

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年11月26日提出
【計算期間】	第10期中(自 2024年2月27日至 2024年8月26日)
【ファンド名】	新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	積木 利浩
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,765,672,272	97.28
内 パミュウダ	3,765,672,272	97.28
親投資信託受益証券	48,783	0.00
内 日本	48,783	0.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	105,209,597	2.72
純資産総額	3,870,930,652	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

D I A Mマネーマザーファンド

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	4,197,999,000	82.58
内 日本	4,197,999,000	82.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	885,756,765	17.42
純資産総額	5,083,755,765	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（2024年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 (2016年 2月25日)	26	26	0.9824	0.9824
第2計算期間末 (2017年 2月27日)	2	2	1.0003	1.0663
第3計算期間末 (2018年 2月26日)	1,854	1,885	1.0001	1.0171
第4計算期間末 (2019年 2月25日)	9,987	9,987	0.9967	0.9967
第5計算期間末 (2020年2月25日)	7,688	7,942	1.0000	1.0330
第6計算期間末 (2021年2月25日)	6,450	6,634	1.0003	1.0288
第7計算期間末 (2022年2月25日)	5,516	5,516	0.9751	0.9751
第8計算期間末 (2023年2月27日)	4,434	4,434	0.8845	0.8845
第9計算期間末 (2024年2月26日)	4,111	4,111	0.8946	0.8946
2023年8月末日	4,254	-	0.8867	-

9月末日	4,142	-	0.8700	-
10月末日	4,031	-	0.8541	-
11月末日	4,158	-	0.8845	-
12月末日	4,229	-	0.9034	-
2024年1月末日	4,181	-	0.9015	-
2月末日	4,108	-	0.8940	-
3月末日	4,112	-	0.9000	-
4月末日	4,014	-	0.8834	-
5月末日	4,010	-	0.8882	-
6月末日	3,984	-	0.8922	-
7月末日	3,903	-	0.9018	-
8月末日	3,870	-	0.9077	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0660
第3計算期間	0.0170
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0330
第6計算期間	0.0285
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
2024年2月27日～2024年8月26日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.8
第2計算期間	8.5
第3計算期間	1.7
第4計算期間	0.3
第5計算期間	3.6
第6計算期間	2.9
第7計算期間	2.5
第8計算期間	9.3
第9計算期間	1.1
2024年2月27日～2024年8月26日	1.7

（注）収益率は期間騰落率です。

2【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	45,043,660	18,300,000
第2計算期間	0	24,200,000
第3計算期間	1,971,264,617	119,645,273
第4計算期間	9,528,101,329	1,361,683,235
第5計算期間	813,852,375	3,146,204,876
第6計算期間	417,858,123	1,657,462,348
第7計算期間	264,228,184	1,055,310,037

第8計算期間	195,840,527	840,075,528
第9計算期間	13,925,743	431,405,387
2024年2月27日～ 2024年8月26日	0	320,147,696

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間(2024年2月27日から2024年8月26日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 2024年2月26日現在	第10期中間計算期間末 2024年8月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	116,139,584	104,024,726
投資信託受益証券	4,040,700,605	3,773,756,130
親投資信託受益証券	48,788	48,783
未収入金	-	67,000,000
流動資産合計	4,156,888,977	3,944,829,639
資産合計	4,156,888,977	3,944,829,639
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,245,644	20,134,567
未払受託者報酬	687,492	658,057
未払委託者報酬	35,522,285	34,001,980
その他未払費用	61,105	58,477
流動負債合計	45,516,526	54,853,081
負債合計	45,516,526	54,853,081
純資産の部		
元本等		
元本	4,595,827,874	4,275,680,178
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	484,455,423	385,703,620
(分配準備積立金)	20,941,827	19,483,027
元本等合計	4,111,372,451	3,889,976,558
純資産合計	4,111,372,451	3,889,976,558
負債純資産合計	4,156,888,977	3,944,829,639

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第9期中間計算期間 自 2023年2月28日 至 2023年8月27日	第10期中間計算期間 自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
営業収益		
受取配当金	37,346,700	-
受取利息	627	44,558
有価証券売買等損益	14,853,185	100,055,520
営業収益合計	22,494,142	100,100,078
営業費用		
支払利息	30,053	248
受託者報酬	717,079	658,057
委託者報酬	37,051,620	34,001,980
その他費用	63,745	58,477
営業費用合計	37,862,497	34,718,762
営業利益又は営業損失()	15,368,355	65,381,316
経常利益又は経常損失()	15,368,355	65,381,316
中間純利益又は中間純損失()	15,368,355	65,381,316
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	321,706	376,469
期首剰余金又は期首欠損金()	579,120,004	484,455,423
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,997,234	33,746,956
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,997,234	33,746,956
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,608,424	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,608,424	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	573,421,255	385,703,620

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第10期中間計算期間	
	自 2024年2月27日	至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月25日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年2月26日、当中間計算期間末日を2024年8月26日としております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在
1. 期首元本額	5,013,307,518円	4,595,827,874円
期中追加設定元本額	13,925,743円	- 円
期中一部解約元本額	431,405,387円	320,147,696円
2. 受益権の総数	4,595,827,874口	4,275,680,178口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は484,455,423円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は385,703,620円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期中間計算期間	第10期中間計算期間
	自 2023年2月28日 至 2023年8月27日	自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
1. 委託費用	<p>信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 14,342,580円</p>	<p>信託財産の運用の指図にかかわる権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 13,162,068円</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期	第10期中間計算期間末
	2024年2月26日現在	2024年8月26日現在

1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第9期 2024年2月26日現在	第10期中間計算期間末 2024年8月26日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8946円 (8,946円)	0.9098円 (9,098円)

(参考)

当ファンドは、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS(JPY)」投資信託証券及び「DIAMマネーマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」及び「親投資信託受益証券」は、すべてこれらの証券であります。

同投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

DIAMマネーマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2024年8月26日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	885,730,971
国債証券	4,197,941,000
未収利息	3,952
前払費用	712
流動資産合計	5,083,676,635
資産合計	5,083,676,635
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	5,055,874,095
剰余金	
剰余金又は欠損金()	27,802,540
元本等合計	5,083,676,635
純資産合計	5,083,676,635
負債純資産合計	5,083,676,635

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月27日 至 2024年8月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8月26日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	496,151,514円
同期中追加設定元本額	5,867,727,501円
同期中一部解約元本額	1,308,004,920円
元本の内訳	
ファンド名	
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,843,407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,867,169円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし/年1回決算型）	1,088,285円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり/年1回決算型）	98,095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48,517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791,316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2,474,972円
クルーズコントロール	4,868,885,634円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円
USストラテジック・インカム・ファンド Aコース（為替ヘッジあり）	993,740円
USストラテジック・インカム・ファンド Bコース（為替ヘッジなし）	1,987,479円
D I A M - ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<DC年金>	9,935円
マシューズ・アジア株式ファンド	14,723,185円

One世界分散セレクト(Aコース)	99,040円
One世界分散セレクト(Bコース)	99,040円
One世界分散セレクト(Cコース)	99,040円
世界8資産リスク分散バランスファンド(目標払出し型)	99,109円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド(年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド(為替ヘッジあり)	301,134円
PIMCOストラテジック・インカム・ファンド(為替ヘッジなし)	1,493,740円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド(成長型)	9,943,324円
One/フィデリティ・ブルーチップ・グロース株式ファンド(隔月決算・予想分配金提示型)	1,988,665円
計	5,055,874,095円
2. 受益権の総数	5,055,874,095口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月26日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月26日現在
1口当たり純資産額	1.0055円
(1万口当たり純資産額)	(10,055円)

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA
 ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド(M)

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS(JPY)」は、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」を構成する個別クラスであり、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド(M)」に投資しております。

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」及び「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド(M)」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

資産・負債計算書

(単位：受益証券数を除き、千米ドル)

	2023年10月31日現在
資産：	
投資 - 評価額	
有価証券投資	348,778
関連当事者に係る投資	10,181,475
金融デリバティブ商品	
店頭	34,654
現金	52
売却済投資に係る未収金	3
関連当事者に係る売却済投資に係る未収金	14,717
売却済ファンド受益証券に係る未収金	18,758
未収利息および未収配当金	6
	10,598,443
負債：	
金融デリバティブ商品	
店頭	158,549
購入済投資に係る未払金	53
関連当事者に係る購入済投資に係る未払金	14,565
未払利息	11
取引相手方からの預託金	61
償還済ファンド受益証券に係る未払金	18,935
運用手数料未払金	458
助言手数料未払金	11
管理手数料未払金	9
代理店手数料未払金	6
販売手数料未払金	94
	192,752
純資産	10,405,691
有価証券投資の取得原価	348,759
関連当事者に係る投資の取得原価	10,020,480

0となっている金額は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

投資有価証券明細表

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA

2023年10月31日現在

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資 3.4%		
短期金融商品 3.4%		
定期預金 0.0%		
Bank of Nova Scotia		
4.830% due 11/01/2023	USD	27
Brown Brothers Harriman & Co.		
4.830% due 11/01/2023		2
Citibank N.A.		
4.830% due 11/01/2023		113
DBS Bank Ltd.		
4.830% due 11/01/2023		97
JPMorgan Chase Bank N.A.		
4.830% due 11/01/2023		206
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	2
4.830% due 11/01/2023	USD	11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	9
4.830% due 11/01/2023	USD	262
		<u>718</u>
米国短期国債 3.4%		
5.334% due 11/14/2023 (a)		14,000
5.355% due 11/21/2023 (a)		21,261
5.365% due 12/12/2023 (a)		13,000
5.372% due 01/18/2024 (b)(d)		7,800
5.374% due 12/07/2023 (a)(d)		5,600
5.377% due 12/14/2023 (b)		26,200
5.385% due 01/25/2024 (a)		22,700
5.396% due 11/24/2023 (a)(d)		9,200
5.405% due 01/04/2024 (a)(d)		20,600
5.405% due 01/11/2024 (b)		154,700
5.414% due 01/23/2024 (a)		18,000
5.414% due 01/16/2024 (a)(d)		10,700
5.431% due 01/30/2024 (a)(d)		10,300
5.441% due 02/06/2024 (a)(d)		17,300
		<u>348,060</u>
短期金融商品合計		<u>348,778</u>
(取得原価 348,759千米ドル)		
有価証券投資合計		<u>348,778</u>
(取得原価 348,759千米ドル)		
	受益証券口数 (単位:千)	
関連当事者に係る投資 97.8%		
その他の投資会社 97.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M)		
(取得原価 10,020,480千米ドル)	693,561	10,181,475
関連当事者に係る投資合計		<u>10,181,475</u>
(取得原価 10,020,480千米ドル)		
投資合計 101.2%		10,530,253
(取得原価 10,369,239千米ドル)		
金融デリバティブ商品(c) (1.2%)		(123,895)
(取得原価またはプレミアム(純額) 0千米ドル)		
その他の資産および負債(純額)(0.0%)		<u>(667)</u>
純資産 100.0%		<u>10,405,691</u>

* 額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(a) 利率は満期までの利回りです。

(b) 利率は満期までの利回り(加重平均)です。

(c)金融デリバティブ商品：店頭
為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額(千通貨)	外貨受取額(千通貨)	未実現利益(損失)	
				資産(千米ドル)	負債(千米ドル)
BPS	11/2023	JPY 1,610,831	USD 10,811	175	0
BPS	11/2023	USD 1,754	JPY 262,091	0	(23)
BPS	11/2023	2,751	409,559	0	(44)
BPS	11/2023	2,470	367,656	0	(40)
JPM	11/2023	JPY 300,970	USD 2,012	25	0
JPM	11/2023	USD 778	JPY 116,391	0	(10)
JPM	11/2023	45	6,799	0	(1)
MYI	11/2023	JPY 141,586	USD 935	0	0
MYI	11/2023	USD 2,979	JPY 450,909	0	0
MYI	11/2023	125	18,978	0	0
				200	(118)

