCE OF 7.50000% 99-15.09.29	3 000 000.00	3 342 109.71	0.08
USD ST ENGINEERING URBAN SOLUTIONS US-REG-S 3.75000% 22-05.05.32	500 000.00	449 542.76	0.01
USD SWEDISH EXPORT CREDIT CORP 4.87500% 23-04.10.30	25 000 000.00	24 827 426.25	0.58
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-144A 1.00000% 20-06.10.30	2 000 000.00	1 552 506.16	0.04
USD TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 1.00000% 20-06.10.30	5 000 000.00	3 881 265.40	0.09
USD TEMASEK FINANCIAL LTD-REG-S 1.62500% 21-02.08.31	12 500 000.00	9 966 182.13	0.23
USD UAE INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND-REG-S 2.00000% 21-19.10.31	5 000 000.00	4 045 000.00	0.10
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32	15 000 000.00	14 001 000.00	0.33
米ドル合計		466 503 936.90	10.92
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		466 503 936.90	10.92

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 19-30.09.29	17 500 000.00	15 400 000.00	0.36
USD ALBERTA, PROVINCE OF 1.30000% 20-22.07.30	20 000 000.00	16 065 289.00	0.38
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.75000% 20-23.09.30	15 800 000.00	12 331 383.04	0.29
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.75000% 23-14.02.33	20 000 000.00	18 537 568.60	0.43
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.62500% 23-15.07.30	5 000 000.00	4 684 580.75	0.11
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.12500% 24-13.02.34	55 000 000.00	52 031 501.49	1.22
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 1.25000% 20-21.09.30	1 200 000.00	946 392.00	0.02
USD FANNIE MAE 6.62500% 00-15.11.30	45 000 000.00	49 483 688.40	1.16
USD FANNIE MAE 7.25000% 00-15.05.30	20 000 000.00	22 569 769.00	0.53
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 2.45000% 22-03.02.32	10 000 000.00	8 171 989.80	0.19
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.05000% 23-01.04.28	2 000 000.00	1 988 919.58	0.05
USD FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.10000% 23-01.04.33	5 000 000.00	4 874 340.00	0.11
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 3.87500% 23-14.02.30	30 000 000.00	28 537 968.00	0.67
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	30 000 000.00	23 813 867.71	0.56
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	30 000 000.00	23 387 197.80	0.55
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	10 000 000.00	7 942 089.59	0.18
USD JOHNSON & JOHNSON 4.95000% 03-15.05.33	2 500 000.00	2 520 825.95	0.06
USD KOREA DEVELOPMENT BANK 1.62500% 21-19.01.31	2 000 000.00	1 593 140.00	0.04
USD KOREA GAS CORP-REG-S 2.87500% 19-16.07.29	5 000 000.00	4 437 900.00	0.10
USD KOREA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-16.09.30	3 500 000.00	2 749 145.00	0.06
USD ONTARIO, PROVINCE OF 1.12500% 20-07.10.30	15 000 000.00	11 823 070.80	0.28
USD TENNESSEE VALLEY AUTHORITY 7.12500% 00-01.05.30	5 631 000.00	6 275 504.89	0.15
米ドル合計		320 166 131.40	7.50
債券、固定利付債合計		320 166 131.40	7.50

財務省証券（T-note）、固定利付債

米ドル			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.12500% 99-15.08.29	40 000 000.00	42 598 437.60	1.00
USD AMERICA, UNITED STATES OF 6.25000% 99-15.05.30	20 000 000.00	21 586 718.80	0.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 5.37500% 01-15.02.31	45 000 000.00	46 991 601.45	1.10
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.05.29	20 000 000.00	17 910 156.20	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 19-15.08.29	25 000 000.00	21 441 406.24	0.50
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	50 000 000.00	42 988 281.00	1.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 20-15.02.30	60 000 000.00	50 313 281.40	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.05.30	70 000 000.00	55 094 921.70	1.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.62500% 20-15.08.30	85 000 000.00	66 280 077.70	1.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30	40 000 000.00	31 504 687.59	0.74
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31	64 000 000.00	50 982 499.84	1.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.62500% 21-15.05.31	70 000 000.00	57 285 156.60	1.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.25000% 21-15.08.31	80 000 000.00	63 190 624.80	1.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 21-15.11.31	80 000 000.00	63 281 249.60	1.48
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.87500% 22-15.02.32	80 000 000.00	65 387 499.99	1.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 22-31.03.29	20 000 000.00	17 943 750.00	0.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-30.04.29	10 000 000.00	9 178 125.00	0.21
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.32	80 000 000.00	70 293 750.40	1.65
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-31.05.29	30 000 000.00	27 338 671.80	0.64
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.25000% 22-30.06.29	30 000 000.00	27 969 140.70	0.65
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.62500% 22-31.07.29	25 000 000.00	22 580 078.00	0.53
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 22-15.08.32	70 000 000.00	60 700 390.79	1.42
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.12500% 22-31.08.29	40 000 000.00	37 006 250.00	0.87
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.875000% 22-30.09.29	30 000 000.00	28 785 937.50	0.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 22-31.10.29	15 000 000.00	14 476 171.80	0.34
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 22-30.11.29	12 500 000.00	11 979 492.25	0.28
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-31.12.29	25 000 000.00	23 948 242.25	0.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-31.01.30	40 000 000.00	37 548 437.60	0.88
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-15.02.33	90 000 000.00	82 304 297.10	1.93
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 23-28.02.30	35 000 000.00	33 717 578.30	0.79
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-31.03.30	50 000 000.00	47 193 359.51	1.10
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-30.04.30	50 000 000.00	46 847 656.00	1.10

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.37500% 23-15.05.33	80 000 000.00	72 300 000.00	1.69
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 23-31.05.30	25 000 000.00	23 723 632.75	0.56
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 23-30.06.30	35 000 000.00	33 192 578.30	0.78
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 23-31.07.30	30 000 000.00	28 839 843.60	0.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-15.08.33	82 500 000.00	77 446 875.00	1.81
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 23-31.08.30	40 000 000.00	38 707 812.40	0.91
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.62500% 23-30.09.30	50 000 000.00	49 748 047.00	1.16
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.87500% 23-31.10.30	50 000 000.00	50 437 500.00	1.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 23-15.11.33	80 000 000.00	78 825 000.00	1.85
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.37500% 23-30.11.30	25 000 000.00	24 522 461.00	0.57
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 24-31.12.30	10 000 000.00	9 454 687.50	0.22
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 24-31.01.31	20 000 000.00	19 183 593.80	0.45
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 24-15.02.34	115 000 000.00	108 890 625.00	2.55
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.25000% 24-28.02.31	30 000 000.00	29 207 812.50	0.68
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 24-31.03.31	50 000 000.00	48 296 875.00	1.13
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32	90 000 000.00	86 414 062.50	2.02
米ドル合計		2 075 839 335.86	48.60
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		2 075 839 335.86	48.60
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		4 050 447 622.20	94.84

