

【表紙】

- 【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書
- 【提出先】 関東財務局長
- 【提出日】 2024年9月30日
- 【発行者名】 マニユライフ・インベストメント・マネジメント（HK）リミテッド
（Manulife Investment Management (Hong Kong) Limited）
- 【代表者の役職氏名】 取締役 マイケル・フロイド・ドマーマス
（Michael Floyd Dommermuth, Director）
- 【本店の所在の場所】 香港、銅鑼灣、希慎道33號、リー・ガーデン・ワン、10階（10/F,
Lee Garden One, 33 Hysan Avenue, Causeway Bay, Hong Kong）
- 【代理人の氏名又は名称】 弁護士 竹野康造
弁護士 廣本文晴
- 【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【事務連絡者氏名】 弁護士 竹野康造
同 廣本文晴
同 中条咲耶子
- 【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
- 【電話番号】 03（6212）8316
- 【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券に係るファンドの名称】
マニユライフ・インベストメント・トラスト -
US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
（Manulife Investments Trust- US Core Fixed Income Fund）
- 【届出の対象とした募集（売出）外国投資信託受益証券の金額】
クラスA（米ドル建て）受益証券
100億米ドル（約1兆5,690億円）を上限とします。
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）受益証券
100億豪ドル（約1兆296億円）を上限とします。
（注）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2024年4月30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=156.90円および1豪ドル=102.96円）によります。
- 【縦覧に供する場所】 該当事項ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2024年6月28日に提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を下表のとおり新たな情報により追加・更新するため、また、2024年9月付でファンドの設立地における英文目論見書が更新され、投資制限および投資リスクに関する事項が修正されたため、これに関連する記載およびその他一部の情報を更新するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

(1) 半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、下記のとおりです。

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

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

* 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

(「5 管理会社の経理の概況」は訂正内容に該当しないため省略します。)

[次へ](#)

1 ファンドの運用状況

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

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

（1）投資状況

資産別および地域別の投資状況

本表は、ファンドの全クラスの資産を合計して表示したものです。

（2024年7月末日現在）

資産の種類	国名/地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
変動利付債	アメリカ合衆国	46,267,755	58.60
	カナダ	417,352	0.53
	ケイマン諸島	262,622	0.33
	イギリス	257,943	0.33
普通社債	アメリカ合衆国	14,406,346	18.24
	ノルウェー	228,978	0.29
	バミューダ	176,941	0.22
	イギリス	140,355	0.18
	アイルランド	138,844	0.18
	シンガポール	100,997	0.13
国債	アメリカ合衆国	15,020,441	19.02
小計		77,418,574	98.05
現金その他の資産（負債控除後）		1,542,419	1.95
合計 (純資産総額)		78,960,993 (約12,037百万円)	100.00

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

（注2）米ドルおよび豪ドルの円貨換算は、2024年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=152.44円および1豪ドル=99.65円）によります。以下同じです。

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

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

投資有価証券の主要銘柄

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

（2024年7月末日現在）

順位	銘柄	発行国 (発行地)	種類	利率 (%)	償還日	数量	(米ドル)				投資 比率 (%)
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
1	US TREASURY 4.25% 15/02/2054	アメリカ 合衆国	国債	4.250	2054年2月15日	2,369,000	0.94	2,228,168	0.98	2,330,151	2.95
2	US TREASURY 4.375% 15/05/2034	アメリカ 合衆国	国債	4.375	2034年5月15日	2,166,000	1.00	2,164,322	1.03	2,221,768	2.81
3	US TREASURY 4.75% 15/11/2043	アメリカ 合衆国	国債	4.750	2043年11月15日	2,032,000	1.02	2,064,556	1.04	2,122,710	2.69
4	US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	アメリカ 合衆国	国債	2.500	2045年2月15日	2,431,000	1.13	2,753,899	0.74	1,792,931	2.27
5	US TREASURY 4.125% 31/07/2031	アメリカ 合衆国	国債	4.125	2031年7月31日	1,678,000	1.00	1,680,548	1.01	1,695,036	2.15
6	US TREASURY 4.25% 30/06/2031	アメリカ 合衆国	国債	4.250	2031年6月30日	1,130,000	1.00	1,126,336	1.02	1,149,593	1.46
7	FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年4月1日	1,216,000	0.93	1,131,465	0.91	1,104,436	1.40
8	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.500	2050年12月1日	1,945,000	0.71	1,377,861	0.56	1,079,823	1.37
9	US TREASURY 4% 31/01/2031	アメリカ 合衆国	国債	4.000	2031年1月31日	1,073,000	0.99	1,066,349	1.00	1,075,164	1.36
10	FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2052年8月1日	1,036,000	0.87	906,000	0.89	924,891	1.17
11	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2050	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2050年5月1日	1,800,000	0.52	940,727	0.51	924,641	1.17
12	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2053年3月1日	1,012,000	0.92	935,280	0.91	917,063	1.16
13	FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2052年7月1日	986,000	0.83	815,670	0.83	815,148	1.03
14	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年9月1日	900,000	0.86	775,044	0.85	764,032	0.97
15	US TREASURY 4.625% 15/05/2044	アメリカ 合衆国	国債	4.625	2044年5月15日	692,000	0.98	678,547	1.03	710,674	0.90
16	US TREASURY 4% 15/11/2042	アメリカ 合衆国	国債	4.000	2042年11月15日	745,000	1.00	744,407	0.95	708,685	0.90
17	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年1月1日	690,000	0.95	657,987	0.95	656,477	0.83
18	FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年10月1日	708,000	0.86	609,008	0.86	612,174	0.78
19	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.500	2049年5月1日	2,138,000	0.29	616,748	0.29	610,430	0.77
20	FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2052年1月1日	845,000	0.82	690,517	0.71	601,587	0.76
21	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2037	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2037年9月1日	785,000	0.74	580,233	0.74	578,904	0.73
22	FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2053年7月1日	620,000	0.93	573,522	0.93	577,479	0.73
23	FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	アメリカ 合衆国	変動利 付債	3.000	2049年12月1日	1,350,000	0.49	659,356	0.39	520,855	0.66

順位	銘柄	発行国 (発行地)	種類	利率 (%)	償還日	数量	(米ドル)				投資 比率 (%)
							取得価格		時価		
							単価	合計	単価	合計	
24	US TREASURY 3.375% 15/11/2048	アメリカ 合衆国	国債	3.375	2048年11月15日	614,000	0.93	568,876	0.84	514,587	0.65
25	FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2052年5月1日	624,000	0.80	500,906	0.81	506,145	0.64
26	FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.500	2052年6月1日	601,000	0.82	492,497	0.83	498,241	0.63
27	FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.500	2052年9月1日	569,000	0.87	492,824	0.87	495,835	0.63
28	FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	アメリカ 合衆国	変動利 付債	4.000	2051年3月1日	646,000	0.77	497,427	0.73	468,683	0.59
29	FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	2.000	2052年2月1日	660,000	0.70	463,533	0.71	466,732	0.59
30	FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	アメリカ 合衆国	変動利 付債	5.000	2052年9月1日	535,000	0.85	456,089	0.85	457,191	0.58

投資不動産物件

該当事項はありません。（2024年7月末日現在）

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。（2024年7月末日現在）

（２）運用実績

純資産の推移

2024年7月末日および同日前1年間における各月末の純資産の推移は次の通りです。

<クラスA（米ドル建て）>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	米ドル	円
2023年8月末日	70,056,245	10,679,374	82.41	12,563
9月末日	66,935,359	10,203,626	79.55	12,127
10月末日	62,489,406	9,525,885	77.90	11,875
11月末日	64,403,687	9,817,698	81.67	12,450
12月末日	67,655,271	10,313,370	85.17	12,983
2024年1月末日	66,273,086	10,102,669	84.99	12,956
2月末日	64,437,382	9,822,835	83.61	12,746
3月末日	63,911,899	9,742,730	84.05	12,813
4月末日	59,768,269	9,111,075	81.81	12,471
5月末日	60,526,653	9,226,683	83.28	12,695
6月末日	59,733,939	9,105,842	84.04	12,811
7月末日	59,849,201	9,123,412	86.02	13,113

（参考情報）

純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移（2024年7月末日現在）

【クラスA（米ドル建て）】



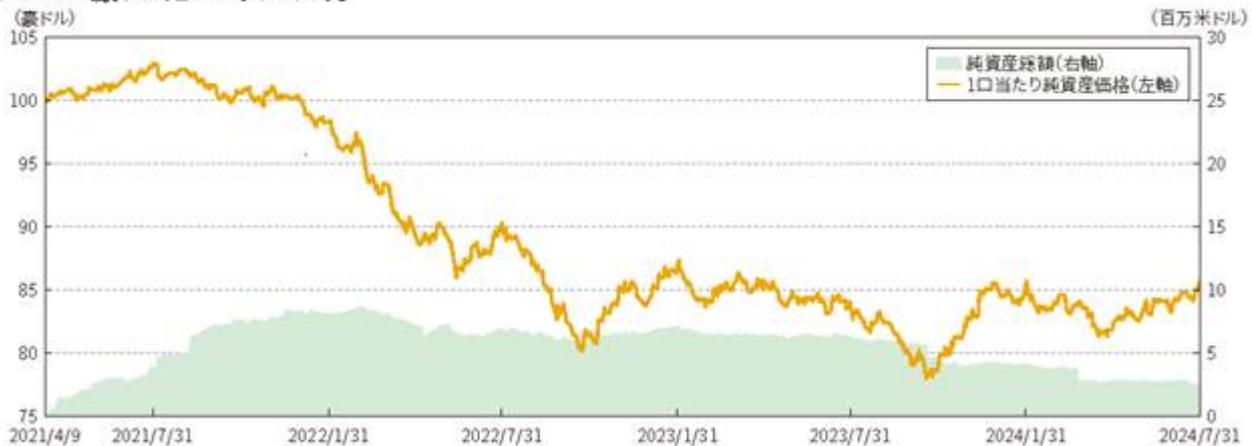
<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	米ドル	千円	豪ドル	円
2023年8月末日	6,099,059	929,741	83.27	8,298
9月末日	5,838,522	890,024	80.31	8,003
10月末日	4,654,496	709,531	78.51	7,824
11月末日	4,004,818	610,494	82.18	8,189
12月末日	4,297,395	655,095	85.52	8,522
2024年1月末日	4,126,890	629,103	85.24	8,494
2月末日	3,758,621	572,964	83.76	8,347
3月末日	2,860,523	436,058	84.07	8,378
4月末日	2,722,349	414,995	81.76	8,147
5月末日	2,762,549	421,123	83.11	8,282
6月末日	2,762,274	421,081	83.76	8,347
7月末日	2,574,661	392,481	85.65	8,535

(参考情報)

純資産総額及び1口当たり純資産価格の推移(2024年7月末日現在)

【クラスA(豪ドル建てヘッジあり)】



分配の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
2023年8月1日～2024年7月末日	1.00	152

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	米ドル	円
第7会計年度中 （2024年1月1日～2024年7月末日）	0.50	76
設定来累計	3.50	534

（注）設定来累計とは、運用開始日である2020年9月25日から2024年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

期間	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
2023年8月1日～2024年7月末日	1.00	100

