

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年6月17日提出
【計算期間】	第37特定期間(自 2024年9月18日至 2025年3月17日)
【ファンド名】	日興スリートップ（隔月分配型）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日にアモーヴァ・ア セットマネジメント株式会社へ変更
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	050-5785-6187
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

世界の債券および株式に投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単体型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外

目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回			()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ		
資産複合 (その他資産(投資 信託証券(株式、 債券)))		中近東 (中東)		
資産配分固定型		エマージング		
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
 資産複合 資産配分固定型(その他資産(投資信託証券(株式、債券)))
 当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行いません。
 「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
 年6回(隔月)
 目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。
 グローバル(含む日本)
 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
 ファンド・オブ・ファンズ
 「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
 為替ヘッジなし
 目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。
 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの特色

**特色
1**

**世界の債券および株式に幅広く分散投資を行ない、
収益の源泉を分散するとともに、
高水準のインカムを追求します。**

**特色
2**

**奇数月（原則15日）に決算を行ない、
安定的な分配を行なうことをめざします。**

- ◆組入債券や株式の利子・配当等収益を原資として分配を行ないます。
※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行わない場合もあります。

**特色
3**

**各資産の運用については、各分野において
世界屈指のマネージャーを選抜しました。**

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

特色
1

**世界の債券および株式に幅広く分散投資を行ない、
収益の源泉を分散するとともに、高水準のインカムを追求します。**

- ◇世界の債券や株式などで運用を行なう投資信託証券などをバランスよく組み合わせることにより、マーケット環境などに左右されにくい、安定した資産の成長をめざします。
- ◇SMBCグローバルインベストメント&コンサルティングの助言に基づき、資産配分比率を随時見直しします。
- ◇外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。

当ファンドの基本ポートフォリオ



※上記は基本ポートフォリオ(2024年9月末現在)であり、実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

【ご参考】各資産の特性

① 高格付債券



景気が後退する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

② 世界株式、 世界高配当株式



景気が回復する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

③ 高利回り債券、 新興国債券



景気が拡大する局面において、良好なパフォーマンスが期待できます。

※上記はイメージ図であり、将来の運用成果などを約束するものではありません。

特色
2

**奇数月(原則15日)に決算を行ない、
安定的な分配を行なうことをめざします。**

分配方針

隔月に安定的な分配を行なうことをめざします。

- ◇インカム収益(組入債券や組入株式の利子・配当等収益)を原資として、毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各15日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に安定した収益を行なうことをめざします。
- ◇更に、毎年1月および7月の決算時には、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額に加えて、値上がり益を積極的に分配する場合があります。

分配のイメージ



※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行わない場合もあります。

※上図はイメージであり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

特色
3

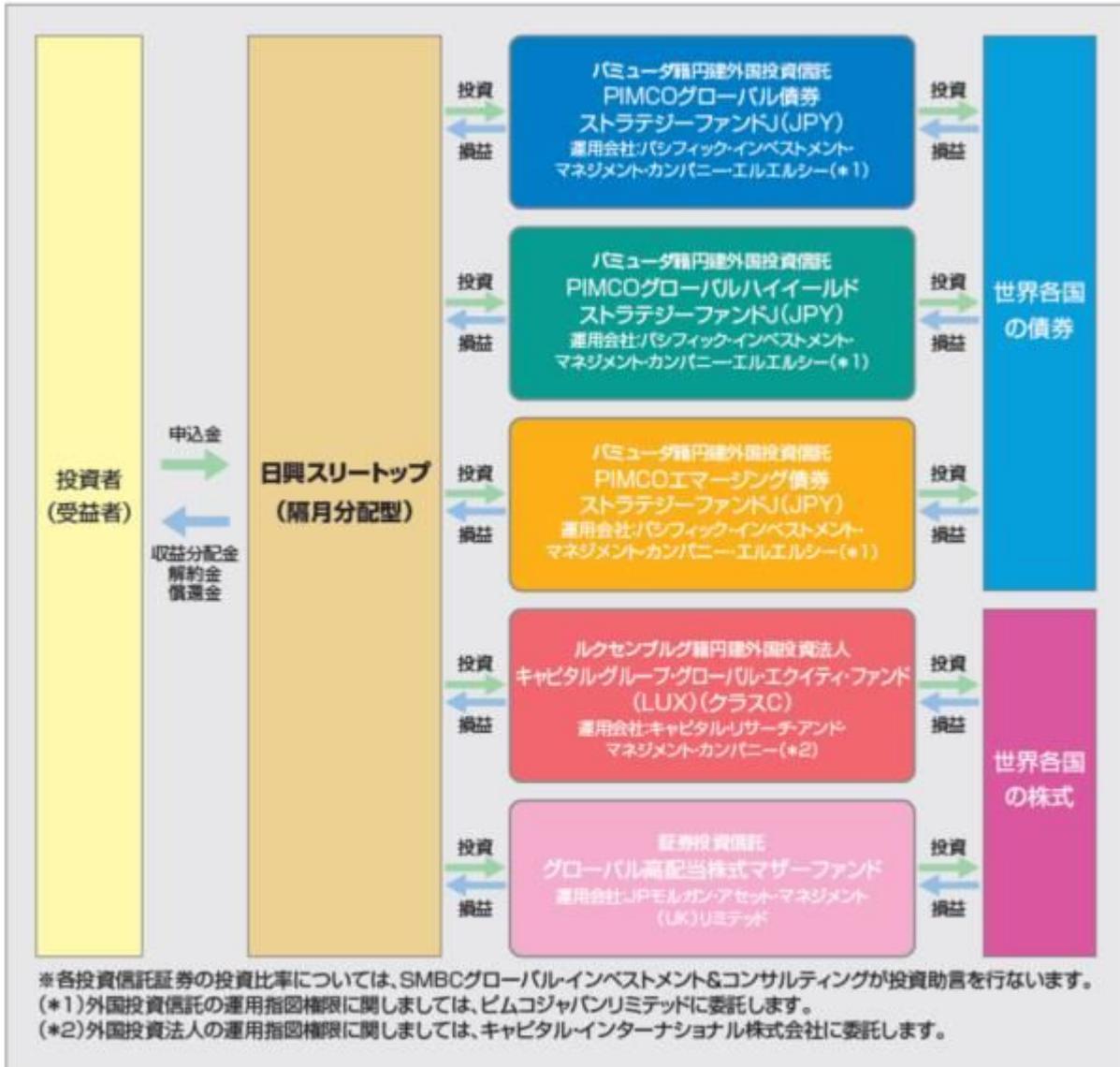
各資産の運用については、
各分野において世界屈指のマネージャーを選抜しました。

各資産への投資比率については、
SMBCグローバル・インベストメント&コンサルティング株式会社(SGIC)の助言を
もとに、日興アセットマネジメントが最適と考える資産配分を行ないます。



ファンドの仕組み

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



(主な投資制限)

- 投資信託証券、短期社債等、コマーシャルペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(分配方針)

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※ 上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりか小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



- ・ 普通分配金：個別元本（投資者のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、（特別分配金）元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※ 元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

信託金限度額

- ・ 2兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

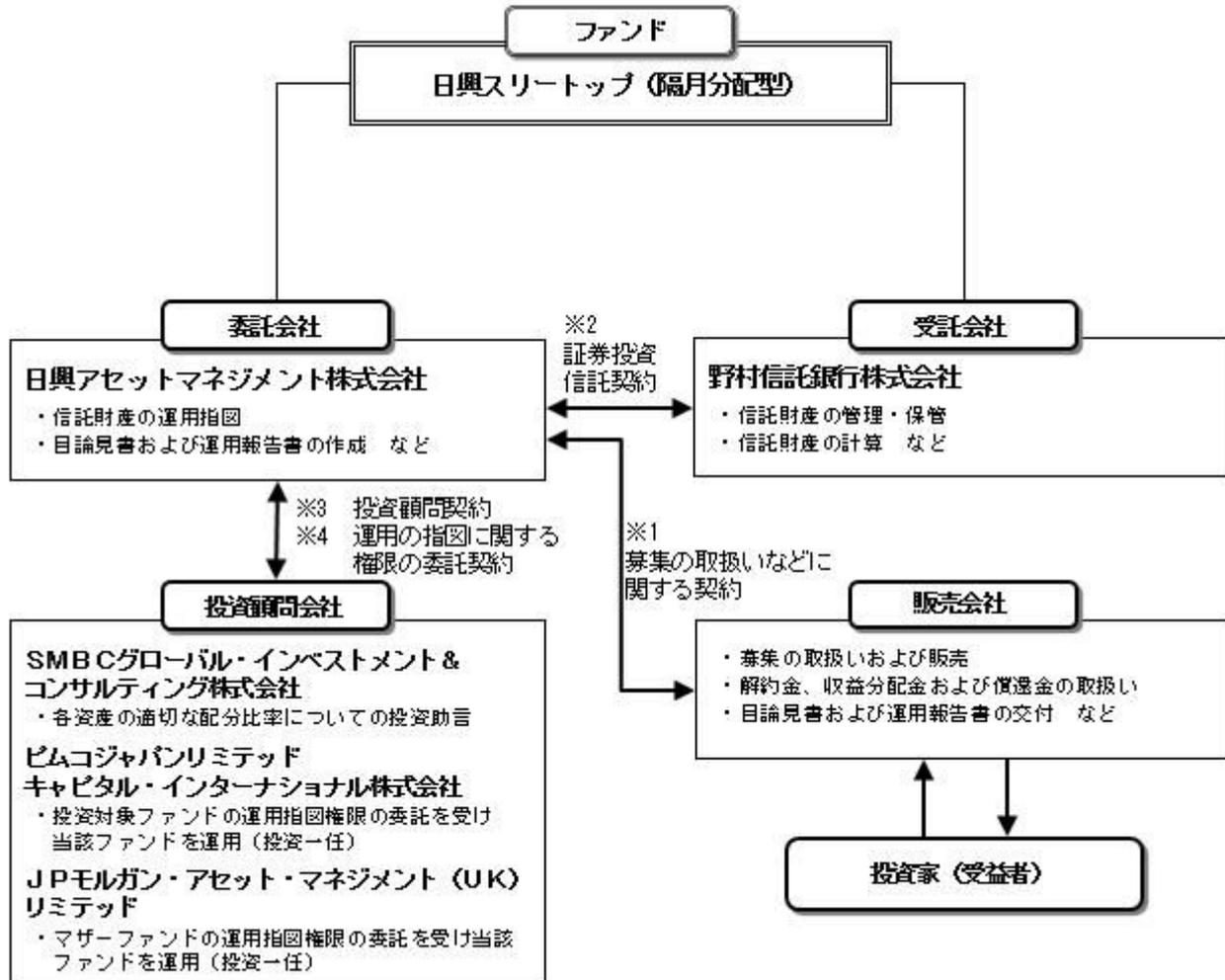
(2) 【ファンドの沿革】

2006年10月31日

- ・ ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

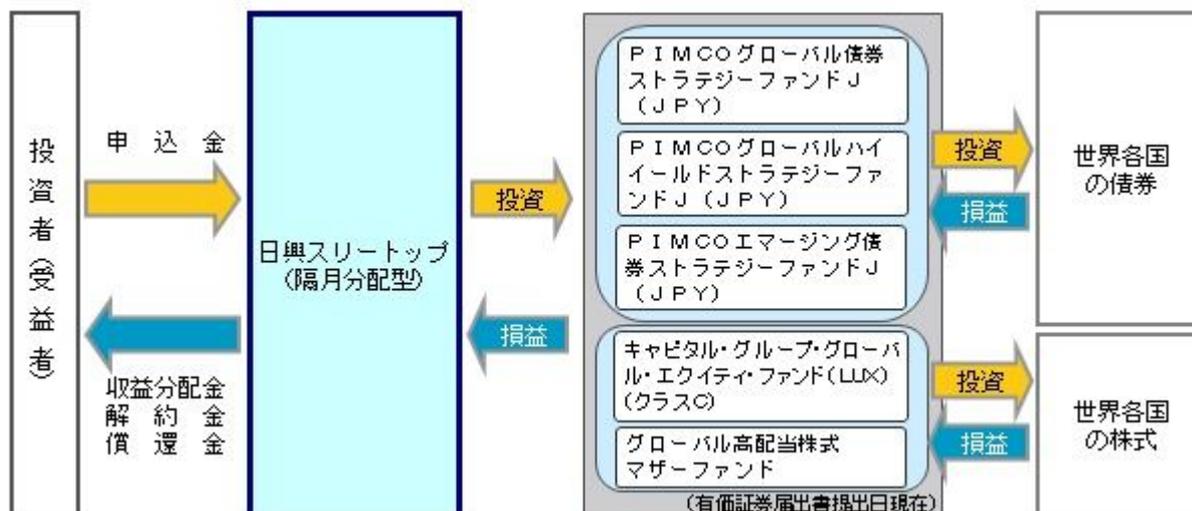
ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。
- 4 投資顧問会社に運用の指図に関する権限を委託するにあたり、そのルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。委託する業務内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

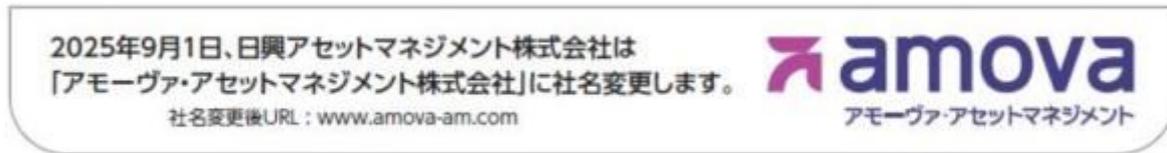
<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



委託会社の概況（2025年3月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
2025年：「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更予定



3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、別に定める投資信託証券の一部、またはすべてに分散投資を行ない、インカム収益の確保を図るとともに、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ・投資信託証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性などを勘案して決定します。なお、資金動向などによっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることがあります。
- ・別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価などを勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準になったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

主として別に定めるマザーファンドの受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

投資対象とする投資信託証券の概要

- < P I M C O グローバル債券ストラテジーファンド J (J P Y) > (バミューダ籍円建外国投資信託)
- < P I M C O グローバルハイイールドストラテジーファンド J (J P Y) > (バミューダ籍円建外国投資信託)
- < P I M C O エマージング債券ストラテジーファンド J (J P Y) > (バミューダ籍円建外国投資信託)

名称	PIMCO グローバル債券 ストラテジーファンドJ (JPY)	PIMCO グローバルハイイールド ストラテジーファンドJ (JPY)	PIMCO エマージング債券 ストラテジーファンドJ (JPY)
運用の基本方針			
基本方針	トータルリターンを最大化をめざして運用を行いません。		
主な投資対象	通常、ファンドの純資産総額の90%以上を、日本を除く3カ国以上の発行体が発行する債券などに投資します。	通常、ファンドの純資産総額の3分の2以上を、ユーロ建やその他の欧州通貨建あるいは米ドル建のハイイールド債券などに投資します。	通常、ファンドの純資産総額の3分の2以上を、新興国（過去5年連続で高所得のOECD諸国として世界銀行に分類されている国々以外の各国。以下同じ。）の債券、通貨などに分散投資を行いません。
	投資可能な債券は、以下のものを含まず。 ・各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ・社債 ・政府および企業が発行したインフレ連動債 ・仕組債 ・ローンおよびローン・パーティシペーション ・譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ・現先取引および逆現先取引 ・国際機関の債券 など		
投資方針	ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。	ICE BofAメリルリンチ米国ハイイールド・マスター・コンストレインド・インデックス50% + ICE BofAメリルリンチ・ヨーロッパ・カレンシー・ハイイールド・コンストレインド・インデックス50%（ヘッジなし・円ベース）で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。	J P モルガン・エマージング・ローカル・マーケット・インデックス・プラス50% + J P モルガン・G B I - E M グローバル・ディバースファイド50%（ヘッジなし・円ベース）で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。
	外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。		
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 原則として投資時において、B a a 格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含まず。以下同じ。）以上の債券などに投資します。 ポートフォリオの平均格付は、原則としてA a 格以上とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 原則として純資産総額の3分の2以上をB a a 格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含まず。以下同じ。）未満の債券などに投資します。 ポートフォリオの平均格付は、原則としてB 格以上とします。 	<ul style="list-style-type: none"> 純資産総額の3分の2以上を、新興国の債券、通貨などに分散投資を行いません。 B 格（ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含まず。）未満の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の15%まで可能とします。 ファンドの平均デュレーションは、通常環境では、0年から8年の範囲を超えないものとします。
	<ul style="list-style-type: none"> ファンドの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーション±2年以内で変動させるものとします。 エマージング国の発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の10%まで可能とします。 		

	<ul style="list-style-type: none"> ・1つの発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の5%を限度として投資することができます。ただし、各国政府、その政府の部局、政府系機関、政府系企業が発行し、または保証した債券などは、この限りではありません。また、クレジットリンク債、クレジット・デリバティブなどについては、参照資産を基礎として上記投資割合を算出します。 ・ファンドは、全体のポートフォリオ運用戦略の一環として、または債券価格の下落を相殺するために、空売りを行なうことができます。 ・ファンドは、先物取引などの派生商品に投資をすることができます。 ・借入れの合計金額が各ファンドの純資産総額の10%を越える借入残高が生じる借入れは行なえないものとします。 ・流動性の乏しい証券への投資は、ファンドの純資産総額の15%までとします。 ・優先株式などの有価証券に投資を行なう場合があります。
収益分配	毎月、利子収入および売買益などから分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。

ファンドに係る費用

信託報酬など	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用など。

その他

投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
管理会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー
信託期間	無期限（2006年10月31日設定）
決算日	原則として、毎年6月末日