クラスF(JPY)、クラスJ(JPY)、クラスM(JPY 助言)、クラスN(JPY)、クラスP(JPY)、
クラスQ(JPY)、クラスR(JPY)、クラスS(JPY)、クラスT(JPY)、クラスU2(JPY)、
クラスX(JPY)、クラスY(JPY)およびクラスZ(JPY)為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額(千通貨)	外貨受取額(千通貨)	未実現利益(損失)	
				資産(千米ドル)	負債(千米ドル)
AZD	11/2023	USD 51,176	JPY 7,606,046	0	(953)
BOA	11/2023	JPY 1,030,945	USD 6,875	68	0
BOA	11/2023	USD 1,911	JPY 283,637	0	(38)
BPS	11/2023	JPY 1,144,916	USD 7,683	123	0
BPS	11/2023	3,767,140	25,167	292	0
BPS	11/2023	USD 7,597	JPY 1,144,916	0	(37)
CBK	11/2023	JPY 112,987,492	USD 751,417	5,354	0
CBK	12/2023	USD 635,353	JPY 95,219,229	0	(3,205)
DUB	11/2023	JPY 282,100,651	USD 1,869,628	6,901	0
DUB	11/2023	USD 1,291,052	JPY 191,043,295	0	(29,582)
DUB	12/2023	1,869,628	280,681,417	0	(6,221)
GLM	11/2023	JPY 3,566,356	USD 23,994	445	0
GLM	11/2023	USD 52,569	JPY 7,798,910	0	(1,072)
JPM	11/2023	JPY 6,555,452	USD 43,301	15	0
JPM	11/2023	USD 140,639	JPY 20,885,896	0	(2,728)
JPM	12/2023	43,301	6,522,486	1	0
MBC	11/2023	JPY 637,972	USD 4,277	64	0
MBC	11/2023	USD 3,679	JPY 546,680	0	(70)
MYI	11/2023	JPY 34,492,948	USD 228,170	411	0
MYI	11/2023	USD 34,144	JPY 5,073,696	0	(642)
MYI	12/2023	120,636	18,160,488	0	(71)
SCX	11/2023	JPY 1,185,857	USD 7,934	103	0
SSB	11/2023	60,546,400	400,000	209	0
SSB	12/2023	USD 400,000	JPY 60,242,184	0	(60)
TOR	11/2023	JPY 85,314,933	USD 568,577	5,237	0
TOR	11/2023	USD 4,749,153	JPY 704,953,574	0	(94,304)
TOR	12/2023	568,577	84,882,758	0	(5,051)
UAG	11/2023	JPY 357,791,315	USD 2,377,747	15,231	0
UAG	12/2023	USD 2,377,747	JPY 355,986,844	0	(14,397)
				34,454	(158,431)
為替予約契約合計				34,654	(158,549)

金融デリバティブ商品：店頭概要

以下は、2023年10月31日現在の店頭金融デリバティブ商品の時価及び担保の相手方別の概要です。

2023年10月31日現在、国際スワップデリバティブ協会のマスター契約に準拠して、時価総額27,347ドルの証券を金融デリバティブ商品の担保として差し入れています。

取引相手方	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭金融デリバティブ商品の時価 (千米ドル)	店頭金融デリバティブ担保差入 (千米ドル)	純額エクスポージャー (千米ドル)
	為替予約 契約 (千米ドル)	買建オプション (千米ドル)	スワップ 契約 (千米ドル)	店頭 合計 (千米ドル)	為替予約 契約 (千米ドル)	売建オプション (千米ドル)	スワップ 契約 (千米ドル)	店頭 合計 (千米ドル)			
AZD	0	0	0	0	(953)	0	0	(953)	(953)	564	(389)
BOA	68	0	0	68	(38)	0	0	(38)	30	0	30
BPS	590	0	0	590	(144)	0	0	(144)	446	0	446
CBK	5,354	0	0	5,354	(3,205)	0	0	(3,205)	2,149	(61)	2,088
DUB	6,901	0	0	6,901	(35,803)	0	0	(35,803)	(28,902)	9,070	(19,832)
GLM	445	0	0	445	(1,072)	0	0	(1,072)	(627)	261	(366)
JPM	41	0	0	41	(2,739)	0	0	(2,739)	(2,698)	447	(2,251)
MBC	64	0	0	64	(70)	0	0	(70)	(6)	0	(6)
MYI	411	0	0	411	(713)	0	0	(713)	(302)	0	(302)
SCX	103	0	0	103	0	0	0	0	103	0	103
SSB	209	0	0	209	(60)	0	0	(60)	149	0	149
TOR	5,237	0	0	5,237	(99,355)	0	0	(99,355)	(94,118)	17,005	(77,113)
UAG	15,231	0	0	15,231	(14,397)	0	0	(14,397)	834	0	834
店頭 合計	34,654	0	0	34,654	(158,549)	0	0	(158,549)			

(1) 純額エクスポージャーは、デフォルトが発生した場合に支払期限となる、取引相手方に対する正味受取債権/(支払債務)を表します。店頭金融デリバティブ商品からのエクスポージャーは、同一の法人との同一の基本契約に基づいて管理される取引間でのみネットティングが可能です。

投資有価証券明細表 - ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド(M)
2023年10月31日現在

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資	148.7%		
バンクローン債務証券	4.3%		
AAdvantage Loyalty IP Ltd.			
10.427% due 04/20/2028	USD	9,453	9,600
AmSurg LLC			
13.258% due 04/29/2027		78,267	91,831
16.695% due 04/28/2028 (b)		39,584	36,017
Azalea TopCo, Inc.			
9.184% due 07/24/2026		818	778
Carnival Corp.			
7.618% due 06/30/2025	EUR	11,263	11,919
8.689% due 10/18/2028	USD	2,290	2,252
Cengage Learning, Inc.			
10.405% due 07/14/2026		11,893	11,783
Charter Communications Operating LLC			
7.074-7.133% due 02/01/2027		3,069	3,065
DIRECTV Financing LLC			
10.439% due 08/02/2027		7,101	6,923
Envalior Finance GmbH			
9.448% due 03/29/2030	EUR	10,900	10,686
10.883% due 03/29/2030	USD	19,602	18,070
Envision Healthcare Corp.			
13.250% due 07/10/2026		23,591	23,591
Finastra USA, Inc.			
2.579% due 09/13/2029 (c)		614	603
12.582% due 09/13/2029		6,161	6,053
GTCR W Merger Sub LLC			
8.334% due 09/20/2030		9,200	9,146
iHeartCommunications, Inc.			
8.439% due 05/01/2026		49,324	42,248
Iqvia, Inc.			
5.868% due 03/07/2024	EUR	3,900	4,123
Lealand Finance Co. BV			
3.000-6.439% due 06/30/2025	USD	613	337
8.439% due 06/28/2024		261	190
Poseidon Bidco SAS			
9.222% due 09/30/2028	EUR	39,600	42,014
Pug LLC			
8.939% due 02/12/2027	USD	780	738
Sigma Holdco BV			
7.413% due 07/02/2025	EUR	1,820	1,920
Sotera Health Holdings LLC			
8.395% due 12/11/2026	USD	3,362	3,340
SS&C Technologies Holdings, Inc.			
7.189% due 04/16/2025		2,824	2,825
SVF II Finco (Cayman) LP			
5.000% due 12/21/2025		32,083	30,109
Syniverse Holdings LLC			
12.390% due 05/13/2027		24,909	22,192
Team Health Holdings, Inc.			
8.189% due 02/06/2024		1,685	1,650
TransDigm, Inc.			
8.640% due 02/22/2027		786	787
8.640% due 08/24/2028		24,180	24,180
U.S. Renal Care, Inc.			
10.446% due 06/20/2028		3,155	1,956
United AirLines, Inc.			
9.189% due 04/21/2028		2,439	2,438
Westmoreland Coal Co.			
8.000% due 03/15/2029		349	260
Windstream Services LLC			
9.424% due 02/23/2027		4,920	4,846
11.674% due 09/21/2027		8,020	7,450

バンクローン債務証券合計
(取得原価 444,839千円)

社債 15.6%

銀行および金融 7.4%

AGFC Capital Trust I

7.405% due 01/15/2067

		額面 (千通貨)	時価 (千円)
		2,200	1,157
AIB Group PLC			
5.250% due 10/23/2031	EUR	4,060	4,326
6.608% due 09/13/2029	USD	5,200	5,088
Armor Holdco, Inc.			
8.500% due 11/15/2029		200	175
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates			
5.849% due 06/15/2050		7,900	6,006
Aroundtown S.A.			
5.375% due 03/21/2029		11,300	8,843
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2.528% due 11/18/2027		43,530	36,373
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
1.875% due 01/09/2026	EUR	7,100	6,735
2.625% due 04/28/2025		1,000	996
3.625% due 09/24/2024		900	929
6.750% due 03/02/2026		12,961	13,648
7.708% due 01/18/2028		1,200	1,111
8.000% due 01/22/2030		5,237	5,217
8.500% due 09/10/2030		2,000	1,992
Banco de Credito del Peru S.A.			
4.650% due 09/17/2024	PEN	16,400	4,133
Banco Santander S.A. (d)			
6.527% due 11/07/2027	USD	11,000	11,022
6.607% due 11/07/2028		8,400	8,413
Bank of Nova Scotia			
4.900% due 06/04/2025 (e)(f)		1,124	1,029
Barclays PLC			
4.972% due 05/16/2029		2,600	2,394
6.490% due 09/13/2029		8,500	8,290
6.692% due 09/13/2034		9,900	9,368
7.437% due 11/02/2033		400	399
BPCE S.A.			
6.714% due 10/19/2029		19,000	18,741
7.003% due 10/19/2034		11,600	11,278
Brandywine Operating Partnership LP			
3.950% due 11/15/2027		2,000	1,659
4.550% due 10/01/2029		1,500	1,149
CA Immobilien Anlagen AG			
1.000% due 10/27/2025	EUR	3,400	3,214
CaixaBank S.A.			
6.208% due 01/18/2029	USD	5,400	5,214
6.840% due 09/13/2034		7,800	7,376
CIFI Holdings Group Co. Ltd. (b)			
4.375% due 04/12/2027		300	17
4.450% due 08/17/2026		500	32
5.950% due 10/20/2025		200	15
6.000% due 07/16/2025		200	14
6.450% due 11/07/2024		600	39
Corestate Capital Holding S.A. (g)			
8.000% due 12/31/2026	EUR	8,491	6,066
10.000% due 12/31/2026		1,300	1,374
Corsair International Ltd.			
8.802% due 01/28/2027		10,000	10,411
9.152% due 01/28/2029		4,100	4,247
Country Garden Holdings Co. Ltd. (b)			
2.700% due 07/12/2026	USD	2,100	92
3.125% due 10/22/2025		3,400	147
3.875% due 10/22/2030		1,700	78

CPI Property Group S.A.			
2.750% due 05/12/2026	EUR	2,100	1,850
Credit Suisse AG			
0.495% due 02/02/2024	USD	5,200	5,116
5.500% due 08/20/2026	EUR	14,000	15,202
7.500% due 02/15/2028	USD	10,500	10,907
Credit Suisse Group AG AT1 Claim (b)		9,046	995
Cromwell Ereit Lux Finco Sarl			
2.125% due 11/19/2025	EUR	433	418
CTP NV			
1.250% due 06/21/2029		7,500	5,937
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
1.500% due 09/27/2031	EUR	8,200	6,001
Deutsche Bank AG			
1.375% due 02/17/2032		8,500	6,708
1.750% due 11/19/2030		6,200	5,286
2.129% due 11/24/2026	USD	1,200	1,084
3.035% due 05/28/2032		700	522
3.547% due 09/18/2031		7,400	5,815
3.961% due 11/26/2025		3,127	3,016
6.720% due 01/18/2029		2,900	2,848
EPR Properties			
4.750% due 12/15/2026		256	234
4.950% due 04/15/2028		1,132	987
G City Europe Ltd.			
4.250% due 09/11/2025	EUR	400	376
GLP Capital LP			
5.250% due 06/01/2025	USD	650	635
5.300% due 01/15/2029		3,142	2,873
Goodman U.S. Finance Three LLC			
3.700% due 03/15/2028		2,324	2,070
Highwoods Realty LP			
3.050% due 02/15/2030		200	150
HSBC Holdings PLC			
2.848% due 06/04/2031		3,300	2,591
3.973% due 05/22/2030		14,100	12,187
5.402% due 08/11/2033		400	360
6.254% due 03/09/2034		29,500	28,014
Hudson Pacific Properties LP			
3.250% due 01/15/2030		100	64
3.950% due 11/01/2027		500	384
5.950% due 02/15/2028		2,200	1,733
InCaps Funding I Ltd.			
7.671% due 06/01/2033		6,069	5,705
KBC Group NV			
6.324% due 09/21/2034		5,500	5,211
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3.250% due 11/12/2025	EUR	1,400	1,322
Kilroy Realty LP			
4.250% due 08/15/2029	USD	300	250
Lloyds Banking Group PLC			
7.875% due 06/27/2029 (e)(f)	GBP	1,706	1,829
Nationwide Building Society			
3.960% due 07/18/2030	USD	5,600	4,867
4.302% due 03/08/2029		12,500	11,366
4.500% due 11/01/2026 (d)	EUR	12,400	13,186
NatWest Group PLC			
4.445% due 05/08/2030	USD	17,600	15,610
5.076% due 01/27/2030		16,500	15,150
6.016% due 03/02/2034		15,900	14,817
New Metro Global Ltd.			
4.500% due 05/02/2026		1,000	173
4.625% due 10/15/2025		200	46
4.800% due 12/15/2024		1,400	441
Park Aerospace Holdings Ltd.			