（注）1口当たりの支払分配金は、税引前の数字です。以下同じです。

（参考情報）

	1口当たりの支払分配金	
	豪ドル	円
第7会計年度中 （2024年1月1日～2024年7月末日）	0.50	50
設定来累計	3.00	299

（注）設定来累計とは、運用開始日である2021年4月9日から2024年7月末日までの期間における分配金の累計額です。

収益率の推移

<クラスA（米ドル建て）>

期間	収益率（注）
2023年8月1日～2024年7月末日	4.86%

（注）収益率（%）= $100 \times (a - b) / b$

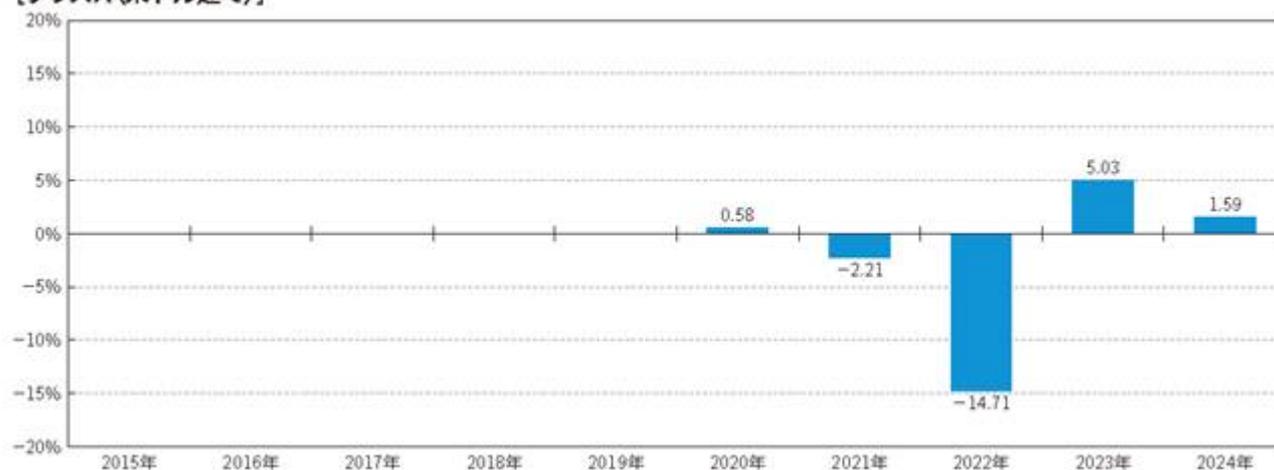
a：2024年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2023年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）

収益率の推移（暦年ベース）

【クラスA（米ドル建て）】



（注）収益率（%）= $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

*2024年の場合は、7月末日の1口当たり純資産価格（7月末日までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

*クラスA（米ドル建て）については、2020年の場合は、100米ドル

なお、ファンドにはベンチマークはありません。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

期間	収益率（注）
2023年8月1日～2024年7月末日	3.08%

（注）収益率（%）= $100 \times (a - b) / b$

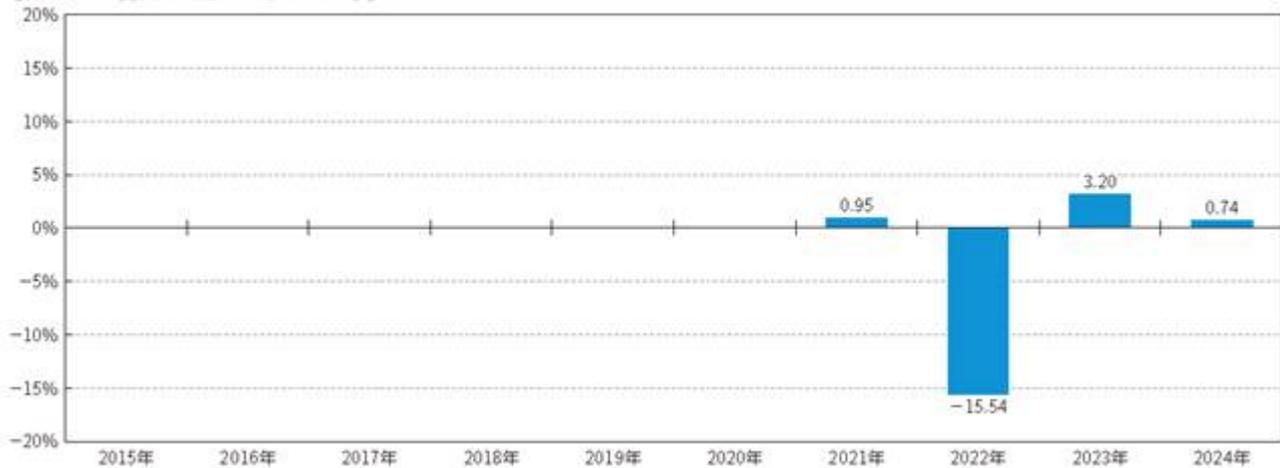
a：2024年7月末日現在の1口当たり純資産価格（上記期間の分配金の合計額を加えた額）

b：2023年7月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）

（参考情報）

収益率の推移（暦年ベース）

【クラスA（豪ドル建てヘッジあり）】



（注）収益率（%）= $100 \times (a - b) / b$

a：暦年末の1口当たり純資産価格（当該暦年の分配金の合計額を加えた額）

*2024年の場合は、7月末の1口当たり純資産価格（7月末までの分配金の合計額を加えた額）

b：当該暦年の直前の暦年末の1口当たり純資産価格（分配落の額）

*クラスA（豪ドル建てヘッジあり）については、2021年の場合は、100豪ドル
なお、ファンドにはベンチマークはありません。

2 販売及び買戻しの実績

2024年7月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2024年7月末日現在の発行済口数は次のとおりです。

<クラスA（米ドル建て）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
27,310 (27,310)	228,567 (228,567)	695,778 (695,778)

（注）（ ）内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済口数です。

<クラスA（豪ドル建てヘッジあり）>

販売口数	買戻し口数	発行済口数
910 (910)	67,955 (67,955)	45,959 (45,959)

（注）（ ）内の数字は本邦における販売・買戻しおよび発行済口数です。

[次へ](#)

3 ファンドの経理状況

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、香港財務報告基準に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものです（ただし、円換算部分を除きます。）。これは「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す。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいいます。）の監査を受けていません。
- c . ファンドの中間財務書類において記載されているクラスA（円ヘッジあり）およびクラスA（円ヘッジなし）は、本書に基づく開示の対象ではなく、参考情報として記載されています。
- d . ファンドの原文の中間財務書類は、別途記載される場合を除き、米ドル、日本円または豪ドルで表示されています。日本語の中間財務書類には、主要な金額について2024年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=152.44円および1豪ドル=99.65円）で換算された円換算額が併記されています。なお、千円未満の金額は四捨五入されているため、円換算額は合計欄の数値が総数と一致しない場合があります。

[次へ](#)

（１）資産及び負債の状況

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
 US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 財政状態計算書（未監査）
 2024年1月1日から2024年6月30日までの期間

	2024年6月30日現在	
	米ドル	千円
資産		
損益を通じて公正価値で測定される金融資産	79,087,159	12,056,047
利付証券に係る未収利息	586,079	89,342
預金未収利息	54	8
投資対象売却未収金	39,927	6,086
現金および現金同等物	388,966	59,294
資産合計	<u>80,102,185</u>	<u>12,210,777</u>
負債		
デリバティブ金融負債	246,758	37,616
受益証券買戻未払金	202,332	30,843
その他の未払金	93,688	14,282
負債合計（受益者に帰属する純資産を除く）	<u>542,778</u>	<u>82,741</u>
受益者に帰属する純資産	<u>79,559,407</u>	<u>12,128,036</u>
発行済受益証券口数		
クラスA（円ヘッジあり）	2,716,879	口
クラスA（円ヘッジなし）	878,293	口
クラスA（米ドル建て）	710,868	口
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）	49,459	口
受益証券1口当たり純資産価格		
クラスA（円ヘッジあり）	648	円
クラスA（円ヘッジなし）	1,121	円
クラスA（米ドル建て）	84.04	米ドル 12,811 円
クラスA（豪ドル建てヘッジあり）	83.76	豪ドル 8,347 円

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
 US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
 包括利益計算書（未監査）
 2024年1月1日から2024年6月30日までの期間

	2024年1月1日から2024年6月30日 までの期間	
	米ドル	千円
収益		
利付証券利息	2,206,682	336,387
銀行利息	9,640	1,470
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る実現純損失	(3,486,240)	(531,442)
損益を通じて公正価値で測定される金融資産および デリバティブ金融商品に係る未実現損失の純変動	(984,854)	(150,131)
為替差損の純額	(6,031)	(919)
	<u>(2,260,803)</u>	<u>(344,637)</u>
費用		
運用報酬	(105,543)	(16,089)
保管および手続費用	(23,127)	(3,525)
受託会社報酬	(5,952)	(907)
監査報酬	(20,403)	(3,110)
評価費用	(46,000)	(7,012)
取引取扱手数料	(4,896)	(746)
年次費用	(1,386)	(211)
会計およびその他の専門家報酬	(3,181)	(485)
販売報酬および管理会社代行サービス会社報酬	(289,897)	(44,192)
その他の運用費用	(9,163)	(1,397)
運用費用合計	<u>(509,548)</u>	<u>(77,675)</u>
運用損失	(2,770,351)	(422,312)
財務費用		
受益者への分配	<u>(846,338)</u>	<u>(129,016)</u>
分配後および税引前損失	<u>(3,616,689)</u>	<u>(551,328)</u>
税金		
源泉税	<u>(5,258)</u>	<u>(802)</u>
受益者に帰属する純資産の減少	<u><u>(3,621,947)</u></u>	<u><u>(552,130)</u></u>

マニユライフ・インベストメンツ・トラスト -
US・コア・フィクスト・インカム・ファンド
受益者に帰属する純資産変動計算書（未監査）
2024年1月1日から2024年6月30日までの期間

	2024年1月1日から2024年6月30日 までの期間	
	米ドル	千円
期首現在受益者に帰属する純資産	94,749,522	14,443,617
受益証券の発行	707,839	107,903
分配金再投資	441,280	67,269
受益証券の買戻し	(12,717,287)	(1,938,623)
	<u>(11,568,168)</u>	<u>(1,763,452)</u>
受益者に帰属する純資産の減少	<u>(3,621,947)</u>	<u>(552,130)</u>
期末現在受益者に帰属する純資産	<u>79,559,407</u>	<u>12,128,036</u>

（２）投資有価証券明細表等

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

[次へ](#)