上記の投資対象とする投資信託証券については、日々の基準価額が取得できるため、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、当ファンドにおいてデリバティブ取引等の投資制限に係る管理を行ないます。

<キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC）>（ルクセンブルグ籍円建外国投資法人）

運用の基本方針

基本方針	主として世界の株式に投資を行ない、長期的な元本の成長をめざします。
主な投資対象	<p>主として以下の譲渡性証券およびマネーマーケット商品に投資します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・適格国の金融商品取引所に上場しているもの。 <p>（適格国：MSCIワールドインデックスに随時組み入れられる国およびルクセンブルグ。以下同じ。）</p> <ul style="list-style-type: none"> ・その他の規制ある市場で取引されているもの。 ・発行後1年以内に上記いずれかの要件を満たすもの。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・原則として、適格国の公の金融商品取引所に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている世界の様々な国々の普通株式または普通株式の特性を有する譲渡性証券に投資を行ないます。 ・また、経済、社会、政治的展開、為替変動リスク、諸国の市場の流動性に然るべき配慮をしながら、主として世界先進諸国の企業の株式などの証券に重点をおいて投資を行ないます。 ・市場環境に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<p>以下の投資は行ないません。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・貴金属、市況商品あるいはそれらを表象する証券。 ・不動産またはこれに関わるオプション、権利もしくは権益。ただし、不動産もしくはその権益によって担保される証券または不動産もしくはその権益への投資を行なう企業によって発行される証券への投資は行ないません。 ・証券を信用で買い付けないものとします（組入れ証券売買の決済のため必要な短期与信を除きます。）。また、マネーマーケット商品、その他の金融資産においても、空売りまたはショート・ポジションによる投資を行ないません。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬など	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	事務管理費用、資産の保管費用、有価証券売買時の売買委託手数料、設立に係る費用、法律顧問費用、監査費用、信託財産に関する租税など。

その他

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
--------	-----------------------------

副投資顧問会社	キャピタル・インターナショナル・エス・エイ・アール・エル
管理会社	キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル
信託期間	無期限
決算日	原則として、毎年12月末日

上記の投資対象とする投資信託証券については、日々の基準価額が取得できるため、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、当ファンドにおいてデリバティブ取引等の投資制限に係る管理を行いません。

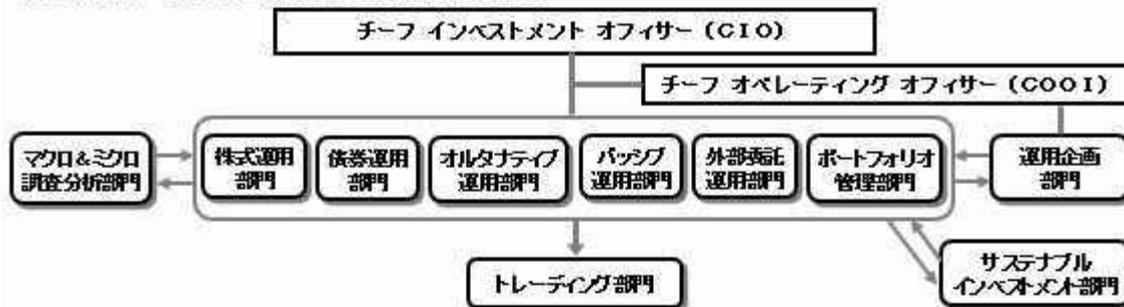
<グローバル高配当株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主な投資対象	世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・相対的に配当利回りが高く、かつ中長期的な増配および値上がりの期待できる世界各国（日本を含みます。）の株式に分散投資を行なうことで、安定的な配当収入の確保と信託財産の成長をめざします。 ・株式の銘柄選定にあたっては、各銘柄毎の配当利回り水準、配当余力に加えて、各国市況動向や、各銘柄毎のファンダメンタルズ、割安性、流動性などの分析も行ない投資を行いません。 ・株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行いません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	野村信託銀行株式会社
投資顧問会社	J P モルガン・アセット・マネジメント（UK）リミテッド（投資一任）
信託期間	無期限（2006年10月31日設定）
決算日	毎年9月15日（休業日の場合は翌営業日）

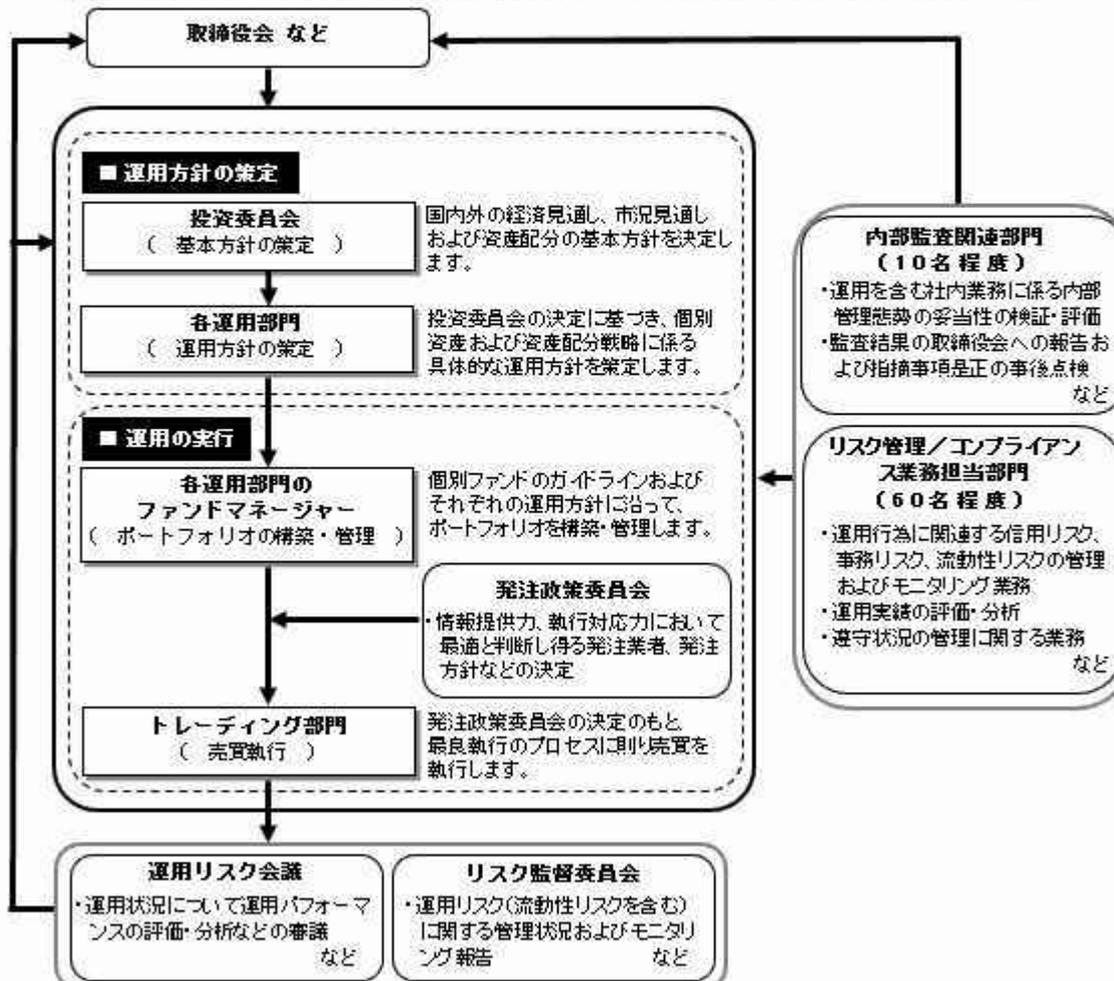
（3）【運用体制】

<委託会社における運用体制>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

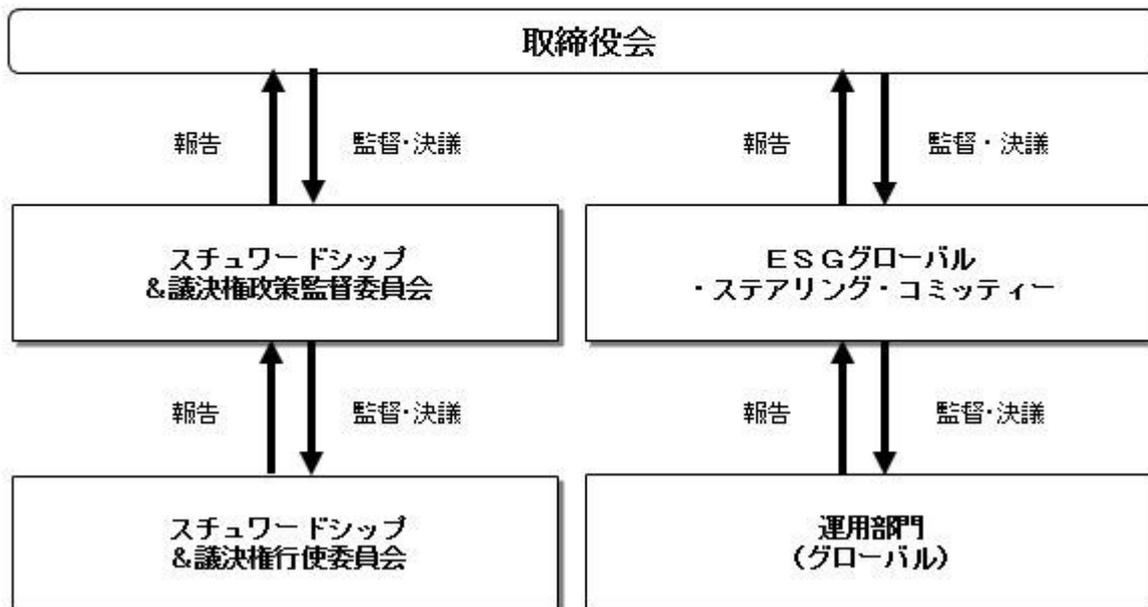
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行ないます。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行っております。

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



上記体制は2025年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
- 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託会社が決定する金額を付加して分配を行なう場合があります。
- 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないません。

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

<分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券またはマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・ 投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・ 一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ 一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・ 一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

流動性リスク

- ・ 市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・ 一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

- ・ 一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格が大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ 一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・ 一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・ 格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

- ・ 外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
 - ・ 一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。
- #### カントリー・リスク
- ・ 投資対象国における非常事態など(金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
 - ・ 一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延

する場合があります。

- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

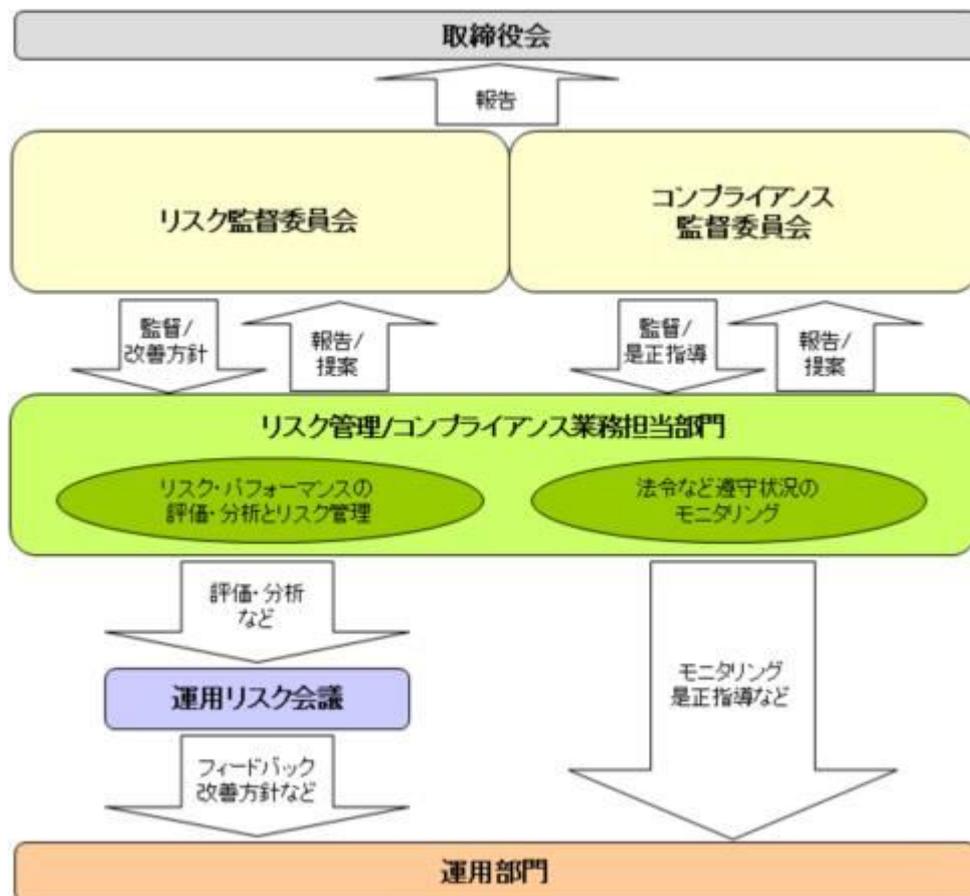
ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項
諸事情により、投資対象とする投資信託証券にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。
ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取り扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社もしくは運用委託先またはこれらの関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社もしくは運用委託先またはこれらの関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制

<委託会社におけるリスク管理体制>



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

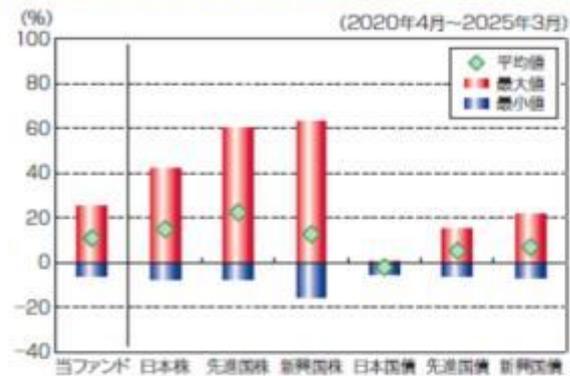
法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2025年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%))

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	11.0%	14.9%	22.5%	12.7%	-2.0%	5.3%	6.9%
最大値	25.5%	42.1%	59.8%	62.7%	0.6%	15.3%	21.5%
最小値	-6.2%	-7.1%	-7.4%	-15.2%	-5.5%	-6.1%	-7.0%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2020年4月から2025年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

新興国株……MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込み、円ベース)

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルレティバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※上記各指数の著作権等の知的財産権その他一切の権利は、各指数の算出元または公表元に帰属します。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX(東証株価指数)配当込み

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

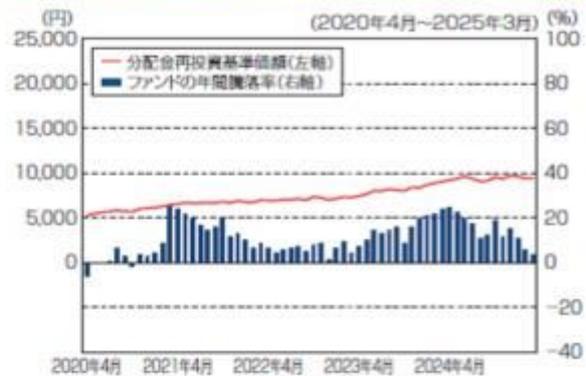
NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2020年4月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】**(1)【申込手数料】**

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。
 - ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
 - ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
 - ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができます場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.4663%（税抜1.333%）の率を乗じて得た額とします。
信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
1.333%	0.793%	0.510%	0.030%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4)【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。
目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）

す。）。
 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
 ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
 格付の取得に要する費用。
 ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

- 「PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド」(JPY)
- 「PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド」(JPY)
- 「PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド」(JPY)
- ・有価証券売買時の売買委託手数料
- ・先物・オプション取引に要する費用 など

「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)(クラスC)」

- ・事務管理費用
- ・資産の保管費用
- ・有価証券売買時の売買委託手数料
- ・設立に係る費用
- ・法律顧問費用
- ・監査費用
- ・信託財産に関する租税 など

「グローバル高配当株式マザーファンド」

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

- ・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度(NISA)の適用対象となります。
- ・当ファンドは、NISAの対象ではありません。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

* 解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。）を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損（譲渡損失）については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限り）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

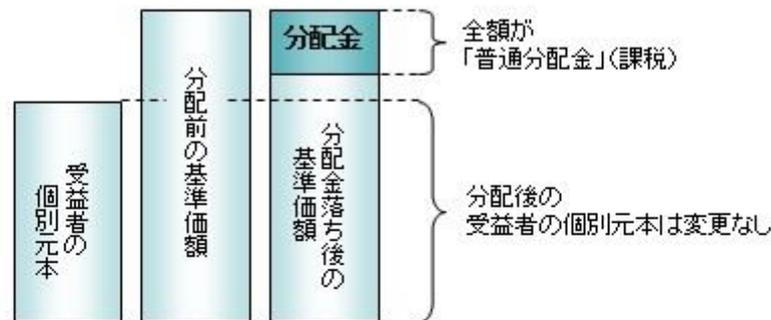
- 1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

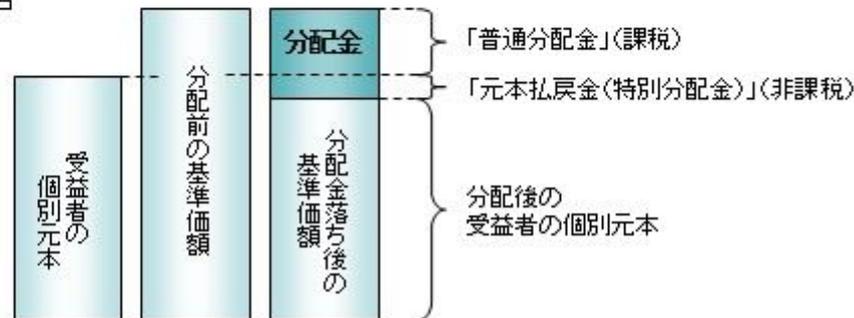
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2025年6月17日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2024年9月18日~2025年3月17日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.57%	1.46%	0.11%