5.500% due 02/15/2024 Preferred Term Securities XVIII Ltd.		575	571
6.051% due 09/23/2035 Preferred Term Securities XXIV Ltd.		68	67
5.971% due 03/22/2037		763	686
6.051% due 03/22/2037 Preferred Term Securities XXV Ltd.		4,829	3,622
5.961% due 06/22/2037 Preferred Term Securities XXVI Ltd.		18,320	15,939
5.971% due 09/22/2037 Santander Holdings USA, Inc.		27,065	22,734
4.500% due 07/17/2025 Santander UK Group Holdings PLC		1,007	968
2.469% due 01/11/2028		1,000	864
3.823% due 11/03/2028		3,400	2,993
6.534% due 01/10/2029		9,900	9,690
6.750% due 06/24/2024 (e)(f)	GBP	16,610	19,749
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
7.482% due 08/29/2029 Seazen Group Ltd.	GBP	4,800	5,976
6.000% due 08/12/2024 Societe Generale S.A.	USD	700	301
6.446% due 01/10/2029		8,050	7,868
6.691% due 01/10/2034 Sunac China Holdings Ltd.		15,100	14,150
7.000% due 07/09/2025 SVB Financial Group		800	128
3.125% due 06/05/2030 (b) U.S. Capital Funding VI Ltd.		100	57
5.948% due 07/10/2043 UBS Group AG		23,084	17,602
3.091% due 05/14/2032		2,850	2,193
3.750% due 03/26/2025		6,200	5,972
3.869% due 01/12/2029		31,650	28,346
4.194% due 04/01/2031		9,150	7,826
5.959% due 01/12/2034		15,900	14,830
6.301% due 09/22/2034		4,900	4,643
6.327% due 12/22/2027		10,000	9,902
6.442% due 08/11/2028		3,360	3,326
6.537% due 08/12/2033		22,110	21,257
7.750% due 03/01/2029	EUR	3,540	4,151
9.016% due 11/15/2033 UniCredit SpA	USD	4,350	4,875
7.830% due 12/04/2023 Unique Pub Finance Co. PLC		72,590	72,690
7.395% due 03/28/2024 Uniti Group LP	GBP	344	414
6.500% due 02/15/2029	USD	2,280	1,483
10.500% due 02/15/2028 VICI Properties LP		6,545	6,307
3.500% due 02/15/2025		4,784	4,567
3.750% due 02/15/2027		4,300	3,873
4.125% due 08/15/2030		5,684	4,694
4.250% due 12/01/2026		3,600	3,326
4.625% due 12/01/2029 Voyager Aviation Holdings LLC		3,600	3,117
8.500% due 05/09/2026 (b)		4,421	2,404
			757,304
工業 3.2%			
Air Canada 2020-2 Class A Pass-Through Trust			
5.250% due 04/01/2029		1,869	1,791
Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			
4.800% due 08/15/2027		3,270	3,119
Amdocs Ltd.			
2.538% due 06/15/2030		4,000	3,150
American Airlines 2013-1 Class A Pass-Through Trust			

		78	73
4.000% due 07/15/2025			
American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust			
3.700% due 10/01/2026		1,849	1,672
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust			
3.375% due 05/01/2027		1,381	1,221
American Airlines 2016-1 Class AA Pass-Through Trust			
3.575% due 01/15/2028		1,467	1,340
American Airlines 2016-2 Class AA Pass-Through Trust			
3.200% due 06/15/2028		767	678
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust			
3.350% due 10/15/2029		337	297
BAT Capital Corp.			
6.343% due 08/02/2030		1,200	1,165
6.421% due 08/02/2033		1,000	943
7.081% due 08/02/2053		1,100	982
Boeing Co.			
5.705% due 05/01/2040		5,728	5,071
5.805% due 05/01/2050		4,500	3,878
5.930% due 05/01/2060		9,900	8,338
British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust			
3.300% due 12/15/2032		85	72
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Broadcom, Inc.			
2.450% due 02/15/2031	USD	7,900	6,065
3.137% due 11/15/2035		4,435	3,130
3.469% due 04/15/2034		4,513	3,440
Carvana Co. (g)			
12.000% due 12/01/2028		11,453	8,536
13.000% due 06/01/2030		17,180	12,729
14.000% due 06/01/2031		20,329	15,161
Community Health Systems, Inc.			
5.625% due 03/15/2027		21,336	17,351
8.000% due 03/15/2026		8,401	7,691
CoStar Group, Inc.			
2.800% due 07/15/2030		2,000	1,554
CVS Pass-Through Trust			
5.773% due 01/10/2033		129	125
7.507% due 01/10/2032		515	525
8.353% due 07/10/2031		514	532
Energy Transfer LP			
4.950% due 05/15/2028		424	401
Exela Intermediate LLC			
11.500% due 04/15/2026 (g)		541	92
Ford Foundation			
2.815% due 06/01/2070		1,940	989
Greene King Finance PLC			
3.593% due 03/15/2035	GBP	1,956	2,016
4.064% due 03/15/2035		532	556
5.106% due 03/15/2034		131	147
7.139% due 12/15/2034		4,156	3,915
GTCR W-2 Merger Sub LLC			
7.500% due 01/15/2031	USD	900	889
Imperial Brands Finance PLC			
3.500% due 07/26/2026		1,900	1,771
JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust			
4.000% due 11/15/2032		6,106	5,408
Market Bidco Finco PLC			
4.750% due 11/04/2027	EUR	17,800	16,152
Massachusetts Institute of Technology			
4.678% due 07/01/2114	USD	65	50
5.600% due 07/01/2111		103	96
Mitchells & Butlers Finance PLC			
6.013% due 12/15/2028	GBP	820	922
6.022% due 12/15/2030	USD	373	346
Nissan Motor Co. Ltd.			
3.522% due 09/17/2025		8,300	7,852

4.345% due 09/17/2027		8,700	7,869
4.810% due 09/17/2030		2,250	1,912
NMG Holding Co., Inc.			
7.125% due 04/01/2026		11,900	11,142
ONEOK, Inc.			
5.800% due 11/01/2030		800	770
6.050% due 09/01/2033		3,500	3,356
6.625% due 09/01/2053		2,900	2,713
Oracle Corp.			
3.850% due 04/01/2060		899	540
PeaceHealth Obligated Group			
3.218% due 11/15/2050		3,100	1,735
Roadster Finance DAC			
2.375% due 12/08/2027	EUR	1,000	889
Rolls-Royce PLC			
4.625% due 02/16/2026		3,514	3,672
5.750% due 10/15/2027	GBP	3,199	3,672
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
11.500% due 06/01/2025	USD	2,410	2,549
Russian Railways Via RZD Capital PLC			
7.487% due 03/25/2049 (b)	GBP	6,300	4,969
Sands China Ltd.			
4.300% due 01/08/2026	USD	1,800	1,671
5.375% due 08/08/2025		2,300	2,228
5.650% due 08/08/2028		2,400	2,222
		額面 (千通貨)	時価 (千円ドル)
Syngenta Finance NV			
4.892% due 04/24/2025	USD	800	782
Times Square Hotel Trust			
8.528% due 08/01/2026		823	813
U.S. Renal Care, Inc.			
10.625% due 06/28/2028		2,342	1,446
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust			
2.700% due 05/01/2032		1,288	1,049
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			
5.875% due 10/15/2027		20,509	20,217
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3.875% due 08/15/2029		7,400	6,165
3.875% due 11/01/2033		16,500	12,486
4.125% due 08/15/2031		5,000	4,025
Venture Global LNG, Inc.			
8.125% due 06/01/2028		7,600	7,384
8.375% due 06/01/2031		8,400	8,022
9.500% due 02/01/2029		46,750	47,524
9.875% due 02/01/2032		15,550	15,777
Veritas U.S., Inc.			
7.500% due 09/01/2025		1,950	1,598
			331,428
公益 5.0%			
Altice Financing S.A.			
5.750% due 08/15/2029		11,389	8,820
Altice France S.A.			
8.125% due 02/01/2027		2,744	2,316
Charter Communications Operating LLC			
3.900% due 06/01/2052		9,800	5,536
3.950% due 06/30/2062		2,600	1,389
4.400% due 12/01/2061		7,100	4,137
Constellation Oil Services Holding S.A.			
3.000% due 12/31/2026 (g)		387	273
DISH DBS Corp.			
5.250% due 12/01/2026		11,110	8,983
5.750% due 12/01/2028		11,110	8,089
Enel Finance America LLC			
7.100% due 10/14/2027		1,000	1,023
Enel Finance International NV			
7.500% due 10/14/2032		600	621

Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.			
2.250% due 11/22/2024	EUR	100	82
2.949% due 01/24/2024		450	381
4.950% due 03/23/2027	USD	1,800	1,251
4.950% due 02/06/2028		1,000	695
5.150% due 02/11/2026		5,700	4,275
7.288% due 08/16/2037		500	390
8.625% due 04/28/2034		2,372	2,163
Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC			
1.500% due 02/17/2027	EUR	31,800	20,504
2.950% due 04/15/2025		5,000	3,964
2.950% due 01/27/2029	USD	23,200	13,340
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6.500% due 03/15/2030		70,143	61,763
Netflix, Inc.			
3.875% due 11/15/2029	EUR	3,065	3,181
Noble Finance II LLC			
8.000% due 04/15/2030	USD	2,072	2,073
NPC Ukrenerg			
6.875% due 11/09/2028		1,200	324
Pacific Gas & Electric Co.			
2.100% due 08/01/2027		1,910	1,618
2.500% due 02/01/2031		2,600	1,929
2.950% due 03/01/2026		8,508	7,813
3.000% due 06/15/2028		11,288	9,559
3.150% due 01/01/2026		15,753	14,585
3.250% due 06/01/2031		3,800	2,952
3.300% due 03/15/2027		3,838	3,443
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.300% due 12/01/2027	USD	14,666	12,779
3.400% due 08/15/2024		6,570	6,421
3.450% due 07/01/2025		12,102	11,478
3.500% due 06/15/2025		8,068	7,678
3.500% due 08/01/2050		4,660	2,597
3.750% due 02/15/2024		10,188	10,121
3.750% due 07/01/2028		13,613	11,944
3.750% due 08/15/2042		418	258
3.850% due 11/15/2023		1,830	1,828
3.950% due 12/01/2047		2,200	1,315
4.000% due 12/01/2046		3,144	1,904
4.200% due 03/01/2029		9,900	8,635
4.250% due 03/15/2046		5,219	3,299
4.300% due 03/15/2045		3,000	1,944
4.400% due 03/01/2032		7,300	6,003
4.450% due 04/15/2042		4,333	2,933
4.500% due 07/01/2040		36,242	25,754
4.500% due 12/15/2041		743	490
4.550% due 07/01/2030		50,195	43,469
4.600% due 06/15/2043		1,794	1,230
4.650% due 08/01/2028		100	90
4.750% due 02/15/2044		2,707	1,888
4.950% due 07/01/2050		25,950	18,136
5.250% due 03/01/2052		7,300	5,292
Petroleos de Venezuela S.A. (b)			
5.375% due 04/12/2027		11,932	1,647
5.500% due 04/12/2037		10,372	1,365
6.000% due 05/16/2024		8,283	1,093
6.000% due 11/15/2026		13,183	1,691
9.000% due 11/17/2023		400	53
9.750% due 05/17/2035		4,730	700
Petroleos Mexicanos			
5.950% due 01/28/2031		5,319	3,809
6.700% due 02/16/2032		58,087	42,867
6.950% due 01/28/2060		6,116	3,468
7.690% due 01/23/2050		1,570	971
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			