< 参考情報 >

投資サマリー（2024年6月末時点）

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
US TREASURY 4.25% 15/02/2054	2,858,000	95.25002	2,722,246	アメリカ合衆国	3.42
US TREASURY 4.75% 15/11/2043	2,032,000	101.369356	2,059,825	アメリカ合衆国	2.59
US TREASURY 4% 31/01/2031	2,023,000	97.998387	1,982,507	アメリカ合衆国	2.49
US TREASURY 4.375% 15/05/2034	1,861,000	100.04318	1,861,804	アメリカ合衆国	2.34
US TREASURY N/B 2.5% 15/02/2045	2,431,000	71.344717	1,734,390	アメリカ合衆国	2.18
US TREASURY 4.625% 31/05/2031	1,508,000	101.639938	1,532,730	アメリカ合衆国	1.93
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2053	1,216,000	89.649229	1,090,135	アメリカ合衆国	1.37
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	1,945,000	54.400827	1,058,096	アメリカ合衆国	1.33
US TREASURY 4.625% 15/05/2044	1,049,000	99.838262	1,047,303	アメリカ合衆国	1.32
US TREASURY 4.5% 31/05/2029	960,000	100.700709	966,727	アメリカ合衆国	1.22
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	1,036,000	88.769035	919,647	アメリカ合衆国	1.16
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2050	1,800,000	50.568651	910,236	アメリカ合衆国	1.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2053	1,012,000	88.898481	899,653	アメリカ合衆国	1.13
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	986,000	81.4871	803,463	アメリカ合衆国	1.01
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	900,000	84.483165	760,348	アメリカ合衆国	0.96
US TREASURY 4% 15/11/2042	745,000	92.232054	687,129	アメリカ合衆国	0.86
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2053	690,000	93.692785	646,480	アメリカ合衆国	0.81
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	708,000	85.625111	606,226	アメリカ合衆国	0.76
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2049	2,138,000	28.144408	601,727	アメリカ合衆国	0.76
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	845,000	70.0344	591,791	アメリカ合衆国	0.74
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2037	785,000	73.695806	578,512	アメリカ合衆国	0.73
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	620,000	91.806018	569,197	アメリカ合衆国	0.72
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2049	1,350,000	37.725996	509,301	アメリカ合衆国	0.64
US TREASURY 3.375% 15/11/2048	614,000	81.275441	499,031	アメリカ合衆国	0.63
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2052	624,000	79.700295	497,330	アメリカ合衆国	0.63
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	569,000	86.930138	494,632	アメリカ合衆国	0.62
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	601,000	81.788268	491,547	アメリカ合衆国	0.62
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	646,000	71.398176	461,232	アメリカ合衆国	0.58
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2052	660,000	68.80974	454,144	アメリカ合衆国	0.57
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	535,000	84.824759	453,812	アメリカ合衆国	0.57
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2051	801,000	54.881875	439,604	アメリカ合衆国	0.55
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2036	758,000	56.126886	425,442	アメリカ合衆国	0.53
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/04/2045	2,580,000	16.260069	419,510	アメリカ合衆国	0.53
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	491,000	82.76354	406,369	アメリカ合衆国	0.51
US TREASURY 3.375% 15/08/2042	480,000	84.539877	405,791	アメリカ合衆国	0.51
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	478,000	84.364275	403,261	アメリカ合衆国	0.51
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2036	653,000	61.364382	400,709	アメリカ合衆国	0.50
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2052	440,000	88.795565	390,700	アメリカ合衆国	0.49
FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2053	428,000	86.386012	369,732	アメリカ合衆国	0.46
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	414,000	83.685227	346,457	アメリカ合衆国	0.44
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2052	399,000	84.480003	337,075	アメリカ合衆国	0.42
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2037	423,000	75.06494	317,525	アメリカ合衆国	0.40
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2052	403,160	77.552438	312,660	アメリカ合衆国	0.39
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 22/04/2032	341,000	84.24275	287,268	アメリカ合衆国	0.36

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	341,000	83.609058	285,107	アメリカ合衆国	0.36
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2053	316,000	89.800815	283,771	アメリカ合衆国	0.36
BROADCOM INC (REG) 4.75% 15/04/2029	287,000	98.520073	282,753	アメリカ合衆国	0.36
FREDDIE MAC POOL FRN 01/05/2052	353,000	79.919315	282,115	アメリカ合衆国	0.35
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2049	330,000	83.502343	275,558	アメリカ合衆国	0.35
US TREASURY 4.125% 31/03/2031	279,000	98.70188	275,378	アメリカ合衆国	0.35
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2033	1,075,000	25.274542	271,701	アメリカ合衆国	0.34
WARNERMEDIA HOLDINGS INC (SER WI) (REG) 4.279% 15/03/2032	306,000	87.17205	266,746	アメリカ合衆国	0.34
T-MOBILE USA INC (REG) 3.875% 15/04/2030	284,000	93.63665	265,928	アメリカ合衆国	0.33
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2053	279,000	93.352798	260,454	アメリカ合衆国	0.33
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2053	279,000	91.496469	255,275	アメリカ合衆国	0.32
BARCLAYS PLC (REG) VAR 12/03/2030	252,000	100.87075	254,194	イギリス	0.32
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	277,000	89.844242	248,869	アメリカ合衆国	0.31
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2053	265,000	93.60521	248,054	アメリカ合衆国	0.31
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2052	363,000	67.882655	246,414	アメリカ合衆国	0.31
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2050	445,000	54.853087	244,096	アメリカ合衆国	0.31
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	289,000	83.854117	242,338	アメリカ合衆国	0.30
ENERGY TRANSFER OPERATNG (REG) 5.25% 15/04/2029	243,000	99.7231	242,327	アメリカ合衆国	0.30
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2050	399,000	59.464896	237,265	アメリカ合衆国	0.30
FORD MOTOR CREDIT CO LLC (REG) 4% 13/11/2030	253,000	89.5043	226,446	アメリカ合衆国	0.28
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) VAR 02/06/2028	245,000	92.3114	226,163	アメリカ合衆国	0.28
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	270,000	83.249262	224,773	アメリカ合衆国	0.28
VAR ENERGI ASA (SER 144A) 8% 15/11/2032	200,000	111.86625	223,733	ノルウェー	0.28
FREDDIE MAC POOL FRN 01/06/2036	368,000	60.604048	223,023	アメリカ合衆国	0.28
FREDDIE MAC POOL FRN 01/06/2052	265,000	80.861393	214,283	アメリカ合衆国	0.27
AMGEN INC 5.25% 02/03/2030	213,000	100.6	214,278	アメリカ合衆国	0.27
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	261,000	81.566062	212,887	アメリカ合衆国	0.27
CENTENE CORP (REG) 4.625% 15/12/2029	223,000	95.125	212,129	アメリカ合衆国	0.27
EXPEDIA INC SER WI (REG) 3.8% 15/02/2028 W/I	218,000	95.2652	207,678	アメリカ合衆国	0.26
MONROE CAPITAL ABS FUNDING 2021-1 LTD SER 1A CL A2 FRN 22/04/2031	257,000	80.753198	207,536	ケイマン諸島	0.26
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 2.4% 15/10/2028	230,000	88.44575	203,425	アメリカ合衆国	0.26
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 3.244% 05/10/2026	214,000	94.72885	202,720	アメリカ合衆国	0.25
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 4% 22/06/2050 WI	300,000	67.40555	202,217	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2052	230,000	87.874337	202,111	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	234,000	86.356681	202,075	アメリカ合衆国	0.25
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	228,000	88.533111	201,855	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2052	238,000	84.724681	201,645	アメリカ合衆国	0.25
WINGSTOP FUNDING LLC FRN 05/12/2050	224,000	89.634694	200,782	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	217,000	92.368103	200,439	アメリカ合衆国	0.25
BANK OF AMERICA CORP VAR 22/04/2032	237,000	84.26815	199,716	アメリカ合衆国	0.25
FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2054	203,000	97.28625	197,491	アメリカ合衆国	0.25
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (REG) VAR 02/03/2033	225,000	87.02865	195,814	アメリカ合衆国	0.25
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 6.75% 01/11/2029	181,000	106.25	192,313	アメリカ合衆国	0.24
BANK OF AMERICA CORP (REG) VAR 23/07/2029	197,000	96.3908	189,890	アメリカ合衆国	0.24

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 4.2% 15/03/2028	199,000	94.581986	188,218	アメリカ合衆国	0.24
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2051	244,000	75.185101	183,452	アメリカ合衆国	0.23
UNITED AIR 2020-1 A PTT (SER 20-1) 5.875% 15/10/2027	328,000	55.500622	182,042	アメリカ合衆国	0.23
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	634,923	28.667563	182,017	アメリカ合衆国	0.23
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2052	206,000	87.084969	179,395	アメリカ合衆国	0.23
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 2.375% 16/02/2031	226,000	79.375	179,388	アメリカ合衆国	0.23
SAN DIEGO G & E 4.95% 15/08/2028	179,000	99.5111	178,125	アメリカ合衆国	0.22
PNC FINANCIAL SERVICES VAR 12/06/2029	173,000	101.215	175,102	アメリカ合衆国	0.22
FREDDIE MAC POOL FRN 01/06/2052	222,000	78.43721	174,131	アメリカ合衆国	0.22
BANK OF AMERICA CORP (SER MTN) (REG) VAR 14/06/2029	196,000	88.79405	174,036	アメリカ合衆国	0.22
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2047	470,000	36.614209	172,087	アメリカ合衆国	0.22
ATHENE HOLDING LTD 3.5% 15/01/2031	195,000	88.09605	171,787	バミューダ	0.22
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	205,000	83.622995	171,427	アメリカ合衆国	0.22
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	200,000	85.114681	170,229	アメリカ合衆国	0.21
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	198,000	85.137503	168,572	アメリカ合衆国	0.21
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.5% 15/05/2030	174,000	96	167,040	アメリカ合衆国	0.21
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 22/04/2031	193,000	86.39705	166,746	アメリカ合衆国	0.21
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2052	199,000	83.55228	166,269	アメリカ合衆国	0.21
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2052	189,000	86.684436	163,834	アメリカ合衆国	0.21
WELLS FARGO & COMPANY (SER MTN) (REG) VAR 30/10/2030	183,000	88.4722	161,904	アメリカ合衆国	0.20
NEXTERA ENERGY CAPITAL (REG) 2.25% 01/06/2030	189,000	85.4069	161,419	アメリカ合衆国	0.20
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	388,000	41.315599	160,305	アメリカ合衆国	0.20
JPMORGAN CHASE & CO VAR 13/05/2031	182,000	87.57575	159,388	アメリカ合衆国	0.20
DOMINOS PIZZA MASTER ISSUER LL FRN 25/07/2047	175,000	90.805193	158,909	アメリカ合衆国	0.20
WELLS FARGO & COMPANY VAR 23/01/2030	159,000	99.37185	158,001	アメリカ合衆国	0.20
CHENIERE ENERGY PARTNERS (REG) 3.25% 31/01/2032	184,000	85.5	157,320	アメリカ合衆国	0.20
PNC FINANCIAL SERVICES (SER T) VAR PERP 31/12/2049	172,000	90.375	155,445	アメリカ合衆国	0.20
MARVELL TECHNOLOGY INC (REG) 5.95% 15/09/2033	148,000	104.125	154,105	アメリカ合衆国	0.19
TACO BELL FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 25/08/2051	172,000	89.214134	153,448	アメリカ合衆国	0.19
BROADCOM INC (SER 144A) (REG) 3.419% 15/04/2033	178,000	86.036483	153,145	アメリカ合衆国	0.19
ENTERPRISE PRODUCTS OPER (SER E) VAR 16/08/2077	161,000	94.59225	152,294	アメリカ合衆国	0.19
CLI FUNDING VI LLC SER 1A CL A FRN 18/09/2045	272,000	55.811093	151,806	アメリカ合衆国	0.19
DEUTSCHE BANK NY (REG) VAR 07/01/2028	164,000	92.5296	151,749	ドイツ	0.19
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2052	176,000	85.597731	150,652	アメリカ合衆国	0.19
KRAFT HEINZ FOODS CO (REG) 4.375% 01/06/2046	183,000	81.42095	149,000	アメリカ合衆国	0.19
DELL INT LLC / EMC CORP 5.4% 15/04/2034	150,000	98.60575	147,909	アメリカ合衆国	0.19
FN BM1277 FRN 01/05/2047	700,000	21.10719	147,750	アメリカ合衆国	0.19
AMSR 2019-SFR1 TRUST 2.153% 17/06/2038	167,000	87.78958	146,609	アメリカ合衆国	0.18
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2049	571,000	25.614084	146,256	アメリカ合衆国	0.18
NEW ECONOMY ASSETS PHASE 1 SPONSOR LLC SER 1 CL A1 FRN 20/10/2061	164,000	89.16075	146,224	アメリカ合衆国	0.18
JBS USA/FOOD/FINANCE (REG) 5.75% 01/04/2033	146,000	99.875	145,818	アメリカ合衆国	0.18
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	167,000	87.046118	145,367	アメリカ合衆国	0.18
VMWARE INC (REG) 4.7% 15/05/2030	150,000	96.69425	145,041	アメリカ合衆国	0.18