※対象期間の運用管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みます。

※投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【日興スリートップ(隔月分配型)】

以下の運用状況は2025年3月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	バミューダ	14,644,641,223	67.07
投資証券	ルクセンブルク	2,808,420,128	12.86
親投資信託受益証券	日本	4,063,073,761	18.61
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		318,437,465	1.46
合計（純資産総額）		21,834,572,577	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
バミューダ	投資信託受益証券	PIMCOグローバルハイールド ストラテジーファンドJ（JPY）	1,440,759	4,812.21	6,933,234,867	4,860	7,002,088,740	32.07
日本	親投資信託受益証券	グローバル高配当株式マザーファンド	871,623,675	4.6781	4,077,542,715	4.6615	4,063,073,761	18.61
バミューダ	投資信託受益証券	PIMCOグローバル債券ストラ テジーファンドJ（JPY）	1,323,411	2,977.17	3,940,019,526	3,025	4,003,318,275	18.33
バミューダ	投資信託受益証券	PIMCOエマージング債券ストラ テジーファンドJ（JPY）	1,761,488	2,070.1	3,646,456,308	2,066	3,639,234,208	16.67
ルクセンブルク	投資証券	キャピタル・グループ・グローバ ル・エクイティ・ファンド（LUX） （クラスC）	290,336	9,723.03	2,822,945,638	9,673	2,808,420,128	12.86

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	67.07
投資証券	12.86
親投資信託受益証券	18.61
合計	98.54

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第18特定期間末 （2015年 9月15日）	40,950	41,365	0.6899	0.6969
第19特定期間末 （2016年 3月15日）	35,555	35,949	0.6315	0.6385
第20特定期間末 （2016年 9月15日）	31,061	31,438	0.5768	0.5838
第21特定期間末 （2017年 3月15日）	32,078	32,432	0.6338	0.6408
第22特定期間末 （2017年 9月15日）	30,740	31,074	0.6458	0.6528
第23特定期間末 （2018年 3月15日）	28,206	28,522	0.6253	0.6323
第24特定期間末 （2018年 9月18日）	26,554	26,859	0.6099	0.6169

第25特定期間末	(2019年 3月15日)	25,651	25,949	0.6027	0.6097
第26特定期間末	(2019年 9月17日)	23,977	24,265	0.5819	0.5889
第27特定期間末	(2020年 3月16日)	20,519	20,792	0.5248	0.5318
第28特定期間末	(2020年 9月15日)	21,671	21,941	0.5616	0.5686
第29特定期間末	(2021年 3月15日)	22,194	22,455	0.5953	0.6023
第30特定期間末	(2021年 9月15日)	21,504	21,757	0.5956	0.6026
第31特定期間末	(2022年 3月15日)	20,058	20,306	0.5651	0.5721
第32特定期間末	(2022年 9月15日)	21,079	21,322	0.6080	0.6150
第33特定期間末	(2023年 3月15日)	19,866	20,105	0.5825	0.5895
第34特定期間末	(2023年 9月15日)	21,776	22,015	0.6373	0.6443
第35特定期間末	(2024年 3月15日)	22,502	22,738	0.6676	0.6746
第36特定期間末	(2024年 9月17日)	21,529	21,761	0.6498	0.6568
第37特定期間末	(2025年 3月17日)	21,746	21,975	0.6645	0.6715
	2024年 3月末日	23,075		0.6826	
	4月末日	23,464		0.6969	
	5月末日	23,415		0.6996	
	6月末日	23,883		0.7189	
	7月末日	23,057		0.6937	
	8月末日	22,307		0.6719	
	9月末日	22,187		0.6676	
	10月末日	23,170		0.6984	
	11月末日	22,450		0.6793	
	12月末日	22,935		0.7008	
	2025年 1月末日	22,671		0.6919	
	2月末日	22,106		0.6749	
	3月末日	21,834		0.6671	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	0.0210
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	0.0210
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	0.0210
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	0.0210
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	0.0210
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.0210
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.0210
第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	0.0210
第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.0210
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	0.0210
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	0.0210
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	0.0210
第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	0.0210

第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	0.0210
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	0.0210
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	0.0210
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	0.0210
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	0.0210
第36特定期間	2024年 3月16日～2024年 9月17日	0.0210
第37特定期間	2024年 9月18日～2025年 3月17日	0.0210

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	3.02
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	5.42
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	5.34
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	13.52
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	5.21
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	0.08
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	0.90
第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	2.26
第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	0.03
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	6.20
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	11.01
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	9.74
第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	3.58
第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	1.60
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	11.31
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	0.74
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	13.01
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	8.05
第36特定期間	2024年 3月16日～2024年 9月17日	0.48
第37特定期間	2024年 9月18日～2025年 3月17日	5.49

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第18特定期間	2015年 3月17日～2015年 9月15日	572,580,620	5,047,402,074
第19特定期間	2015年 9月16日～2016年 3月15日	697,582,559	3,750,226,166
第20特定期間	2016年 3月16日～2016年 9月15日	766,674,152	3,219,187,762
第21特定期間	2016年 9月16日～2017年 3月15日	717,886,483	3,954,039,839
第22特定期間	2017年 3月16日～2017年 9月15日	555,513,912	3,565,621,923
第23特定期間	2017年 9月16日～2018年 3月15日	517,129,806	3,015,426,652
第24特定期間	2018年 3月16日～2018年 9月18日	589,815,284	2,154,764,472
第25特定期間	2018年 9月19日～2019年 3月15日	749,727,050	1,729,004,466

第26特定期間	2019年 3月16日～2019年 9月17日	610,154,866	1,970,554,827
第27特定期間	2019年 9月18日～2020年 3月16日	712,695,420	2,817,658,635
第28特定期間	2020年 3月17日～2020年 9月15日	742,243,910	1,249,264,580
第29特定期間	2020年 9月16日～2021年 3月15日	568,881,376	1,877,695,308
第30特定期間	2021年 3月16日～2021年 9月15日	600,603,484	1,777,249,821
第31特定期間	2021年 9月16日～2022年 3月15日	588,398,109	1,199,513,588
第32特定期間	2022年 3月16日～2022年 9月15日	564,776,947	1,387,101,494
第33特定期間	2022年 9月16日～2023年 3月15日	628,354,741	1,191,336,475
第34特定期間	2023年 3月16日～2023年 9月15日	1,247,204,020	1,185,924,317
第35特定期間	2023年 9月16日～2024年 3月15日	769,387,816	1,234,695,316
第36特定期間	2024年 3月16日～2024年 9月17日	578,964,276	1,152,541,557
第37特定期間	2024年 9月18日～2025年 3月17日	692,661,172	1,097,840,208

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

以下の運用状況は2025年 3月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	130,654,156	3.22
	アメリカ	2,490,610,403	61.30
	カナダ	33,095,298	0.81
	ドイツ	169,696,113	4.18
	イタリア	43,440,941	1.07
	フランス	199,645,898	4.91
	オランダ	87,167,711	2.15
	スペイン	71,444,938	1.76
	オーストリア	19,847,788	0.49
	フィンランド	22,985,816	0.57
	アイルランド	228,884,532	5.63
	イギリス	109,877,174	2.70
	スウェーデン	61,288,205	1.51
	オーストラリア	54,313,857	1.34
	シンガポール	94,075,753	2.32
台湾	141,750,829	3.49	
小計		3,958,779,412	97.43
投資証券	アメリカ	29,339,439	0.72
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		74,932,088	1.84
合計（純資産総額）		4,063,050,939	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,446,537	0.11

売建	4,455,417	0.11
----	-----------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,393	64,481.99	218,787,410	56,638.17	192,173,331	4.73
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	2,015	85,607.43	172,498,975	86,234.16	173,761,842	4.28
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SPADR	半導体・半導体製造装置	5,737	26,823.68	153,887,463	24,708.18	141,750,829	3.49
アメリカ	株式	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	金融サービス	10,260	12,314.69	126,348,757	11,012.14	112,984,638	2.78
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	2,315	44,216.20	102,360,510	45,916.09	106,295,764	2.62
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	4,137	27,473.74	113,658,864	25,286.82	104,611,584	2.57
ドイツ	株式	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	保険	856	77,608.98	66,433,289	95,238.20	81,523,906	2.01
アメリカ	株式	ANALOG DEVICES INC	半導体・半導体製造装置	2,659	34,045.34	90,526,569	30,137.25	80,134,951	1.97
アメリカ	株式	SOUTHERN CO	公益事業	5,769	13,253.45	76,459,170	13,625.75	78,606,996	1.93
アメリカ	株式	CME GROUP INC	金融サービス	1,972	33,249.24	65,567,504	39,207.13	77,316,469	1.90
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	805	100,132.78	80,606,888	95,157.16	76,601,520	1.89
アイルランド	株式	TRANE TECHNOLOGIES PLC	資本財	1,528	57,869.80	88,425,063	49,640.64	75,850,898	1.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	4,209	16,806.63	70,739,141	17,602.98	74,090,983	1.82
アメリカ	株式	OTIS WORLDWIDE CORP	資本財	4,784	14,273.17	68,282,890	15,267.48	73,039,659	1.80
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,970	24,387.42	72,430,641	24,477.91	72,699,420	1.79
アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	6,818	12,028.09	82,007,520	10,533.68	71,818,658	1.77
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,800	21,644.05	60,603,354	24,833.77	69,534,575	1.71
アメリカ	株式	MORGAN STANLEY	金融サービス	3,831	15,883.50	60,849,725	17,244.14	66,062,306	1.63
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,054	28,664.47	58,876,841	30,694.96	63,047,450	1.55
アメリカ	株式	BAKER HUGHES CO	エネルギー	9,712	6,855.67	66,582,332	6,441.32	62,558,115	1.54
スウェーデン	株式	VOLVO AB-B SHS-B	資本財	13,579	3,900.13	52,959,920	4,513.45	61,288,205	1.51
シンガポール	株式	DBS GROUP HOLDINGS LTD	銀行	11,830	4,398.09	52,029,514	5,180.47	61,285,026	1.51
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	4,150	16,633.02	69,027,064	14,663.42	60,853,220	1.50
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	9,653	6,074.99	58,641,952	6,167.69	59,536,808	1.47
アイルランド	株式	EATON CORP PLC	資本財	1,419	42,745.23	60,655,491	40,993.89	58,170,342	1.43

アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア 機器・サー ビス	2,928	17,495.33	51,226,341	19,560.20	57,272,284	1.41
アメリカ	株式	LOWE'S COS INC	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	1,666	37,054.36	61,732,575	34,153.35	56,899,495	1.40
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	707	86,369.37	61,063,146	77,158.30	54,550,919	1.34
アイルラ ンド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェ ア・サービ ス	1,083	51,614.11	55,898,088	45,503.42	49,280,206	1.21
イギリス	株式	RELX PLC	商業・専門 サービス	6,500	7,125.53	46,315,993	7,533.78	48,969,592	1.21

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	素材	1.04
		自動車・自動車部品	0.62
		保険	0.97
		半導体・半導体製造装置	0.59
	国外	エネルギー	6.91
		素材	0.94
		資本財	8.73
		商業・専門サービス	1.21
		運輸	0.84
		自動車・自動車部品	0.95
		耐久消費財・アパレル	1.89
		消費者サービス	2.62
		メディア・娯楽	7.19
		一般消費財・サービス流通・小売り	2.38
		食品・飲料・タバコ	2.49
		家庭用品・パーソナル用品	1.06
		ヘルスケア機器・サービス	2.75
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.86
		銀行	7.03
		金融サービス	8.49
		保険	4.89
		ソフトウェア・サービス	6.83
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.12
電気通信サービス	2.91		
公益事業	6.87		
半導体・半導体製造装置	10.26		
投資証券			0.72
合計			98.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	29,742.13	4,481,800	4,446,537	0.11
	ユーロ	売建	27,490.65	4,481,800	4,455,417	0.11

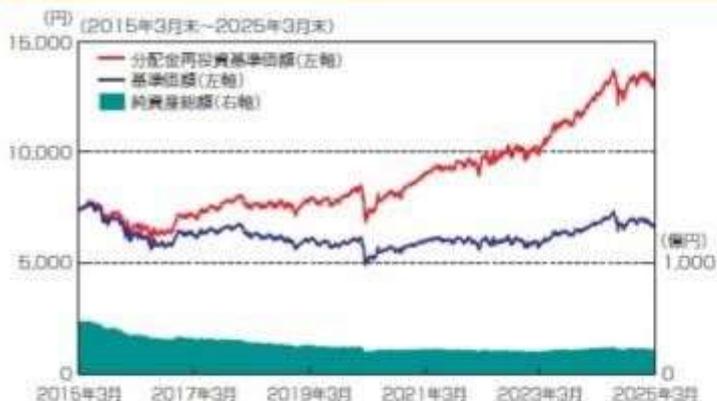
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2025年3月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額 ……………6,671円
純資産総額 ……………218.34億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2015年3月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2024年7月	2024年9月	2024年11月	2025年1月	2025年3月	設定来累計
70円	70円	70円	70円	70円	8.780円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
高格付債券	18.3%
高利回り債券	32.1%
新興国債券	16.7%
世界株式	12.9%
世界高配当株式	18.6%
現金その他	1.5%

※対純資産総額比です。

各資産の内訳は以下の通りです。

- ・高格付債券:PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)
- ・高利回り債券:PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)
- ・新興国債券:PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)
- ・世界株式:キャピタルグループグローバルエクイティファンド(LUX)(クラスC)
- ・世界高配当株式:グローバル高配当株式マザーファンド

<通貨別構成比率>

通貨	比率
アメリカドル	45.4%
ユーロ	24.3%
イギリスポンド	3.9%
オーストラリアドル	0.4%
日本円	2.7%
エマージング通貨	21.3%
その他	2.0%

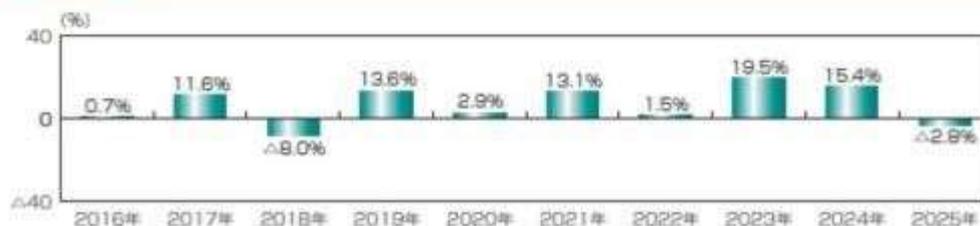
※上記の数値は各投資信託証券の通貨構成比率を基に計算した概算値です。

<予想利回り(年率)>

ファンド	5.56%
高格付債券	4.61%
高利回り債券	6.80%
新興国債券	10.66%
世界株式	1.88%
世界高配当株式	2.80%

※ファンドの予想利回りは、月末時点で組み入れている各投資信託証券の利回り評価額のウェイトで加重平均したものです。「高格付債券」「高利回り債券」「新興国債券」については最終利回りです。「世界株式」「世界高配当株式」については予想配当利回りです。運用管理費用(信託報酬)等の費用および税金を控除したものではありません。また、上記の数値は当ファンドの運用成果等について何ら約束をするものではありません。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2025年は、2025年3月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
英国証券取引所の休業日
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドンの銀行休業日
ニューヨークの銀行休業日
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、投資対象とする投資信託証券への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
英国証券取引所の休業日
ニューヨーク証券取引所の休業日
ロンドンの銀行休業日
ニューヨークの銀行休業日
- (4) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基つき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1 口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1 口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- 委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- 解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

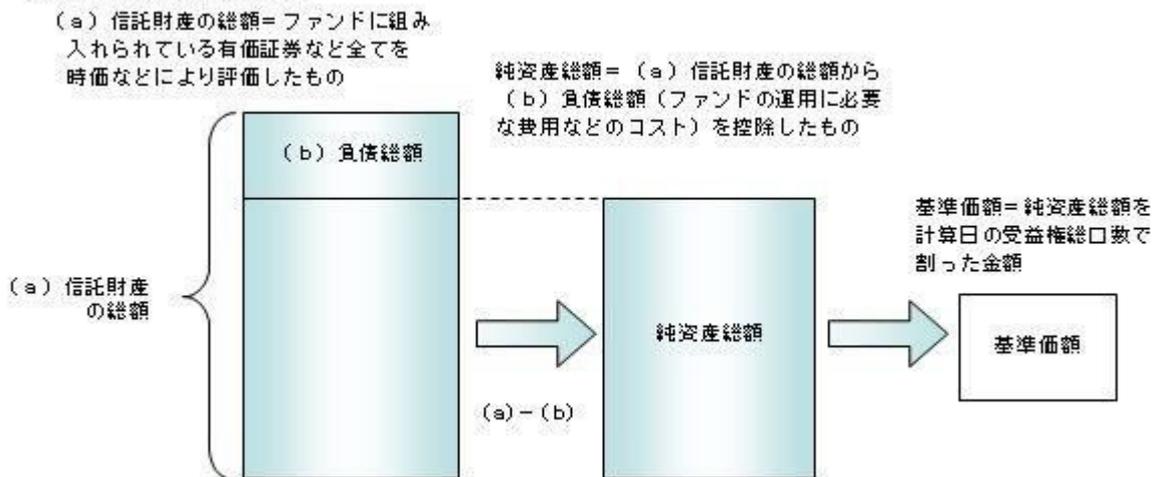
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

- 基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- 基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