4.263% due 06/01/2036		3,600	3,148
4.377% due 06/01/2039		3,990	3,407
4.451% due 12/01/2047		7,700	6,063
Prosus NV			
1.985% due 07/13/2033	EUR	5,600	3,873
2.085% due 01/19/2030		4,200	3,382
3.061% due 07/13/2031	USD	9,600	6,919
4.193% due 01/19/2032		4,000	3,074
4.987% due 01/19/2052		1,300	803
Rio Oil Finance Trust Series 2014-1			
9.250% due 07/06/2024		499	504
Rio Oil Finance Trust Series 2014-3			
9.750% due 01/06/2027		443	459
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1			
8.200% due 04/06/2028		2,101	2,121
Sprint Capital Corp.			
8.750% due 03/15/2032		2,200	2,479
Sprint LLC			
7.125% due 06/15/2024		3,992	4,017
7.625% due 03/01/2026		839	862
Sprint Spectrum Co. LLC			
5.152% due 03/20/2028		2,482	2,443
System Energy Resources, Inc.			
2.140% due 12/09/2025		6,100	5,555
Topaz Solar Farms LLC			
4.875% due 09/30/2039		5,109	4,602
5.750% due 09/30/2039		7,292	6,633
Valaris Ltd.			
8.375% due 04/30/2030		1,666	1,636
Viasat, Inc.			
6.500% due 07/15/2028		2,700	1,917
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Windstream Escrow LLC			
7.750% due 08/15/2028	USD	13,507	10,723
			517,242
社債合計 (取得原価 1,896,675千米ドル)			1,605,974
転換社債 0.4%			
Multiplan Corp.			
6.000% due 10/15/2027		5,700	3,802
Nationwide Building Society			
10.250% due 06/20/2166	GBP	7,405	10,221
Stichting AK Rabobank Certificaten			
6.500% due 03/29/2170 (f)	EUR	30,963	29,586
転換社債合計 (取得原価 67,905千米ドル)			43,609
地方債 0.1%			
Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			
6.630% due 02/01/2035	USD	605	599
6.725% due 04/01/2035		286	283
7.350% due 07/01/2035		467	476
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022			
0.000% due 11/01/2043		12,731	6,350
Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			
2.246% due 06/01/2029		1,600	1,332
3.000% due 06/01/2046		635	560
Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (b)			
6.050% due 07/01/2032		800	202
6.125% due 07/01/2040		3,000	757
地方債合計 (取得原価 12,129千米ドル)			10,559

米国政府関係機関 52.4%

Fannie Mae

0.765% due 05/25/2048 (h)		2,065	207
3.000% due 04/01/2037		611	546
3.000% due 09/01/2049		188	152
3.000% due 03/01/2050		16,878	13,664
3.000% due 10/01/2051		1,350	1,084
3.000% due 12/01/2051		204	164
3.000% due 01/01/2052		194	156
3.000% due 02/01/2052		10,310	8,273
3.000% due 03/01/2052		23,085	18,518
3.000% due 04/01/2052		25,731	20,639
3.000% due 05/01/2052		8,343	6,695
3.000% due 06/01/2052		9,332	7,485
3.000% due 07/01/2052		6,806	5,459
3.000% due 08/01/2052		10,442	8,379
3.000% due 09/01/2052		164	132
3.000% due 05/01/2053		111	89
3.500% due 08/01/2042		18	16
3.500% due 09/01/2047		166	142
3.500% due 03/01/2048		49	42
3.500% due 04/01/2051		676	578
3.500% due 02/01/2052		977	816
3.500% due 03/01/2052		1,590	1,330
3.500% due 04/01/2052		2,751	2,301
3.500% due 05/01/2052		2,950	2,467
3.500% due 07/01/2052		3,348	2,793
3.500% due 09/01/2052		981	819
4.000% due 07/01/2040		5	5
4.000% due 12/01/2041		46	40
4.000% due 07/01/2042		36	31
4.000% due 08/01/2042		541	476
4.000% due 09/01/2042		125	109
4.000% due 10/01/2042		20	18
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
4.000% due 01/01/2043	USD	5	4
4.000% due 11/01/2045		86	76
4.000% due 03/01/2047		27	24
4.000% due 04/01/2047		230	204
4.000% due 08/01/2047		3,707	3,278
4.000% due 10/01/2047		205	181
4.000% due 12/01/2047		80	71
4.000% due 01/01/2048		46	40
4.000% due 02/01/2048		514	454
4.000% due 07/01/2048		6,176	5,430
4.000% due 08/01/2048		3,627	3,190
4.000% due 09/01/2048		1,049	927
4.500% due 05/01/2033		13	12
4.500% due 02/01/2038		1	1
4.500% due 01/01/2041		156	138
4.750% due 06/01/2033		160	145
5.000% due 10/01/2035		60	59
5.000% due 12/01/2035		134	125
5.000% due 10/01/2036		5	5
5.000% due 05/01/2038		2	2
5.000% due 11/01/2039		6	6
5.500% due 07/01/2033		18	18
5.500% due 06/01/2035		657	624
5.500% due 04/01/2036		1	1
5.500% due 11/01/2036		1	1
5.500% due 03/01/2037		11	11
5.500% due 09/01/2037		4	4
5.500% due 02/01/2038		3	3
5.500% due 04/01/2038		11	11
6.000% due 08/01/2031		20	19

6.000% due 06/01/2032		1	1
6.000% due 09/01/2039		358	345
6.000% due 10/01/2047		8	7
6.000% due 01/01/2053		26,626	26,056
6.500% due 01/01/2037		1	1
6.500% due 10/01/2037		3	3
6.500% due 10/01/2053		6,847	6,815
7.000% due 09/01/2031		27	27
Fannie Mae, TBA (d)			
2.500% due 12/01/2053		146,000	112,203
3.000% due 11/01/2038		1,800	1,609
3.000% due 11/01/2053		0	0
3.000% due 12/01/2053		199,150	159,563
3.500% due 12/01/2053		652,683	544,157
4.000% due 12/01/2053		155,150	134,132
4.500% due 12/01/2053		101,800	90,950
5.000% due 12/01/2053		3,500	3,226
5.500% due 12/01/2053		286,200	271,420
6.000% due 12/01/2053		30,800	29,962
6.500% due 12/01/2053		35,100	34,867
Freddie Mac			
1.115% due 06/15/2042 (h)		30	3
3.000% due 11/01/2046		57	47
3.000% due 12/01/2047		1,779	1,469
3.000% due 03/01/2048		101	84
3.000% due 12/01/2051		187	151
3.000% due 03/01/2052		89	71
3.000% due 04/01/2052		538	432
3.000% due 05/01/2052		7,575	6,075
3.000% due 06/01/2052		203	163
3.000% due 07/01/2052		158	127
3.000% due 09/01/2052		99	79
3.000% due 10/01/2052		396	317
3.000% due 01/01/2053		242	194
3.000% due 03/01/2053		260	209
3.500% due 10/01/2039		108	94
3.500% due 10/01/2047		1,937	1,657
3.500% due 12/01/2047		601	513
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.500% due 03/01/2048	USD	2,330	1,989
3.500% due 04/01/2048		836	714
3.500% due 10/01/2048		938	800
3.500% due 12/01/2048		2,300	1,966
3.500% due 03/01/2049		1,432	1,221
3.500% due 05/01/2051		75	63
3.500% due 04/01/2052		2,952	2,463
3.500% due 06/01/2052		2,323	1,939
3.500% due 07/01/2052		993	828
3.500% due 09/01/2052		33	27
3.500% due 11/01/2052		836	700
4.000% due 09/01/2033		1	1
4.000% due 08/01/2042		465	410
4.000% due 09/01/2042		656	578
4.000% due 12/01/2042		7	6
4.000% due 04/01/2047		296	262
4.000% due 05/01/2047		287	254
4.000% due 08/01/2047		522	462
4.000% due 08/01/2048		602	530
4.000% due 09/01/2048		245	216
4.000% due 12/01/2048		9,227	8,119
4.000% due 02/01/2049		3,684	3,241
4.000% due 03/01/2049		287	252
5.000% due 06/01/2034		65	64
5.000% due 08/01/2035		39	38
5.000% due 01/01/2037		2	2
5.000% due 01/01/2038		1	1

5.500% due 01/01/2035		257	252
5.500% due 05/01/2037		2	2
5.500% due 06/01/2037		90	88
5.750% due 05/01/2037		83	82
6.000% due 07/01/2037		40	40
6.000% due 01/01/2053		8,304	8,121
Ginnie Mae			
4.000% due 06/20/2041		1	1
4.000% due 04/20/2047		1,441	1,290
4.000% due 05/20/2047		26,657	23,925
4.000% due 06/20/2047		12,651	11,325
4.000% due 07/20/2047		10,939	9,792
4.000% due 02/20/2048		7,567	6,768
4.000% due 05/20/2049		26,126	23,437
4.000% due 02/20/2050		318	287
4.000% due 07/20/2050		156	140
4.000% due 08/20/2050		24	22
4.000% due 09/20/2050		1,893	1,698
4.000% due 10/20/2050		59,971	53,798
4.000% due 11/20/2052		252	222
4.500% due 10/20/2035		416	380
4.500% due 01/20/2040		76	69
4.500% due 03/20/2040		7	7
4.500% due 07/15/2040		1,105	1,032
4.500% due 07/20/2040		1,207	1,122
4.500% due 08/15/2040		1,317	1,239
4.500% due 08/20/2040		871	810
4.500% due 09/20/2040		3,628	3,371
4.500% due 10/20/2040		987	918
4.500% due 01/20/2041		4,678	4,348
4.500% due 02/20/2041		2,268	2,096
4.500% due 03/20/2041		8,736	8,093
4.500% due 04/15/2041		1,054	991
4.500% due 04/20/2041		926	861
4.500% due 06/20/2041		7,991	7,428
4.500% due 07/20/2041		2,066	1,920
4.500% due 09/20/2041		206	191
4.500% due 10/20/2041		1,179	1,083
4.500% due 12/20/2041		1,847	1,718
4.500% due 05/20/2043		438	407
4.500% due 07/20/2043		292	272
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
4.500% due 07/20/2053	USD	103,767	93,851
4.500% due 08/20/2053		1,022	925
4.500% due 09/20/2053		299,110	270,538
5.000% due 08/20/2030		170	160
5.000% due 05/20/2040		262	246
5.000% due 04/20/2041		7	6
5.500% due 05/20/2038		7	7
5.500% due 06/20/2038		35	34
5.500% due 07/20/2038		34	32
5.500% due 08/20/2038		233	225
5.500% due 09/20/2038		72	69
5.500% due 10/20/2038		15	14
5.500% due 01/20/2039		10	10
5.500% due 02/20/2039		26	25
5.500% due 09/20/2039		50	48
5.500% due 10/20/2039		8	7
5.500% due 11/20/2039		212	204
5.500% due 12/20/2039		24	22
5.500% due 01/20/2040		187	176
5.500% due 06/20/2040		208	203
5.500% due 07/20/2040		470	443
5.500% due 07/20/2053		21,057	20,155
5.500% due 08/20/2053		18,417	17,627
Ginnie Mae, TBA (d)			

2.000% due 11/01/2053	19,000	14,653
2.500% due 12/01/2053	46,200	36,816
3.000% due 11/01/2053	147,100	121,256
3.000% due 12/01/2053	494,900	408,181
3.500% due 10/01/2053	182,700	155,733
3.500% due 12/01/2053	99,000	84,418
4.000% due 11/01/2053	513,000	450,979
4.000% due 12/01/2053	944,000	830,204
4.500% due 11/01/2053	177,660	160,530
4.500% due 12/01/2053	496,000	448,368
5.000% due 11/01/2041	277,000	257,751
5.500% due 11/01/2053	22,000	21,039
5.500% due 12/01/2053	247,000	236,155
米国政府関係機関合計 (取得原価 5,497,999千米ドル)		5,383,620

米国長期国債 15.1%

Treasury Inflation Protected Securities (i)

0.125% due 07/15/2024	194,667	190,176
0.125% due 10/15/2024	141,986	137,773
0.125% due 04/15/2025	33,341	31,837
0.125% due 07/15/2030	54,737	46,922
0.125% due 01/15/2031	2,005	1,692
0.125% due 07/15/2031	7,606	6,371
0.250% due 01/15/2025	72,526	69,835
0.250% due 07/15/2029	148,070	131,114
0.250% due 02/15/2050	21,926	12,189
0.375% due 01/15/2027	5,903	5,486
0.375% due 07/15/2027	1,581	1,463
0.500% due 04/15/2024	96,682	95,057
0.625% due 01/15/2024	169,533	168,013
0.625% due 07/15/2032	91,088	78,043
0.625% due 02/15/2043	2,938	2,035
0.750% due 07/15/2028	34,682	32,098
0.750% due 02/15/2042	6,930	5,013
0.750% due 02/15/2045	18,905	13,052
0.875% due 01/15/2029	63,316	58,326
0.875% due 02/15/2047	22,131	15,330
1.000% due 02/15/2046	11,921	8,609
1.000% due 02/15/2048	25,897	18,280
1.000% due 02/15/2049	65,655	46,012
1.375% due 07/15/2033	117,671	106,538
1.375% due 02/15/2044	3,425	2,733
1.500% due 02/15/2053	26,958	21,153

額面

(千通貨)

時価

(千米ドル)

2.125% due 02/15/2040	USD	3,551	3,322
2.125% due 02/15/2041		1,963	1,832
U.S. Treasury Bonds			
2.250% due 08/15/2046		100	60
2.750% due 08/15/2047		2,830	1,865
3.000% due 08/15/2048		155	107
3.000% due 02/15/2049		77	53
3.125% due 05/15/2048		180	127
4.375% due 08/15/2043		33,800	30,151
U.S. Treasury Notes			
1.625% due 02/15/2026		2,200	2,040
2.000% due 02/15/2025		11,021	10,572
2.000% due 08/15/2025		1,400	1,326
2.000% due 11/15/2026		800	735
2.250% due 11/15/2024		12,300	11,906
2.250% due 02/15/2027		28,000	25,789
2.375% due 05/15/2029		32,200	28,297
2.625% due 02/15/2029		5,000	4,478
2.750% due 08/15/2032		150,100	126,999
2.875% due 05/15/2032		290	249
米国長期国債合計			1,555,058