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

米ドル			
USD BLACKROCK FUNDING INC 5.00000% 24-14.03.34	4 000 000.00	3 884 139.00	0.09
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 5.30100% 23-12.07.28	5 000 000.00	4 963 210.10	0.12
USD FANNIE MAE 0.87500% 20-05.08.30	40 000 000.00	31 548 906.00	0.74
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 1.55000% 20-09.10.30	2 900 000.00	2 289 132.00	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.55000% 20-09.10.30	5 800 000.00	4 578 263.98	0.11
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 1.55000% 21-07.01.31	2 000 000.00	1 557 930.90	0.04
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.30000% 22-25.08.29	3 000 000.00	2 823 496.38	0.06
USD NESTLE HOLDINGS INC-144A 4.95000% 23-14.03.30	3 500 000.00	3 461 242.86	0.08
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 4.30000% 22-01.10.32	3 000 000.00	2 852 885.85	0.07
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.20000% 20-07.08.30	2 740 000.00	2 123 124.10	0.05
USD ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-144A 2.00000% 21-16.04.31	2 000 000.00	1 635 316.18	0.04
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 2.45000% 22-11.01.32	4 100 000.00	3 222 027.80	0.07
USD PACIFIC LIFE GLOBAL FUNDING II-REG-S 1.45000% 21-20.01.28	6 020 000.00	5 232 235.20	0.12
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.73700% 20-21.09.30	2 500 000.00	1 997 735.55	0.05
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 1.93000% 21-13.12.28	3 500 000.00	3 034 451.42	0.07
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 1.93000% 21-13.12.28	7 550 000.00	6 545 745.21	0.15
USD ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.07600% 21-13.12.31	17 500 000.00	13 991 127.50	0.33
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 2.15000% 21-11.03.31	1 500 000.00	1 238 141.66	0.03
米ドル合計		96 979 111.69	2.27
ノート、固定利付債合計		96 979 111.69	2.27

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 5.51400% 23-05.07.33	3 750 000.00	3 711 127.34	0.09
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850% 19-13.09.29	20 000 000.00	17 872 557.11	0.42
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 2.4000% 22-11.01.32	10 000 000.00	8 019 760.59	0.19
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-144A 3.30000% 22-21.03.29	3 000 000.00	2 723 532.04	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.15000% 23-28.03.33	3 000 000.00	2 905 905.18	0.07
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.05000% 19-17.06.29	4 100 000.00	3 637 123.28	0.08
USD NBN CO LTD-REG-S 2.62500% 21-05.05.31	10 743 000.00	8 952 698.06	0.21
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.00000% 24-09.01.34	5 000 000.00	4 776 457.45	0.11
USD NEW YORK LIFE INSURANCE CO-144A 5.87500% 03-15.05.33	6 535 000.00	6 593 849.83	0.15
USD NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FUNDING-144A 1.70000% 21-01.06.28	879 000.00	757 603.86	0.02
米ドル合計		59 950 614.74	1.40
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		59 950 614.74	1.40

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
米ドル			
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 300 000.00	2 860 781.62	0.07
USD QATAR, STATE OF-144A 9.75000% 00-15.06.30	2 000 000.00	2 493 125.00	0.06
USD SOUTHERN CALIFORNIA 5.20000% 23-01.06.33	2 500 000.00	2 431 460.67	0.05
米ドル合計		7 785 367.29	0.18
債券、固定利付債合計		7 785 367.29	0.18
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		164 715 093.72	3.85

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

投資信託、オープン・エンド型

アイルランド			
USD UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-USD-S-DIST	2 000.00	20 000 000.00	0.47
アイルランド合計		20 000 000.00	0.47
投資信託、オープン・エンド型合計		20 000 000.00	0.47
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		20 000 000.00	0.47
投資有価証券合計		4 235 162 715.92	99.16

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 18.06.24	-200.00	701 562.40	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	950.00	-1 824 655.72	-0.04
債券関連金融先物合計		-1 123 093.32	-0.03
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-1 123 093.32	-0.03
金融派生商品合計		-1 123 093.32	-0.03

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
先渡為替契約			
購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日			
SGD	23 299 000.00 USD	17 319 907.97 2.5.2024	-235 398.35 -0.01
GBP	180 645 600.00 USD	228 196 525.80 2.5.2024	-2 001 137.74 -0.05
JPY	1 805 100 000.00 USD	11 993 462.10 7.5.2024	-518 716.04 -0.01
EUR	1 362 619 000.00 USD	1 477 549 099.56 2.5.2024	-20 568 733.67 -0.48
CHF	408 502 300.00 USD	452 879 510.34 2.5.2024	-7 475 487.01 -0.18
EUR	2 360 300.00 USD	2 556 889.39 2.5.2024	-33 138.61 0.00
CHF	2 531 000.00 USD	2 805 299.99 2.5.2024	-45 664.16 0.00
GBP	301 500.00 USD	380 851.12 2.5.2024	-3 327.89 0.00
EUR	2 176 800.00 USD	2 353 183.93 2.5.2024	-25 640.53 0.00
CHF	1 049 000.00 USD	1 160 699.58 2.5.2024	-16 939.02 0.00
EUR	2 096 800.00 USD	2 274 128.47 2.5.2024	-32 125.07 0.00
JPY	42 600 000.00 USD	282 288.02 7.5.2024	-11 486.30 0.00
USD	3 928 600.08 CHF	3 544 900.00 2.5.2024	63 474.42 0.00
USD	425 016.10 GBP	335 400.00 2.5.2024	5 044.99 0.00
USD	1 669 639.63 SGD	2 244 000.00 2.5.2024	24 176.75 0.00
CHF	1 173 600.00 USD	1 288 507.56 2.5.2024	-8 891.36 0.00
USD	205 714.23 JPY	31 400 000.00 7.5.2024	6 109.21 0.00
USD	30 321 218.03 EUR	28 452 100.00 2.5.2024	-101 189.90 0.00
USD	2 917 067.35 GBP	2 341 300.00 2.5.2024	-14 591.45 0.00
USD	6 827 190.35 CHF	6 215 300.00 2.5.2024	50 436.27 0.00
USD	307 042.17 SGD	417 400.00 2.5.2024	974.34 0.00
SGD	113 800.00 USD	83 599.14 2.5.2024	-152.76 0.00
EUR	2 148 400.00 USD	2 286 185.92 2.5.2024	10 990.78 0.00
GBP	609 200.00 USD	759 433.41 2.5.2024	3 376.37 0.00
SGD	290 700.00 USD	213 618.95 2.5.2024	-456.71 0.00
CHF	1 266 300.00 USD	1 394 073.07 2.5.2024	-13 382.89 0.00
EUR	2 744 800.00 USD	2 923 567.18 2.5.2024	11 310.22 0.00
USD	60 428.25 SGD	82 200.00 2.5.2024	153.27 0.00
USD	3 045 127.51 EUR	2 840 400.00 2.5.2024	8 029.81 0.00
SGD	20 959 900.00 USD	15 425 929.54 3.6.2024	-34 111.91 0.00
JPY	1 816 300 000.00 USD	11 712 726.54 3.6.2024	-115 068.19 0.00
USD	15 402 630.81 SGD	20 959 900.00 2.5.2024	33 318.25 0.00
USD	11 665 175.36 JPY	1 816 300 000.00 7.5.2024	119 232.60 0.00
EUR	1 342 853 600.00 USD	1 438 550 718.95 3.6.2024	-930 597.48 -0.02
USD	1 436 719 066.64 EUR	1 342 853 600.00 2.5.2024	872 854.70 0.02
CHF	404 762 000.00 USD	445 410 128.31 3.6.2024	-2 546 827.10 -0.06
USD	443 817 982.46 CHF	404 762 000.00 2.5.2024	2 492 136.09 0.06
USD	223 897 066.21 GBP	178 879 600.00 2.5.2024	-87 024.95 0.00
GBP	178 879 600.00 USD	223 929 908.51 3.6.2024	91 389.54 0.00
先渡為替契約合計			-31 027 081.48 -0.73
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産			19 779 150.71 0.46
当座借越およびその他の短期負債			-23 277.67 0.00
その他の資産および負債			48 160 860.04 1.14
純資産総額			4 270 929 274.20 100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーUSコーポレート・ボンド・サステナブル・米ドル