- 信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
- < 主な資産の評価方法 >
 - 投資信託証券（国内籍）
 - 原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。
 - 投資信託証券（外国籍）
 - 原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。
- 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします(2006年10月31日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年1月16日から3月15日まで、3月16日から5月15日まで、5月16日から7月15日まで、7月16日から9月15日まで、9月16日から11月15日までおよび11月16日から翌年1月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

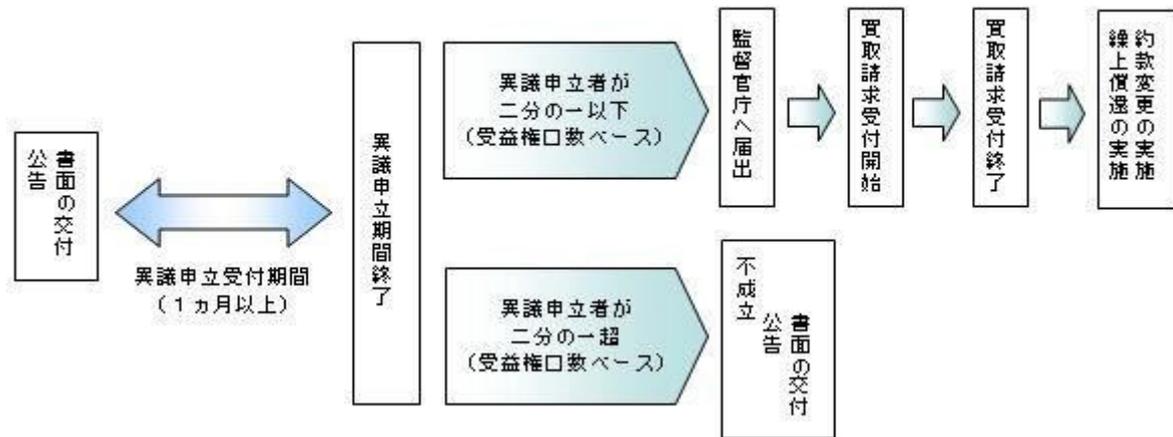
(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
 - 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
 - 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
 - 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - ・ 償還金について
 - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日まで)から受益者に支払います。
 - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。
- 信託約款の変更
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
 - 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
 - 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。
- 異議の申立て
- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べるすることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
 - 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
 - 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権

を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（3月、9月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して提供されます。

- ・法令で定められた所要の要件¹を満たすことにより、交付運用報告書は電磁的方法²により提供されます。ただし、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

1 あらかじめ、受益者からの承諾の取得または受益者への告知を行いません。

2 販売会社が受益者のために開設している取引専用ページ内で提供する方法やメールにて送信する方法などがあります。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。

- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社との運用の指図に関する権限の委託契約または投資顧問契約は、ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。

(3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「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）並びに同規則第2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）に基づき作成しております。
なお、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) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 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、2024年 9月18日から2025年 3月17日までの特定期間の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【日興スリートップ（隔月分配型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 9月17日現在	当期 2025年 3月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	710,953,667	722,220,729
投資信託受益証券	16,500,078,104	14,523,940,920
投資証券	1,630,790,772	2,822,460,501
親投資信託受益証券	3,073,878,234	4,079,349,321
未収入金	38,812,728	996,425
未収利息	4,564	9,593
流動資産合計	21,954,518,069	22,148,977,489
資産合計	21,954,518,069	22,148,977,489
負債の部		
流動負債		
未払金	123,304,608	111,820,862
未払収益分配金	231,913,525	229,077,272
未払解約金	10,630,870	5,138,036
未払受託者報酬	1,276,500	1,234,678
未払委託者報酬	55,443,668	53,627,159
その他未払費用	2,524,758	1,370,146
流動負債合計	425,093,929	402,268,153
負債合計	425,093,929	402,268,153
純資産の部		
元本等		
元本	33,130,503,648	32,725,324,612
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,601,079,508	10,978,615,276
（分配準備積立金）	4,557,192,527	4,359,333,419
元本等合計	21,529,424,140	21,746,709,336
純資産合計	21,529,424,140	21,746,709,336
負債純資産合計	21,954,518,069	22,148,977,489

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自 至	2024年 3月16日 2024年 9月17日	自 至	2024年 9月18日 2025年 3月17日
営業収益				
受取配当金		795,227,275		727,276,125
受取利息		240,863		622,595
有価証券売買等損益		495,811,223		626,089,152
営業収益合計		299,656,915		1,353,987,872
営業費用				
支払利息		69		-
受託者報酬		3,872,756		3,693,992
委託者報酬		168,209,591		160,444,893
その他費用		1,646,600		1,698,021
営業費用合計		173,729,016		165,836,906
営業利益又は営業損失（ ）		125,927,899		1,188,150,966
経常利益又は経常損失（ ）		125,927,899		1,188,150,966
当期純利益又は当期純損失（ ）		125,927,899		1,188,150,966
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,354,857		3,224,546
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,201,836,014		11,601,079,508
剰余金増加額又は欠損金減少額		353,930,601		348,270,896
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		353,930,601		348,270,896
当期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		179,226,615		221,316,449
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		179,226,615		221,316,449
分配金		698,520,522		689,416,635
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,601,079,508		10,978,615,276

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき当該投資証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年1月16日から3月15日まで、3月16日から5月15日まで、5月16日から7月15日まで、7月16日から9月15日まで、9月16日から11月15日まで及び、11月16日から翌年1月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当特定期間は2024年9月18日から2025年3月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 2024年9月17日現在	当期 2025年3月17日現在
1. 期首元本額	33,704,080,929円	33,130,503,648円
期中追加設定元本額	578,964,276円	692,661,172円
期中一部解約元本額	1,152,541,557円	1,097,840,208円
2. 受益権の総数	33,130,503,648口	32,725,324,612口
3. 元本の欠損		
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	11,601,079,508円	10,978,615,276円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2024年 3月16日 至 2024年 9月17日	当期 自 2024年 9月18日 至 2025年 3月17日
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 63,338,771円	1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用 60,641,175円
2. 分配金の計算過程 自 2024年 3月16日 至 2024年 5月15日	2. 分配金の計算過程 自 2024年 9月18日 至 2024年 11月15日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 277,573,500円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 264,476,045円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C 信託約款に定める収益調整金 2,020,012,860円	C 信託約款に定める収益調整金 2,080,005,722円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,607,129,385円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,517,713,767円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,904,715,745円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,862,195,534円
F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,060円	F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,074円
G 分配金額 234,560,660円	G 分配金額 231,505,169円
H 分配金額 (1万口当たり) 70円	H 分配金額 (1万口当たり) 70円
自 2024年 5月16日 至 2024年 7月16日	自 2024年 11月16日 至 2025年 1月15日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 256,421,492円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 189,692,763円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C 信託約款に定める収益調整金 2,021,044,134円	C 信託約款に定める収益調整金 2,077,251,662円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,577,698,632円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,476,991,609円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,855,164,258円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,743,936,034円
F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,067円	F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,062円
G 分配金額 232,046,337円	G 分配金額 228,834,194円
H 分配金額 (1万口当たり) 70円	H 分配金額 (1万口当たり) 70円
自 2024年 7月17日 至 2024年 9月17日	自 2025年 1月16日 至 2025年 3月17日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 221,816,836円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 187,134,292円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C 信託約款に定める収益調整金 2,052,102,730円	C 信託約款に定める収益調整金 2,120,846,166円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,567,289,216円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 4,401,276,399円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,841,208,782円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 6,709,256,857円
F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,064円	F 分配対象収益 (1万口当たり) 2,050円
G 分配金額 231,913,525円	G 分配金額 229,077,272円
H 分配金額 (1万口当たり) 70円	H 分配金額 (1万口当たり) 70円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2024年 3月16日 至 2024年 9月17日	当期 自 2024年 9月18日 至 2025年 3月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2024年 9月17日現在	当期 2025年 3月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (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 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
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

(有価証券に関する注記)

前期（2024年 9月17日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,630,946,030
投資証券	169,374,738
親投資信託受益証券	302,321,185
合計	2,102,641,953

当期（2025年 3月17日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	501,376,868
投資証券	104,704,825
親投資信託受益証券	114,629,833
合計	720,711,526

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2024年 9月17日現在	当期 2025年 3月17日現在
1口当たり純資産額	0.6498円	0.6645円

(1万口当たり純資産額)

(6,498円)|(1万口当たり純資産額)

(6,645円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)	1,323,894	3,941,232,438	
	PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)	1,441,116	6,934,650,192	
	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)	1,762,347	3,648,058,290	
投資信託受益証券 合計		4,527,357	14,523,940,920	
投資証券	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)(クラスC)	290,287	2,822,460,501	
投資証券 合計		290,287	2,822,460,501	
親投資信託受益証券	グローバル高配当株式マザーファンド	872,009,859	4,079,349,321	
親投資信託受益証券 合計		872,009,859	4,079,349,321	
合計		876,827,503	21,425,750,742	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)」、「PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)」、「PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

また、当ファンドは、「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)(クラスC)」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資証券」は同投資証券です。なお、同投資証券の財務書類は2024年12月17日提出の有価証券報告書に記載されております。

また、当ファンドは、「グローバル高配当株式マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)

同投資信託はバミューダ籍のオープン・エンド契約型円建外国投資信託であります。同投資信託は、計算期間(2023年7月1日から2024年6月30日まで)が終了し、現地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書類が作成され、独立の監査人による監査を受けております。

同投資信託の「資産・負債計算書」、「損益計算書」およびそれに続く「純資産変動計算書」などは、委託会社が同投資信託の投資顧問会社から入手した2024年6月30日現在の財務書類の原文の一部を翻訳したものであります。

資産・負債計算書

2024年6月30日

PIMCOエマージ
グ債券ストラ
テ
ジーファンドPIMCOグローバル
債券ストラ
テ
ジーファンド

(金額単位: 受益証券1口当たり金額を除き、千円ドル)

資産:			
投資(公正価値)			
投資有価証券*	\$	31,202	\$ 364,556
金融デリバティブ商品			
上場または中央清算		101	439
店頭		736	2,995
現金		0	0
取引相手先預け金		796	6,085
外貨(公正価値)		245	202
投資売却に係る未収金		521	7
TBA投資売却に係る未収金		0	94,142
ファンド受益証券売却に係る未収金		0	25
未収利息および/または未収配当		526	1,960
その他の資産		0	1
		34,127	470,412
負債:			
借入および他の金融取引			
リバース・レポ契約に係る未払金	\$	784	\$ 773
売建に係る未払金		0	0
空売りに係る未払金		0	11,228
金融デリバティブ商品			
上場または中央清算		104	411
店頭		589	1,613
投資購入に係る未払金		1,582	3,021
遅延引渡投資購入に係る未払金		467	500
TBA投資購入に係る未払金		0	156,221
未払利息		0	5
取引相手先預かり金		0	2,149
ファンド受益証券買戻しに係る未払金		0	305
保管会社からの当座借越		1	3
未払投資顧問報酬		0	64
未払管理報酬		0	0
未払税金		96	0
		3,623	176,293
純資産	\$	30,504	\$ 294,119
投資有価証券に係る費用	\$	34,185	\$ 372,609
外国通貨保有に係る費用	\$	244	\$ 203
売建に係る受取金	\$	0	\$ 11,292
金融デリバティブ商品取得原価またはプレミアム(純額)	\$	(68)	\$ 19
* 内レポ契約	\$	2,500	\$ 17,200
純資産:			
(日本円、為替ヘッジあり)	機関	N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジあり)	小売	N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジなし)	小売	N/A	N/A
J(日本円)		\$ 30,504	\$ 83,804
J(日本円、為替ヘッジあり)		N/A	N/A
S(日本円)		N/A	210,315
米ドル		N/A	N/A
発行済受益証券数:			
(日本円、為替ヘッジあり)	機関	N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジあり)	小売	N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジなし)	小売	N/A	N/A
J(日本円)		2,144	4,055
J(日本円、為替ヘッジあり)		N/A	N/A
S(日本円)		N/A	2,647
米ドル		N/A	N/A
発行済受益証券1口当たりの純資産額および買戻価格:			
(日本円、為替ヘッジあり)	機関		
(機能通貨表示)		N/A	N/A
(報告通貨表示)		N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジあり)	小売		
(機能通貨表示)		N/A	N/A
(報告通貨表示)		N/A	N/A
(日本円、為替ヘッジなし)	小売		
(機能通貨表示)		N/A	N/A
(報告通貨表示)		N/A	N/A
J(日本円)			
(機能通貨表示)		\$ 14.23	\$ 20.67
(報告通貨表示)		¥ 2,288	¥ 3,325
J(日本円、為替ヘッジあり)			
(機能通貨表示)		N/A	N/A
(報告通貨表示)		N/A	N/A

S（日本円） （機能通貨表示） （報告通貨表示）	N/A	\$	79.46
米ドル （機能通貨表示）	N/A	¥	12,781
	N/A		N/A

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

資産・負債計算書

2024年6月30日

PIMCOグローバル ハイイールドスト ラテジーファンド

（金額単位：受益証券1口当たり金額を除き、千米ドル）

資産：			
投資（公正価値）			
投資有価証券		\$	52,106
金融デリバティブ商品			
上場または中央清算			16
店頭			27
現金			6
取引相手先預け金			473
外貨（公正価値）			3
投資売却に係る未収金			321
未収利息および/または未収配当			824
その他の資産			2
			53,778
負債：			
借入および他の金融取引			
リバース・レボ契約に係る未払金		\$	721
金融デリバティブ商品			
上場または中央清算			7
店頭			210
投資購入に係る未払金			1,542
			2,480
純資産		\$	51,298
投資有価証券に係る費用		\$	52,494
外国通貨保有に係る費用		\$	3
金融デリバティブ商品取得原価またはプレミアム（純額）		\$	(2)
純資産：			
J（日本円）		\$	51,298
発行済受益証券数：			
J（日本円）			1,615
発行済受益証券1口当たりの純資産額および買戻価格：			
J（日本円）			
（機能通貨表示）		\$	31.75
（報告通貨表示）		¥	5,108

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

損益計算書

2024年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル）

投資収益：					
受取利息（外国源泉税控除後）*		\$	2,267	\$	8,497
雑収益			5		46
収益合計			2,272		8,543
費用：					
未払投資顧問報酬（日本円、為替ヘッジあり）	機関		N/A		N/A
未払投資顧問報酬（日本円、為替ヘッジあり）	小売		N/A		N/A
未払投資顧問報酬（日本円、為替ヘッジなし）	小売		N/A		N/A
未払投資顧問報酬 S（日本円）			N/A		650
運用報酬 C（日本円、為替ヘッジあり）			N/A		22 ⁽¹⁾
管理報酬（日本円、為替ヘッジあり）	機関		N/A		N/A
支払利息			54		69
その他費用			0		0
費用合計			54		741
投資純利益（費用）			2,218		7,802

実現純利益（損失）：

投資有価証券（外国源泉税控除後）*	(977)	(5,580)
上場または中央清算金融デリバティブ商品	425	781
店頭金融デリバティブ商品	107	4,626
外国通貨	(114)	464
実現純利益（損失）	(559)	291

未実現評価損益の純変動額

投資有価証券	127	2,983
上場または中央清算金融デリバティブ商品	(186)	582
店頭金融デリバティブ商品	268	875
外貨建資産および負債	(27)	(4)
未実現評価損益の純変動額	182	4,436
純利益（損失）	(377)	4,727

運用による純資産の純増加（減少）額 \$ 1,841 \$ 12,529

* 外国源泉税 \$ 15 \$ 0

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

(1) 2023年7月1日から2023年12月6日（解約日）までの期間。

損益計算書

2024年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル）	PIMCOグローバル ハイイールドスト ラテジーフアンド	
投資収益：		
受取利息	\$	3,628
受取配当		11
雑収益		9
収益合計		3,648
費用：		
支払利息		6
費用合計		6
投資純利益（費用）		3,642

実現純利益（損失）：

投資有価証券	(1,426)
上場または中央清算金融デリバティブ商品	290
店頭金融デリバティブ商品	33
外国通貨	(2)
実現純利益（損失）	(1,105)

未実現評価損益の純変動額

投資有価証券	3,214
上場または中央清算金融デリバティブ商品	(14)
店頭金融デリバティブ商品	(273)
外貨建資産および負債	29
未実現評価損益の純変動額	2,956
純利益（損失）	1,851

運用による純資産の純増加（減少）額 \$ 5,493

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

純資産変動計算書

2024年6月30日までの1年間

（金額単位：千米ドル）	PIMCOエマージ グ債券ストラ テジーフアンド		PIMCOグローバル 債券ストラ テジーフアンド	
純資産の増加（減少）の内訳：				
運用：				
投資純利益（費用）	\$	2,218	\$	7,802
実現純利益（損失）		(559)		291
未実現評価損益の純変動額		182		4,436
運用による純増加（減少）額		1,841		12,529

受益者への分配金：

分配		N/A	N/A
（日本円、為替ヘッジあり）	機関	N/A	N/A
（日本円、為替ヘッジあり）	小売	N/A	N/A
（日本円、為替ヘッジなし）	小売	N/A	N/A
J（日本円）		(4,377)	(5,990)
J（日本円、為替ヘッジあり）		N/A	N/A
米ドル		N/A	N/A
分配金合計		(4,377)	(5,990)

ファンド受益証券取引：

ファンド受益証券取引による純増加（減少）額* (731) 152,328

純資産の増加（減少）額合計 (3,267) 158,867

純資産：

期首残高		33,771	135,252
期末残高	\$	30,504	\$ 294,119

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

* 財務諸表の注記を参照のこと。

純資産変動計算書

2024年6月30日までの1年間

**PIMCOグローバル
ハイイールドスト
ラテジーファンド**

（金額単位：千米ドル）

純資産の増加（減少）の内訳：**運用：**

投資純利益（費用）	\$	3,642
実現純利益（損失）		(1,105)
未実現評価損益の純変動額		2,956
運用による純増加（減少）額		5,493

受益者への分配金：

J（日本円）		(3,283)
分配金合計		(3,283)