(取得原価 1,734,056千米ドル)

モーゲージバック証券 40.8%		
Accredited Mortgage Loan Trust		
6.384% due 07/25/2035	7,714	7,468
7.134% due 07/25/2035 (b)	2,206	1,765
ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
5.749% due 08/25/2036	3,308	3,105
6.234% due 01/25/2035	841	763
6.264% due 02/25/2034	1,389	1,402
6.339% due 08/25/2035	4,516	4,289
6.369% due 11/25/2034	1,120	1,090
6.609% due 02/25/2035	6,632	6,153
Adjustable Rate Mortgage Trust		
6.389% due 08/25/2035	3,175	2,764
AFC Home Equity Loan Trust		
6.249% due 06/25/2029	1,587	926
Alternative Loan Trust		
4.140% due 08/25/2035 (b)	420	385
4.158% due 08/25/2036	5,426	4,855
5.268% due 09/25/2034	772	686
5.500% due 04/25/2034	8,776	8,291
5.500% due 06/25/2035	4,396	3,424
5.500% due 08/25/2035 (b)	49	40
5.500% due 09/25/2035	2,541	1,568
5.500% due 02/25/2036 (b)	14	8
5.644% due 09/20/2046	542	541
5.799% due 07/25/2036	3,895	3,842
5.819% due 08/25/2046 (b)	8,382	6,782
5.839% due 05/25/2036	12,205	10,255
5.874% due 03/20/2046	4,994	3,948
5.939% due 12/25/2046	13,414	10,764
5.979% due 07/25/2036	18,309	15,296
6.000% due 11/25/2036	1,701	960
6.000% due 07/25/2037 (b)	24,518	11,622
6.039% due 01/25/2036	5,261	4,498
6.094% due 12/20/2035	5,133	4,495
6.150% due 08/25/2035 (b)	367	285
7.000% due 10/25/2037	29,361	10,459
7.089% due 10/25/2034	2,026	1,953
Ameritrust Mortgage Securities Trust		
5.949% due 04/25/2036	656	652
6.054% due 03/25/2036	26,883	24,379
Ameritrust Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
3.610% due 09/25/2032	104	106
6.459% due 01/25/2036	7,000	5,725
	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
7.194% due 10/25/2034	9,913	8,989
Angel Oak Mortgage Trust		
6.500% due 12/25/2067	4,058	4,011
Argent Mortgage Loan Trust		
5.919% due 05/25/2035	18,802	16,781
Argent Securities Trust		
5.799% due 04/25/2036	7,677	2,458
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
4.131% due 09/25/2033	2,584	2,441
6.204% due 10/25/2035	36,400	31,230
Asset-Backed Funding Certificates Trust		
5.659% due 10/25/2036	10,129	8,252
6.099% due 03/25/2035	10,915	10,340
6.174% due 06/25/2035	6,550	6,181
6.414% due 06/25/2035 (b)	4,194	3,727
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		

3.842% due 05/25/2036 (b) Atrium Hotel Portfolio Trust		46,467	41,083
7.062% due 06/15/2035 Austin Fairmont Hotel Trust		18,395	17,797
7.182% due 09/15/2032 Avon Finance		3,000	2,927
0.000% due 12/28/2049 Banc of America Alternative Loan Trust (b)	GBP	2,400	2,808
3.986% due 01/24/2024 6.000% due 07/25/2046 Banc of America Funding Trust	USD	52 1,370	42 1,102
4.129% due 02/20/2035 4.156% due 06/20/2036 4.429% due 01/20/2047 (b)		1,283 4,044 78	1,066 3,205 70
6.299% due 04/25/2037 BCAP LLC Trust		7,934	6,646
4.229% due 04/26/2036 5.876% due 04/26/2037 Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		4,613 2,725	2,335 1,250
4.703% due 11/25/2034 Bear Stearns Alternative-A Trust		188	177
5.779% due 04/25/2037 5.859% due 11/25/2046 6.159% due 08/25/2035 (b) Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		5,937 6,882 4,527	5,046 4,968 4,166
1.161% due 05/25/2036 (h) 4.845% due 11/25/2035 (b) 5.224% due 06/25/2034 5.387% due 12/25/2035 5.438% due 09/25/2034 5.462% due 04/25/2036 5.739% due 06/25/2047 5.839% due 05/25/2036 (b) 5.844% due 07/25/2036 5.919% due 02/25/2037 6.054% due 02/25/2036 (b) 6.489% due 08/25/2037 7.464% due 03/25/2035 Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		8,516 2,773 3,406 9,275 4,736 3,944 6,300 13,454 7,785 2,089 9,845 15,783 3,262	158 2,599 3,272 7,956 4,517 3,916 6,037 4,102 7,044 4,655 9,469 13,308 3,074
5.500% due 11/25/2033 Bear Stearns Mortgage Funding Trust		3,513	3,056
5.839% due 02/25/2037 (b) Benchmark Mortgage Trust		4,876	4,369
3.509% due 09/15/2048 3.899% due 03/15/2062 BHP Trust		47,290 9,775	41,029 6,555
7.153% due 08/15/2036 7.950% due 08/15/2036 Bridgegate Funding PLC		10,500 33,656	10,283 32,883
7.442% due 10/16/2062 8.192% due 10/16/2062 9.192% due 10/16/2062	GBP	12,821 18,993 9,971	15,532 22,788 11,992
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
10.192% due 10/16/2062 BSST Mortgage Trust	GBP	7,217	8,654
8.185% due 02/15/2037 8.835% due 02/15/2037 9.835% due 02/15/2037 BX Commercial Mortgage Trust	USD	11,000 24,700 7,500	8,810 18,963 5,591
6.347% due 02/15/2039 BX Trust		6,805	6,614
7.094% due 10/15/2036 7.336% due 10/15/2036 7.344% due 10/15/2036 9.944% due 07/15/2034 Canterbury Finance No.4 PLC		16,400 7,150 25,610 6,800	15,715 6,730 24,145 6,692

6.042% due 05/16/2058 Carrington Mortgage Loan Trust	GBP	82,252	99,544
6.609% due 02/25/2035 CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage	USD	3,468	2,912
6.040% due 01/25/2039 (b) Centex Home Equity Loan Trust		504	447
6.084% due 03/25/2035 Chase Home Lending Mortgage Trust		1,952	1,925
3.250% due 03/25/2063 Chase Mortgage Finance Trust		21,203	17,664
4.017% due 12/25/2035 (b) ChaseFlex Trust		3,694	3,154
5.739% due 07/25/2037 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates		853	700
5.799% due 03/25/2035 CIM Trust		298	281
3.250% due 10/25/2058 6.639% due 12/25/2067 CIT Mortgage Loan Trust		17,962	15,283
6.789% due 10/25/2037 6.939% due 10/25/2037		4,642	4,598
6.939% due 10/25/2037 Citigroup Commercial Mortgage Trust		315	314
0.280% due 03/11/2047 (h) Citigroup Mortgage Loan Trust		28,585	27,688
4.313% due 08/25/2036 4.507% due 07/25/2037 (b)		25,400	0
5.714% due 08/25/2036 5.719% due 12/25/2036		3,773	3,468
5.759% due 12/25/2036 5.764% due 01/25/2037 (b)		2,291	1,957
6.259% due 09/25/2037 7.250% due 05/25/2036 (b)		15,222	6,195
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. 6.474% due 05/25/2035 7.939% due 07/25/2037		2,337	2,198
Commercial Mortgage Trust 0.177% due 04/10/2047 (h) 3.633% due 02/10/2037		9,652	5,304
8.599% due 12/15/2038 Conseco Finance Corp. 6.920% due 12/01/2030		2,205	954
7.500% due 03/01/2030 7.600% due 04/15/2026		12,220	10,065
Countrywide Asset-Backed Certificates 5.939% due 08/26/2033 7.314% due 05/25/2035 (b)		8,567	4,259
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 0.000% due 06/25/2034 3.765% due 03/25/2037 (b)		10,698	9,722
4.295% due 10/20/2035 (b) 4.371% due 11/25/2037 4.703% due 11/25/2034		3,507	3,193
5.500% due 11/25/2035 (b) 6.000% due 07/25/2036 6.000% due 11/25/2037		33,000	5
		10,000	9,208
		8,575	7,709
		805	800
		45,434	16,682
		4,902	1,114
		178	167
		4,282	4,123
		1	1
		3,573	3,079
		4,097	3,698
		4,383	3,917
		7	6
		5,427	2,885
		17,226	8,805
		3,330	1,277
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. 7.889% due 01/25/2033 \$	USD	1,040	975
Credit Suisse Mortgage Capital 3.000% due 01/29/2036 3.000% due 06/27/2037		321	305
5.755% due 11/27/2036 6.199% due 10/26/2036		1,039	1,010
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 0.000% due 01/25/2058 0.000% due 04/25/2058 (h)		10,152	12,301
		131	107
		20	19
		1	1

3.431% due 11/10/2032		1,922	1,606
3.616% due 01/25/2058		17,606	13,598
4.390% due 06/25/2050		41,375	33,819
4.454% due 04/25/2058		27,655	24,088
5.556% due 06/01/2050		36,218	36,129
6.194% due 07/15/2032		2,303	2,194
6.444% due 07/15/2032		4,000	3,766
6.644% due 07/15/2032		2,400	2,238
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
7.480% due 03/25/2046		4,266	3,505
CWABS Asset-Backed Certificates Trust			
4.341% due 12/25/2034		6,805	6,216
5.579% due 06/25/2035 (b)		1,473	1,240
5.579% due 06/25/2037		12,462	11,213
5.579% due 07/25/2037 (b)		3,130	3,072
5.619% due 11/25/2047		2,027	2,223
5.633% due 06/25/2035		8,644	6,664
5.659% due 08/25/2037		25,800	22,270
5.669% due 10/25/2047		5,333	5,203
5.689% due 02/25/2036		1,031	952
5.859% due 01/25/2045		765	759
5.899% due 05/25/2037 (b)		10,937	10,133
5.919% due 05/25/2036		9,196	7,407
5.919% due 03/25/2037		27,139	24,503
5.919% due 03/25/2047 (b)		26,535	21,424
5.959% due 09/25/2046		5,600	5,070
5.964% due 08/25/2036		2,303	2,197
6.039% due 06/25/2036		858	848
6.139% due 03/25/2036 (b)		1,451	1,237
6.519% due 05/25/2036 (b)		2,262	1,537
6.534% due 06/25/2035		8,400	7,947
7.014% due 11/25/2034		7,394	7,166
7.389% due 08/25/2035		3,000	2,790
CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust			
6.789% due 08/25/2047		34,300	30,495
7.014% due 03/25/2035		16,905	16,185
7.839% due 02/25/2035 (b)		6,963	5,083
DBGS Mortgage Trust			
8.099% due 10/15/2036		15,000	8,342
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust			
5.759% due 03/25/2037		9,093	4,898
5.769% due 08/25/2037 (b)		18,540	14,508
5.939% due 09/25/2047		11,350	9,410
Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
4.460% due 10/25/2035 (b)		8,549	7,310
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
4.240% due 11/27/2036		812	807
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates			
4.051% due 06/27/2037		11,382	9,780
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
5.638% due 10/19/2036 (b)		7,097	5,680
6.108% due 09/19/2045		4,847	2,527
Ellington Loan Acquisition Trust			
6.539% due 05/25/2037		1,020	965
EMC Mortgage Loan Trust			
6.489% due 04/25/2042 (b)		5,437	5,398
		額面 (千通貨)	時価 (千円ドル)
Encore Credit Receivables Trust			
6.369% due 11/25/2035	USD	6,510	5,821
Eurosail-UK PLC			
6.109% due 09/13/2045	GBP	3,605	4,173
6.289% due 06/13/2045		5,237	6,273
Extended Stay America Trust			
8.298% due 07/15/2038	USD	15,158	14,849