2024年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	7 200 000.00	6 494 749.63	0.45
USD ABBVIE INC 5.05000% 24-15.03.34	6 000 000.00	5 851 070.88	0.41
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 5.90000% 23-09.03.26	3 850 000.00	3 839 183.70	0.27
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	1 850 000.00	1 863 254.86	0.13
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 2.45000% 21-29.10.26	10 000 000.00	9 239 318.60	0.64
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	4 000 000.00	2 938 598.00	0.20
USD AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 5.20000% 23-15.01.29	6 000 000.00	5 903 739.42	0.41
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 5.50000% 24-01.02.34	5 250 000.00	5 062 335.97	0.35
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.25000% 19-15.03.29	2 400 000.00	2 263 038.17	0.16
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33	7 750 000.00	7 580 858.73	0.53
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	7 000 000.00	6 883 345.91	0.48
USD AON CORP/AON GLOBAL HOLDINGS PLC 5.35000% 23-28.02.33	2 500 000.00	2 431 711.25	0.17
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 4.25000% 19-01.11.29	9 225 000.00	8 450 055.81	0.59
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 1.50000% 21-12.08.26	3 600 000.00	3 261 881.95	0.23
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.80000% 24-26.02.27	4 000 000.00	3 953 139.77	0.27
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.85000% 24-26.02.29	3 500 000.00	3 446 283.08	0.24
USD AT&T INC 2.75000% 20-01.06.31	6 955 000.00	5 820 269.91	0.40
USD AT&T INC 5.40000% 23-15.02.34	5 000 000.00	4 885 219.45	0.34
USD AUTOZONE INC 5.05000% 23-15.07.26	4 000 000.00	3 970 810.64	0.28
USD BHP BILLITON FINANCE USA LTD 5.10000% 23-08.09.28	2 500 000.00	2 480 321.22	0.17
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 4.23400% 18-06.11.28	3 000 000.00	2 881 492.89	0.20
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.90000% 24-22.02.27	4 000 000.00	3 966 381.04	0.28
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.10000% 24-22.02.31	2 250 000.00	2 213 765.98	0.15
USD CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 6.09200% 23-03.10.33	6 500 000.00	6 612 936.40	0.46
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY 1.75000% 21-02.12.26	10 000 000.00	9 121 020.50	0.63
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.33000% 22-15.07.29	4 042 000.00	4 100 239.56	0.29
USD CELANESE US HOLDINGS LLC 6.35000% 23-15.11.28	5 500 000.00	5 585 989.53	0.39
USD CENTENE CORP 2.45000% 21-15.07.28	12 750 000.00	11 128 217.84	0.77
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	900 000.00	843 471.50	0.06
USD CF INDUSTRIES INC 5.15000% 14-15.03.34	3 000 000.00	2 831 857.23	0.20
USD CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC 6.15000% 23-10.11.26	4 500 000.00	4 511 071.49	0.31
USD CISCO SYSTEMS INC 4.80000% 24-26.02.27	5 000 000.00	4 957 863.90	0.34
USD CISCO SYSTEMS INC 4.85000% 24-26.02.29	7 000 000.00	6 912 644.13	0.48
USD CMS ENERGY CORP 2.95000% 16-15.02.27	2 000 000.00	1 856 177.30	0.13
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.55000% 23-10.04.28	5 000 000.00	4 813 060.45	0.33
USD COMCAST CORP 1.95000% 20-15.01.31	5 000 000.00	4 036 750.20	0.28
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NY 5.50000% 23-15.03.34	6 500 000.00	6 479 398.45	0.45
USD CONSTELLATION BRANDS INC 5.00000% 23-02.02.26	6 000 000.00	5 933 567.46	0.41
USD COPT DEFENSE PROPERTIES LP 2.00000% 21-15.01.29	1 000 000.00	832 844.68	0.06
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	4 500 000.00	3 937 367.03	0.27
USD CVS HEALTH CORP 2.87500% 16-01.06.26	2 721 000.00	2 576 907.24	0.18
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	2 366 000.00	2 270 301.81	0.16
USD CVS HEALTH CORP 5.30000% 23-01.06.33	2 500 000.00	2 417 012.37	0.17
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.62500% 20-15.07.27	10 000 000.00	10 015 800.00	0.70
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 3.25000% 21-15.02.32	2 100 000.00	1 766 615.55	0.12
USD EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33	4 000 000.00	3 677 322.96	0.26
USD ENBRIDGE INC 5.70000% 23-08.03.33	2 000 000.00	1 977 055.88	0.14
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 4.60000% 24-11.01.27	8 500 000.00	8 356 075.28	0.58
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	6 000 000.00	5 659 208.40	0.39
USD EQT CORP 5.75000% 24-01.02.34	3 000 000.00	2 913 126.90	0.20
USD EQUINIX INC 1.80000% 20-15.07.27	3 400 000.00	3 024 227.37	0.21
USD EQUINIX INC 3.20000% 19-18.11.29	4 733 000.00	4 173 024.71	0.29
USD ESTEE LAUDER COS INC/THE 4.37500% 23-15.05.28	2 500 000.00	2 429 017.87	0.17