ファンド受益証券取引：

ファンド受益証券取引による純増加（減少）額* (820)

純資産の増加（減少）額合計 1,390

純資産：

期首残高		49,908
期末残高	\$	51,298

残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

* 財務諸表の注記を参照のこと。

投資明細表**PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド**

（金額の単位は千*、ただし株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く）

2024年6月30日現在

	元本金額（単位：千）	評価額（単位：千）
投資有価証券102.3%		
アゼルバイジャン1.0%		
社債等1.0%		
SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC		
7.230% due 03/17/2026	\$ 300	\$ 298
アゼルバイジャン合計		298
（取得原価 \$ 299）		
ブラジル3.2%		
社債等2.9%		
Banco BTG Pactual S.A.		
8.300% due 08/15/2024	BRL 4,000	718

Banco do Brasil S.A. 8.500% due 07/29/2026	MXN	3,000	155
Oi S.A. 1.913% due 02/25/2035	BRL	1	2
			<u>875</u>
仕組債0.3%			
Vale S.A. 1.971% due 03/31/2173 (b)		1,550	97
ブラジル合計 (取得原価 \$ 1,402)			<u>972</u>
英領バージン諸島0.0%			
社債等0.0%			
Flourish Century Holdings Ltd. 14.298% due 02/04/2049 (a)(f)(h)	\$	200	8
英領バージン諸島合計 (取得原価 \$ 195)			<u>8</u>
ケイマン諸島1.2%			
資産担保証券0.0%			
MidOcean Credit CLO II 6.616% due 01/29/2030		2	3
社債等1.2%			
Interoceanica IV Finance Ltd. 0.000% due 11/30/2025		6	5
Peru Payroll Deduction Finance Ltd. 0.000% due 11/01/2029		39	32
Poinsettia Finance Ltd. 6.625% due 06/17/2031 (j)		164	141
QNB Finance Ltd. 4.875% due 01/30/2029 (j)		200	198
			<u>376</u>
ケイマン諸島合計 (取得原価 \$ 400)			<u>379</u>
チリ4.0%			
ソブリン債4.0%			
Bonos de la Tesoreria de la Republica 3.400% due 10/01/2039 (c)	CLP	112,727	126
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% due 10/01/2028		285,000	296
5.300% due 11/01/2037		10,000	10
5.800% due 10/01/2034		90,000	94
6.200% due 10/01/2040		225,000	243
Titulos de Tesoreria (d) 6.250% due 11/03/2027	COP	495,000	106
6.250% due 09/18/2030		465,600	100
6.250% due 03/26/2031		973,300	197
6.250% due 06/30/2032		253,000	50
チリ合計 (取得原価 \$ 1,242)			<u>1,222</u>
中国1.6%			
ソブリン債1.6%			
China Government International Bond 2.600% due 09/01/2032	CNY	1,280	181
2.750% due 02/17/2032		160	23
3.020% due 05/27/2031		1,600	233
3.120% due 10/25/2052		180	28
3.810% due 09/14/2050		200	35
中国合計 (取得原価 \$ 493)			<u>500</u>
コロンビア2.7%			
社債等0.8%			
Empresas Publicas de Medellin ESP 7.625% due 09/10/2024	COP	961,000	229
ソブリン債1.9%			
Colombian TES			

6.000% due 04/28/2028		335,900	71
6.250% due 07/09/2036		1,177,300	196
9.250% due 05/28/2042		914,000	184
13.250% due 02/09/2033		417,100	114
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter			
7.875% due 08/12/2024		94,000	23
			588
コロンビア合計			817
(取得原価 \$ 1,110)			

チェコ共和国1.8%			
ソブリン債1.8%			
Czech Republic Government Bond			
0.950% due 05/15/2030	CZK	3,900	140
1.200% due 03/13/2031		3,600	129
2.000% due 10/13/2033		4,400	158
4.200% due 12/04/2036		1,100	47
4.900% due 04/14/2034		300	14
5.000% due 09/30/2030		1,200	54
チェコ共和国合計			542
(取得原価 \$ 608)			

ドミニカ共和国3.0%			
ソブリン債3.0%			
Dominican Republic Central Bank Notes			
13.000% due 12/05/2025	DOP	11,300	195
13.000% due 01/30/2026		1,200	21
Dominican Republic International Bond			
10.750% due 06/01/2036 (d)		16,500	285
11.250% due 09/15/2035		11,400	204
13.625% due 02/03/2033		10,800	217
ドミニカ共和国合計			922
(取得原価 \$ 882)			

エクアドル0.2%			
ソブリン債0.2%			
Ecuador Government International Bond			
3.500% due 07/31/2035 (j)	\$	82	41
6.000% due 07/31/2030		30	19
エクアドル合計			60
(取得原価 \$ 48)			

ハンガリー2.8%			
ソブリン債2.8%			
Hungary Government Bond			
2.000% due 05/23/2029	HUF	14,200	31
2.250% due 04/20/2033		11,300	22
3.000% due 08/21/2030		49,900	111
3.000% due 10/27/2038		2,700	5
4.500% due 03/23/2028		20,600	52
4.750% due 11/24/2032		45,700	108
6.750% due 10/22/2028		109,300	297
7.000% due 10/24/2035		4,600	13
9.500% due 10/21/2026		38,100	109
Magyar Export-Import Bank Zrt			
6.000% due 05/16/2029	EUR	100	113
ハンガリー合計			861
(取得原価 \$ 869)			

インド0.8%			
社債等0.8%			
HDFC Bank Ltd.			
8.100% due 03/22/2025	INR	20,000	240
インド合計			240
(取得原価 \$ 242)			

インドネシア1.4%			
ソブリン債1.4%			
Indonesia Government International Bond			
7.125% due 06/15/2038	IDR	1,688,000	104
7.125% due 06/15/2043		478,000	29

7.500% due 04/15/2040		2,563,000	162
8.375% due 03/15/2034		2,003,000	133
インドネシア合計 (取得原価 \$ 426)			428
<hr/>			
アイルランド1.0% 社債等1.0%			
Alfa Bank A0 Via Alfa Bond Issuance PLC			
9.350% due 08/06/2049 (a)	RUB	62,400	22
Iridium Capital PLC			
9.250% due 06/18/2029	EUR	250	270
アイルランド合計 (取得原価 \$ 1,155)			292
<hr/>			
イタリア0.7% ソブリン債0.7%			
Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5.875% due 04/30/2029 (j)	\$	200	203
イタリア合計 (取得原価 \$ 198)			203
<hr/>			
コートジボワール0.9% ソブリン債0.9%			
Ivory Coast Government International Bond			
4.875% due 01/30/2032	EUR	200	180
5.250% due 03/22/2030		100	98
コートジボワール合計 (取得原価 \$ 279)			278
<hr/>			
ルクセンブルク0.0% 社債等0.0%			
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.			
5.250% due 05/23/2049 (a)(e)	\$	200	12
ルクセンブルク合計 (取得原価 \$ 193)			12
<hr/>			
マレーシア4.2% ソブリン債4.2%			
Malaysia Government International Bond			
2.632% due 04/15/2031	MYR	2,500	494
3.885% due 08/15/2029		990	212
4.291% due 08/14/2043		1,360	295
4.417% due 09/30/2041		230	51
4.504% due 04/30/2029		480	106
4.696% due 10/15/2042		368	84
5.357% due 05/15/2052		148	37
マレーシア合計 (取得原価 \$ 1,278)			1,279
<hr/>			
メキシコ8.1% 社債等0.2%			
America Movil SAB de C.V.			
8.460% due 12/18/2036	MXN	1,000	46
<hr/>			
ソブリン債7.9%			
Mexico Government International Bond			
3.000% due 12/03/2026 (c)		17,884	904
4.000% due 11/30/2028 (c)		1,626	83
4.000% due 08/24/2034 (c)		813	40
5.750% due 03/05/2026		8,000	405
7.000% due 09/03/2026		2,300	117
7.500% due 05/26/2033		3,900	184
7.750% due 05/29/2031		8,600	421
8.000% due 11/07/2047		3,500	157
8.000% due 07/31/2053		2,200	98
			2,409
メキシコ合計 (取得原価 \$ 2,618)			2,455
<hr/>			
パラグアイ0.2% ソブリン債0.2%			
Paraguay Government International Bond			

7.900% due 02/09/2031	PYG	519,000	72
パラグアイ合計 (取得原価 \$ 71)			72
<hr/>			
ペルー7.9% 社債等2.6%			
Banco de Credito del Peru S.A.			
4.650% due 09/17/2024	PEN	1,830	475
Credicorp Capital Sociedad Titulizadora S.A.			
10.100% due 12/15/2043		1,200	321
			796
<hr/>			
ソブリン債5.3%			
Peru Government International Bond			
5.350% due 08/12/2040		700	148
5.400% due 08/12/2034		200	46
5.940% due 02/12/2029		1,700	447
6.150% due 08/12/2032		300	75
6.350% due 08/12/2028		200	54
6.900% due 08/12/2037		1,500	376
6.950% due 08/12/2031		900	241
7.300% due 08/12/2033		800	215
			1,602
ペルー合計 (取得原価 \$ 2,498)			2,398
<hr/>			
フィリピン0.8% ソブリン債0.8%			
Philippines Government International Bond			
6.250% due 02/28/2044	PHP	15,300	246
フィリピン合計 (取得原価 \$ 245)			246
<hr/>			
ポーランド0.8% ソブリン債0.8%			
Poland Government International Bond			
1.750% due 04/25/2032	PLN	500	95
2.750% due 04/25/2028		200	45
6.000% due 10/25/2033		400	102
ポーランド合計 (取得原価 \$ 229)			242
<hr/>			
ルーマニア3.0% ソブリン債3.0%			
Romania Government International Bond			
3.650% due 07/28/2025	RON	500	105
4.150% due 01/26/2028		700	141
4.250% due 04/28/2036		600	102
4.750% due 10/11/2034		300	55
4.850% due 04/22/2026		800	169
5.000% due 02/12/2029		300	61
5.250% due 05/30/2032	EUR	100	104
5.625% due 05/30/2037		100	103
7.900% due 02/24/2038	RON	300	70
ルーマニア合計 (取得原価 \$ 953)			910
<hr/>			
シンガポール3.6% ソブリン債3.6%			
Singapore Government Bond			
1.875% due 10/01/2051	SGD	50	28
2.125% due 06/01/2026		1,280	922
3.250% due 06/01/2054		200	153
シンガポール合計 (取得原価 \$ 1,111)			1,103
<hr/>			
南アフリカ12.8% 社債等1.7%			
Development Bank of Southern Africa Ltd.			
8.600% due 10/21/2024 (h)	ZAR	3,900	212
Eskom Holdings SOC Ltd.			
0.000% due 08/18/2027		2,800	95

0.000% due 12/31/2032	6,900	91
Transnet SOC Ltd.		
10.000% due 03/30/2029	2,000	102
		500

ソブリン債11.1%

South Africa Government CPI-Linked Bond		
2.000% due 01/31/2025 (c)	3,857	208
South Africa Government International Bond		
6.250% due 03/31/2036	7,600	277
6.500% due 02/28/2041	2,700	90
8.000% due 01/31/2030	15,225	765
8.500% due 01/31/2037	7,600	328
9.000% due 01/31/2040	4,700	203
10.500% due 12/21/2026	26,850	1,526
		3,397
南アフリカ合計		3,897
(取得原価 \$ 4,231)		

国際機関7.5%**社債等4.0%**

Arab Bank for Economic Development in Africa			
3.750% due 01/25/2027	EUR	100	107
Asian Infrastructure Investment Bank			
7.000% due 03/01/2029	INR	62,400	743
7.200% due 01/25/2029		16,200	194
7.200% due 07/02/2031		9,900	118
Inter-American Development Bank			
5.100% due 11/17/2026	IDR	80,000	5
7.000% due 01/25/2029	INR	5,000	59
			1,226

ソブリン債3.5%

Asian Development Bank			
6.720% due 02/08/2028		38,700	463
European Investment Bank			
2.875% due 11/15/2029	PLN	1,300	282
6.950% due 03/01/2029	INR	5,900	71
International Bank for Reconstruction & Development			
5.000% due 12/01/2026	IDR	260,000	15
7.050% due 07/22/2029	INR	20,000	243
			1,074
国際機関合計			2,300
(取得原価 \$ 2,323)			

タイ0.2%**ソブリン債0.2%**

Thailand Government Bond			
3.450% due 06/17/2043	THB	2,320	65
4.000% due 06/17/2055		230	7
タイ合計			72
(取得原価 \$ 71)			

トルコ2.2%**ソブリン債2.2%**

Turkiye Government Bond			
26.200% due 10/05/2033	TRY	9,900	296
37.000% due 02/18/2026		2,300	69
50.000% due 05/17/2028		10,000	304
トルコ合計			669
(取得原価 \$ 671)			

ウクライナ0.2%**ソブリン債0.2%**

Ukraine Government International Bond			
7.750% due 08/01/2041	\$	100	49
ウクライナ合計			49
(取得原価 \$ 48)			

英国1.3%**社債等0.9%**

Panama Infrastructure Receivable Purchaser PLC			
0.000% due 04/05/2032 (j)		400	262
<hr/>			
モーゲージ証券0.4%			
Harbour No.1 PLC			
6.122% due 01/28/2054	GBP	100	126
英国合計			388
(取得原価 \$ 374)			
<hr/>			
米国4.7%			
資産担保証券0.4%			
OneMain Financial Issuance Trust			
4.130% due 05/14/2035	\$	100	98
<hr/>			
モーゲージ証券4.3%			
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust			
5.540% due 05/25/2037		3	2
Banc of America Funding Trust			
5.913% due 02/20/2047		31	26
Banc of America Mortgage Trust			
4.875% due 02/25/2036		2	2
6.650% due 07/25/2034		8	7
Bear Stearns Alternative-A Trust			
5.780% due 02/25/2034		19	17
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust			
6.510% due 08/25/2037		22	19
Chase Mortgage Finance Trust			
4.675% due 03/25/2037		12	11
Citigroup Mortgage Loan Trust			
5.261% due 07/25/2046		8	7
5.520% due 07/25/2045		25	17
5.530% due 01/25/2037		6	5
6.238% due 03/25/2034		2	1
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
4.425% due 09/25/2047		5	4
Credit Suisse Mortgage Capital			
3.199% due 11/30/2037		175	157
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5.559% due 07/25/2037		113	73
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
5.580% due 11/25/2036		5	2
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
5.643% due 10/19/2036		106	88
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
5.125% due 11/25/2035		17	10
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
6.850% due 08/25/2037		51	17
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates			
6.724% due 10/25/2033		3	2
GSAMP Trust			
5.530% due 12/25/2036		16	8
HarborView Mortgage Loan Trust			
6.035% due 08/19/2036		1	1
Home Equity Asset Trust			
6.810% due 02/25/2033		63	59
HSI Asset Loan Obligation Trust			
4.806% due 12/25/2036		6	2
Impac CMB Trust			
6.100% due 03/25/2035		69	64
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust			
4.767% due 12/25/2034		5	5
JPMorgan Mortgage Trust			
5.112% due 04/25/2036		22	19
Luminent Mortgage Trust			
5.820% due 12/25/2036		6	5
Mastr Asset-Backed Securities Trust			
5.560% due 01/25/2037		21	6
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5.960% due 11/25/2035		18	17

Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust			
4.209% due 04/25/2037		15	12
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust			
5.520% due 05/25/2037		10	9
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6.965% due 06/25/2036		3	2
Mortgage Equity Conversion Asset Trust			
5.600% due 05/25/2042		67	66
New Century Home Equity Loan Trust			
5.820% due 05/25/2036		16	16
New Residential Mortgage Loan Trust			
2.750% due 11/25/2059		82	76
New York Mortgage Trust			
6.000% due 04/25/2035		71	66
Option One Mortgage Loan Trust			
5.600% due 03/25/2037		159	140
Residential Asset Securitization Trust			
5.860% due 01/25/2046		55	15
Residential Funding Mortgage Securities I Trust			
5.322% due 09/25/2035		12	8
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5.580% due 12/25/2036		54	12
5.620% due 11/25/2036		30	8
Sequoia Mortgage Trust			
4.898% due 01/20/2047		6	4
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
6.575% due 07/25/2034		84	80
Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
5.953% due 07/19/2035		21	20
6.113% due 10/19/2034		68	63
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			
6.000% due 10/25/2036		25	25
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3.767% due 01/25/2037		15	13
4.209% due 12/25/2036		32	28
4.422% due 09/25/2036		3	2
			1,318
<hr/>			
米国政府機関債0.0%			
Fannie Mae			
5.498% due 12/25/2036		3	3
米国合計			1,419
(取得原価 \$ 1,682)			
<hr/>			
ウルグアイ1.3%			
ソブリン債1.3%			
Uruguay Government International Bond			
3.400% due 05/16/2045 (c)	UYU	9,672	245
9.750% due 07/20/2033		6,300	160
ウルグアイ合計			405
(取得原価 \$ 421)			
<hr/>			
ウズベキスタン0.3%			
ソブリン債0.3%			
National Bank of Uzbekistan			
19.875% due 07/05/2027	UZS	1,100,000	88
ウズベキスタン合計			88
(取得原価 \$ 87)			
<hr/>			
ザンビア0.2%			
ソブリン債0.2%			
Zambia Government International Bond			
11.000% due 07/27/2025	ZMW	1,200	47
12.000% due 05/03/2028		50	2
13.000% due 01/25/2031		50	1
23.000% due 01/22/2031		600	24
ザンビア合計			74
(取得原価 \$ 79)			
<hr/>			
短期金融商品16.7%			