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
VERIZON MASTER TRUST SERIES 2024-5 SER 5X CL A FRN 21/06/2032	145,000	99.668139	144,519	アメリカ合衆国	0.18
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	168,000	86.018255	144,511	アメリカ合衆国	0.18
AMERICAN TOWER CORP 3.8% 15/08/2029	153,000	93.0817	142,415	アメリカ合衆国	0.18
CITIGROUP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST SER GC46 CL A2 FRN 15/01/2053	150,000	93.5342	140,301	アメリカ合衆国	0.18
CNO FINANCIAL GROUP INC (REG) 5.25% 30/05/2029	144,000	97.375	140,220	アメリカ合衆国	0.18
OCCIDENTAL PETROLEUM COR (REG) 6.45% 15/09/2036	134,000	104.625	140,198	アメリカ合衆国	0.18
UNITED AIR 2014-2 A PTT SER A 03/09/2026	275,000	50.805167	139,714	アメリカ合衆国	0.18
MORGAN STANLEY VAR 16/01/2030	139,000	100.00065	139,001	アメリカ合衆国	0.17
JBS USA/FOOD/FINANCE (REG) 3.625% 15/01/2032	160,000	86.625	138,600	アメリカ合衆国	0.17
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	168,000	82.033445	137,816	アメリカ合衆国	0.17
NATIONAL GRID PLC 5.809% 12/06/2033	136,000	101.13255	137,540	イギリス	0.17
FRESENIUS MED CARE III (SER 144A) (REG) 3.75% 15/06/2029	150,000	90.625	135,938	アメリカ合衆国	0.17
AERCAP IRELAND CAP/GLOBA (REG) 3% 29/10/2028	150,000	90.61345	135,920	アイルランド	0.17
INDIANAPOLIS PWR & LIGHT (SER 144A) (REG) 5.65% 01/12/2032	134,000	101.3164	135,764	アメリカ合衆国	0.17
NEIGHBORLY ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 30/04/2051	158,000	85.790835	135,550	アメリカ合衆国	0.17
NETFLIX INC (SER 144A) (REG) 4.875% 15/06/2030	138,000	98.2179	135,541	アメリカ合衆国	0.17
CHARTER COMM OPT LLC/CAP (REG) 6.384% 23/10/2035	139,000	97.40025	135,386	アメリカ合衆国	0.17
VISTRA CORP (SER 144A) (REG) 4.3% 15/07/2029	142,000	94.375	134,013	アメリカ合衆国	0.17
REGENERON PHARMACEUTICAL (REG) 1.75% 15/09/2030	163,000	82.001	133,662	アメリカ合衆国	0.17
BANK OF AMERICA CORP VAR 29/04/2031	154,000	86.4651	133,156	アメリカ合衆国	0.17
FIRSTKEY HOMES 2020-SFR1 TRUST SER SFR1 CL C FRN 17/08/2028	144,000	91.77107	132,150	アメリカ合衆国	0.17
RADIAN GROUP INC 6.2% 15/05/2029	131,000	100.875	132,146	アメリカ合衆国	0.17
MORGAN STANLEY VAR 16/09/2036	167,000	78.7002	131,429	アメリカ合衆国	0.17
BANK OF AMERICA CORP VAR 08/03/2037	150,000	87.40865	131,113	アメリカ合衆国	0.16
CSMC 2021-RPL2TRUST SER RPL2 CL A1A FRN 25/01/2060	278,000	46.96731	130,569	アメリカ合衆国	0.16
BXHPP TRUST FRN 15/08/2036	138,000	93.67598	129,273	アメリカ合衆国	0.16
TEACHERS INSUR & ANNUITY (REG) SER 144A 4.27% 15/05/2047	162,000	79.73625	129,173	アメリカ合衆国	0.16
FORD CREDIT AUTO OWNER TRUST 2023-REV2 SER 2 CL A FRN 15/02/2036	128,000	100.898	129,149	アメリカ合衆国	0.16
UNITED AIR 2023-1 A PTT 5.8% 15/07/2036	127,000	101.4994	128,904	アメリカ合衆国	0.16
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	580,000	22.161203	128,535	アメリカ合衆国	0.16
DATABANK ISSUER SER 2A CL A2 FRN 25/10/2051	141,000	91.04938	128,380	アメリカ合衆国	0.16
VIATRIS INC (SER WI) (REG) 2.7% 22/06/2030 WI	151,000	84.85155	128,126	アメリカ合衆国	0.16
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2054	127,000	98.821129	125,503	アメリカ合衆国	0.16
DISCOVER FINANCIAL SVS (REG) 6.7% 29/11/2032	120,000	104.20835	125,050	アメリカ合衆国	0.16
NRG ENERGY INC (SER 144A) 7% 15/03/2033	118,000	105.6392	124,654	アメリカ合衆国	0.16
FREDDIE MAC POOL FRN 01/02/2052	171,000	72.829918	124,539	アメリカ合衆国	0.16
UNITED AIR 2016-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 07/01/2030	208,000	59.85138	124,491	アメリカ合衆国	0.16
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2045	616,000	20.111901	123,889	アメリカ合衆国	0.16
JPMORGAN CHASE & CO (SER HH) (REG) VAR PERP 31/12/2049	124,000	99	122,760	アメリカ合衆国	0.15
BANK OF AMERICA CORP (REG) FRN 05/03/2029	128,000	95.8105	122,637	アメリカ合衆国	0.15

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
DUKE ENERGY CORP 5.75% 15/09/2033	120,000	101.56575	121,879	アメリカ合衆国	0.15
CONCENTRIX CORP (REG) 6.6% 02/08/2028	120,000	101.5092	121,811	アメリカ合衆国	0.15
OWENS CORNING (REG) 3.95% 15/08/2029	129,000	94.23765	121,567	アメリカ合衆国	0.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.75% 24/05/2031	143,000	84.7032	121,126	アメリカ合衆国	0.15
AMGEN INC 5.25% 02/03/2033	121,000	99.9137	120,896	アメリカ合衆国	0.15
N/A SER 1A CL A2 FRN 01/02/2062	130,000	92.95353	120,840	カナダ	0.15
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2052	165,000	73.073143	120,571	アメリカ合衆国	0.15
DELTA AIR LINES/SKYMILES (SER 144A) (REG) 4.75% 20/10/2028	123,102	97.4199	119,926	アメリカ合衆国	0.15
HOTWIRE FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/05/2053	120,000	98.57302	118,288	アメリカ合衆国	0.15
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2047	400,000	29.571773	118,287	アメリカ合衆国	0.15
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	137,000	86.189567	118,080	アメリカ合衆国	0.15
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2052	144,612	81.649183	118,075	アメリカ合衆国	0.15
SCF EQUIPMENT LEASING 2021-1 LLC SER 1A CL B FRN 20/08/2029	122,000	96.73846	118,021	アメリカ合衆国	0.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC (REG) 2.3% 15/11/2030	139,000	84.10615	116,908	アメリカ合衆国	0.15
COSTAR GROUP INC (SER 144A) 2.8% 15/07/2030	138,000	84.5825	116,724	アメリカ合衆国	0.15
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2052	136,000	85.623837	116,448	アメリカ合衆国	0.15
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2052	136,000	85.525958	116,315	アメリカ合衆国	0.15
BX TRUST 2022-CLS SER CLS CL A FRN 13/10/2027	117,000	99.08038	115,924	アメリカ合衆国	0.15
AMERISOURCEBERGEN CORP 2.8% 15/05/2030	130,000	88.04305	114,456	アメリカ合衆国	0.14
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2019-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	137,000	83.360462	114,204	ケイマン諸島	0.14
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (REG) 4% 15/01/2029 WI	125,000	91.31425	114,143	アメリカ合衆国	0.14
DIAMOND INFRASTRUCTURE FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 15/04/2049	126,000	90.27582	113,748	アメリカ合衆国	0.14
VANTAGE DATA CENTERS LLC SER 2A CL A2 FRN 15/09/2045	130,000	87.44087	113,673	アメリカ合衆国	0.14
ENBRIDGE INC (REG) VAR 01/03/2078	118,000	96.125	113,428	カナダ	0.14
CHARLES SCHWAB CORP VAR 17/11/2029	109,000	103.9347	113,289	アメリカ合衆国	0.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2050	180,000	62.841013	113,114	アメリカ合衆国	0.14
MARYLAND HLTH & HGR EDUCTNL 3.197% 01/07/2050	160,000	70.578	112,925	アメリカ合衆国	0.14
STARWOOD MORTGAGE RESIDENTIAL TRUST 2022-1 SER 1 CL A1 FRN 25/12/2066	172,000	65.650601	112,919	アメリカ合衆国	0.14
SESAC FINANCE LLC SER 1 CL A2 FRN 25/07/2049	121,000	92.934062	112,450	アメリカ合衆国	0.14
FIFTH THIRD BANCORP (REG) VAR 27/07/2029	109,000	102.5832	111,816	アメリカ合衆国	0.14
DUKE ENERGY CAROLINAS (REG) 4.95% 15/01/2033	113,000	98.6753	111,503	アメリカ合衆国	0.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2050	470,000	23.720678	111,487	アメリカ合衆国	0.14
ENBRIDGE INC (SER 20-A) (REG) VAR 15/07/2079	120,000	92.69055	111,229	カナダ	0.14
PNC FINANCIAL SERVICES VAR 18/08/2034	108,000	102.31385	110,499	アメリカ合衆国	0.14
SLG OFFICE TRUST 2021-OVA SER OVA CL C FRN 15/07/2041	136,000	80.48258	109,456	アメリカ合衆国	0.14
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	128,000	85.218568	109,080	アメリカ合衆国	0.14
ALLY FINANCIAL INC (REG) VAR 13/06/2029	105,000	103.8425	109,035	アメリカ合衆国	0.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	130,000	83.731529	108,851	アメリカ合衆国	0.14
FORD MOTOR COMPANY (REG) 3.25% 12/02/2032	131,000	82.92505	108,632	アメリカ合衆国	0.14
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2050	131,000	82.142715	107,607	アメリカ合衆国	0.14