注記は当財務書類の一部である。

銘柄		数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD	EVERSOURCE ENERGY 3.37500% 22-01.03.32	5 000 000.00	4 213 549.35	0.29
USD	EVERSOURCE ENERGY 5.45000% 23-01.03.28	2 500 000.00	2 480 236.28	0.17
USD	EXELON CORP 2.75000% 22-15.03.27	2 000 000.00	1 851 498.44	0.13
USD	EXTRA SPACE STORAGE LP 5.40000% 24-01.02.34	3 000 000.00	2 872 968.93	0.20
USD	FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	3 200 000.00	3 072 043.58	0.21
USD	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.12200% 23-07.11.33	4 000 000.00	4 162 108.16	0.29
USD	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.80000% 24-05.03.27	8 000 000.00	7 946 988.48	0.55
USD	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.00000% 23-09.01.28	7 500 000.00	7 572 482.93	0.53
USD	GLOBAL PAYMENTS INC 2.90000% 20-15.05.30	6 000 000.00	5 113 665.54	0.36
USD	HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	4 000 000.00	3 716 710.36	0.26
USD	HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	5 000 000.00	4 948 628.45	0.34
USD	HEICO CORP 5.25000% 23-01.08.28	2 500 000.00	2 473 408.00	0.17
USD	HEICO CORP 5.35000% 23-01.08.33	2 000 000.00	1 964 144.42	0.14
USD	HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	5 700 000.00	4 966 583.00	0.35
USD	HUMANA INC 5.70000% 23-13.03.26	2 000 000.00	1 996 021.50	0.14
USD	INTEL CORP 5.20000% 23-10.02.33	6 200 000.00	6 049 172.91	0.42
USD	INTUIT INC 5.20000% 23-15.09.33	4 500 000.00	4 441 469.27	0.31
USD	INVITATION HOMES OPERATING PARTNER LP 5.45000% 23-15.08.30	2 000 000.00	1 957 333.81	0.14
USD	INVITATION HOMES OPERATING PARTNER LP 5.50000% 23-15.08.33	3 500 000.00	3 383 304.01	0.24
USD	J M SMUCKER CO/THE 5.90000% 23-15.11.28	3 750 000.00	3 821 452.12	0.27
USD	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 5.50000% 24-19.04.29	4 500 000.00	4 518 445.64	0.31
USD	JONES LANG LASALLE INC 6.87500% 23-01.12.28	6 500 000.00	6 737 866.13	0.47
USD	KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	3 000 000.00	2 863 637.91	0.20
USD	KROGER CO/THE 1.70000% 21-15.01.31	6 000 000.00	4 720 499.46	0.33
USD	KYNDRYL HOLDINGS INC 6.35000% 24-20.02.34	5 500 000.00	5 470 412.26	0.38
USD	LOWE ' S COS INC 4.80000% 23-01.04.26	3 000 000.00	2 965 699.29	0.21
USD	LSEGA FINANCING PLC-144A 2.00000% 21-06.04.28	7 000 000.00	6 167 814.38	0.43
USD	LSEGA FINANCING PLC-144A 2.50000% 21-06.04.31	5 000 000.00	4 121 463.75	0.29
USD	MARSH & MCLENNAN COS INC 5.75000% 22-01.11.32	7 500 000.00	7 677 364.20	0.53
USD	MCKESSON CORP 4.90000% 23-15.07.28	3 000 000.00	2 953 629.15	0.21
USD	MCKESSON CORP 5.10000% 23-15.07.33	2 000 000.00	1 948 251.16	0.14
USD	MICRON TECHNOLOGY INC 5.30000% 24-15.01.31	2 750 000.00	2 698 419.52	0.19
USD	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.66700% 23-27.05.29	2 500 000.00	2 499 817.20	0.17
USD	NASDAQ INC 5.55000% 23-15.02.34	5 000 000.00	4 890 290.55	0.34
USD	NATIONAL GRID PLC 5.60200% 23-12.06.28	3 500 000.00	3 496 811.18	0.24
USD	NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 4.45000% 23-13.03.26	2 500 000.00	2 458 609.42	0.17
USD	NEXTERA ENERGY 1.90000% 21-15.06.28	5 000 000.00	4 346 842.95	0.30
USD	NEXTERA ENERGY CAP 2.44000% 21-15.01.32	2 833 000.00	2 274 768.34	0.16
USD	NISOURCE INC 5.35000% 24-01.04.34	5 500 000.00	5 263 996.05	0.37
USD	NNN REIT INC 5.60000% 23-15.10.33	2 500 000.00	2 452 720.30	0.17
USD	NORDSON CORP 5.80000% 23-15.09.33	2 500 000.00	2 525 889.88	0.18
USD	ONEOK INC 6.10000% 22-15.11.32	5 000 000.00	5 079 306.80	0.35
USD	ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27	5 000 000.00	4 644 825.70	0.32
USD	ORACLE CORP 6.25000% 22-09.11.32	4 500 000.00	4 667 792.49	0.32
USD	PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	2 600 000.00	2 194 154.76	0.15
USD	PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.45000% 23-19.05.28	8 000 000.00	7 758 905.92	0.54
USD	PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES PTE LTD 4.75000% 23-19.05.33	3 000 000.00	2 857 767.02	0.20
USD	POLARIS INC 6.95000% 23-15.03.29	1 875 000.00	1 953 240.04	0.14
USD	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	3 200 000.00	3 017 847.64	0.21
USD	PROLOGIS LP 5.00000% 24-15.03.34	3 500 000.00	3 349 448.09	0.23
USD	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 5.85000% 22-15.11.27	5 000 000.00	5 052 468.95	0.35
USD	PUBLIC STORAGE 1.95000% 21-09.11.28	2 000 000.00	1 730 517.94	0.12
USD	QUANTA SERVICES INC 2.90000% 20-01.10.30	5 000 000.00	4 276 050.65	0.30
USD	RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	4 900 000.00	4 677 990.51	0.33
USD	REALTY INCOME CORP 4.75000% 24-15.02.29	3 000 000.00	2 902 783.89	0.20
USD	SEMPRA 3.25000% 17-15.06.27	5 050 000.00	4 705 719.98	0.33
USD	STEEL DYNAMICS INC 2.40000% 20-15.06.25	3 000 000.00	2 886 653.85	0.20
USD	SWEDBANK AB-144A 1.53800% 21-16.11.26	6 500 000.00	5 900 682.64	0.41
USD	T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	14 000 000.00	12 704 482.00	0.88
USD	TAPESTRY INC 7.70000% 23-27.11.30	3 000 000.00	3 113 294.58	0.22
USD	TAPESTRY INC 7.85000% 23-27.11.33	3 000 000.00	3 133 783.47	0.22
USD	TARGA RESOURCES CORP 6.15000% 23-01.03.29	4 500 000.00	4 577 188.73	0.32
USD	TOTALENERGIES CAPITAL SA 5.15000% 24-05.04.34	4 000 000.00	3 941 420.40	0.27
USD	TRUIST BANK-SUB 3.62500% 15-16.09.25	5 200 000.00	5 045 189.97	0.35

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	9 900 000.00	9 307 139.19	0.65
USD VICI PROPERTIES LP 5.12500% 22-15.05.32	4 500 000.00	4 180 988.24	0.29
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 2.30000% 21-15.11.31	7 500 000.00	6 039 976.50	0.42
USD VMWARE LLC 3.90000% 17-21.08.27	5 200 000.00	4 921 815.60	0.34
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.27900% 23-15.03.32	6 000 000.00	5 168 319.24	0.36
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 6.41200% 23-15.03.26	4 500 000.00	4 501 266.03	0.31
USD WEC ENERGY GROUP INC 5.60000% 23-12.09.26	3 000 000.00	3 003 373.74	0.21
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 6.15000% 23-01.04.33	2 137 000.00	2 133 209.82	0.15
USD ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	4 000 000.00	3 295 448.40	0.23
米ドル合計		546 211 071.89	38.00
ノート、固定利付債合計		546 211 071.89	38.00