レボ契約(i) 8.2%			2,500
仕組債1.4%			
Egypt Treasury Bills (Issuer JPMorgan Structured Product BV) (h)			
31.880% due 12/12/2024 (f)	EGP	11,400	213
30.841% due 03/13/2025 (g)		12,700	224
			437
定期預金0.5%			
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
3.360% due 07/01/2024	AUD	1	0
4.830% due 07/01/2024	\$	5	5
Bank of Nova Scotia			
3.770% due 07/02/2024	CAD	1	1
4.830% due 07/01/2024	\$	1	1
BNP Paribas Bank			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	27	0
0.320% due 07/01/2024	CHF	0	1
2.600% due 07/01/2024	SGD	1	1
3.380% due 07/01/2024	NOK	3	0
6.330% due 07/01/2024	ZAR	81	5
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	5	0
2.500% due 07/01/2024	DKK	2	0
Citibank N.A.			
4.830% due 07/01/2024	\$	60	60
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 07/01/2024		10	10
HSBC Bank			
2.600% due 07/01/2024	SGD	1	1
HSBC Bank PLC			
2.840% due 07/01/2024	EUR	11	12
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 07/01/2024	\$	11	11
MUFG Bank Ltd.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	344	2
Royal Bank of Canada			
3.770% due 07/02/2024	CAD	2	2
4.830% due 07/01/2024	\$	2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	48	0
4.830% due 07/01/2024	\$	9	9
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	1,699	11
2.840% due 07/01/2024	EUR	3	3
4.830% due 07/01/2024	\$	9	9
			146
日本短期国債5.7%			
0.038% due 08/19/2024 (f)	¥	280,000	1,741
ナイジェリア短期国債0.6%			
24.356% due 04/01/2025 (f)	NGN	68,800	39
25.482% due 02/25/2025 (g)		41,500	23
26.099% due 03/06/2025 (f)		93,000	53
27.168% due 05/20/2025 (f)		83,000	45
27.687% due 05/27/2025 (f)		36,720	19
			179
米国短期国債0.3%			
5.313% due 09/05/2024 (f)	\$	100	99
短期金融商品合計			5,102
(取得原価 \$ 5,154)			
投資有価証券合計102.3%			
(取得原価 \$ 34,185)	\$		31,202
金融デリバティブ商品(k)(l) 0.5%			144
(取得原価あるいはプレミアム(純額) \$ (68))			

その他の資産および負債（純額）（2.8%）
純資産100.0%

(842)

\$ 30,504

投資明細表に対する注記：

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

- (a) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
 (b) 永久債（記載日は次回の契約上の償還日）である。
 (c) 当有価証券の元本金額は、インフレの状況に合わせて調整される。
 (d) 発行日前取引証券
 (e) 偶発転換社債
 (f) クーボンは最終利回りである。
 (g) クーボンは加重平均最終利回りである。

(h) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価額の対純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	\$ 262	\$ 212	0.69%
Flourish Century Holdings Ltd.	14.298%	02/04/2049	08/25/2021	195	8	0.03%
Egypt Treasury Bills (Issuer JPMorgan Structured Product BV)	31.880%	12/12/2024	03/11/2024	206	213	0.70%
Egypt Treasury Bills (Issuer JPMorgan Structured Product BV)	30.841%	03/13/2025	03/07/2024	216	224	0.73%
制限証券合計				\$ 879	\$ 657	2.15%

借入およびその他の金融取引

(i) レボ契約：

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	元本金額	担保	受入担保（公正価値）	レボ契約（公正価値）	レボ契約に係る未収金 ⁽¹⁾
SAL	5.400%	06/28/2024	07/01/2024	\$ 2,500	U.S. Treasury Notes due 03/31/2026	\$ (2,554)	\$ 2,500	\$ 2,501
レボ契約合計						\$ (2,554)	\$ 2,500	\$ 2,501

リバース・レボ契約：

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日 ⁽³⁾	借入金額 ⁽²⁾	リバース・レボ契約に係る未払金
BPS	5.550%	02/08/2024	TBD	\$ (189)	(193)
BPS	5.740%	01/25/2024	TBD	(128)	(132)
SCX	5.550%	05/01/2024	TBD	(417)	(421)
SCX	5.750%	05/01/2024	TBD	(38)	(38)
リバース・レボ契約合計				\$ (784)	(784)

担保付借入として会計処理される振替

	契約の残存期間			合計
	翌日物および継続	30日以下	31～90日	
リバース・レボ契約				
Non-U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (553)
Non-U.S. Government Debt	0	0	0	(231)
リバース・レボ契約合計	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (784)
借入合計	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (784)
リバース・レボ契約に係る未払金				\$ (784)

借入およびその他の金融取引要約

以下は、2024年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

(j) 2024年6月30日現在、以下のマスター契約に基づき、市場価格合計 \$ 845の有価証券が担保として差し入れられている。

取引相手	レポ契約に係る未収金	リバース・レポ契約に係る未払金	売建に係る未払金	空売りに係る未払金	借入およびその他の金融取引合計	差入（受入）担保	ネット・エクスポージャー ⁽⁴⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 0	\$ (325)	\$ 0	\$ 0	\$ (325)	\$ 339	\$ 14
SAL	2,501	0	0	0	2,501	(2,554)	(53)
SCX	0	(459)	0	0	(459)	506	47
借入およびその他の金融取引合計	\$ 2,501	\$ (784)	\$ 0	\$ 0	\$ 1,717		

(1) 未収利息を含む。

(2) 2024年6月30日に終了した会計期間中の平均借入額は\$ 805で、加重平均金利は5.715%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(3) 満期の定めがないリバース・レポ契約

(4) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金/未払金の純額を表す。借入れおよびその他の金融取引からのエクスポージャーは同一の法主体との同一のマスター契約に基づく取引間でのみ相殺することができる。マスター・ネットティングの取決めの詳細に関しては財務諸表に対する注記を参照のこと。

(k) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

銘柄	種類	限月	契約件数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	Long	09/2024	2	\$ 3	\$ 0	\$ 0
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2024	1	(2)	0	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Long	09/2024	26	(2)	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Long	09/2024	5	1	0	(1)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2024	5	2	0	(2)
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	Short	09/2024	3	2	4	0
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Short	09/2024	1	(1)	1	0
先物契約合計				\$ 3	\$ 5	\$ (3)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定金利	満期日	インフラ イド・ク レジット ・スワ ップ レド (2024年 6月30日 現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	0.946%	\$ 200	\$ 0	(2)	\$ 0	\$ 0

金利スワップ

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
支払	3-Month ILS-TELBOR	3.792%	11/06/2028	ILS 300	\$ 0	(1)	\$ 0	\$ 0
支払	3-Month THOR	2.770%	12/20/2028	THB 1,551	1	0	0	0
受取 ⁽⁴⁾	3-Month THOR	2.250%	09/18/2029	8,670	2	3	0	0
支払	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.410%	07/13/2025	ZAR 1,700	0	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.881%	02/09/2026	5,800	1	(1)	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.565%	03/22/2026	900	0	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.100%	06/05/2026	3,300	(1)	(1)	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.185%	07/31/2026	2,300	(1)	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.500%	09/16/2026	760	(2)	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.324%	12/21/2026	5,890	19	(1)	1	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	6,100	(4)	1	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.205%	04/22/2027	1,800	2	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.210%	04/22/2027	1,400	1	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.440%	11/02/2028	500	0	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.599%	06/05/2029	3,600	(3)	(3)	1	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.650%	01/31/2030	1,700	(1)	0	0	0
受取	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.695%	01/31/2030	1,900	(2)	0	0	0

支払	3-Month	ZAR-SAJIBOR	10.150%	05/18/2033		1,100	4	0	0	0
支払	3-Month	ZAR-SAJIBOR	9.330%	02/09/2034		1,200	0	2	0	0
支払	6-Month	CZK-PRIBOR	4.388%	11/15/2028	CZK	6,600	12	5	0	0
支払	6-Month	CZK-PRIBOR	3.765%	01/09/2029		4,800	(4)	(5)	0	0
支払	6-Month	CZK-PRIBOR	3.645%	02/01/2029		13,800	(12)	(12)	1	0
受取	6-Month	CZK-PRIBOR	3.534%	03/21/2029		6,000	5	5	0	0
支払	6-Month	CZK-PRIBOR	3.850%	05/10/2029		5,000	(1)	(1)	0	0
受取	6-Month	CZK-PRIBOR	4.130%	06/03/2029		4,100	(2)	(2)	0	0
受取 ⁽⁴⁾	6-Month	EURIBOR	3.000%	09/18/2026	EUR	400	1	1	0	0
支払	6-Month	EURIBOR	2.860%	04/24/2029		100	0	0	0	0
支払	6-Month	EURIBOR	2.780%	05/02/2029		700	(5)	(5)	0	0
受取 ⁽⁴⁾	6-Month	EURIBOR	2.750%	09/18/2029		1,400	4	1	1	0
受取	6-Month	EURIBOR	3.300%	10/03/2033		100	(5)	2	1	0
支払 ⁽⁴⁾	6-Month	EURIBOR	2.750%	09/18/2034		475	(2)	(2)	0	(1)
受取 ⁽⁴⁾	6-Month	EURIBOR	2.500%	09/18/2054		220	1	1	1	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	2.325%	07/20/2024	HUF	33,000	(2)	1	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	13.600%	12/12/2024		181,000	49	25	0	(15)
支払	6-Month	HUF-BUBOR	0.995%	06/19/2025		192,600	(29)	11	2	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.220%	02/15/2026		100,300	4	1	0	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	5.670%	01/15/2027		11,200	1	1	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	4.790%	01/17/2027		56,900	(9)	(4)	1	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.280%	03/18/2027		206,700	(4)	(9)	1	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	8.700%	01/16/2028		104,600	(20)	10	1	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	8.740%	04/28/2028		27,200	(6)	2	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	7.610%	11/03/2028		20,000	5	1	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	7.330%	11/06/2028		91,300	18	2	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	5.440%	01/15/2029		111,600	(16)	(10)	0	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	5.880%	02/08/2029		55,700	4	4	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	5.735%	03/14/2029		45,000	(4)	(4)	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.200%	03/20/2029		44,300	(1)	(1)	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.400%	03/28/2029		36,600	0	0	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.500%	04/02/2029		32,700	0	0	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.590%	05/07/2029		20,200	1	1	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	8.670%	05/23/2029		36,800	10	(3)	0	(6)
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.450%	06/06/2029		71,100	(1)	(1)	0	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.299%	06/10/2029		33,000	0	0	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	1.760%	01/21/2030		41,600	(27)	(4)	1	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	9.240%	09/02/2032		74,300	(46)	(1)	2	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.100%	02/08/2034		32,000	4	4	0	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.040%	02/12/2034		1,500	0	0	0	0
受取	6-Month	HUF-BUBOR	6.080%	02/12/2034		3,700	0	0	0	0
支払	6-Month	HUF-BUBOR	6.140%	02/15/2034		20,400	(2)	0	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	6.830%	08/19/2024	PLN	3,200	(32)	(29)	0	(1)
受取	6-Month	PLN-WIBOR	6.890%	08/22/2024		2,800	(29)	(26)	0	(1)
受取	6-Month	PLN-WIBOR	0.655%	05/21/2025		1,500	18	(4)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.520%	03/20/2026		200	0	0	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.620%	03/21/2026		400	0	(1)	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.335%	06/28/2026		900	0	0	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	4.350%	03/09/2027		300	2	1	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.158%	03/22/2027		3,100	(2)	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.175%	03/24/2027		400	0	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.285%	03/25/2027		700	0	2	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.290%	03/25/2027		600	0	2	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.575%	04/08/2027		600	(1)	2	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.870%	04/22/2027		400	(2)	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	6.210%	04/26/2027		300	(2)	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	6.480%	05/25/2027		500	(5)	2	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	6.940%	06/09/2027		200	2	(1)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	0.663%	06/25/2027		500	(15)	0	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	6.745%	07/05/2027		900	19	5	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	4.910%	07/25/2027		650	(1)	(5)	0	(4)
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.430%	03/16/2028		920	2	(4)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	3.250%	06/20/2028		800	(13)	(2)	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	4.735%	10/09/2028		600	(2)	(1)	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	4.560%	11/06/2028		1,700	(2)	(3)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	4.730%	02/16/2029		100	0	0	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	4.810%	02/16/2029		200	(1)	(1)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	4.660%	02/19/2029		500	(2)	(2)	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	4.970%	03/21/2029		500	0	0	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.020%	03/21/2029		200	0	0	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	4.923%	03/22/2029		1,900	(2)	(1)	0	(1)
受取	6-Month	PLN-WIBOR	1.490%	08/29/2029		200	8	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	1.110%	01/12/2031		500	29	3	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	2.920%	12/13/2031		300	9	0	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.220%	03/20/2033		200	(1)	1	0	0
受取	6-Month	PLN-WIBOR	5.310%	03/21/2033		580	(2)	4	0	0
支払	6-Month	PLN-WIBOR	5.087%	06/28/2034		200	0	0	0	0
受取	7-Day	China Fixing Repo Rate	2.405%	12/20/2028	CNY	2,935	(8)	(3)	0	0
受取 ⁽⁴⁾	7-Day	China Fixing Repo Rate	2.250%	09/18/2029		380	(1)	(1)	0	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.200%	06/19/2025	¥	520,000	2	1	0	0	0
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.232%	10/05/2025		500,000	(2)	0	1	0	0

	Bank of Japan Uncollateralized								
受取	Overnight Call Rate	0.350%	03/21/2026	BRL	5,000	0	0	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.350%	07/01/2024		4,200	(1)	0	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	12.490%	07/01/2024		4,500	(2)	0	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	12.595%	07/01/2024		3,700	3	0	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	13.080%	07/01/2024		8,400	14	0	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.336%	01/02/2025		4,450	111	(4)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.660%	01/02/2025		11,500	0	0	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.830%	01/02/2026		5,700	(25)	(25)	0	(2)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.710%	01/02/2025		19,400	(2)	(2)	0	(2)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.164%	01/02/2026		390	2	2	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.529%	01/02/2026		1,800	5	8	1	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.691%	01/02/2026		1,600	(3)	(7)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	6.151%	01/04/2027		4,110	(147)	(30)	0	(1)
受取	BRL-CDI-Compounded	9.783%	01/04/2027		6,000	44	42	3	0
支払	BRL-CDI-Compounded	9.795%	01/04/2027		3,200	(23)	(23)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.815%	01/04/2027		1,500	(10)	(10)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.832%	01/04/2027		1,400	(9)	(10)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	9.840%	01/04/2027		2,200	(15)	(15)	0	(1)
受取	BRL-CDI-Compounded	9.840%	01/04/2027		3,400	24	24	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	9.842%	01/04/2027		3,300	(22)	(22)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.225%	01/04/2027		1,150	(6)	(6)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.235%	01/04/2027		1,150	(6)	(6)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.565%	01/04/2027		1,800	(7)	(7)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	10.602%	01/04/2027		1,910	(11)	(13)	0	(1)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.671%	01/04/2027		3,900	14	14	2	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.768%	01/04/2027		800	3	6	0	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.792%	01/04/2027		7,500	(29)	(52)	0	(4)
受取	BRL-CDI-Compounded	10.872%	01/04/2027		2,200	7	15	1	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.880%	01/04/2027		4,800	14	14	3	0
受取	BRL-CDI-Compounded	10.943%	01/04/2027		2,900	8	8	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.980%	01/04/2027		2,900	(8)	(8)	0	(2)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.064%	01/04/2027		900	(2)	(6)	0	0
受取	BRL-CDI-Compounded	11.133%	01/04/2027		2,600	6	6	1	0
受取	BRL-CDI-Compounded	11.603%	01/04/2027		3,000	2	2	2	0
支払	BRL-CDI-Compounded	10.044%	01/02/2029		2,000	(21)	(17)	0	(1)
支払	BRL-CDI-Compounded	11.928%	01/02/2029		1,300	(1)	(1)	0	(1)
受取	BRL-CDI-Compounded	12.569%	01/02/2029		600	(1)	6	1	0
支払 ⁽⁴⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	09/18/2026	CAD	300	(1)	1	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/18/2029		400	5	(3)	0	0
支払 ⁽⁴⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.250%	09/18/2034		300	(3)	4	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.000%	09/18/2054		100	5	(2)	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.500%	02/15/2025	COP	365,000	2	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.855%	02/22/2025		20,070	0	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.450%	03/31/2025		87,000	1	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.800%	05/05/2025		329,000	5	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.470%	07/01/2025		164,000	0	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.340%	02/26/2026		2,722,900	4	3	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.500%	04/04/2026		2,161,000	4	4	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.540%	04/05/2026		671,000	1	1	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.500%	04/09/2026		211,000	0	0	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.515%	04/09/2026		420,500	1	1	0	0
受取	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.620%	04/10/2026		181,100	0	0	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.600%	04/11/2026		954,000	(1)	(1)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.653%	04/11/2026		579,100	(1)	(1)	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.860%	04/12/2026		784,500	0	0	0	0
支払	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.920%	04/12/2026		784,500	0	0	0	0