FBR Securitization Trust			
6.114% due 10/25/2035		19,109	15,937
6.204% due 09/25/2035		7,327	7,013
FFMLT Trust			
6.369% due 11/25/2035		2,069	1,654
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4.330% due 04/25/2035		2,811	2,639
5.749% due 11/25/2036		59,328	45,737
5.759% due 04/25/2036		3,831	3,638
6.114% due 03/25/2034		2,412	2,313
6.129% due 01/25/2036		24,773	22,083
6.144% due 05/25/2036		56	55
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
0.000% due 05/25/2035 (b)(h)		1,162	21
5.500% due 05/25/2035 (b)		1,162	686
Fontainebleau Miami Beach Trust			
3.963% due 12/10/2036		33,098	31,391
Fremont Home Loan Trust			
5.719% due 02/25/2037		6,602	4,955
5.729% due 05/25/2036		6,191	5,946
6.099% due 01/25/2036		6,000	5,597
6.459% due 01/25/2035		6,493	5,200
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.129% due 10/25/2035		9,882	8,187
Glen Securities Finance DAC			
5.814% due 10/28/2038	EUR	4,383	4,565
6.814% due 10/28/2038		3,287	3,383
7.852% due 10/28/2038		1,607	1,656
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			
5.456% due 03/10/2051	USD	11,781	10,098
GreenPoint Mortgage Funding Trust			
5.999% due 11/25/2045		32	21
Grifonas Finance No.1 PLC			
4.212% due 08/28/2039	EUR	513	518
GS Mortgage Securities Corporation Trust			
4.591% due 10/10/2032	USD	8,215	7,823
GSA Home Equity Trust (b)			
6.182% due 11/25/2036		2,934	662
6.500% due 11/25/2037		20	8
GSAMP Trust			
5.579% due 03/25/2047		3,675	3,184
5.599% due 01/25/2037		16,585	9,373
5.959% due 06/25/2036		10,860	10,229
6.084% due 11/25/2035 (b)		5,636	4,885
6.414% due 08/25/2034		3,081	2,874
6.414% due 04/25/2035 (b)		5,325	4,827
7.239% due 06/25/2035		3,500	3,214
GSMSC Resecuritization Trust			
2.122% due 04/26/2037		44,351	11,193
5.614% due 09/26/2036		3,694	2,285
GSR Mortgage Loan Trust			
1.261% due 03/25/2037 (h)		7,490	549
5.739% due 03/25/2037		7,490	1,147
HarborView Mortgage Loan Trust			
4.038% due 06/19/2036 (b)		6,049	3,060
5.928% due 12/19/2036 (b)		772	711
6.008% due 02/19/2036		9,501	5,852
6.088% due 08/19/2045		7,547	5,589
Hawaii Hotel Trust			
7.032% due 05/15/2038		2,000	1,959
7.541% due 05/15/2038		12,500	12,225
		額面	時価
		(千通貨)	(千円ドル)
Home Equity Asset Trust			
5.919% due 10/25/2036	USD	23,475	13,588
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
5.579% due 11/25/2036		11,236	10,041

5.679% due 04/25/2037	12,380	7,821
5.799% due 06/25/2036	2,039	1,872
5.979% due 06/25/2036	16,717	11,398
6.429% due 08/25/2035	3,660	3,588
HPLY Trust		
7.451% due 11/15/2036	4,675	4,528
7.801% due 11/15/2036	26,212	25,322
HSI Asset Securitization Corp. Trust		
5.539% due 07/25/2036	2,197	913
5.739% due 07/25/2036	8,971	3,744
5.814% due 05/25/2037	7,197	6,772
Impac CMB Trust		
6.119% due 01/25/2035	7,756	7,130
Impac Secured Assets Corp.		
5.999% due 03/25/2036 (b)	8,132	6,351
Impac Secured Assets Trust		
5.629% due 01/25/2037	1,986	1,567
IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust		
6.500% due 10/25/2037	8,467	4,234
IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust		
3.894% due 06/25/2037 (b)	8,206	4,916
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
3.285% due 07/25/2037	17,978	15,515
3.342% due 04/25/2037	13,319	11,321
3.473% due 04/25/2037 (b)	6,519	5,701
3.546% due 03/25/2036 (b)	3,949	2,796
4.157% due 11/25/2036 (b)	10,927	7,428
5.799% due 02/25/2037 (b)	20,856	19,365
5.819% due 10/25/2036	4,825	1,963
6.039% due 07/25/2035	5,676	4,413
INTOWN Mortgage Trust		
9.019% due 08/15/2039	11,495	11,506
IXIS Real Estate Capital Trust		
6.204% due 12/25/2035	686	721
Jefferies Resecuritization Trust		
8.746% due 06/25/2047 (b)	431	348
JPMorgan Alternative Loan Trust		
3.896% due 03/25/2036 (b)	270	192
4.036% due 09/25/2036	8,788	7,263
5.730% due 03/25/2036 (b)	56	52
5.999% due 04/25/2047	1,536	1,445
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
4.128% due 07/05/2031	2,500	2,241
6.548% due 12/15/2036	3,700	2,794
7.235% due 10/05/2040	6,900	6,774
7.799% due 09/15/2029	1,740	1,193
7.964% due 11/15/2038	16,193	15,571
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.		
6.369% due 12/25/2035	12,010	11,443
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust		
4.573% due 11/25/2036	1,976	1,824
5.589% due 12/25/2036	13,723	7,088
5.709% due 08/25/2036	8,600	7,511
5.709% due 06/25/2037	34,606	32,318
5.719% due 06/25/2037 (b)	22,826	18,699
5.844% due 05/25/2036	8,051	7,712
5.874% due 05/25/2036	16,179	14,897
JPMorgan Mortgage Trust		
4.686% due 01/25/2037 (b)	375	319
5.250% due 11/25/2063	987	913
5.739% due 10/25/2035 (b)	3,510	2,473
6.000% due 06/25/2037 (b)	3,266	1,298
JPMorgan Resecuritization Trust		
3.968% due 02/26/2037	1,850	1,657

額面
(千通貨)

時価
(千米ドル)

Kentmere No.2 PLC

0.000% due 01/28/2042	GBP	11,939	4,273
5.987% due 01/28/2042		40,807	49,412
6.587% due 01/28/2042		5,693	6,702
6.937% due 01/28/2042		4,066	4,778
7.387% due 01/28/2042		2,439	2,862
8.187% due 01/28/2042		1,626	1,908
10.187% due 01/28/2042		3,252	3,729
Kinbane DAC			
4.711% due 09/25/2062	EUR	53,317	55,976
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			
4.145% due 06/15/2045		2,557	2,557
Legacy Mortgage Asset Trust			
0.000% due 09/25/2059	USD	18,019	5,150
0.000% due 09/25/2059 (h)		582,847	2,313
3.000% due 09/25/2059		93,500	85,921
4.151% due 09/25/2059		129,610	83,697
5.750% due 03/25/2060		30,590	30,000
6.250% due 05/25/2060		9,950	9,873
7.191% due 01/28/2070		14,554	14,570
7.250% due 11/25/2059		8,626	8,596
Lehman XS Trust			
5.639% due 02/25/2037 (b)		11,956	10,452
5.819% due 09/25/2036		4,609	3,649
5.819% due 12/25/2036		11,465	8,177
5.839% due 06/25/2046		9,022	7,373
5.959% due 02/25/2047		20,849	18,287
6.500% due 06/25/2046		4,527	3,527
7.139% due 10/25/2037		12,652	11,250
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5.819% due 02/25/2036		23,058	17,770
5.819% due 03/25/2046		32,775	11,617
LUXE Trust			
7.204% due 10/15/2038		1,710	1,674
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			
8.689% due 03/25/2032		303	303
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3.849% due 04/25/2034		1	1
6.000% due 12/25/2046		7,328	6,538
Mastr Asset-Backed Securities Trust			
5.879% due 11/25/2036		24	14
5.994% due 01/25/2036		7,500	6,603
6.589% due 08/25/2037		14,253	11,589
Mastr Specialized Loan Trust			
6.159% due 02/25/2036		5,379	3,995
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
8.439% due 10/25/2037		13,130	12,180
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4.926% due 02/25/2033		7	7
5.719% due 05/25/2037		18,801	9,287
5.719% due 10/25/2037		53,882	7,909
6.159% due 07/25/2034		4,729	4,058
6.234% due 09/25/2035		665	659
6.519% due 10/25/2035		518	508
MFA Trust			
6.775% due 10/25/2058		5,073	5,048
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			
5.689% due 07/25/2036		4,737	4,004
5.699% due 02/25/2037		7,251	3,360
5.739% due 07/25/2036		44,061	15,856
5.919% due 06/25/2036		19,511	16,327
5.939% due 07/25/2036		43,845	15,776
5.979% due 03/25/2036		4,101	3,866
6.174% due 07/25/2035		4,929	4,727
6.439% due 03/25/2033		65	63
6.439% due 07/25/2037		253	245
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			

		129,113	2,858
		額面 (千通貨)	時価 (千円ドル)
0.771% due 11/15/2052 (h)			
Morgan Stanley Capital I Trust			
2.428% due 04/05/2042	USD	13,500	9,709
7.032% due 08/15/2033		2,619	1,506
7.827% due 12/15/2038		21,942	20,713
8.526% due 12/15/2038		40,574	37,466
Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust			
5.979% due 02/25/2036 (b)		18,224	15,765
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
5.949% due 02/25/2036		14,415	12,698
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			
5.899% due 07/25/2036		9,969	3,961
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
3.275% due 11/25/2037		1,208	781
6.000% due 12/25/2035 (b)		480	184
Morgan Stanley Reremic Trust			
5.754% due 11/26/2036		5,003	4,135
Mortgage Loan Trust			
5.370% due 03/25/2034		3,310	2,981
MortgageIT Trust			
7.014% due 08/25/2035		299	274
MTN Commercial Mortgage Trust			
6.737% due 03/15/2039		1,120	1,097
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust			
3.790% due 11/15/2032		1,700	1,023
3.821% due 02/15/2039		2,900	2,531
New Century Home Equity Loan Trust			
6.564% due 10/25/2033		157	153
New York Mortgage Trust			
5.979% due 04/25/2035		565	522
Newgate Funding PLC			
5.741% due 12/15/2050	GBP	15,345	17,740
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust			
5.034% due 05/25/2035 (b)	USD	2,780	1,356
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
6.204% due 05/25/2035		6,036	5,838
6.245% due 10/25/2036 (b)		21,460	4,846
Nomura Resecuritization Trust			
1.952% due 03/26/2037		5,464	4,442
NovaStar Mortgage Funding Trust			
5.639% due 09/25/2037		15,625	14,955
5.759% due 05/25/2036		4,708	4,565
5.759% due 10/25/2036		5,312	2,721
6.159% due 10/25/2035		848	835
NYO Commercial Mortgage Trust			
7.444% due 11/15/2038		30,130	22,865
7.994% due 11/15/2038		14,400	9,491
OBX Trust			
6.319% due 01/25/2062		10,517	10,413
6.520% due 07/25/2063		7,550	7,499
Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.189% due 07/25/2035		5,051	5,036
Option One Mortgage Loan Trust			
5.539% due 02/25/2037		17,611	8,665
5.559% due 03/25/2037		7,079	6,625
5.579% due 03/25/2037		33,857	27,990
5.719% due 07/25/2036		1,970	1,095
6.249% due 02/25/2035		3,416	2,606
Ownit Mortgage Loan Trust			
5.699% due 10/25/2037		3,641	3,411
5.759% due 10/25/2037		2,501	2,351
5.819% due 07/25/2037		2,795	2,790
5.979% due 03/25/2037		6,225	5,807

Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6.174% due 09/25/2035		3,376	3,218
6.219% due 09/25/2035 (b)		25,075	21,014
6.909% due 01/25/2035 (b)		2,000	1,445
7.464% due 12/25/2034		25,974	22,618
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
5.599% due 09/25/2036	USD	26,232	4,993
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust			
3.437% due 11/25/2035		17,970	15,256
3.556% due 07/25/2035 (b)		9,601	6,979
5.749% due 11/25/2036 (b)		15,325	12,011
Precise Mortgage Funding PLC			
0.000% due 12/12/2055	GBP	0	250
PRET LLC			
1.843% due 09/25/2051	USD	36,709	33,071
8.232% due 09/25/2053		17,191	17,153
Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
8.497% due 10/25/2053 (d)		16,040	16,040
Prime Mortgage Trust			
6.000% due 04/25/2037		3,713	2,807
PRKCM Trust			
6.584% due 09/25/2058		9,307	9,248
PRPM LLC			
1.793% due 07/25/2026		8,562	8,006
PRPM Trust			
6.250% due 08/25/2068		8,200	8,072
Quest Trust			
6.864% due 03/25/2035		1,327	1,314
RAAC Trust			
6.144% due 02/25/2036 (b)		8,360	7,682
6.189% due 06/25/2047		21,346	14,966
RBSGC Mortgage Loan Trust			
6.000% due 01/25/2037 (b)		2	1
Real Estate Asset Liquidity Trust			
2.419% due 06/12/2054	CAD	1,194	854
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5.612% due 04/25/2037	USD	10,124	2,724
5.675% due 06/25/2037 (b)		3,910	1,006
6.159% due 11/25/2034		167	142
6.439% due 09/25/2037		33	27
Residential Accredit Securities Corporation Trust			
5.268% due 04/25/2034		1,162	1,012
5.659% due 02/25/2037		20,256	19,003
5.739% due 01/25/2037		36,046	25,552
5.934% due 04/25/2036		5,478	5,341
6.054% due 03/25/2036		6,180	5,538
6.414% due 09/25/2035		5,649	5,444
6.474% due 08/25/2035		2,060	1,998
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5.789% due 10/25/2036		14,675	13,617
6.039% due 02/25/2036		1,063	1,048
6.114% due 11/25/2035		8,981	8,664
6.119% due 12/25/2035		9,964	8,431
6.189% due 09/25/2035		7,021	6,784
Residential Mortgage Acceptance Corporation No.3 PLC			
0.000% due 02/15/2047	GBP	26,100	31,720
RESIMAC Bastille Trust			
6.372% due 09/05/2057	USD	598	598
RMAC Securities No.1 PLC			
4.230% due 06/12/2044	EUR	3,720	3,674
Saxon Asset Securities Trust			
1.922% due 03/25/2035 (b)	USD	367	347
7.189% due 12/25/2037		2,648	2,411