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
ORACLE CORP (REG) 2.95% 01/04/2030	121,000	88.8286	107,483	アメリカ合衆国	0.14
TRUIST FINANCIAL CORP (SER MTN) VAR 24/01/2030	108,000	99.5044	107,465	アメリカ合衆国	0.14
US BANCORP VAR 12/06/2034	105,000	101.1775	106,236	アメリカ合衆国	0.13
ABPCI DIRECT LENDING FUND ABS I LTD SER 1A CL A FRN 20/12/2030	130,000	81.70657	106,219	アメリカ合衆国	0.13
FREDDIE MAC FRN 01/12/2049	270,000	39.112346	105,603	アメリカ合衆国	0.13
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 5.327% 06/02/2029	104,000	100.75	104,780	アメリカ合衆国	0.13
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2052	119,000	86.942923	103,462	アメリカ合衆国	0.13
JPMORGAN CHASE & CO VAR 23/01/2030	104,000	99.184	103,151	アメリカ合衆国	0.13
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/10/2051	121,000	84.85238	102,671	アメリカ合衆国	0.13
CHARLES SCHWAB CORP VAR 19/05/2029	101,000	101.48815	102,503	アメリカ合衆国	0.13
BEACON CONTAINER FINANCE II LLC SER 1A CL A 22/10/2046	157,000	65.260369	102,459	アメリカ合衆国	0.13
SEMPRA ENERGY 5.5% 01/08/2033	102,000	100.43315	102,442	アメリカ合衆国	0.13
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2037	134,000	75.745369	101,499	アメリカ合衆国	0.13
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2052	116,000	87.239147	101,197	アメリカ合衆国	0.13
NATIONAL RURAL UTIL COOP (SER GMTN) 4.85% 07/02/2029	101,000	99.5857	100,582	アメリカ合衆国	0.13
AMER AIRLINE 16-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/01/2028	166,000	60.486344	100,407	アメリカ合衆国	0.13
AMER AIRLINE 19-1AA PTT (SER AA) (REG) 3.15% 15/08/2033	144,000	69.563848	100,172	アメリカ合衆国	0.13
SUNOCO LOGISTICS PARTNER (REG) 5.4% 01/10/2047	113,000	88.30155	99,781	アメリカ合衆国	0.13
FREEMPORT-MCMORAN INC (REG) 4.25% 01/03/2030	105,000	94.875	99,619	アメリカ合衆国	0.13
FREEMPORT-MCMORAN INC (REG) 5.45% 15/03/2043	105,000	94.75	99,488	アメリカ合衆国	0.13
METLIFE INC (REG) 6.4% 15/12/2036	99,000	100.26955	99,267	アメリカ合衆国	0.12
CITIGROUP INC VAR 01/05/2032	119,000	83.077914	98,863	アメリカ合衆国	0.12
PFIZER INVESTMENT ENTER 4.75% 19/05/2033	101,000	97.41155	98,386	シンガポール	0.12
WELLS FARGO & COMPANY SER U (REG) VAR PERP 29/12/2049	98,000	100.25	98,245	アメリカ合衆国	0.12
FREDDIE MAC FRN 01/12/2046	385,000	25.477148	98,087	アメリカ合衆国	0.12
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2051	122,000	80.345688	98,022	アメリカ合衆国	0.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC VAR 21/10/2032	117,000	83.0942	97,220	アメリカ合衆国	0.12
CITIGROUP INC VAR 25/05/2034	95,000	101.72356	96,637	アメリカ合衆国	0.12
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2050	400,000	24.131255	96,525	アメリカ合衆国	0.12
BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030	98,000	98.4282	96,460	アメリカ合衆国	0.12
PROGRESS RESIDENTIAL TRUST FRN 17/09/2038	105,000	91.30209	95,867	アメリカ合衆国	0.12
NISOURCE INC (REG) 3.6% 01/05/2030	103,000	92.14525	94,910	アメリカ合衆国	0.12
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2I FRN 25/04/2051	110,000	86.271437	94,899	アメリカ合衆国	0.12
DATABANK ISSUER SER 1A CL A2 FRN 27/02/2051	102,000	92.74795	94,603	アメリカ合衆国	0.12
PROLOGIS LP 5.125% 15/01/2034	95,000	99.421	94,450	アメリカ合衆国	0.12
TRUIST FINANCIAL CORP (SER MTN) VAR 08/06/2034	94,000	100.47195	94,444	アメリカ合衆国	0.12
EVERSOURCE ENERGY (REG) 5.125% 15/05/2033	98,000	96.05715	94,136	アメリカ合衆国	0.12
UNIVERSAL HEALTH SVCS (SER WI) (REG) 2.65% 15/10/2030	110,000	85.5	94,050	アメリカ合衆国	0.12
JEFFERIES FIN GROUP INC (REG) 5.875% 21/07/2028	93,000	101.0642	93,990	アメリカ合衆国	0.12

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
CYRUSONE DATA CENTERS ISSUER I LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2048	100,000	93.96736	93,967	アメリカ合衆国	0.12
ARES CAPITAL CORP (REG) 2.875% 15/06/2028	105,000	88.28035	92,694	アメリカ合衆国	0.12
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 2A CL A2 FRN 20/01/2051	105,000	87.943592	92,341	アメリカ合衆国	0.12
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2053	100,000	92.268597	92,269	アメリカ合衆国	0.12
WENDY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2I FRN 15/06/2051	109,000	84.442688	92,043	アメリカ合衆国	0.12
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 2.45% 02/12/2027	102,000	90.19795	92,002	アメリカ合衆国	0.12
ONEOK INC 6.05% 01/09/2033	89,000	102.90145	91,582	アメリカ合衆国	0.12
SBL HOLDINGS INC (SER 144A) 5% 18/02/2031	104,000	88.0431	91,565	アメリカ合衆国	0.12
TARGA RESOURCES PARTNERS 6.15% 01/03/2029	88,000	103.39425	90,987	アメリカ合衆国	0.11
ONEOK INC 6.625% 01/09/2053	85,000	106.8017	90,781	アメリカ合衆国	0.11
CF HIPPOLYTA LLC SER 1 CL A1 FRN 15/07/2060	106,000	85.360333	90,482	アメリカ合衆国	0.11
CF HIPPOLYTA LLC SER 1A CL A1 FRN 15/03/2061	104,000	86.458178	89,917	アメリカ合衆国	0.11
AUTONATION INC 4.75% 01/06/2030	94,000	95.58715	89,852	アメリカ合衆国	0.11
FORD MOTOR COMPANY (REG) 6.1% 19/08/2032	90,000	99.61475	89,653	アメリカ合衆国	0.11
REGIONS FINANCIAL CORP (REG) VAR 06/06/2030	89,000	100.1839	89,164	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/09/2047	415,000	21.484376	89,160	アメリカ合衆国	0.11
AMER AIRLINE 16-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/07/2029	148,000	60.217727	89,122	アメリカ合衆国	0.11
SONIC CAPITAL LLC SER 1A CL A2I FRN 20/08/2051	104,000	85.409092	88,825	アメリカ合衆国	0.11
NEXTERA ENERGY CAPITAL VAR 01/09/2054	88,000	100.625	88,550	アメリカ合衆国	0.11
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) VAR 06/01/2028	96,000	92.22515	88,536	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2051	130,000	68.063648	88,483	アメリカ合衆国	0.11
NEW RESIDENTIAL MORTGAGE LOAN TRUST SER 1A CL A1B FRN 25/10/2059	250,000	35.203321	88,008	アメリカ合衆国	0.11
DELL INT LLC / EMC CORP (REG) 5.3% 01/10/2029	87,000	100.68955	87,600	アメリカ合衆国	0.11
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/03/2046	136,000	63.861709	86,852	アメリカ合衆国	0.11
HOTWIRE FUNDING LLC SER 2021-1 CL A 2 20/11/2051	94,000	92.30447	86,766	アメリカ合衆国	0.11
TARGA RESOURCES PARTNERS (REG) 4% 15/01/2032	96,000	90.125	86,520	アメリカ合衆国	0.11
T-MOBILE USA INC 3.375% 15/04/2029	93,000	92.44855	85,977	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC POOL FRN 01/01/2050	320,000	26.625666	85,202	アメリカ合衆国	0.11
AIR LEASE CORP 3.625% 01/12/2027	90,000	94.5001	85,050	アメリカ合衆国	0.11
AMER AIRLINE 17-1 AA PTT SER (AA) (REG) FRN 15/08/2030	137,000	61.989793	84,926	アメリカ合衆国	0.11
METRONET INFRASTRUCTURE ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2053	83,000	102.17054	84,802	アメリカ合衆国	0.11
NATIONAL RURAL UTIL COOP (SER MTN) (REG) 5.6% 13/11/2026	84,000	100.944	84,793	アメリカ合衆国	0.11
AMER AIRLINE 19-1A PTT (SER A) (REG) 3.5% 15/08/2033	123,000	68.903851	84,752	アメリカ合衆国	0.11
ENACT HOLDINGS INC 6.25% 28/05/2029	85,000	99.6844	84,732	アメリカ合衆国	0.11
AMERICAN TOWER TRUST I 5.49% 15/03/2028	84,000	100.50381	84,423	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2053	96,000	87.390199	83,895	アメリカ合衆国	0.11
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 3 CL IO FRN	1,880,000	4.459409	83,837	アメリカ合衆国	0.11
FREDDIE MAC POOL FRN 01/06/2053	90,000	92.9523	83,657	アメリカ合衆国	0.11
LAZARD GROUP LLC (REG) 4.375% 11/03/2029	87,000	95.5874	83,161	アメリカ合衆国	0.10