支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.050%	04/15/2026	438,400	0	0	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.650%	06/17/2026	1,594,100	0	0	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.580%	06/28/2026	1,433,000	0	0	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.790%	01/20/2028	929,400	10	(8)	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	10.060%	03/08/2028	1,185,000	16	(10)	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.305%	04/28/2028	62,580	0	(1)	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.150%	05/02/2028	903,000	6	(8)	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.050%	10/03/2028	300,500	2	(3)	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.215%	11/14/2028	259,400	0	1	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.090%	06/21/2029	409,600	0	0	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.155%	06/24/2029	465,000	0	0	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	10.400%	11/21/2029	42,800	(1)	1	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.370%	03/17/2030	229,900	(3)	3	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.393%	03/21/2030	51,050	0	1	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	7.715%	09/18/2030	397,200	3	5	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.020%	12/04/2030	392,700	1	5	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	4.155%	01/15/2031	77,000	4	1	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	7.705%	03/26/2031	664,600	4	8	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	10.230%	03/06/2033	88,000	(3)	1	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	10.245%	03/06/2033	220,000	(6)	3	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.930%	03/07/2033	698,680	(16)	10	0	0
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	9.407%	03/21/2033	431,400	(7)	6	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	7.620%	02/26/2034	740,400	(9)	(6)	0	0
支払	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.210%	06/21/2034	969,900	(2)	(2)	0	(1)
受取	Colombia Overnight Reference Rate	IBR Interbank	8.380%	06/28/2034	399,000	0	0	0	0
支払	Financial Benchmarks Overnight Interbank Rate	India Mumbai Outright	6.384%	06/20/2026	INR 97,000	(3)	0	0	0
受取	Financial Benchmarks Overnight Interbank Rate	India Mumbai Outright	6.384%	06/20/2026	172,800	6	6	0	0
受取	Financial Benchmarks Overnight Interbank Rate	India Mumbai Outright	6.621%	12/20/2028	14,849	(1)	0	0	0

受取 ⁽⁴⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	09/18/2029		93,270	7	6	0	(1)
受取 ⁽⁴⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.500%	09/18/2029		45,790	(2)	(3)	0	0
支払	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.397%	06/20/2034		44,200	(1)	(1)	1	0
受取	Rate	6.397%	06/20/2034		24,800	0	0	1	0
受取	IBMEXID	10.900%	06/04/2025	MXN	7,470	0	0	0	0
支払	IBMEXID	9.696%	03/23/2026		4,300	(3)	(3)	1	0
支払	IBMEXID	9.705%	03/23/2026		9,300	(6)	(6)	1	0
受取	IBMEXID	10.285%	04/20/2026		16,700	1	1	0	(2)
支払	IBMEXID	10.310%	06/08/2026		7,900	0	0	1	0
支払	IBMEXID	9.240%	09/03/2026		5,200	(6)	(4)	1	0
受取	IBMEXID	9.740%	09/03/2026		5,400	3	3	0	(1)
支払	IBMEXID	10.230%	09/03/2026		6,100	0	(7)	1	0
支払	IBMEXID	9.440%	03/04/2027		4,200	(3)	(5)	1	0
受取	IBMEXID	9.270%	03/23/2027		6,500	6	6	0	(1)
受取	IBMEXID	8.728%	05/22/2028		2,800	5	4	0	0
支払	IBMEXID	9.295%	10/30/2028		1,000	(1)	0	0	0
支払	IBMEXID	9.605%	05/30/2029		3,230	0	0	1	0
支払	IBMEXID	9.620%	05/30/2029		10,300	1	1	1	0
受取	IBMEXID	9.800%	06/15/2029		8,100	(4)	(4)	0	(1)
支払	IBMEXID	9.645%	06/09/2034		2,540	2	2	1	0
受取	IBMEXID	6.540%	05/31/2040		5,100	68	10	0	(4)
受取	KRW-CD-KSDA- Bloomberg	3.302%	06/20/2026	KRW	692,130	0	0	0	0
支払	KRW-CD-KSDA- Bloomberg	3.820%	12/20/2028		249,259	5	1	0	0
支払	KRW-CD-KSDA- Bloomberg	3.580%	12/20/2033		29,394	0	0	0	0
支払	KRW-CD-KSDA- Bloomberg	3.192%	06/20/2034		136,980	0	0	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	4.455%	06/30/2026	\$	5,500	3	3	0	0
支払 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	09/18/2026		800	(10)	3	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	06/21/2028		600	20	5	0	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/20/2028		800	(19)	(16)	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/20/2028		700	17	14	1	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.940%	02/22/2029		300	(4)	(4)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2029		4,137	(62)	52	0	(7)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2029		1,800	27	(5)	3	0
受取 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	09/18/2029		200	4	0	0	0
支払 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/18/2029		1,200	(8)	(3)	0	(3)
受取 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/18/2029		2,800	20	7	6	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2031		1,300	(19)	6	0	(5)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.175%	10/10/2033		100	1	(2)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	11/01/2033		100	3	(2)	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	4.030%	12/15/2033		100	0	2	1	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.950%	12/19/2033		400	3	8	2	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033		160	(7)	(3)	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033		160	7	3	1	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.854%	12/29/2033		100	2	2	1	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.684%	01/03/2034		100	3	2	1	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.725%	02/07/2034		100	(2)	(3)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.090%	04/30/2034		100	1	1	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.200%	05/06/2034		100	2	2	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2034		1,970	34	(40)	13	0

支払 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	09/18/2034		100	(1)	(1)	0	(1)
支払 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/18/2034		500	(5)	(7)	0	(4)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.880%	10/16/2053		200	2	(4)	0	(4)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	12/20/2053		200	19	4	3	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	06/20/2054		700	30	(10)	12	0
受取 ⁽⁴⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	09/18/2054		100	4	2	2	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	4.800%	02/13/2026	CLP	100,200	2	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	4.775%	02/23/2026		534,200	9	6	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	5.360%	06/28/2026		535,000	1	1	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	6.070%	02/28/2028		211,100	(6)	7	1	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	5.550%	06/05/2028		135,800	1	(4)	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	4.640%	10/01/2028		85,000	3	3	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	4.940%	10/01/2028		75,000	(1)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	4.980%	10/01/2028		70,000	(1)	(1)	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.220%	10/01/2028		119,000	1	4	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.290%	10/01/2028		75,500	1	3	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.920%	10/02/2028		73,000	(2)	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.780%	10/03/2028		71,500	(2)	2	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	5.500%	11/13/2028		134,800	1	(2)	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.260%	11/17/2028		65,200	0	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	4.695%	02/14/2029		82,500	3	3	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	5.020%	06/24/2029		389,700	(5)	(5)	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.350%	09/01/2030		60,900	0	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.690%	09/01/2030		8,900	(1)	0	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	6.146%	10/30/2032		416,300	(25)	15	1	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.030%	03/20/2033		25,140	1	1	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.400%	04/01/2033		39,800	0	2	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Sinacofi Interbank Average Rate	5.250%	05/13/2033		81,400	0	0	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.855%	10/05/2033		160,000	(6)	6	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.790%	10/06/2033		56,000	(2)	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.870%	10/11/2033		62,700	(3)	2	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	5.940%	10/20/2033		26,000	(1)	1	0	0

受取	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.990%	10/20/2033	247,720	(12)	9	0	0
受取	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	6.235%	10/26/2033	77,300	(5)	3	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.400%	11/16/2033	87,100	0	(3)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.230%	11/17/2033	36,800	0	(1)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	4.920%	02/13/2034	23,900	(1)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.030%	02/23/2034	125,900	(4)	(3)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.313%	04/25/2034	122,400	(1)	(1)	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.360%	04/26/2034	53,600	0	0	0	0
支払 ⁽⁴⁾	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.750%	05/13/2034	83,300	0	0	0	0
支払	Sinacofi Interbank Average Rate	Chile	5.200%	06/13/2034	187,000	(3)	(3)	0	0
受取	Singapore Overnight Index Average	Rate	5.450%	06/28/2034	131,000	(1)	(1)	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Singapore Overnight Index Average	Rate	3.000%	09/18/2026	SGD 1,500	2	4	1	0
受取	Singapore Overnight Index Average	Rate	3.322%	12/20/2028	538	(5)	3	1	0
受取 ⁽⁴⁾	Singapore Overnight Index Average	Rate	2.750%	09/18/2029	960	7	4	1	0
支払 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	Rate	4.250%	09/18/2026	GBP 300	0	0	0	0
受取 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	Rate	4.000%	09/18/2029	500	(3)	(4)	1	0
受取 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	Rate	3.750%	09/18/2034	100	1	1	0	0
支払 ⁽⁴⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	Rate	3.750%	09/18/2054	150	(5)	(3)	0	\$ (2)
						\$ (93)	\$ (66)	\$ 96	\$ (101)
スワップ 契約 合計						\$ (93)	\$ (68)	\$ 96	\$ (101)

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2024年6月30日現在の市場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

2024年6月30日現在、上場および中央清算金融デリバティブ商品について\$786の現金が担保として差し入れられている。マスター・ネットリング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				
	市場価格	変動証拠金資産			市場価格	変動証拠金負債			合計
	買建オプション	先物	スワップ 契約	合計	売建オプション	先物	スワップ 契約		
上場 または 中央 清算 合計	\$ 0	\$ 5	\$ 96	\$ 101	\$ 0	\$ (3)	\$ (101)	\$ (104)	

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スワ

レドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(3) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(4) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(I) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨		受取通貨	未実現評価(損)益		
					資産	負債	
AZD	07/2024	\$	11	NZD	18	\$	0
AZD	08/2024	NZD	18	\$	11	\$	0
AZD	10/2024	CNH	1,159		162		0
BOA	07/2024	EUR	1,245		1,352		17
BOA	07/2024	HUF	268,477		728		0
BOA	07/2024	IDR	7,061,175		431		0
BOA	07/2024	PLN	1,491		368		(2)
BOA	07/2024	SGD	38		28		0
BOA	07/2024	\$	317	GBP	250		(1)
BOA	07/2024		416	KRW	569,245		(3)
BOA	07/2024		1,321	PLN	5,314		0
BOA	08/2024	JPY	280,000	\$	1,822		69
BOA	08/2024	\$	27	PKR	7,790		1
BOA	11/2024	TRY	576	\$	15		(1)
BOA	11/2024	ZMW	686		25		(2)
BOA	12/2024	EGP	952		14		(4)
BOA	01/2025	TRY	1,619		37		(2)
BOA	02/2025	CNH	393		55		0
BOA	05/2025	TRY	795		17		(1)
BPS	07/2024	AUD	23		15		0
BPS	07/2024	BRL	828		154		5
BPS	07/2024	CAD	315		231		1
BPS	07/2024	CLP	171,083		181		0
BPS	07/2024	GBP	644		823		9
BPS	07/2024	PLN	589		146		(1)
BPS	07/2024	RON	4,172		899		1
BPS	07/2024	SGD	58		42		0
BPS	07/2024	TRY	14,768		439		(1)
BPS	07/2024	\$	157	BRL	828		(8)
BPS	07/2024		87	CAD	119		0
BPS	07/2024		181	CLP	171,083		0
BPS	07/2024		1,001	EUR	936		2
BPS	07/2024		161	JPY	25,000		(5)
BPS	07/2024		412	KRW	564,958		(1)
BPS	07/2024		1,225	PLN	4,908		(5)
BPS	07/2024		706	THB	26,019		4
BPS	08/2024	EUR	858	\$	919		(2)
BPS	08/2024	\$	15	AUD	23		0
BPS	08/2024		42	SGD	57		0
BPS	08/2024		99	TRY	3,459		1
BPS	09/2024	CNH	324	\$	45		1
BPS	09/2024	COP	383,420		95		4
BPS	09/2024	INR	1,938		23		0
BPS	09/2024	\$	293	CLP	270,147		(7)
BPS	09/2024		671	COP	2,811,906		(1)
BPS	09/2024		410	TWD	13,182		(2)
BPS	10/2024	CNH	170	\$	24		0
BPS	10/2024	\$	718	CNH	5,164		(5)
BPS	12/2024		95		681		(1)
BPS	12/2024		16	EGP	789		(1)
BPS	01/2025	CNH	721	\$	101		1
BPS	05/2029	KWD	46		157		5
BPS	05/2029		32		111		3
BPS	05/2029		46		157		5
BPS	05/2029		46		157		5
BPS	07/2029		19		67		0
BRC	07/2024	CZK	4,053		176		2
BRC	07/2024	EUR	43		46		0
BRC	07/2024	IDR	599,507		37		0
BRC	07/2024	MXN	2,242		123		0
BRC	07/2024	NOK	43		4		0
BRC	07/2024	PLN	457		114		0
BRC	07/2024	\$	368	HUF	136,386		2
BRC	07/2024		81	INR	6,777		0
BRC	07/2024		63	JPY	9,800		(2)
BRC	07/2024		42	PLN	171		0
BRC	07/2024		566	RON	2,609		(4)
BRC	07/2024		19	SEK	201		0
BRC	07/2024		25	TRY	857		0
BRC	07/2024		54		1,834		0
BRC	07/2024		484		16,465		7
BRC	07/2024		91		3,230		6
BRC	07/2024		18		616		0
BRC	08/2024	SEK	201	\$	19		0
BRC	08/2024	\$	44	EUR	41		0
BRC	08/2024		38	TRY	1,344		0
BRC	08/2024		42		1,433		0
BRC	09/2024	MXN	18,100	\$	966		(12)

BRC	09/2024	TRY	1,346		37	0	0
BRC	09/2024	\$	1,235	MXN	23,266	22	0
BRC	09/2024		19	TRY	718	1	0
BRC	10/2024	TRY	1,029	\$	26	0	(2)
BRC	10/2024	\$	46	CNH	335	0	0
BRC	11/2024		15	TRY	577	1	0
BRC	01/2025	TRY	1,249	\$	30	0	(1)
BRC	01/2025		1,257		30	0	(1)
BRC	01/2025		1,238		30	0	(1)
BRC	01/2025	\$	30	TRY	1,304	2	0
BRC	02/2025		55	CNH	393	0	0
BRC	04/2025	TRY	1,235	\$	27	0	(1)
BRC	05/2025	\$	17	TRY	795	1	0
CBK	07/2024	BRL	2,181	\$	401	8	0
CBK	07/2024	CHF	16		17	0	0
CBK	07/2024	CLP	85,560		93	2	0
CBK	07/2024	EUR	21		22	0	0
CBK	07/2024	GBP	11		14	0	0
CBK	07/2024	PEN	395		106	3	0
CBK	07/2024		395		104	1	0
CBK	07/2024	PLN	879		220	1	0
CBK	07/2024	RON	202		44	0	0
CBK	07/2024	SEK	541		51	0	0
CBK	07/2024	TRY	1,369		41	0	0
CBK	07/2024	\$	403	BRL	2,181	0	(10)
CBK	07/2024		76	EUR	70	0	(1)
CBK	07/2024		64	GBP	50	0	0
CBK	07/2024		7	KES	966	0	0
CBK	07/2024		33	KRW	45,450	0	0
CBK	07/2024		286	MXN	5,235	0	(1)
CBK	07/2024		36		628	0	(2)
CBK	07/2024		6	NGN	9,034	0	0
CBK	07/2024		41	NOK	430	0	0
CBK	07/2024		104	PEN	395	0	(1)
CBK	07/2024		30	PHP	1,759	0	0
CBK	07/2024		316	PLN	1,254	0	(4)
CBK	07/2024		33	SEK	340	0	0
CBK	07/2024		32	TRY	1,086	0	0
CBK	07/2024		47	UYU	1,854	0	0
CBK	07/2024		96	ZAR	1,737	0	(1)
CBK	07/2024	UYU	1,573	\$	40	0	0
CBK	07/2024		1,854		48	1	0
CBK	07/2024	ZAR	634		34	0	0
CBK	08/2024	\$	209	BRL	1,144	0	(4)
CBK	09/2024	BRL	1,065	\$	192	2	0
CBK	09/2024	MXN	7,912		421	0	(6)
CBK	09/2024	PEN	2,389		640	17	0
CBK	09/2024	\$	16	EGP	786	0	0
CBK	09/2024		162	INR	13,585	0	0
CBK	09/2024		514	PEN	1,954	0	(4)
CBK	09/2024		155	TWD	5,005	0	(1)
CBK	09/2024	UYU	79	\$	2	0	0
CBK	10/2024	\$	105	COP	458,010	4	0
CBK	12/2024		20	EGP	988	0	(1)
CBK	01/2025		101	CNH	721	0	(1)
CBK	01/2025		105	COP	462,840	4	0
CBK	02/2025	UGX	41,546	\$	10	0	(1)
CBK	04/2025	\$	105	COP	470,925	4	0
CBK	04/2025		27	TRY	1,233	1	0
CBK	10/2025		52	COP	253,344	5	0
DUB	07/2024	BRL	530	\$	101	6	0
DUB	07/2024	CLP	465,722		504	10	0
DUB	07/2024	NGN	16,244		13	2	0
DUB	07/2024	\$	95	BRL	530	0	0
DUB	07/2024		19	EGP	908	0	0
DUB	07/2024		229	KRW	315,026	0	0
DUB	07/2024		1,008	MYR	4,751	0	0
DUB	07/2024		45	PLN	176	0	(1)
DUB	08/2024	BRL	2,071	\$	390	18	0
DUB	08/2024	EUR	272	PLN	1,256	20	0
DUB	08/2024	\$	10	KES	1,338	0	0
DUB	09/2024	KZT	9,357	\$	20	1	0
DUB	09/2024	\$	9	KZT	4,207	0	0
DUB	10/2024		14	TRY	577	1	0
DUB	11/2024	JPY	12,901	\$	91	10	0
DUB	11/2024	ZMW	690		25	0	(2)
DUB	02/2025	UGX	94,173		24	0	(1)
DUB	02/2025		41,704		10	0	(1)
DUB	02/2025	\$	14	PKR	4,200	0	0
FAR	07/2024	NZD	213	\$	131	1	0
FAR	07/2024	\$	17	AUD	25	0	0
FAR	07/2024		21	NZD	34	0	0
FAR	08/2024	NZD	34	\$	21	0	0
GLM	07/2024	BRL	2,443		450	10	0
GLM	07/2024	CLP	159,645		174	5	0
GLM	07/2024		85,523		93	2	0
GLM	07/2024	MXN	301		16	0	0
GLM	07/2024	MYR	175		37	0	0
GLM	07/2024	PLN	1,423		352	0	(2)
GLM	07/2024	TRY	847		25	0	0
GLM	07/2024	\$	439	BRL	2,443	0	0
GLM	07/2024		493	CZK	11,418	0	(4)
GLM	07/2024		2	EGP	82	0	0
GLM	07/2024		327	MXN	5,960	0	(2)
GLM	07/2024		38	PLN	154	0	0
GLM	07/2024		1,422	THB	52,274	4	0