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5.979% due 03/25/2036		4,673	4,021
6.264% due 10/25/2035		10,136	9,109
6.489% due 03/25/2035		5,127	4,906
Sequoia Mortgage Trust			
5.854% due 05/20/2035		1,008	859
5.974% due 06/20/2034		19	17
Sestante Finance Srl			
4.222% due 07/23/2046	EUR	7,845	7,837
SFO Commercial Mortgage Trust			
7.848% due 05/15/2038	USD	885	687
8.348% due 05/15/2038		22,000	16,501
SG Mortgage Securities Trust			
5.799% due 02/25/2036		4,682	2,334
5.899% due 07/25/2036		8,095	1,698
Shamrock Residential DAC			
4.713% due 01/24/2061	EUR	19,491	20,446
5.113% due 02/24/2071		24,604	25,942
Soundview Home Loan Trust			
4.154% due 04/25/2035	USD	2,319	2,127
5.859% due 06/25/2036 (b)		7,815	6,085
5.904% due 06/25/2036 (b)		49,916	39,853
5.919% due 07/25/2036		24,020	20,383
6.414% due 03/25/2036		8,102	7,004
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
6.414% due 12/25/2035		567	553
SREIT Trust			
6.893% due 10/15/2038		24,605	23,869
7.241% due 10/15/2038		20,425	19,743
Stratton Mortgage Funding PLC			
7.299% due 09/25/2051	GBP	2,000	2,406
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4.097% due 06/25/2037	USD	1,507	1,352
5.041% due 07/25/2035 (b)		1,993	900
5.759% due 10/25/2035		5,328	4,757
6.200% due 05/25/2035 (b)		53	37
6.414% due 08/25/2035		8,667	7,332
Structured Asset Investment Loan Trust			
5.739% due 06/25/2036		5,118	4,683
5.939% due 06/25/2036		25,000	8,293
6.159% due 04/25/2035		3,571	3,451
6.239% due 02/25/2034		12,178	11,773
6.639% due 12/25/2034		2,200	2,164
Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
5.859% due 09/25/2047 (b)		18,876	15,170
5.879% due 05/25/2036		9,371	7,179
6.123% due 04/19/2035		1,318	1,209
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
6.108% due 09/19/2032		12	12
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
5.569% due 05/25/2036		5,123	4,851
5.689% due 05/25/2036		3,418	2,728
5.729% due 07/25/2036 (b)		9,526	8,821
5.749% due 07/25/2036		14,180	13,778
5.759% due 10/25/2036		8,263	5,536
5.939% due 04/25/2031		5,841	5,780
6.369% due 11/25/2035		3,185	3,175
Summerhill Residential			
0.000% due 03/24/2059	EUR	5	3
4.713% due 03/24/2059		121,196	127,947
5.113% due 03/24/2059		22,011	23,224
5.663% due 03/24/2059		17,746	18,718
6.263% due 03/24/2059		14,202	14,946
6.500% due 03/24/2059		6,568	5,181

7.000% due 03/24/2059		35,506	29,385
7.513% due 03/24/2059		8,521	8,960
8.863% due 03/24/2059		4,256	4,475
9.863% due 03/24/2059		4,256	4,475
Temple Quay No.1 PLC			
6.689% due 07/24/2085	GBP	58,277	70,553
7.189% due 07/24/2085		15,904	19,093
8.189% due 07/24/2085		14,681	17,627
Terwin Mortgage Trust			
6.819% due 03/25/2035	USD	2,943	2,706
Tharaldson Hotel Portfolio Trust			
7.750% due 11/11/2034		4,718	4,606
Towd Point Mortgage Funding Vantage2 PLC			
8.261% due 02/20/2054	GBP	16,900	20,505
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Towd Point Mortgage Trust			
3.750% due 03/25/2058	USD	3,080	2,987
3.750% due 09/25/2062		91,538	81,578
Truman Capital Mortgage Loan Trust			
5.699% due 03/25/2036		491	485
Verus Securitization Trust			
4.474% due 04/25/2067		29,167	27,139
5.811% due 05/25/2068		14,703	14,434
5.999% due 02/25/2068		4,974	4,897
6.443% due 08/25/2068		7,096	7,038
6.665% due 09/25/2068		19,177	19,038
Visio Trust			
6.598% due 10/25/2058		4,640	4,609
Wachovia Mortgage Loan Trust			
6.129% due 10/25/2035		2,862	2,490
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6.159% due 01/25/2045		360	312
6.354% due 08/25/2045		3,143	2,557
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC			
0.000% due 12/21/2049	GBP	1	3,768
6.151% due 12/21/2049		21,173	25,727
6.870% due 12/21/2049		4,921	5,914
7.370% due 12/21/2049		2,460	2,940
7.870% due 12/21/2049		1,406	1,675
8.370% due 12/21/2049		1,406	1,648
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates			
WMALT Trust (b)			
5.500% due 11/25/2035	USD	58	48
5.650% due 10/25/2046		9,705	7,646
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5.859% due 03/25/2037		658	638
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6.039% due 04/25/2034		3,311	3,150
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
6.389% due 10/25/2036 (b)		145	122
WFRBS Commercial Mortgage Trust			
0.481% due 03/15/2047 (h)		8,800	13
WSTN Trust			
6.297% due 07/05/2037		6,000	5,772
モーゲージバック証券合計			4,187,952
(取得原価 4,663,284千米ドル)			
アセットバック証券 7.5%			
AASET Trust			
3.967% due 05/16/2042		23	20
ACHV ABS TRUST			
6.600% due 08/19/2030		525	525
AGL CLO 6 Ltd.			
6.877% due 07/20/2034		3,000	2,979
ALESCO Preferred Funding XI Ltd.			

6.112% due 12/23/2036		5,000	3,925
American Homes 4 Rent Trust			
6.231% due 10/17/2036		1,150	1,141
Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.			
7.185% due 05/15/2037		3,146	3,095
AREIT LLC			
7.447% due 02/17/2028		2,900	2,901
Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion			
5.683% due 02/28/2032	EUR	1,411	1,472
Barings CLO Ltd.			
6.747% due 01/20/2032	USD	14,700	14,590
BlueMountain CLO XXII Ltd.			
6.735% due 07/15/2031		3,863	3,855
BPCRE Ltd.			
7.735% due 01/16/2037		13,800	13,706
8.435% due 01/16/2037		3,468	3,442
9.135% due 01/16/2037		13,516	13,433
		額面 (千通貨)	時価 (千円ドル)
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.			
6.699% due 07/27/2031	USD	5,612	5,590
6.757% due 01/20/2032		12,400	12,330
Carlyle U.S. CLO Ltd.			
6.815% due 10/15/2035		19,200	19,095
Carvana Auto Receivables Trust			
5.710% due 07/10/2029		2,500	2,455
6.090% due 11/10/2026		2,445	2,442
Castlelake Aircraft Securitization Trust			
4.125% due 06/15/2043		1,112	1,012
Cedar Funding VII CLO Ltd.			
6.677% due 01/20/2031		2,357	2,353
CIFC Funding I Ltd.			
6.684% due 04/23/2029		5,130	5,109
CIFC Funding III Ltd.			
6.795% due 07/15/2036		12,000	11,930
6.874% due 10/22/2031		2,640	2,639
Cologix Canadian Issuer LP			
4.940% due 01/25/2052	CAD	1,800	1,174
CPS Auto Receivables Trust			
5.380% due 01/18/2028	USD	1,000	982
6.040% due 07/16/2029		2,100	2,057
6.130% due 09/15/2026		13,341	13,381
Dewolf Park CLO Ltd.			
6.575% due 10/15/2030		3,617	3,608
Diamond Infrastructure Funding LLC			
1.760% due 04/15/2049		900	768
Elmwood CLO VIII Ltd.			
6.917% due 01/20/2034		6,600	6,574
FAB CBO BV			
4.941% due 08/20/2080 (b)	EUR	52	54
Finance of America Structured Securities Trust			
2.000% due 04/25/2073	USD	5,198	5,016
3.000% due 09/25/2061		14,495	13,399
Galaxy Xxviii CLO Ltd.			
6.755% due 07/15/2031		9,809	9,770
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.			
5.000% due 03/12/2038	CAD	8,182	4,981
Goldentree Loan Management U.S. CLO 6 Ltd.			
6.736% due 04/20/2035	USD	1,700	1,685
Goodgreen			
3.930% due 10/15/2053		4,058	3,693
Goodleap Sustainable Home Solutions Trust			
6.500% due 07/20/2055		877	854
Harley Marine Financing LLC			
6.682% due 05/15/2043		4,742	4,446
Humboldt Americas LLC			

0.000% due 10/31/2031 KKR CLO 18 Ltd.	COP	62,570,000	14,021
6.597% due 07/18/2030 LCM XVII LP	USD	1,335	1,331
6.785% due 10/15/2031 LoanCore Issuer Ltd.		33,700	33,579
6.749% due 07/15/2036		2,350	2,321
6.749% due 11/15/2038 Lockwood Grove CLO Ltd.		19,100	18,624
6.810% due 01/25/2030 Magnetite XV Ltd.		3,484	3,487
6.650% due 07/25/2031 MAN Euro CLO DAC		30,132	30,034
TBD% due 10/15/2036 (d) METAL LLC	EUR	20,000	21,140
4.581% due 10/15/2042 MF1 LLC	USD	10,563	6,510
7.484% due 06/19/2037		22,100	22,080
7.969% due 09/17/2037		9,600	9,660
7.984% due 06/19/2037		8,236	8,215
MKS CLO Ltd.			
6.867% due 01/20/2031		13,039	13,047
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
MMcapS Funding XVII Ltd.			
6.021% due 12/01/2035	USD	518	495
Nassau Ltd.			
6.805% due 07/15/2031		3,836	3,821
National Collegiate Student Loan Trust			
5.792% due 10/25/2033		2,336	2,301
Navient Private Education Loan Trust			
6.349% due 11/15/2068		1,194	1,181
7.599% due 12/15/2045		2,087	2,098
Nelnet Student Loan Trust			
6.235% due 09/25/2065		2,128	2,113
6.640% due 02/20/2041		6,296	6,230
Octagon Investment Partners 33 Ltd.			
6.867% due 01/20/2031		9,874	9,864
Octagon Loan Funding Ltd.			
6.821% due 11/18/2031		395	395
Pagaya AI Debt Trust			
7.179% due 04/15/2031		13,040	13,051
7.600% due 12/16/2030		5,506	5,523
7.625% due 04/15/2031		3,300	3,297
Palmer Square CLO Ltd.			
6.963% due 10/20/2033		23,100	23,096
Palmer Square European Loan Funding DAC			
TBD% due 05/15/2033 (d)	EUR	9,200	9,724
Rad CLO 1 Ltd.			
6.635% due 07/15/2031	USD	11,124	11,100
Rockford Tower Europe CLO DAC			
4.933% due 12/20/2031	EUR	11,755	12,268
Sapphire Aviation Finance I Ltd.			
4.250% due 03/15/2040	USD	9,365	7,822
Saranac CLO III Ltd.			
7.258% due 06/22/2030		16,400	16,425
Saratoga Investment Corp. CLO Ltd.			
7.238% due 04/20/2033		15,000	14,928
SMB Private Education Loan Trust			
TBD% due 09/15/2053 (d)		20,504	20,585
0.000% due 02/16/2055		3	4,060
3.940% due 02/16/2055		20,138	18,587
4.550% due 02/16/2055		8,414	7,672
4.950% due 02/16/2055		2,185	1,944
5.950% due 02/16/2055		3,907	3,626
6.150% due 09/15/2053 (d)		12,645	12,695
6.770% due 02/16/2055		20,138	19,997