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
DIAMONDBACK ENERGY INC 5.75% 18/04/2054	86,000	96.568	83,048	アメリカ合衆国	0.10
PROVIDENT FUNDING MORTGAGE TRUST 2020-F1 SER F1 CL A2 FRN 25/01/2036	207,000	40.103173	83,014	アメリカ合衆国	0.10
FOOTHILL ESTRN TRANSPRTN CORRI 4.094% 15/01/2049	99,000	83.737	82,900	アメリカ合衆国	0.10
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2050	305,000	27.128041	82,741	アメリカ合衆国	0.10
CSMC 2021-NQM6 SER NQM6 CL A1 FRN 25/07/2066	161,000	51.019516	82,141	アメリカ合衆国	0.10
FREDDIE MAC GOLD POOL FRN 01/11/2046	315,000	25.933458	81,690	アメリカ合衆国	0.10
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP SER R VAR PERP	81,000	100.75	81,608	アメリカ合衆国	0.10
REGAL REXNORD CORP (SER WI) (REG) 6.4% 15/04/2033	79,000	102.789	81,203	アメリカ合衆国	0.10
ARES CAPITAL CORP 2.15% 15/07/2026	88,000	92.23165	81,164	アメリカ合衆国	0.10
TIF FUNDING II LLC SER 1A CL A FRN 20/02/2046	126,000	63.320997	79,784	アメリカ合衆国	0.10
AMERICAN TOWER CORP 5.2% 15/02/2029	80,000	99.72525	79,780	アメリカ合衆国	0.10
SOUTHERN CO 5.7% 15/03/2034	78,000	101.52485	79,189	アメリカ合衆国	0.10
VERUS SECURITIZATION TRUST SER 3 CL A1 FRN 25/06/2066	207,000	38.216453	79,108	アメリカ合衆国	0.10
KINDER MORGAN ENER PART (REG) 7.75% 15/03/2032	69,000	114.17	78,777	アメリカ合衆国	0.10
NMI HOLDINGS (REG) 6% 15/08/2029	79,000	99.5	78,605	アメリカ合衆国	0.10
CVS HEALTH CORP (REG) 5.05% 25/03/2048	91,000	86.29015	78,524	アメリカ合衆国	0.10
GCAT SER NQM3 CL A1 FRN 25/05/2066	194,000	40.081248	77,758	アメリカ合衆国	0.10
BENCHMARK 2018-B1 MORTGAGE TRUST SER B12 CL A2 FRN 15/08/2052	93,000	83.544109	77,696	アメリカ合衆国	0.10
CVS HEALTH CORP 3.75% 01/04/2030	85,000	91.29375	77,600	アメリカ合衆国	0.10
COMM 2020-CX MORTGAGE TRUST SER CX CL D FRN 10/11/2046	100,000	77.49333	77,493	アメリカ合衆国	0.10
UNIV OF CALIFORNIA CA RGTS MED 3.006% 15/05/2050	115,000	67.297	77,392	アメリカ合衆国	0.10
ONSLow BAY MORTGAGE LOAN TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2061	170,000	45.0821	76,640	アメリカ合衆国	0.10
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.625% 01/12/2029	80,000	94.75	75,800	アメリカ合衆国	0.10
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2052	81,000	93.275554	75,553	アメリカ合衆国	0.09
MPLX LP 4.95% 01/09/2032	79,000	95.15045	75,169	アメリカ合衆国	0.09
GOLDEN ST TOBACCO SECURITIZATI 4.214% 01/06/2050	101,000	74.4162	75,160	アメリカ合衆国	0.09
TRICON AMERICAN HOMES 2020-SFR2 TRUST SER SFR2 CL A FRN 17/11/2039	103,000	72.884209	75,071	アメリカ合衆国	0.09
M&T BANK CORPORATION SER F (REG) VAR PERP	79,000	94.5	74,655	アメリカ合衆国	0.09
WESTERN MIDSTREAM OPERAT (REG) 5.3% 01/02/2030	80,000	92.90915	74,327	アメリカ合衆国	0.09
VR FUNDING LLC FRN 15/11/2050	141,000	52.656398	74,246	アメリカ合衆国	0.09
AMER AIRLINE 21-1A EETC (REG) 2.875% 11/07/2034	87,000	85.22005	74,141	アメリカ合衆国	0.09
JETBLUE 2019-1 CLASS AA (SER AA) (REG) 2.75% 15/05/2032	108,000	68.457757	73,934	アメリカ合衆国	0.09
HUNTINGTON BANCSHARES VAR 21/08/2029	72,000	102.4233	73,745	アメリカ合衆国	0.09
NRG ENERGY INC (SER 144A) (REG) 4.45% 15/06/2029	77,000	95.125	73,246	アメリカ合衆国	0.09
SERVPRO MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 25/04/2051	85,000	85.654472	72,806	アメリカ合衆国	0.09
ENERGY TRANSFER LP (REG) 4.2% 15/04/2027	75,000	96.87245	72,654	アメリカ合衆国	0.09
CLI FUNDING LLC SER 1A CL A FRN 18/02/2046	125,000	57.735469	72,169	アメリカ合衆国	0.09
CITIZENS FINANCIAL GROUP (REG) 3.25% 30/04/2030	82,000	87.8739	72,057	アメリカ合衆国	0.09
JEFFERIES FIN GROUP INC (REG) 6.2% 14/04/2034	71,000	101.3452	71,955	アメリカ合衆国	0.09
MORGAN STANLEY (SER GMTN) (REG) VAR 21/07/2032	88,000	81.3777	71,612	アメリカ合衆国	0.09

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
GEORGIA POWER CO 4.95% 17/05/2033	73,000	97.9817	71,527	アメリカ合衆国	0.09
N/A SER INV1 CL A1 FRN 25/06/2026	134,000	52.782433	70,728	アメリカ合衆国	0.09
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 53 CL IO FRN	1,413,000	5.002908	70,691	アメリカ合衆国	0.09
BBCMS TRUST SER C6 CL A2 FRN 15/02/2053	74,000	95.49841	70,669	アメリカ合衆国	0.09
MPLX LP (SER W1) (REG) 4.25% 01/12/2027	73,000	96.56755	70,494	アメリカ合衆国	0.09
MPLX LP 5% 01/03/2033	74,000	95.09675	70,372	アメリカ合衆国	0.09
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 2.703% 15/04/2032	85,000	82.75835	70,345	アメリカ合衆国	0.09
TRITON CONTAINER FINANCE VIII LLC SER 1A CL A FRN 20/09/2045	115,000	61.074941	70,236	アメリカ合衆国	0.09
TRUIST FINANCIAL CORP (SER MTN) VAR 30/10/2029	66,000	106.3463	70,189	アメリカ合衆国	0.09
CONTINENTAL RESOURCES (REG) 4.9% 01/06/2044	84,000	82.75	69,510	アメリカ合衆国	0.09
KRAFT FOODS GROUP INC (REG) 5% 04/06/2042	76,000	90.71955	68,947	アメリカ合衆国	0.09
ELLINGTON FINANCIAL MORTGAGE TRUST 2017-1 SER 2 CL A1 FRN 25/06/2066	153,000	45.031972	68,899	アメリカ合衆国	0.09
DOMINION ENERGY INC (SER C) 3.375% 01/04/2030	76,000	90.29515	68,624	アメリカ合衆国	0.09
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2049	100,000	68.43199	68,432	アメリカ合衆国	0.09
TARGA RESOURCES CORP (REG) 4.95% 15/04/2052	80,000	85.2201	68,176	アメリカ合衆国	0.09
FREDDIE MAC POOL FRN 01/04/2053	74,000	90.313596	66,832	アメリカ合衆国	0.08
VERUS SECURITIZATION TRUST 2021-5 SER 5 CL A1 FRN 25/09/2066	129,000	51.652419	66,632	アメリカ合衆国	0.08
AUTODESK INC (REG) 2.85% 15/01/2030	74,000	89.13015	65,956	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2052	76,000	85.558183	65,024	アメリカ合衆国	0.08
ENBRIDGE INC VAR 15/01/2084	61,000	106.36145	64,880	カナダ	0.08
DOMINO'S PIZZA MASTER ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 25/10/2049	73,000	87.523171	63,892	アメリカ合衆国	0.08
ARES CAPITAL CORP (REG) 5.875% 01/03/2029	64,000	98.4069	62,980	アメリカ合衆国	0.08
THERMO FISHER SCIENTIFIC (REG) 4.977% 10/08/2030	62,000	100.0949	62,059	アメリカ合衆国	0.08
FREDDIE MAC POOL FRN 01/11/2037	80,000	77.446382	61,957	アメリカ合衆国	0.08
CONSTELLATION EN GEN LLC 6.5% 01/10/2053	58,000	106.40585	61,715	アメリカ合衆国	0.08
CITIZENS FINANCIAL GROUP (REG) VAR 25/04/2035	59,000	104.5804	61,702	アメリカ合衆国	0.08
MICRON TECHNOLOGY INC (REG) 5.3% 15/01/2031	62,000	99.4613	61,666	アメリカ合衆国	0.08
COLUMBIA PIPELINES OPCO (SER 144A) 6.036% 15/11/2033	60,000	102.76465	61,659	アメリカ合衆国	0.08
CITIGROUP INC VAR 13/02/2030	62,000	99.246	61,533	アメリカ合衆国	0.08
ARROYO MORTGAGE TRUST 2021-1R SER 1R CL A1 FRN 25/10/2048	171,000	35.982543	61,530	アメリカ合衆国	0.08
DOMINION ENERGY INC (SER A) VAR 01/02/2055	60,000	102.2382	61,343	アメリカ合衆国	0.08
US BANCORP VAR 23/01/2030	61,000	100.37525	61,229	アメリカ合衆国	0.08
JPMORGAN CHASE & CO VAR 22/04/2030	60,000	101.86225	61,117	アメリカ合衆国	0.08
PILGRIM'S PRIDE CORP (REG) 6.25% 01/07/2033	60,000	101.625	60,975	アメリカ合衆国	0.08
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2054	62,000	97.662	60,550	アメリカ合衆国	0.08
FREDDIE MAC POOL FRN 01/07/2052	69,000	86.574411	59,736	アメリカ合衆国	0.08
COMERICA INC VAR 30/01/2030	60,000	98.37295	59,024	アメリカ合衆国	0.07
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 11 CL IO FRN	1,123,000	5.25335	58,995	アメリカ合衆国	0.07
SEMPRA (REG) VAR 01/10/2054	60,000	98.21085	58,927	アメリカ合衆国	0.07
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2052	65,000	90.569199	58,870	アメリカ合衆国	0.07

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
PNC FINANCIAL SERVICES (SER W) VAR PERP 31/12/2049	60,000	97.365561	58,419	アメリカ合衆国	0.07
GENERAL MOTORS FINL CO (REG) 5.6% 18/06/2031	58,000	99.43495	57,672	アメリカ合衆国	0.07
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	175,000	32.950253	57,663	アメリカ合衆国	0.07
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 4% 15/01/2030	63,000	91.51615	57,655	アメリカ合衆国	0.07
BENCHMARK 2019-B13 MORTGAGE TRUST SER B13 CL A2 FRN 15/08/2057	65,000	88.372671	57,442	アメリカ合衆国	0.07
CSMC 2021-NQM3 SER NQM3 CL A1 FRN 25/04/2066	147,000	38.809966	57,051	アメリカ合衆国	0.07
GLP CAPITAL LP / FIN II (REG) 3.25% 15/01/2032	68,000	83.60245	56,850	アメリカ合衆国	0.07
VCP RRL ABS I LTD 2021 SER 1A CL A FRN 20/10/2031	100,000	55.976344	55,976	アメリカ合衆国	0.07
MORGAN STANLEY (REG) VAR 20/04/2029	56,000	99.8253	55,902	アメリカ合衆国	0.07
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES SER NQM5 CL A1 FRN	119,000	46.930669	55,848	アメリカ合衆国	0.07
TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2019-1 SER 1 CL A1 FRN 25/03/2058	183,000	30.419462	55,668	アメリカ合衆国	0.07
AMERICAN HOMES 4 RENT (REG) 4.25% 15/02/2028	58,000	95.9585	55,656	アメリカ合衆国	0.07
OCCIDENTAL PETROLEUM COR (REG) 6.625% 01/09/2030	53,000	105	55,650	アメリカ合衆国	0.07
NEIGHBORLY ISSUER 2022-1 SER 1A CL A2 FRN 30/01/2052	64,000	86.77939	55,539	アメリカ合衆国	0.07
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	62,000	89.307913	55,371	アメリカ合衆国	0.07
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2047	165,000	33.545276	55,350	アメリカ合衆国	0.07
HUNTINGTON INGALLS INDUS (SER WI) (REG) 4.2% 01/05/2030 (WHEN ISSUED)	59,000	93.64085	55,248	アメリカ合衆国	0.07
TAPESTRY INC 7.7% 27/11/2030	53,000	104.1799	55,215	アメリカ合衆国	0.07
QORVO INC (SER 144A) (REG) 3.375% 01/04/2031	64,000	85.75	54,880	アメリカ合衆国	0.07
BANK OF NY MELLON CORP VAR 14/03/2030	55,000	98.8442	54,364	アメリカ合衆国	0.07
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO VAR 01/12/2062	1,090,000	4.925952	53,693	アメリカ合衆国	0.07
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	143,000	37.470867	53,583	アメリカ合衆国	0.07
FANNIE MAE POOL FRN 01/08/2053	57,000	93.812673	53,473	アメリカ合衆国	0.07
BRITISH AIR 20-1 B PTT (SER 144A) (REG) 8.375% 15/11/2028	141,000	37.74244	53,217	アメリカ合衆国	0.07
GOLUB CAPITAL PARTNERS ABS FUNDING 2020-1 LTD SER 1A CL A2 FRN	100,000	52.148125	52,148	アメリカ合衆国	0.07
ZAXBY'S FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 30/07/2051	60,000	86.461833	51,877	アメリカ合衆国	0.07
FLORIDA ST BRD OF ADMIN FIN CO 1.705% 01/07/2027	57,000	90.903	51,815	アメリカ合衆国	0.07
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 17 CL IO FRN 31/12/2064	900,000	5.754846	51,794	アメリカ合衆国	0.07
COREBRIDGE FINANCIAL INC (REG) VAR 15/12/2052	51,000	101.108982	51,566	アメリカ合衆国	0.06
BX 2021-MFM1 SER MFM1 CL D FRN 15/01/2034	68,000	75.525693	51,357	アメリカ合衆国	0.06
ENERGY TRANSFER LP (REG) 5.25% 01/07/2029	51,000	99.36265	50,675	アメリカ合衆国	0.06
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2021-A SER A CL A FRN	169,000	29.676289	50,153	アメリカ合衆国	0.06
SMB PRIVATE EDUCATION LOAN TRUST SER A CL APT2 FRN 15/01/2053	131,000	37.993082	49,771	アメリカ合衆国	0.06
GCAT 2021-NQM2 TRUST SER NQM2 CL A1 FRN 25/05/2066	117,000	42.350768	49,550	アメリカ合衆国	0.06
STARVEST EMERGING MARKETS CBO I SER 2 CL A1 FRN 25/05/2065	209,000	23.650804	49,430	アメリカ合衆国	0.06
QORVO INC (REG) 4.375% 15/10/2029	52,000	94.5	49,140	アメリカ合衆国	0.06
ATLASSIAN CORPORATION (REG) 5.25% 15/05/2029	49,000	99.7124	48,859	アメリカ合衆国	0.06
ONEOK INC (REG) 5.65% 01/11/2028	48,000	101.62745	48,781	アメリカ合衆国	0.06