ノート、変動利付債

米ドル			
USD ALLY FINANCIAL INC 6.992%/VAR 23-13.06.29	3 000 000.00	3 064 643.19	0.21
USD BANCO SANTANDER SA 6.527%/VAR 23-07.11.27	12 547 000.00	12 749 384.11	0.89
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	7 800 000.00	7 229 745.98	0.50
USD BANK OF AMERICA CORP 4.271%/VAR 18-23.07.29	3 600 000.00	3 414 694.28	0.24
USD BANK OF AMERICA CORP 5.202%/VAR 23-25.04.29	8 500 000.00	8 368 447.03	0.58
USD BANK OF AMERICA CORP 5.872%/VAR 23-15.09.34	7 000 000.00	7 012 731.53	0.49
USD BARCLAYS PLC 2.852%/VAR 20-07.05.26	5 500 000.00	5 328 690.73	0.37
USD BARCLAYS PLC 2.894%/VAR 21-24.11.32	7 000 000.00	5 674 529.07	0.39
USD BARCLAYS PLC 5.690%/VAR 24-12.03.30	4 500 000.00	4 440 402.59	0.31
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 6.450%/VAR 24-PRP	5 000 000.00	5 044 403.95	0.35
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.468%/VAR 23-01.02.29	5 350 000.00	5 255 598.24	0.37
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.817%/VAR 23-01.02.34	3 500 000.00	3 387 980.40	0.24
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	11 700 000.00	10 797 403.03	0.75
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	11 000 000.00	9 202 108.08	0.64
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	3 000 000.00	2 547 764.31	0.18
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	4 500 000.00	4 198 439.88	0.29
USD CITIGROUP INC 5.174%/VAR 24-13.02.30	7 500 000.00	7 334 733.15	0.51
USD DANSKE BANK A/S-144A 6.466%/VAR 23-09.01.26	5 500 000.00	5 507 099.24	0.38
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.819%/VAR 23-20.11.29	7 500 000.00	7 708 258.95	0.54
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.992%/VAR 21-27.01.32	7 000 000.00	5 526 533.60	0.38
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.431%/VAR 21-09.03.27	3 200 000.00	2 956 875.26	0.21
USD HSBC HOLDINGS PLC 0.976%/VAR 21-24.05.25	8 500 000.00	8 473 397.55	0.59
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	9 200 000.00	9 037 608.59	0.63
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.099%/VAR 20-04.06.26	10 200 000.00	9 776 366.97	0.68
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.848%/VAR 20-04.06.31	4 000 000.00	3 373 123.68	0.23
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.161%/VAR 23-09.03.29	5 000 000.00	5 056 526.65	0.35
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.540%/VAR 17-01.05.28	2 686 000.00	2 534 565.92	0.18
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	2 357 000.00	2 255 556.65	0.16
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.702%/VAR 19-06.05.30	6 500 000.00	5 962 978.91	0.41
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.182%/VAR 20-01.06.28	5 800 000.00	5 243 296.98	0.36
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	10 000 000.00	9 217 376.60	0.64
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.545%/VAR 21-08.11.32	8 500 000.00	6 896 155.65	0.48
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.912%/VAR 22-25.07.33	8 000 000.00	7 605 971.92	0.53
USD JPMORGAN CHASE & CO 6.087%/VAR 23-23.10.29	2 500 000.00	2 551 021.40	0.18
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.679%/VAR 24-05.01.35	4 000 000.00	3 901 784.28	0.27
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.462%/VAR 24-05.01.28	6 750 000.00	6 690 973.68	0.47
USD MORGAN STANLEY 5.250%/VAR 23-21.04.34	8 300 000.00	7 964 257.78	0.55
USD NATWEST GROUP PLC 5.808%/VAR 23-13.09.29	6 500 000.00	6 485 984.90	0.45
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 6.475%/VAR 24-01.06.34	3 000 000.00	3 012 593.70	0.21
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 5.582%/VAR 23-12.06.29	5 000 000.00	4 977 529.55	0.35
USD US BANCORP 4.653%/VAR 23-01.02.29	3 500 000.00	3 373 324.15	0.23
USD US BANCORP 4.839%/VAR 23-01.02.34	4 000 000.00	3 691 119.88	0.26
USD US BANCORP 5.775%/VAR 23-12.06.29	6 850 000.00	6 863 550.87	0.48
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	5 000 000.00	4 643 555.00	0.32
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	3 200 000.00	2 585 124.09	0.18
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 3.020%/VAR 21-18.11.36	6 900 000.00	5 546 325.98	0.39
米ドル合計		264 470 537.93	18.40
ノート、変動利付債合計		264 470 537.93	18.40

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
メディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 5.25000% 23-07.07.26	4 850 000.00	4 839 704.71	0.34
USD BANK OF MONTREAL 1.25000% 21-15.09.26	11 000 000.00	9 973 761.49	0.69
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 5.15000% 23-08.09.26	3 000 000.00	2 994 631.20	0.21
USD PROSUS NV-144A 3.06100% 21-13.07.31	9 500 000.00	7 648 070.00	0.53
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	4 000 000.00	4 722 964.00	0.33
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.01000% 16-19.10.26	1 500 000.00	1 412 926.35	0.10
米ドル合計		31 592 057.75	2.20
メディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		31 592 057.75	2.20
メディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	5 679 000.00	5 448 976.53	0.38
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	6 700 000.00	5 953 836.28	0.41
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	6 500 000.00	5 649 553.19	0.39
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	8 000 000.00	6 732 693.28	0.47
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	3 200 000.00	3 122 752.13	0.22
USD MORGAN STANLEY 1.794%/VAR 20-13.02.32	4 000 000.00	3 121 216.88	0.22
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	14 000 000.00	13 502 773.34	0.94
USD MORGAN STANLEY 2.475%/VAR 22-21.01.28	5 000 000.00	4 611 749.40	0.32
USD MORGAN STANLEY 3.772%/VAR 18-24.01.29	14 300 000.00	13 419 087.69	0.93
USD MORGAN STANLEY 4.889%/VAR 22-20.07.33	5 000 000.00	4 710 857.60	0.33
USD MORGAN STANLEY 5.656%/VAR 24-18.04.30	6 000 000.00	6 001 273.68	0.42
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.867%/VAR 23-08.06.34	3 050 000.00	2 992 683.30	0.21
米ドル合計		75 267 453.30	5.24
メディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		75 267 453.30	5.24
債券、固定利付債			
米ドル			
USD CONSUMERS ENERGY CO 3.80000% 18-15.11.28	1 500 000.00	1 408 133.58	0.10
USD DUKE ENERGY OHIO INC 5.25000% 23-01.04.33	2 000 000.00	1 951 347.64	0.14
USD DUKE ENERGY PROGRESS LLC 5.25000% 23-15.03.33	3 000 000.00	2 943 657.51	0.20
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.90000% 18-01.11.28	2 000 000.00	1 884 603.68	0.13
USD NATL RURAL UTIL COOPERATIVE FIN CORP 3.70000% 19-15.03.29	5 000 000.00	4 643 031.05	0.32
USD PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 4.55000% 20-01.07.30	5 000 000.00	4 640 859.60	0.32
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 5.45000% 22-15.06.27	4 000 000.00	3 974 524.36	0.28
USD PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 6.15000% 23-15.01.33	3 900 000.00	3 903 580.32	0.27
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC 1.70000% 20-01.10.30	5 000 000.00	3 993 877.30	0.28
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	7 729 000.00	7 543 691.27	0.52
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 5.30000% 23-01.03.28	2 500 000.00	2 485 906.77	0.17
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	2 000 000.00	2 094 370.00	0.15
米ドル合計		41 467 583.08	2.88
債券、固定利付債合計		41 467 583.08	2.88
債券、変動利付債			
米ドル			
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 6.033%/VAR 24-13.03.35	4 000 000.00	3 914 473.80	0.27
USD BANCO SANTANDER SA 5.538%/VAR 24-14.03.30	5 000 000.00	4 900 586.10	0.34
USD BP CAPITAL MARKETS PLC-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	1 035 000.00	1 011 830.80	0.07
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	17 000 000.00	16 130 900.84	1.12
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	3 407 000.00	3 266 878.63	0.23
米ドル合計		29 224 670.17	2.03
債券、変動利付債合計		29 224 670.17	2.03
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		988 233 374.12	68.75