6.930% due 09/15/2053 (d)		5,933	5,956
7.540% due 09/15/2053 (d)		1,205	1,210
8.870% due 09/15/2053 (d)		2,505	2,513
Sound Point CLO XV Ltd.			
6.574% due 01/23/2029		318	319
Sound Point CLO XVIII Ltd.			
6.797% due 01/21/2031		5,111	5,082
Sound Point Euro CLO IV Funding DAC			
5.065% due 01/15/2035	EUR	20,000	20,829
Symphony CLO 39 Ltd.			
7.002% due 04/25/2034	USD	24,800	24,799
Taberna Preferred Funding I Ltd.			
6.146% due 07/05/2035		3,045	2,771
Theorem Funding Trust			
6.060% due 12/15/2028		4,304	4,268
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
4.212% due 05/17/2032		326	302
TRESTLES CLO V Ltd.			
6.847% due 10/20/2034		8,025	7,941
Tropic CDO V Ltd.			
5.975% due 07/15/2036		10,163	9,400
TRTX Issuer Ltd.			
6.971% due 02/15/2039		4,500	4,382
TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
6.826% due 03/30/2039		17,495	16,926
7.229% due 09/20/2039		2,626	2,540
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Upstart Pass-Through Trust			
3.800% due 04/20/2030	USD	15,609	15,014
Upstart Securitization Trust			
5.500% due 06/20/2032		6,632	6,469
Venture 39 CLO Ltd.			
6.935% due 04/15/2033		4,600	4,569
Venture XVII CLO Ltd.			
6.535% due 04/15/2027		10,245	10,197
アセットバック証券合計			766,915
(取得原価 785,820千米ドル)			
ソブリン発行体 6.6%			
Argentina Government International Bond			
0.750% due 07/09/2030		66,427	17,871
1.000% due 07/09/2029		4,943	1,330
3.500% due 07/09/2041		58,125	15,285
3.625% due 07/09/2035		51,459	12,427
3.625% due 07/09/2046		1,035	258
4.250% due 01/09/2038		25,740	7,786
Argentine Bonos del Tesoro			
15.500% due 10/17/2026	ARS	49,200	12
Asian Development Bank			
4.700% due 03/12/2024	MXN	18,100	976
Australia Government Bond			
1.750% due 06/21/2051	AUD	38,100	11,753
Autonomous City of Buenos Aires Argentina			
119.035% due 02/22/2028	ARS	76,810	103
126.571% due 03/29/2024		62,559	79
Israel Government International Bond			
3.800% due 05/13/2060	USD	17,000	10,475
4.500% due 04/03/2120		3,800	2,513
5.000% due 10/30/2026	EUR	119,500	126,171
Mexico Government International Bond (i)			
2.750% due 11/27/2031	MXN	1,229,193	56,573
3.000% due 12/03/2026		119,106	5,976
4.000% due 11/30/2028		685,870	35,408
Peru Government International Bond			
5.400% due 08/12/2034	PEN	862	188
6.150% due 08/12/2032		674	161

6.950% due 08/12/2031		150	38
Provincia de Buenos Aires			
128.738% due 04/12/2025	ARS	399,853	424
Romania Government International Bond			
1.750% due 07/13/2030	EUR	12,200	9,855
2.125% due 03/07/2028		1,100	1,012
2.875% due 04/13/2042		7,300	4,552
5.500% due 09/18/2028		7,400	7,793
6.375% due 09/18/2033		14,800	15,436
Russia Government International Bond			
4.250% due 06/23/2027	USD	28,400	15,336
4.375% due 03/21/2029		200	100
4.750% due 05/27/2026		23,800	16,145
5.100% due 03/28/2035		3,200	1,136
5.250% due 06/23/2047		82,400	30,076
5.625% due 04/04/2042		37,000	24,884
5.875% due 09/16/2043		13,200	8,307
7.150% due 11/12/2025	RUB	4,002,466	17,537
7.500% due 03/31/2030	USD	4,748	3,111
7.950% due 10/07/2026	RUB	1,564,954	6,146
South Africa Government International Bond			
10.500% due 12/21/2026	ZAR	2,032,400	111,719
State Agency of Roads of Ukraine			
6.250% due 06/24/2030	USD	1,200	312
Turkey Government International Bond			
4.250% due 03/13/2025		17,980	17,229
5.250% due 03/13/2030		29,000	24,021
6.125% due 10/24/2028		10,100	9,169
7.625% due 04/26/2029		30,900	29,481
Turkiye Ihracat Kredi Bankasi A/S			
8.250% due 01/24/2024		3,000	3,009
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Ukraine Government International Bond			
4.375% due 01/27/2032	EUR	1,658	402
7.750% due 09/01/2025	USD	4,390	1,358
Venezuela Government International Bond (b)			
6.000% due 12/09/2049		3,367	523
7.000% due 03/31/2038		1,883	324
7.650% due 04/21/2025		5,349	947
7.750% due 04/13/2024		1,200	187
8.250% due 10/13/2024		5,991	1,053
9.000% due 05/07/2049		3,161	566
9.250% due 09/15/2027		4,274	813
9.250% due 05/07/2028		6,512	1,224
11.750% due 10/21/2026		680	134
11.950% due 08/05/2031		6,000	1,176
ソブリン発行体合計			670,880
(取得原価 866,448千米ドル)			
		証券数	
普通株式 0.7%			
Cairo Mezz PLC		847,444	94
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		5,292,182	5,821
Constellation Oil Services Holding S.A.		421,249	46
Corestate Capital Holding S.A.		2,742,788	0
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.		5,318,911	8,685
iHeartMedia, Inc. Class A		1,246,745	2,930
iHeartMedia, Inc. Class B		967,427	2,046
Intelsat S.A.		966,065	26,837
National Bank of Greece S.A.		102,570	587
Neiman Marcus Group Ltd. LLC		151,112	19,868
Serta Simmons Bedding LLC		56	1
SSB Manufacturing Co.		56	1
Stearns Holdings LLC		110,747	0
UBS Group AG		26,741	628
Voyager Aviation Holdings LLC		616	0
WestMet Group Holdings LLC		8,915	42

Westmoreland Mining Holdings LLC		8,837	53
Windstream Holdings II LLC		226,019	4,705
普通株式合計			72,344
(取得原価 163,628千米ドル)			
商業不動産証券 0.2%			
CBL & Associates Properties, Inc.		6	124
Uniti Group, Inc.		81	374
VICI Properties, Inc.		760	21,217
商業不動産証券合計			21,715
(取得原価 6,172千米ドル)			
エクイティリンク証券 0.0%			
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
12/31/2049		211	1,963
エクイティリンク証券合計			1,963
(取得原価 0千米ドル)			
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
ワラント 0.0%			
Intelsat S.A.			
02/17/2027		26	72
Stearns Holdings LLC			
12/31/2049		1	0
ワラント合計			72
(取得原価 20,656千米ドル)			
優先証券 0.0%			
Cayenne Aviation LLC			
9.500%		3,693	0
優先証券合計			0
(取得原価 1,210千米ドル)			
		額面 (千通貨)	
短期金融商品 5.0%			
定期預金 0.5%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.000% due 11/01/2023	AUD	764	484
3.850% due 11/01/2023	NZD	2	1
4.830% due 11/01/2023	USD	1	1
Bank of Nova Scotia			
4.080% due 11/01/2023	CAD	543	391
4.830% due 11/01/2023	USD	593	593
BNP Paribas Bank			
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	68	1
0.550% due 11/01/2023	CHF	16	17
3.000% due 11/01/2023	AUD	501	317
3.330% due 11/01/2023	NOK	12	1
3.850% due 11/01/2023	NZD	1	0
4.420% due 11/01/2023	GBP	1	1
6.430% due 11/01/2023	ZAR	10,398	555
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.370%) due 11/01/2023	JPY	3,630	24
2.750% due 11/01/2023	DKK	3	1
3.100% due 11/01/2023	EUR	1	1
4.420% due 11/01/2023	GBP	23	28
4.830% due 11/01/2023	USD	42	42
Citibank N.A.			
4.830% due 11/01/2023		2,499	2,499
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 11/01/2023		2,137	2,137
DnB Bank ASA			
2.990% due 11/01/2023	SEK	4	0
HSBC Bank PLC			
3.100% due 11/01/2023	EUR	1,097	1,159
4.420% due 11/01/2023	GBP	66	80
JPMorgan Chase Bank N.A.			

4.830% due 11/01/2023 MUFG Bank Ltd. (0.370%) due 11/01/2023 Royal Bank of Canada	USD	4,550	4,550
4.830% due 11/01/2023 Sumitomo Mitsui Banking Corp. (0.370%) due 11/01/2023	JPY	38,019	251
3.100% due 11/01/2023	EUR	10,789	11,404
4.830% due 11/01/2023 Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. (0.370%) due 11/01/2023	USD	253	253
3.100% due 11/01/2023	JPY	927,721	6,126
4.420% due 11/01/2023	EUR	4,002	4,230
4.830% due 11/01/2023	GBP	3,526	4,279
	USD	5,810	5,810
			46,785
		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
アルゼンチン短期国債 0.1% (32.511%) due 05/20/2024 (k) (17.783%) due 11/23/2023 (j)	ARS	551,156	797
		4,688,282	8,139
			8,936
日本短期国債(j) 4.4% (0.234%) due 01/15/2024 (0.216%) due 01/22/2024	JPY	34,990,000	231,136
		34,000,000	224,605
			455,741
短期金融商品合計 (取得原価 518,529千米ドル)			511,462
有価証券投資合計(a) 148.7% (取得原価 16,679,350千米ドル)			15,268,043
金融デリバティブ商品 0.0% (取得原価またはプレミアム(純額) 19,837千米ドル)			1,772
その他の資産および負債(純額) (48.7%)			(5,000,688)
純資産 100.0%			10,269,127

投資有価証券明細表に対する注記：

* 額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(a)2023年10月31日現在の純資産に対する地域別投資割合は、米国112.9%、英国7.1%、その他28.7%です。

(b)当該証券は、デフォルト状態にあります。

(c)この金額の全部または一部は、未実行のローン・コミットメントです。未実行部分の利率は、実行時に決定されます。未実行のローン・コミットメントの詳細については、「財務諸表注記4証券およびその他の投資有価証券」をご参照ください。

(d)発行時決済証券です。

(e)偶発転換社債です。

(f)永久債の償還日は、コール日を記載しています。

(g)ペイメント・イン・カインド債券です。当該債券は、利息支払いに現金ではなく現物債を充当できる債券です。

(h)当該証券は、インタレスト・オンリー(「IO」)またはIOストリップです。

(i)当該証券の額面金額は、インフレ調整後のものです。

(j)利率は満期までの利回り(加重平均)です。

(k)利率は満期までの利回りです。

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

(2024年8月30日現在)

資本金の額	20億円	
発行する株式総数	100,000株	(普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株	(普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能		

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用(投資運用業)ならびにその受益証券(受益権)の募集又は私募(第二種金融商品取引業)を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

2024年8月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除く)

基本的性格	本数	純資産総額(単位:円)
追加型公社債投資信託	26	1,455,299,141,596
追加型株式投資信託	770	16,616,529,639,752
単位型公社債投資信託	21	30,883,481,518
単位型株式投資信託	194	1,065,722,864,899
合計	1,011	19,168,435,127,765

(3)【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

5【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,127	1,093
建物	1 1,001	1 918
器具備品	1 118	1 130
リース資産	1 7	1 5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	5,021	4,495
ソフトウェア仮勘定	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

(単位:百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	1	2,400	1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		-
特別利益計		4		-
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		-
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		-	2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,461
当期末残高	0	0	79,034

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	1,812
当期末残高	0	0	80,846

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

(1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

（損益計算書関係）

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（百万円）

	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2024年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引(為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引)を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。

投資有価証券は、主にその他有価証券(投資信託)、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰りを確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第38期(2023年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

第39期(2024年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	1	-	-

第39期(2024年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

第39期（2024年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（預金・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(第38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第38期(2023年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額180百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第39期(2024年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について584百万円(関係会社株式584百万円)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	44	40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において24百万円、当事業年度において6百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	1.00% ~ 3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103百万円、当事業年度104百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額(一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額(税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	-	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.69 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ(以下「MHFG」という)及び第一生命ホールディングス株式会社(以下「第一生命」という)の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率(議決権比率)

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(4) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,228百万円	3,837百万円

（資産除去債務関係）

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
合計	113,962百万円	121,507百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（1）サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

（持分法損益等）

当社はPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	8,140	未払 手数料	1,870
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,655	未払 手数料	3,137

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79銭

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

(注1) A種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

独立監査人の監査報告書

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長 谷 川 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲 葉 宏 和

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月1日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 森重俊寛
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号の2024年2月27日から2024年8月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号の2024年8月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月27日から2024年8月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。