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
SABINE PASS LIQUEFACTION (REG) 4.2% 15/03/2028	50,000	96.5	48,250	アメリカ合衆国	0.06
AMER AIRLINE 17-2 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/04/2031	79,000	61.008239	48,197	アメリカ合衆国	0.06
SBA TOWER TRUST (SER 144A) (REG) 6.559% 15/11/2052	47,000	102.37056	48,114	アメリカ合衆国	0.06
ENERGY TRANSFER PARTNERS (REG) 5.15% 15/03/2045	55,000	86.9376	47,816	アメリカ合衆国	0.06
LAZARD GROUP LLC (REG) 6% 15/03/2031	47,000	101.4716	47,692	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 169 CL IO FRN	3,835,000	1.20908	46,368	アメリカ合衆国	0.06
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2052	63,000	72.736707	45,824	アメリカ合衆国	0.06
CNA FINANCIAL CORP (REG) 2.05% 15/08/2030	55,000	83.199	45,759	アメリカ合衆国	0.06
HYUNDAI CAPITAL AMERICA (SER 144A) (REG) 2.375% 15/10/2027	50,000	91.097	45,549	アメリカ合衆国	0.06
TAPESTRY INC 7.85% 27/11/2033	43,000	105.41465	45,328	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 170 CL IO FRN	940,000	4.780473	44,936	アメリカ合衆国	0.06
ROYALTY PHARMA PLC (SER WI) (REG) 1.75% 02/09/2027	50,000	89.85545	44,928	イギリス	0.06
IMPERIAL FUND MORTGAGE TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/06/2056	115,000	39.011756	44,864	アメリカ合衆国	0.06
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 163 CL IO FRN	884,994	5.063695	44,813	アメリカ合衆国	0.06
NAVIENT STUDENT LOAN TRUST 2020-2 SER 2A CL A1A FRN 26/08/2069	100,000	44.74612	44,746	アメリカ合衆国	0.06
JPMORGAN CHASE & CO (REG) VAR 05/12/2029	46,000	96.996	44,618	アメリカ合衆国	0.06
WILLIAMS COMPANIES INC (REG) 4.65% 15/08/2032	46,000	95.49865	43,929	アメリカ合衆国	0.06
CNO FINANCIAL GROUP INC (REG) 6.45% 15/06/2034	43,000	100.28735	43,124	アメリカ合衆国	0.05
OVINTIV INC 6.25% 15/07/2033	41,000	102.7896	42,144	アメリカ合衆国	0.05
GCAT 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/01/2066	178,000	23.580099	41,973	アメリカ合衆国	0.05
AMERICAN ELECTRIC POWER (REG) 5.625% 01/03/2033	42,000	99.58915	41,827	アメリカ合衆国	0.05
UNITED AIR 2019-1 A PTT SER A (REG) 4.55% 25/08/2031	66,000	63.310239	41,785	アメリカ合衆国	0.05
VERUS SECURITIZATION TRUST SER R2 CL A1 FRN 25/02/2064	172,000	24.162023	41,559	アメリカ合衆国	0.05
OVINTIV INC (REG) 5.65% 15/05/2028	41,000	101.0552	41,433	アメリカ合衆国	0.05
NAVIENT PRIVATE EDUCATION REFI LOAN TRUST 2020-G SER GA CL A FRN	200,000	20.572632	41,145	アメリカ合衆国	0.05
F&G ANNUITIES & LIFE INC 6.5% 04/06/2029	41,000	100.1479	41,061	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 110 CL IO FRN	712,000	5.624531	40,047	アメリカ合衆国	0.05
COLUMBIA PIPELINES OPCO (SER 144A) 5.927% 15/08/2030	39,000	102.56365	40,000	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/04/2048	175,000	22.719518	39,759	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	82,000	48.090553	39,434	アメリカ合衆国	0.05
CHENIERE ENERGY PARTNERS (REG) 4.5% 01/10/2029	41,000	95.5	39,155	アメリカ合衆国	0.05
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 10 CL IO FRN	735,000	5.320953	39,109	アメリカ合衆国	0.05
VICI PROPERTIES LP 5.125% 15/05/2032	41,000	95.21165	39,037	アメリカ合衆国	0.05
BRAVO RESIDENTIAL FUNDING TRUST 2021-NQM1 SER NQM1 CL A1 FRN	136,000	28.688697	39,017	アメリカ合衆国	0.05
AQUA FINANCE TRUST 2017-A SER A CL A FRN 17/07/2046	106,000	36.687456	38,889	アメリカ合衆国	0.05
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2021-2 SER 2 CL A1 FRN 25/04/2066	124,000	31.16926	38,650	アメリカ合衆国	0.05

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
TD SYNEX CORP (REG) 2.65% 09/08/2031	47,000	82.16235	38,616	アメリカ合衆国	0.05
DUKE ENERGY CORP (REG) 2.45% 01/06/2030	44,000	87.6983	38,587	アメリカ合衆国	0.05
DRIVEN BRANDS FUNDING LLC SER 1A CL A2 FRN 20/04/2048	41,000	93.44993	38,314	アメリカ合衆国	0.05
TD SYNEX CORP 6.1% 12/04/2034	38,000	100.0497	38,019	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	78,000	48.15108	37,558	アメリカ合衆国	0.05
AMER AIRLINE 17-1 A PTT SER (A) (REG) FRN 15/08/2030	61,000	61.186545	37,324	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/05/2052	45,000	82.744114	37,235	アメリカ合衆国	0.05
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	195,000	18.882598	36,821	アメリカ合衆国	0.05
MFA 2021-NQM1 TRUST SER NQM1 CL A1 FRN 25/04/2065	179,000	20.397278	36,511	アメリカ合衆国	0.05
VICI PROPERTIES / NOTE (SER 144A) (REG) 4.125% 15/08/2030	40,000	91.125	36,450	アメリカ合衆国	0.05
FREDDIE MAC POOL FRN 01/09/2053	37,000	96.626268	35,752	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 118 CL IO FRN	1,163,000	3.073915	35,750	アメリカ合衆国	0.04
CONSTELLATION EN GEN LLC 6.125% 15/01/2034	34,000	104.7207	35,605	アメリカ合衆国	0.04
CHENIERE ENERGY PARTNERS (REG) 5.95% 30/06/2033	35,000	101.4375	35,503	アメリカ合衆国	0.04
NISOURCE INC 1.7% 15/02/2031	44,000	80.1185	35,252	アメリカ合衆国	0.04
AMERICAN AIRLINES 14-1 A PTT SER A 3.7% 01/10/2026	73,000	48.221223	35,201	アメリカ合衆国	0.04
BRE GRAND ISLANDER TIMESHARE ISSUER 2019-A LLC SER A CL A FRN 26/09/2033	149,000	23.598807	35,162	アメリカ合衆国	0.04
BRUNSWICK CORP (REG) 5.85% 18/03/2029	35,000	100.203	35,071	アメリカ合衆国	0.04
BRITISH AIR 20-1 A PPT (SER 144A) (REG) 4.25% 15/11/2032	77,000	45.2511	34,843	アメリカ合衆国	0.04
MISSISSIPPI ST HOSP EQUIPMENT 3.72% 01/09/2026	36,000	96.186	34,627	アメリカ合衆国	0.04
FREDDIE MAC POOL FRN 01/12/2049	94,000	36.727701	34,524	アメリカ合衆国	0.04
SANTANDER HOLDINGS USA (REG) 4.4% 13/07/2027	35,000	96.62735	33,820	アメリカ合衆国	0.04
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 183 CL IO FRN	597,000	5.493226	32,795	アメリカ合衆国	0.04
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER WI) (REG) 3.25% 15/03/2027 WI	34,000	92.54215	31,464	アメリカ合衆国	0.04
ALIGNED DATA CENTERS ISSUER LLC SER 1A CL A2 FRN 15/08/2046	33,000	92.22898	30,436	アメリカ合衆国	0.04
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST 2020-R1 SER R1 CL A1 FRN 25/04/2053	209,000	14.290963	29,868	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2052	34,000	86.517766	29,416	アメリカ合衆国	0.04
DOMINION ENERGY INC (SER B) VAR 01/06/2054	28,000	104.4334	29,241	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2049	85,000	33.448728	28,431	アメリカ合衆国	0.04
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2045	115,000	24.618329	28,311	アメリカ合衆国	0.04
NEWMONT GOLDCORP CORP (REG) 2.8% 01/10/2029	31,000	89.44715	27,729	アメリカ合衆国	0.03
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 181 CL IO FRN 16/07/2064	395,000	6.914913	27,314	アメリカ合衆国	0.03
NISOURCE INC (REG) 5.25% 30/03/2028	27,000	100.2497	27,067	アメリカ合衆国	0.03
HCA INC 5.45% 01/04/2031	27,000	100.1161	27,031	アメリカ合衆国	0.03
OHIO ST TURNPIKE COMMISSION 3.216% 15/02/2048	35,000	76.252	26,688	アメリカ合衆国	0.03
ARES CAPITAL CORP (REG) 5.95% 15/07/2029	27,000	97.93665	26,443	アメリカ合衆国	0.03
OVINTIV INC (REG) 7.2% 01/11/2031	23,000	107.2555	24,669	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/02/2054	25,000	98.146411	24,537	アメリカ合衆国	0.03