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 2.00000% 21-15.07.26	3 363 000.00	3 099 642.02	0.22
USD ALCON FINANCE CORP-144A 5.37500% 22-06.12.32	3 000 000.00	2 937 596.25	0.20
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 6.12500% 23-21.11.26	2 500 000.00	2 503 931.67	0.17
USD BERRY GLOBAL INC 1.65000% 21-15.01.27	6 350 000.00	5 726 188.25	0.40
USD BLUE OWL TECHNOLOGY FINANCE CORP-144A 6.75000% 24-04.04.29	11 500 000.00	11 081 276.72	0.77
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 3.87500% 20-01.09.28	1 526 000.00	1 411 317.44	0.10
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC 5.95000% 23-04.08.33	1 750 000.00	1 761 326.00	0.12
USD BROADCOM INC-144A 2.45000% 21-15.02.31	4 500 000.00	3 698 381.43	0.26
USD BROADCOM INC-144A 3.46900% 21-15.04.34	3 500 000.00	2 899 861.09	0.20
USD CARRIER GLOBAL CORP 5.80000% 24-30.11.25	2 500 000.00	2 504 616.70	0.17
USD CARRIER GLOBAL CORP 5.90000% 24-15.03.34	3 000 000.00	3 065 049.57	0.21
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	6 500 000.00	5 799 675.05	0.40
USD CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC-144A 3.40000% 16-01.12.26	3 500 000.00	3 330 988.25	0.23
USD COLUMBIA PIPELINES HOLDING CO LLC-144A 6.05500% 23-15.08.26	2 500 000.00	2 508 516.75	0.17
USD CONSTELLATION ENERGY GENERATION LLC 6.12500% 23-15.01.34	2 500 000.00	2 558 162.10	0.18
USD CSL FINANCE PLC-144A 3.85000% 22-27.04.27	2 500 000.00	2 385 383.45	0.17
USD CSL FINANCE PLC-144A 4.25000% 22-27.04.32	6 250 000.00	5 761 847.19	0.40
USD DELTA AIR LINES INC-144A 7.00000% 20-01.05.25	10 000 000.00	10 074 456.90	0.70
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 6.25000% 22-15.03.33	3 000 000.00	3 097 809.60	0.22
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 5.15000% 24-30.01.30	3 000 000.00	2 942 473.83	0.20
USD EAST OHIO GAS CO/THE-144A 1.30000% 20-15.06.25	5 143 000.00	4 888 482.29	0.34
USD ENEL FINANCE AMERICA LLC-144A 7.10000% 22-14.10.27	2 000 000.00	2 084 753.78	0.15
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 6.80000% 22-14.10.25	6 750 000.00	6 863 166.66	0.48
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 6.50000% 22-01.09.30	2 371 000.00	2 400 763.16	0.17
USD ERAC USA FINANCE LLC-144A 5.00000% 24-15.02.29	3 250 000.00	3 192 036.02	0.22
USD ERAC USA FINANCE LLC-144A 5.20000% 24-30.10.34	2 500 000.00	2 414 677.63	0.17
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST II -144A 2.85000% 20-15.05.30	2 600 000.00	2 234 956.20	0.16
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.80000% 23-07.01.29	5 000 000.00	4 987 916.35	0.35
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.95000% 24-04.04.34	6 000 000.00	5 868 678.84	0.41
USD HCA INC 3.12500% 23-15.03.27	6 000 000.00	5 611 720.74	0.39
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 6.10000% 23-21.09.28	1 000 000.00	1 011 463.79	0.07
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 6.20000% 23-21.09.30	6 500 000.00	6 618 546.03	0.46
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 5.30000% 24-08.01.29	7 500 000.00	7 356 057.60	0.51
USD IQVIA INC 6.25000% 24-01.02.29	2 500 000.00	2 540 692.50	0.18
USD JABIL INC 5.45000% 23-01.02.29	5 425 000.00	5 346 276.20	0.37
USD KENVUE INC 5.35000% 23-22.03.26	3 000 000.00	3 002 673.66	0.21
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 5.85000% 22-15.11.27	3 000 000.00	2 945 691.36	0.20
USD KYNDRYL HOLDINGS INC 2.70000% 22-15.10.28	2 723 000.00	2 375 502.47	0.17
USD MACQUARIE AIRFINANCE HOLDINGS LTD-144A 6.50000% 24-26.03.31	5 500 000.00	5 504 108.50	0.38
USD MACQUARIE BANK LTD-144A-SUB 3.62400% 20-03.06.30	5 000 000.00	4 348 746.00	0.30
USD MARS INC-144A 4.65000% 23-20.04.31	2 500 000.00	2 405 818.50	0.17
USD MARS INC-144A 4.75000% 23-20.04.33	5 000 000.00	4 779 406.15	0.33
USD MARVELL TECHNOLOGY INC 5.75000% 23-15.02.29	3 000 000.00	3 013 860.69	0.21
USD MARVELL TECHNOLOGY INC 5.95000% 23-15.09.33	2 500 000.00	2 514 834.73	0.18
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 5.05000% 23-14.06.28	10 500 000.00	10 349 173.06	0.72
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26	2 395 000.00	2 280 683.15	0.16
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 5.40000% 23-12.09.28	5 000 000.00	4 975 216.45	0.35
USD NGPL PIPECO LLC-144A 3.25000% 21-15.07.31	5 000 000.00	4 165 530.90	0.29
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	2 000 000.00	1 998 360.00	0.14
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA 3.15000% 22-01.05.27	2 000 000.00	1 867 980.00	0.13
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA INC 3.87500% 22-18.06.26	4 677 000.00	4 519 618.94	0.31
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 3.70000% 19-15.11.28	2 345 000.00	2 191 286.33	0.15
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 1.20000% 20-15.11.25	5 000 000.00	4 654 163.95	0.32
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 6.05000% 23-01.08.28	3 500 000.00	3 537 686.39	0.25
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.02.26	3 000 000.00	3 000 425.31	0.21
USD RWE FINANCE US LLC-144A 5.87500% 24-16.04.34	8 000 000.00	7 848 015.20	0.55
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 3.25000% 15-28.10.25	12 000 000.00	11 570 262.84	0.80
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 3.40000% 17-16.03.27	1 500 000.00	1 429 520.99	0.10
USD SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCH NV-144A 1.20000% 21-11.03.26	6 500 000.00	6 039 487.61	0.42