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
FREDDIE MAC POOL FRN 01/10/2049	75,000	32.445292	24,334	アメリカ合衆国	0.03
BRITISH AIR 18-1 A PTT (SER 144A) (REG) 4.125% 20/09/2031	41,000	56.163755	23,027	アメリカ合衆国	0.03
BLACKSTONE PRIVATE CRE (SER REGS) (REG S) (REG) 7.3% 27/11/2028	22,000	103.9137	22,861	アメリカ合衆国	0.03
SCF EQUIPMENT LEASING 2019-2 LLC SER 2A CL C FRN 21/06/2027	128,000	17.683749	22,635	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/01/2049	36,000	62.060273	22,342	アメリカ合衆国	0.03
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 21 CL IO FRN	405,000	5.486145	22,219	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/11/2048	90,970	24.264021	22,073	アメリカ合衆国	0.03
VERUS SECURITIZATION TRUST 2020-5 SER 5 CL A1 FRN (STP) 25/05/2065	100,000	21.661114	21,661	アメリカ合衆国	0.03
FANNIE MAE POOL FRN 01/03/2054	22,000	98.053901	21,572	アメリカ合衆国	0.03
ELARA HGV TIMESHARE ISSUER 2019-A L LC SER A CL A FRN 25/01/2034	100,000	19.880399	19,880	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/09/2049	155,000	12.790148	19,825	アメリカ合衆国	0.02
AMER AIRLINE 21-1B PTT (SER B) (REG) 3.95% 11/07/2030	24,000	79.237762	19,017	アメリカ合衆国	0.02
PNC FINANCIAL SERVICES (REG) 3.15% 19/05/2027	20,000	94.88765	18,978	アメリカ合衆国	0.02
OWENS CORNING (REG) 3.875% 01/06/2030	18,000	92.8032	16,705	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2049	91,000	17.277946	15,723	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/10/2048	70,000	19.606034	13,724	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/12/2048	53,000	25.087416	13,296	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/06/2052	17,000	77.774046	13,222	アメリカ合衆国	0.02
FREDDIE MAC POOL FRN 01/05/2052	17,000	71.958424	12,233	アメリカ合衆国	0.02
FANNIE MAE POOL FRN 01/07/2053	13,000	88.274574	11,476	アメリカ合衆国	0.01
FREDDIE MAC POOL FRN 01/08/2053	12,000	92.152467	11,058	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 158 CL IO VAR	409,000	2.034347	8,320	アメリカ合衆国	0.01
UNITED AIR 2018-1 B PTT SER B (REG) 4.6% 01/03/2026	17,000	47.941708	8,150	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 9 CL IO FRN 16/01/2060	630,000	1.289173	8,122	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A FRN 16/02/2062	185,000	4.343515	8,036	アメリカ合衆国	0.01
COMM MORTGAGE TRUST SER COR3 CL XA FRN 10/05/2051	579,000	1.343083	7,776	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 43 CL IO FRN 16/05/2060	670,000	1.074997	7,202	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 100 CL IO FRN	166,967	3.960844	6,613	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 35 CL IO FRN 16/03/2060	435,000	1.478731	6,432	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 69 CL IO FRN 16/04/2060	565,000	1.119348	6,324	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 131 CL IO FRN	241,000	2.537309	6,115	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 119 CL IO FRN	175,000	3.133226	5,483	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SE 20 CL IO VAR	860,000	0.635899	5,469	アメリカ合衆国	0.01
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 99 CL IO FRN 16/06/2060	755,000	0.712382	5,378	アメリカ合衆国	0.01

投資対象	保有高 (米ドル)	単価 (米ドル)	時価 (米ドル)	国名	純資産 比率 (%)
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION SER 41 CL IO VAR	505,000	0.537571	2,715	アメリカ合衆国	0.00
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE A SER 114 CL IO VAR 16/04/2060	520,000	0.514351	2,675	アメリカ合衆国	0.00
純資産総額			79,559,407		

国別比率（2024年6月末時点）

国名	時価 (米ドル)	対純資産総額比率 (%)
アメリカ合衆国	77,175,762	97.00
イギリス	436,662	0.55
カナダ	410,377	0.52
ケイマン諸島	321,740	0.40
ノルウェー	223,733	0.28
バミューダ	171,787	0.22
ドイツ	151,749	0.19
アイルランド	135,920	0.17
シンガポール	98,386	0.12
純資産総額	79,559,407	

[次へ](#)

4 管理会社の概況

（1）資本金の額

2024年7月末日現在、管理会社の未監査発行済株式資本の額は2,409百万香港ドル（約47,000百万円）で、全額払込済です。管理会社の授権株式総数は、普通株式2,054,961,936株および優先株式301,000,000株です。

最近5年間で、資本金は763百万香港ドル（約14,886百万円）増加しました。

（注）香港ドルの円貨換算は、2024年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1香港ドル=19.51円）によります。

（2）事業の内容及び営業の状況

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

2024年7月末日現在、管理会社は、下記のユニット・トラストの管理および運用を行っています。

国別（設立国）	種類別	本数	純資産総額の合計 （百万米ドル）
ケイマン諸島	ユニット・トラスト （マニユライフ・イン ベストメント・トラ スト）	5	約2,051
香港	ユニット・トラスト （マニユライフ・香 港・シリーズ）	3	約35
合計		8	約2,086

（3）その他

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

[次へ](#)

(2) その他の訂正

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

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

2 投資方針

（5）投資制限

<訂正前>

投資制限

ファンドに適用される投資制限は以下のとおりです。

（中略）

- (b) 投資運用会社は、ファンドの勘定で、エクイティ証券（優先株式および普通株式を含みます。）に対するエクスポージャーに投資することはできず、またかかるエクスポージャーの保有もできません。ファンドが債務証券の保有またはその他のコーポレートアクションの結果としてエクイティ証券を間接的に取得した場合、投資運用会社は、実務上可能な限り速やかにかかる投資対象を売却するようファンドの最善の利益のために行います。

（後略）

<訂正後>

投資制限

ファンドに適用される投資制限は以下のとおりです。

（中略）

- (b) 投資運用会社は、ファンドの勘定で、エクイティ証券に対するエクスポージャーに投資することはできず、またかかるエクスポージャーの保有もできません。ファンドの目的上、特定の優先証券（信託優先証券および優先証券の預託株式を含みますが、これらに限定されません。）に一部投資をする場合がありますが、これらは株式エクスポージャーとはみなされません。ファンドが債務証券の保有またはその他のコーポレートアクションの結果としてエクイティ証券を間接的に取得した場合、投資運用会社は、実務上可能な限り速やかにかかる投資対象を売却するようファンドの最善の利益のために行います。

（後略）

3 投資リスク

リスク要因

<訂正前>

（前略）

外国通貨リスク ファンドの投資対象が、関連するファンドの勘定の通貨以外の通貨建てである可能性があり、その場合、ファンドがかかる投資対象から受領する収益または買戻代金は、当該他の通貨で支払われます。この点において、関連するファンドの勘定の通貨とそれ以外の通貨との間の為替レートの変動により、為替リスクが生じます。さらに、外国為替管理が行われている市場においては、かかる市場から本国への資金の送金が困難な場合があります。

（中略）

ファンドに關係する通貨の下落は突然生じる場合があります、投資運用会社の支配が及ぶものではありません。為替エクスポージャーに対するヘッジが行われていない場合があります、その場合、為替リスクは受益者が負います。ファンドは、通貨を売買する先渡し、先物またはオプション契約を締結することにより、為替変動に伴うリスクの軽減を試みますが、ヘッジ手法を有効に使用できない場合があります。ただし、関連する市場の状況を鑑みて適切な商品が開発された場合、ファンドは将来的に為替ヘッジ取引を行うことができます。かかるヘッジ取引は、関連する現地規制当局の許可が必要となる場合があります。

（後略）

<訂正後>

（前略）

外国通貨リスク ファンドの投資対象が、関連するファンドの勘定の通貨以外の通貨建てである可能性があり、その場合、ファンドがかかる投資対象から受領する収益または買戻代金は、当該他の通貨で支払われます。この点において、関連するファンドの勘定の通貨とそれ以外の通貨との間の為替レートの変動により、為替リスクが生じます。さらに、外国為替管理が行われている市場においては、かかる市場から本国への資金の送金が困難な場合があります。

（中略）

ファンドに關係する通貨の下落は突然生じる場合があります、管理会社の支配が及ぶものではありません。為替エクスポージャーに対するヘッジが行われていない場合があります、その場合、為替リスクは受益者が負います。ファンドは、通貨を売買する先渡し、先物またはオプション契約を締結することにより、為替変動に伴うリスクの軽減を試みますが、ヘッジ手法を有効に使用できない場合があります。ただし、関連する市場の状況を鑑みて適切な商品が開発された場合、ファンドは将来的に為替ヘッジ取引を行うことができます。かかるヘッジ取引は、関連する現地規制当局の許可が必要となる場合があります。

（後略）

リスクに関する参考情報

<訂正前>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2019年5月～2024年4月の5年間に於けるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格（毎月末時点）と、年間騰落率（毎月末時点）の推移を示したものです。クラスA（米ドル建て）は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA（豪ドル建てヘッジあり）は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

【クラスA（米ドル建て）】



【クラスA（豪ドル建てヘッジあり）】



<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX(配当込み)

先進国株・・・FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)

新興国株・・・S&P新興国総合指数

日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数

先進国債・・・FTSE世界国債指数(除く日本、円ベース)

新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数(円ベース)

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

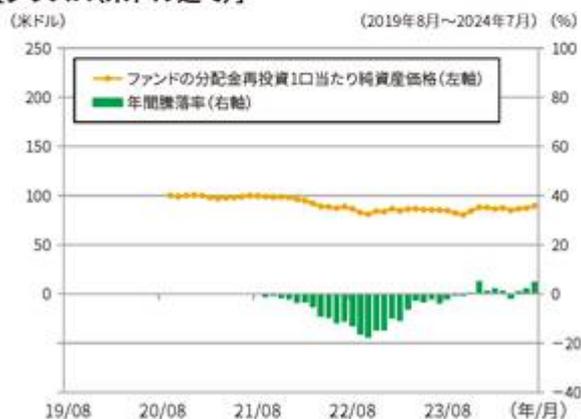
TOPIX(東証株価指数)の指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。FTSE先進国株価指数(除く日本、円ベース)、FTSE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

<訂正後>

ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格・年間騰落率の推移

2019年8月～2024年7月の5年間におけるファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格(毎月末時点)と、年間騰落率(毎月末時点)の推移を示したものです。クラスA(米ドル建て)は、2020年9月25日に運用を開始したため、2020年9月24日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2021年8月以前の年間騰落率の推移は算出されず、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)は、2021年4月9日に運用を開始したため、2021年4月8日以前の分配金再投資1口当たり純資産価格および2022年3月以前の年間騰落率の推移は算出されません。

【クラスA(米ドル建て)】



【クラスA(豪ドル建てヘッジあり)】



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

左のグラフと同じ期間(ただし、クラスA(米ドル建て)については2021年9月～2024年7月の期間、クラスA(豪ドル建てヘッジあり)については2022年4月～2024年7月の期間)における年間騰落率(毎月末時点)の平均と振れ幅を、ファンドと他の代表的な資産クラスとの間で比較したものです。



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

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

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

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

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

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

※ファンドは代表的な資産クラスの全てに投資するものではありません。

<各資産クラスの指数>

日本株・・・TOPIX（配当込み）
先進国株・・・FTSE先進国株価指数（除く日本、円ベース）
新興国株・・・S&P新興国総合指数
日本国債・・・ブルームバーグE1年超日本国債指数
先進国債・・・FTSE世界国債指数（除く日本、円ベース）
新興国債・・・FTSE新興国市場国債指数（円ベース）

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

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

4 手数料等及び税金

（5）課税上の取扱い

<訂正前>

（A）日本

2024年5月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

（後略）

<訂正後>

（A）日本

2024年8月末日現在、日本の受益者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

（後略）