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SWEDBANK AB-144A 6.13600% 23-12.09.26	3 000 000.00	3 016 548.00	0.21
USD TECK RESOURCES LTD 3.90000% 20-15.07.30	3 500 000.00	3 161 236.75	0.22
USD TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD-144A 1.15000% 21-07.06.24	8 800 000.00	8 727 488.00	0.61
USD VAR ENERGI ASA-144A 7.50000% 22-15.01.28	2 750 000.00	2 869 982.50	0.20
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.35500% 22-15.03.32	4 200 000.00	3 351 022.84	0.23
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	3 250 000.00	3 048 265.02	0.21
米ドル合計		268 061 284.34	18.65
ノート、固定利付債合計		268 061 284.34	18.65
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AIB GROUP PLC-144A 6.608%/VAR 23-13.09.29	2 000 000.00	2 038 548.34	0.14
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 5.731%/VAR 24-18.09.34	6 250 000.00	6 095 717.81	0.43
USD FIFTH THIRD BANCORP 1.707%/VAR 21-01.11.27	2 053 000.00	1 855 548.91	0.13
USD ING GROEP NV 3.869%/VAR 22-28.03.26	7 000 000.00	6 871 519.55	0.48
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.340%/VAR 21-12.01.27	3 250 000.00	3 010 276.04	0.21
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 5.068%/VAR 23-24.01.34	6 000 000.00	5 649 732.24	0.39
米ドル合計		25 521 342.89	1.78
ノート、変動利付債合計		25 521 342.89	1.78
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債			
米ドル			
USD CREDIT AGRICOLE SA LONDON-144A 4.12500% 17-10.01.27	6 500 000.00	6 261 868.79	0.44
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 4.70000% 23-26.01.26	2 000 000.00	1 946 483.32	0.13
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 4.15000% 22-26.08.25	2 040 000.00	2 003 791.73	0.14
USD MET TOWER GLOBAL FUNDING-144A 3.70000% 22-13.06.25	4 000 000.00	3 919 562.60	0.27
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-144A-SUB 2.33200% 20-21.08.30	9 380 000.00	7 556 686.53	0.53
米ドル合計		21 688 392.97	1.51
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		21 688 392.97	1.51
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債			
米ドル			
USD AIB GROUP PLC-144A 5.871%/VAR 24-28.03.35	4 000 000.00	3 870 515.24	0.27
USD AUSTRALIA & NEWZEALAND BKG-144A-SUB 2.950%/VAR 20-22.07.30	4 700 000.00	4 513 729.88	0.32
USD COMMONWEALTH BANK AUSTRALIA-144A-SUB 3.610%/VAR 19-12.09.34	3 200 000.00	2 822 800.19	0.20
USD COOPERATIEVE RABOBANK UA-144A 1.339%/VAR 20-24.06.26	5 500 000.00	5 225 160.00	0.36
USD MORGAN STANLEY 5.831%/VAR 24-19.04.35	2 500 000.00	2 498 992.57	0.17
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.873%/VAR 23-26.01.29	8 000 000.00	7 758 888.80	0.54
USD TRUIST FINANCIAL CORP 7.161%/VAR 23-30.10.29	2 500 000.00	2 617 689.80	0.18
米ドル合計		29 307 776.48	2.04
ミディアム・ターム・ノート、変動利付債合計		29 307 776.48	2.04
債券、固定利付債			
米ドル			
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC/AERCAP GL 6.45000% 24-15.04.27	4 998 000.00	5 095 158.27	0.36
USD BERRY GLOBAL INC-144A 5.65000% 24-15.01.34	2 750 000.00	2 655 927.43	0.19
USD DNB BANK ASA-144A 1.12700% 20-16.09.26	6 500 000.00	6 092 368.10	0.42
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	5 000 000.00	4 797 059.85	0.33
米ドル合計		18 640 513.65	1.30
債券、固定利付債合計		18 640 513.65	1.30
債券、変動利付債			
米ドル			
USD CAIXABANK SA-144A 6.208%/VAR 23-18.01.29	4 750 000.00	4 777 416.29	0.33
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 6.066%/VAR 24-19.01.35	3 000 000.00	2 930 797.92	0.20
米ドル合計		7 708 214.21	0.53
債券、変動利付債合計		7 708 214.21	0.53
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		370 927 524.54	25.81

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD AKER BP ASA-144A 5.60000% 23-13.06.28	5 000 000.00	4 986 428.75	0.35
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 6.50000% 23-21.11.33	4 500 000.00	4 485 008.16	0.31
USD ENGIE SA-144A 5.25000% 24-10.04.29	5 000 000.00	4 922 832.65	0.34
USD ENGIE SA-144A 5.62500% 24-10.04.34	4 000 000.00	3 922 806.28	0.27
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 5.59300% 23-13.11.33	5 000 000.00	5 079 048.40	0.36
USD SOLVENTUM CORP-144A 5.40000% 24-01.03.29	1 000 000.00	981 082.62	0.07
米ドル合計		24 377 206.86	1.70
ノート、固定利付債合計		24 377 206.86	1.70
ノート、変動利付債			
米ドル			
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 6.255%/VAR 23-07.12.34	1 000 000.00	1 013 201.51	0.07
米ドル合計		1 013 201.51	0.07
ノート、変動利付債合計		1 013 201.51	0.07
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		25 390 408.37	1.77

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

投資信託、オープン・エンド型

ルクセンブルグ			
USD UBS (LUX) KEY-EUROPEAN FINANCIAL (EUR) (USD HEDGED) U-X-ACC	725.00	7 469 450.25	0.52
USD UBS(LUX)BOND SICAV-GLBL SDG CORPORATES SUSTNBL(USD) U-X-ACC	360.00	3 869 481.60	0.26
ルクセンブルグ合計		11 338 931.85	0.78
投資信託、オープン・エンド型合計		11 338 931.85	0.78
ルクセンブルグ2010年12月17日法（改訂済）の第41条(1)e)に規定されたUCITS/その他のUCIs合計		11 338 931.85	0.78
投資有価証券合計		1 395 890 238.88	97.11

金融派生商品

公認の証券取引所に上場されている金融派生商品

債券関連金融先物			
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	-250.00	295 718.75	0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	150.00	-397 218.68	-0.03
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	125.00	-65 093.68	0.00
債券関連金融先物合計		-166 593.61	-0.01
公認の証券取引所に上場されている金融派生商品合計		-166 593.61	-0.01
金融派生商品合計		-166 593.61	-0.01

注記は当財務書類の一部である。

銘柄	数量／ 額面		米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）		
先渡為替契約						
購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日						
AUD	5 071 200.00	USD	3 359 913.92	16.5.2024	-65 476.94	0.00
JPY	2 273 122 800.00	USD	14 892 050.91	16.5.2024	-415 552.60	-0.03
GBP	293 970 800.00	USD	366 960 868.73	16.5.2024	1 161 865.60	0.08
EUR	218 217 600.00	USD	232 706 157.55	16.5.2024	755 025.21	0.05
CHF	367 581 900.00	USD	403 304 605.43	16.5.2024	-1 875 341.96	-0.13
USD	6 611 084.30	CHF	6 013 000.00	16.5.2024	44 400.35	0.00
AUD	231 800.00	USD	149 820.82	16.5.2024	764.94	0.00
USD	3 892 280.18	GBP	3 123 500.00	16.5.2024	-19 099.32	0.00
USD	223 207.53	JPY	34 370 400.00	16.5.2024	4 317.89	0.00
USD	37 724.73	AUD	58 600.00	16.5.2024	-343.97	0.00
USD	2 535 072.49	EUR	2 378 200.00	16.5.2024	-9 256.59	0.00
先渡為替契約合計					-418 697.39	-0.03
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産					27 538 144.40	1.92
当座借越およびその他の短期負債					-115 533.68	-0.01
その他の資産および負債					14 686 778.62	1.02
純資産総額					1 437 414 337.22	100.00

注記は当財務書類の一部である。

フォーカス・シキャブーワールドバンク・ロング・ターム・ボンド・米ドル

2024年4月30日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
米ドル			
USD INTERNA BNK FOR RECONST & DVLPMNT 4.50000% 24-10.04.31	4 545 000.00	4 454 774.61	0.22
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 4.75000% 23-14.11.33	335 000 000.00	333 220 985.86	16.39
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECON&DEVELOP 4.00000% 24-10.01.31	16 703 000.00	15 906 799.89	0.78
USD INTERNATIONAL BANK FOR REC & DEV 2.50000% 22-29.03.32	145 000 000.00	122 990 370.25	6.05
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONST& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	350 000 000.00	279 979 038.50	13.77
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.75000% 19-23.10.29	178 000 000.00	151 649 118.52	7.46
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500% 22-21.09.29	100 000 000.00	94 258 318.00	4.64
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.75000% 05-15.02.35	12 553 000.00	12 327 910.40	0.61
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 5.67000% 24-01.02.34	12 500 000.00	12 041 818.88	0.59
米ドル合計		1 026 829 134.91	50.51
ノート、固定利付債合計		1 026 829 134.91	50.51

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION 5.55000% 23-05.05.33	5 000 000.00	4 816 952.15	0.24
米ドル合計		4 816 952.15	0.24
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		4 816 952.15	0.24

債券、固定利付債

米ドル			
USD INTL BK FOR RECONS & DEV WORLD BK 3.87500% 23-14.02.30	110 000 000.00	104 639 216.00	5.15
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	260 000 000.00	206 386 853.40	10.15
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.75000% 20-26.08.30	285 000 000.00	222 178 379.10	10.93
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.25000% 21-10.02.31	344 000 000.00	273 207 882.25	13.44
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 4.00000% 23-25.07.30	150 000 000.00	143 420 578.50	7.05
米ドル合計		949 832 909.25	46.72
債券、固定利付債合計		949 832 909.25	46.72
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		1 981 478 996.31	97.47

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ミディアム・ターム・ノート、固定利付債

米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.77850% 19-13.09.29	40 000 000.00	35 745 114.22	1.76
米ドル合計		35 745 114.22	1.76
ミディアム・ターム・ノート、固定利付債合計		35 745 114.22	1.76

ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン

米ドル			
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 00-01.05.30	6 284 000.00	4 601 058.90	0.22
米ドル合計		4 601 058.90	0.22
ミディアム・ターム・ノート、ゼロ・クーポン合計		4 601 058.90	0.22
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		40 346 173.12	1.98
投資有価証券合計		2 021 825 169.43	99.45

注記は当財務書類の一部である。

銘柄							数量／ 額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）	
先渡為替契約										
購入通貨／購入額／売却通貨／売却額／満期日										
GBP	100	807	700.00	USD	127	343	079.01	2.5.2024	-1 116 717.45	-0.05
EUR	428	100	000.00	USD	464	208	094.50	2.5.2024	-6 462 169.46	-0.32
CHF	513	972	800.00	USD	569	807	685.27	2.5.2024	-9 405 570.02	-0.46
USD		595	997.86	CHF		535	200.00	2.5.2024	12 451.00	0.00
USD		141	879.86	GBP		112	800.00	2.5.2024	637.34	0.00
USD	1	796	303.39	EUR	1	666	200.00	2.5.2024	14 719.04	0.00
USD		982	683.62	CHF		886	700.00	2.5.2024	15 884.30	0.00
USD		779	139.80	EUR		718	700.00	2.5.2024	10 669.82	0.00
USD		157	921.77	GBP		125	100.00	2.5.2024	1 277.80	0.00
USD		560	682.99	EUR		516	100.00	2.5.2024	8 843.06	0.00
USD		595	590.17	CHF		536	800.00	2.5.2024	10 298.78	0.00
USD	1	283	237.59	CHF	1	168	800.00	2.5.2024	8 854.99	0.00
USD		698	331.24	CHF		634	700.00	2.5.2024	6 296.13	0.00
USD	1	752	756.98	EUR	1	633	800.00	2.5.2024	5 816.33	0.00
USD	4	087	519.91	GBP	3	283	100.00	2.5.2024	-23 413.76	0.00
AUD	11	712	900.00	USD	7	757	863.62	2.5.2024	-152 092.00	-0.01
AUD		399	600.00	USD		258	203.78	2.5.2024	1 276.48	0.00
USD	1	362	352.25	CHF	1	242	300.00	2.5.2024	7 830.09	0.00
USD	12	880	389.84	CHF	11	726	200.00	2.5.2024	94 913.09	0.01
USD		556	358.09	EUR		522	400.00	2.5.2024	-2 218.11	0.00
USD	1	202	075.64	CHF	1	091	900.00	2.5.2024	11 539.74	0.00
EUR	1	375	300.00	USD	1	464	872.46	2.5.2024	5 667.07	0.00
AUD	5	500	000.00	USD	3	535	541.35	2.5.2024	35 883.65	0.00
AUD		597	400.00	USD		387	155.41	2.5.2024	766.28	0.00
USD		864	638.47	CHF		786	800.00	2.5.2024	6 763.53	0.00
USD		671	362.58	EUR		629	800.00	2.5.2024	-2 051.07	0.00
AUD		27	500.00	USD		17	844.16	2.5.2024	12.97	0.00
USD		811	897.21	EUR		759	800.00	2.5.2024	-518.94	0.00
USD	1	213	515.71	CHF	1	108	600.00	2.5.2024	4 771.23	0.00
USD		847	965.29	CHF		774	300.00	2.5.2024	3 719.53	0.00
USD		451	976.16	EUR		423	300.00	2.5.2024	-637.37	0.00
USD		479	617.27	EUR		447	400.00	2.5.2024	1 234.82	0.00
USD		172	639.95	GBP		137	500.00	2.5.2024	469.32	0.00
USD	1	268	343.59	CHF	1	154	700.00	2.5.2024	9 334.70	0.00
GBP	97	149	200.00	USD	121	918	874.92	4.6.2024	-252 577.52	-0.01
EUR	422	157	800.00	USD	453	137	005.84	4.6.2024	-1 165 976.22	-0.06
AUD	18	237	400.00	USD	11	922	627.30	4.6.2024	-68 340.85	0.00
CHF	492	325	800.00	USD	541	949	993.07	4.6.2024	-3 216 545.83	-0.16
先渡為替契約合計									-21 588 897.51	-1.06
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産									31 845 945.25	1.57
その他の資産および負債									833 301.97	0.04
純資産総額									2 032 915 519.14	100.00

注記は当財務書類の一部である。

5【販売及び買戻しの実績】

2023年6月1日から2024年5月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2024年5月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

		販売口数	買戻し口数	発行済口数
フォーカス・シキャブ ーグローバル・ボンド	クラス米ドル F-acc投資証券	463,581.456 (257,651.000)	214,240.006 (85,670.000)	1,704,456.717 (840,497.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	153,859.000 (144,221.000)	400,708.000 (400,623.000)	662,741.500 (592,263.000)
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	3,403,663.526 (73,674.000)	3,061,914.105 (37,676.000)	5,276,047.999 (143,246.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	953.000 (302.000)	43,542.000 (43,542.000)	92,045.000 (91,394.000)
フォーカス・シキャブ ーハイ・グレード・ ロング・ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	4,426,664.203 (78,505.000)	3,009,729.000 (65,102.000)	9,072,578.191 (199,423.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	18,800.000 (16,031.000)	98,261.000 (98,261.000)	213,973.000 (211,204.000)
フォーカス・シキャブ ーUSコーポレート・ボンド・ サステナブル・米ドル	クラスF-acc投資証券	510,268.150 (61,700.000)	1,592,050.745 (30,487.000)	3,319,369.931 (227,702.000)
	クラス円ヘッジ F-acc投資証券	368.000 (368.000)	40,950.000 (40,950.000)	260,790.000 (260,790.000)
フォーカス・シキャブ ーワールドバンク・ロング・ ターム・ボンド・米ドル	クラスF-acc投資証券	985,318.547 (9,700.000)	1,675,787.404 (5,027.000)	6,033,708.552 (29,360.000)

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