GLM	07/2024		37	TRY	1,272	1	0
GLM	07/2024		16	UYU	650	0	0
GLM	07/2024	UYU	650	\$	17	1	0
GLM	07/2024	ZAR	8,872		485	0	0
GLM	08/2024	DOP	1,066		18	0	0
GLM	08/2024		4,131		69	0	(1)
GLM	08/2024		2,146		36	0	0
GLM	08/2024	\$	1,657	BRL	8,547	0	(124)
GLM	08/2024		44	COP	190,168	2	0
GLM	08/2024		129	DOP	7,676	0	0
GLM	08/2024		6	EGP	292	0	0
GLM	09/2024	DOP	22,572	\$	376	0	(4)
GLM	09/2024		2,803		47	0	0
GLM	09/2024		8,840		147	0	(2)
GLM	09/2024	KZT	9,360		20	1	0
GLM	09/2024	\$	124	TRY	4,387	0	0
GLM	09/2024		102		4,073	13	0
GLM	09/2024		29	UYU	1,148	0	0
GLM	09/2024		1		40	0	0
GLM	10/2024		176	BRL	966	0	(4)
GLM	10/2024		696	CNH	4,997	0	(5)
GLM	10/2024		15	TRY	604	1	0
GLM	10/2024		26		1,024	2	0
GLM	11/2024		91	JPY	12,916	0	(9)
GLM	11/2024		14	TRY	575	1	0
GLM	11/2024		7		303	1	0
GLM	11/2024		7		279	0	0
GLM	01/2025		30		1,238	1	0
GLM	01/2025		30		1,249	1	0
GLM	01/2025		30		1,257	1	0
GLM	03/2025	TRY	2,257	\$	47	0	(6)
GLM	03/2025	\$	276	TRY	13,240	34	0
GLM	04/2025		217	COP	991,365	13	0
JPM	07/2024	CZK	14,952	\$	647	7	0
JPM	07/2024	EUR	33		35	0	0
JPM	07/2024	HUF	19,726		53	0	0
JPM	07/2024	KES	2,757		21	0	0
JPM	07/2024	PLN	841		208	0	(1)
JPM	07/2024	SGD	173		128	1	0
JPM	07/2024	THB	2,372		65	0	0
JPM	07/2024	\$	174	CHF	155	0	(2)
JPM	07/2024		12	CNY	87	0	0
JPM	07/2024		450	IDR	7,295,655	0	(4)
JPM	07/2024		282	KRW	388,785	1	0
JPM	07/2024		92	PLN	366	0	(1)
JPM	07/2024		199	SGD	268	0	(1)
JPM	07/2024		51	TRY	1,741	1	0
JPM	07/2024		15	UYU	590	0	0
JPM	07/2024		52	ZAR	938	0	0
JPM	07/2024	ZAR	16,806	\$	913	0	(6)
JPM	08/2024	CHF	74		83	0	0
JPM	08/2024	CNY	87		12	0	0
JPM	08/2024	EUR	78	PLN	336	0	0
JPM	08/2024	KES	1,338	\$	10	0	0
JPM	08/2024	PLN	1,253	EUR	272	0	(19)
JPM	08/2024	TRY	470	\$	13	0	0
JPM	08/2024		1,734		50	0	0
JPM	08/2024	\$	94	COP	406,527	3	0
JPM	08/2024		5	NGN	6,873	0	0
JPM	08/2024		11	PKR	3,274	0	0
JPM	08/2024		10	TRY	349	0	0
JPM	08/2024		128		4,367	0	0
JPM	08/2024		48		1,740	2	0
JPM	09/2024	COP	2,431,627	\$	578	0	(1)
JPM	09/2024	EUR	61	PLN	289	6	0
JPM	09/2024	INR	3,100	\$	37	0	0
JPM	09/2024	PLN	130	EUR	29	0	(1)
JPM	09/2024	\$	76	CLP	68,840	0	(3)
JPM	09/2024		14	EGP	690	0	0
JPM	09/2024		22	INR	1,853	0	0
JPM	09/2024		265	TWD	8,516	0	(1)
JPM	10/2024	CNH	392	\$	55	1	0
JPM	10/2024	\$	726	CNH	5,196	0	(8)
JPM	12/2024	CNH	682	\$	95	0	0
JPM	12/2024	EGP	939		15	0	(3)
JPM	01/2025	\$	7	TRY	314	0	0
MBC	07/2024	EUR	199	\$	217	3	0
MBC	07/2024	JPY	6,588		44	3	0
MBC	07/2024		55,795		356	9	0
MBC	07/2024	PLN	27		7	0	0
MBC	07/2024	\$	41	AUD	62	0	0
MBC	07/2024		143	CAD	196	0	0
MBC	07/2024		1,364	CZK	31,461	0	(17)
MBC	07/2024		40	EUR	37	0	0
MBC	07/2024		204	GBP	161	0	(1)
MBC	07/2024		588	HUF	219,331	6	0
MBC	07/2024		163	JPY	25,900	0	(2)
MBC	07/2024		48	UYU	1,868	0	(1)
MBC	07/2024	UYU	4,563	\$	115	0	0
MBC	07/2024		590		15	0	0
MBC	07/2024		1,868		47	0	0
MBC	08/2024	CAD	147		107	0	0
MBC	08/2024	GBP	128		162	0	0
MBC	08/2024	\$	61	JPY	9,800	0	0
MBC	09/2024	INR	12,685	\$	151	0	0
MBC	09/2024	\$	2	TWD	64	0	0

MBC	09/2024		16	UYU	629	0	0
MBC	09/2024	UYU	40	\$	1	0	0
MBC	09/2024		1,868		47	0	0
MBC	10/2024	CNH	313		43	0	0
MBC	10/2024	\$	317	CNH	2,276	0	(2)
MBC	12/2024	CNH	657	\$	92	1	0
MBC	12/2024	\$	92	CNH	656	0	(1)
MBC	02/2025	UGX	42,735	\$	11	0	(1)
MBC	02/2025		94,227		23	0	(1)
MYI	07/2024	BRL	3,012		551	8	0
MYI	07/2024	CZK	874		38	1	0
MYI	07/2024	INR	56,740		678	0	(3)
MYI	07/2024	NOK	387		36	0	0
MYI	07/2024	PLN	2,325		579	1	0
MYI	07/2024	\$	559	BRL	3,012	0	(17)
MYI	07/2024		32	CHF	29	0	0
MYI	07/2024		168	EUR	157	0	0
MYI	07/2024		246	GBP	194	0	(1)
MYI	07/2024		44	JPY	6,589	0	(3)
MYI	07/2024		48	NZD	79	0	0
MYI	07/2024		84	PLN	338	0	0
MYI	07/2024	ZAR	597	\$	32	0	(1)
MYI	07/2024		881		48	0	0
MYI	08/2024	\$	116	BRL	642	0	(1)
MYI	08/2024		13	IDR	199,810	0	(1)
MYI	08/2024		36	NOK	387	0	0
MYI	09/2024	MXN	1,445	\$	77	0	(1)
MYI	09/2024	PEN	2,190		577	5	0
MYI	09/2024	\$	272	CLP	254,929	0	(2)
MYI	09/2024		13	INR	1,072	0	0
MYI	09/2024		106	TWD	3,388	0	(1)
MYI	10/2024		68	JPY	10,358	0	(2)
NGF	08/2024		23	IDR	353,510	0	(1)
RBC	07/2024	BRL	123	\$	22	0	0
RBC	07/2024	\$	23	BRL	123	0	0
RBC	07/2024		166	EUR	153	0	(2)
RBC	07/2024		33	PHP	1,936	0	0
RBC	08/2024		134	JPY	21,398	0	0
RBC	09/2024		33	PEN	125	0	0
RBC	09/2024		30	TWD	967	0	0
RYL	07/2024	AUD	64	\$	43	0	0
RYL	07/2024	EUR	89		95	0	0
RYL	07/2024	\$	35	NZD	56	0	(1)
RYL	10/2024	JPY	10,366	\$	68	2	0
SCX	07/2024	BRL	199		37	1	0
SCX	07/2024	CNY	87		12	0	0
SCX	07/2024	MYR	1,652		350	0	0
SCX	07/2024	PEN	4,782		1,276	27	0
SCX	07/2024	\$	36	BRL	199	0	0
SCX	07/2024		242	EUR	225	0	(1)
SCX	07/2024		105	JPY	16,600	0	(2)
SCX	07/2024		13	KES	1,791	1	0
SCX	07/2024		206	KRW	280,892	0	(2)
SCX	07/2024		1	MXN	19	0	0
SCX	07/2024		6	NGN	9,008	0	0
SCX	07/2024		11		16,244	0	(1)
SCX	07/2024	ZAR	3,577	\$	194	0	(2)
SCX	08/2024	NGN	17,405		12	1	0
SCX	08/2024	UGX	41,423		11	0	(1)
SCX	08/2024	\$	42	COP	181,776	2	0
SCX	08/2024		3	EGP	186	1	0
SCX	08/2024		7	NGN	10,531	0	0
SCX	09/2024	CNH	84	\$	12	0	0
SCX	09/2024	INR	17,952		214	0	0
SCX	09/2024	KZT	4,121		9	0	0
SCX	09/2024	PHP	3,002		51	0	0
SCX	09/2024	\$	58	EGP	2,873	0	(1)
SCX	09/2024		14		685	0	0
SCX	09/2024		9	KZT	4,121	0	0
SCX	09/2024		155	TWD	4,995	0	(1)
SCX	10/2024	CNH	290	\$	40	0	0
SCX	12/2024	EGP	1,734		27	0	(7)
SCX	12/2024	\$	39	EGP	1,880	0	(2)
SOG	09/2024		19		935	0	0
SSB	07/2024	BRL	195	\$	36	1	0
SSB	07/2024	IDR	537,647		33	0	0
SSB	07/2024	KRW	49,490		36	0	0
SSB	07/2024	\$	35	BRL	195	0	0
SSB	07/2024		56	EUR	52	0	(1)
SSB	07/2024		1,513	IDR	24,939,989	11	0
SSB	07/2024		55	PLN	221	0	0
TOR	07/2024		16	NZD	26	0	0
TOR	08/2024	COP	3,743,800	\$	933	37	0
TOR	08/2024	NZD	26		16	0	0
UAG	07/2024	CHF	168		186	0	(1)
UAG	07/2024	\$	185	ILS	684	0	(3)
UAG	07/2024		581	RON	2,698	0	(1)
UAG	07/2024	ZAR	4,927	\$	271	2	0
外国為替先渡契約合計						\$ 541	\$ (426)

買建オプション： 外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
------	----	------	-----	---------------------	------	------

BOA	Put - OTC U.S. dollar versus South African Rand	ZAR	18.100	07/11/2024	165	\$	1	\$	1	
BOA	Put - OTC U.S. dollar versus South African Rand		18.300	07/11/2024	165		2		2	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	CNH	7.275	12/06/2024	23		3		6	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.325	12/06/2024	20		2		4	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.400	12/06/2024	28		2		4	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.325	01/14/2025	23		2		4	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.400	01/14/2025	28		2		4	
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.400	01/23/2025	28		3		3	
BRC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.300	02/14/2025	14		2		2	
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.300	01/14/2025	28		3		5	
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.450	02/14/2025	28		3		3	
GLM	Japanese yen	¥	167.000	11/05/2024	118		6		18	
JPM	Put - OTC Euro versus Polish zloty	PLN	4.400	08/22/2024	22		5		19	
MBC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	CNH	7.350	12/06/2024	24		2		4	
MBC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.300	02/14/2025	1		0		0	
MBC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)		7.375	02/14/2025	28		3		4	
MYI	Japanese yen	¥	168.000	10/29/2024	20		2		3	
SCX	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	CNH	7.300	02/14/2025	9		1		1	
買建オプション合計							\$	44	\$	87

売建オプション： 金利スワップオプション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム(受取)	市場価格
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Receive	3.880%	07/08/2024	100	\$ 0	\$ (1)
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	4.230%	07/08/2024	100	(1)	0
MYC	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	2.820%	07/11/2024	100	0	0
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	3.120%	07/11/2024	100	0	0
							\$ (1)	\$ (1)

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム(受取)	市場価格
BOA	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	TRY 43.800	11/01/2024	91	\$ (2)	\$ (1)
BOA	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	49.800	01/28/2025	221	(7)	(5)
BOA	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	55.000	05/01/2025	92	(4)	(3)
BOA	Put - OTC U.S. dollar versus South African Rand	ZAR 17.840	07/11/2024	330	(1)	(1)
BOA	Put - OTC U.S. dollar versus South African Rand	18.000	07/11/2024	330	(2)	(2)
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	MXN 17.450	07/01/2024	200	(7)	(9)
CBK	Put - OTC U.S. dollar versus Mexican peso	17.450	07/01/2024	200	(7)	0
CBK	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	TRY 39.000	04/03/2025	144	(2)	(4)
DUB	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	40.385	10/28/2024	42	(4)	(1)
DUB	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	40.385	10/28/2024	42	(4)	(5)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	40.250	10/30/2024	43	(4)	(1)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	39.800	10/31/2024	21	(2)	(1)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	40.930	11/07/2024	21	(2)	(1)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	41.150	11/07/2024	21	(2)	(1)
GLM	Call - OTC U.S. dollar versus Turkish lira	41.160	11/11/2024	21	(2)	(1)

GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		33.000	07/04/2024	98		(2)	0
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		35.500	10/03/2024	132		(1)	(3)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		40.250	10/30/2024	43		(4)	(5)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		39.800	10/31/2024	21		(2)	(2)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		40.930	11/07/2024	21		(2)	(2)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		41.150	11/07/2024	21		(2)	(3)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		41.160	11/11/2024	21		(2)	(2)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		36.500	01/03/2025	99		(3)	(2)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		36.500	01/07/2025	100		(3)	(2)
GLM	Put - OTC U.S. dollar versus Turkish lira		36.757	01/09/2025	100		(3)	(2)
MYI	Call - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah	IDR	15,370.000	08/13/2024	72		(2)	(4)
MYI	Put - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah		15,370.000	08/13/2024	72		(2)	0
NGF	Call - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah		15,370.000	08/13/2024	121	\$	(4)	\$ (7)
NGF	Put - OTC U.S. dollar versus Indonesian rupiah		15,370.000	08/13/2024	121		(4)	0
							\$ (88)	\$ (70)

ストラドル・オプション

取引相手	詳細	行使レベル ⁽²⁾	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム(受取)	市場価格
MYI	Call & Put- OTC 9 Month vs. 3 Month Forward Volatility Agreement	14.500%	10/25/2024	100	\$ 0	\$ 0
	売建オプション合計				\$ (89)	\$ (71)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの買い⁽³⁾

取引相手	参照債務	固定金利(支払)	満期日	インプライド・クレジット・スプレッド (2024年6月30日現在) ⁽⁵⁾	想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム支払額(受取額)	未実現評価(損益)	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
BOA	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.690%	\$ 200	\$ 4	\$ 1	\$ 5	\$ 0
BOA	Mexico Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.106%	100	1	0	1	0
BRC	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.690%	100	2	1	3	0
BRC	Chile Government International Bond	(1.000%)	12/20/2028	0.511%	100	(2)	0	0	(2)
BRC	Korea Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	0.364%	290	(8)	0	0	(8)
BRC	Mexico Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.106%	200	1	0	1	0
CBK	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.106%	100	1	0	1	0

GST	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.690%	100	2	1	3	0
JPM	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.700%	200	6	0	6	0
MYC	Brazil Government International Bond	(1.000%)	06/20/2029	1.690%	200	6	0	6	0
						\$ 13	\$ 3	\$ 26	\$ (10)

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽⁴⁾

スワップ契約（公正価値）

取引 相手	参照債務	受取固定 金利	満期日	イン プ ラ イ ド ・ ク レ ジ ッ ト ・ ス ワ ッ プ ・ プ レ ド （ 2024 年6月30 日現在 ⁽⁵⁾ ）	想定 元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払額 （受取 額）	未実現評 価（損） 益	資産	負債
BPS	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2029	1.946%	\$ 100	\$ (4)	\$ 0	\$ 0	\$ (4)
BRC	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2029	2.083%	500	(23)	0	0	(23)
CBK	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2029	1.946%	100	(4)	0	0	(4)
GST	Colombia Government International Bond	1.000%	06/20/2029	1.946%	200	(7)	(1)	0	(8)
GST	Israel Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.847%	100	0	0	0	0
GST	Israel Government International Bond	1.000%	12/20/2025	1.005%	100	0	0	0	0
JPM	Brazil Government International Bond	1.000%	12/20/2024	0.530%	100	(2)	2	0	0
JPM	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2029	2.083%	100	(5)	0	0	(5)
MYC	South Africa Government International Bond	1.000%	06/20/2029	2.083%	100	(5)	0	0	(5)
						\$ (50)	\$ 1	\$ 0	\$ (49)

クロス・カレンシー・スワップ

スワップ契約（公正価値）

取引 相手	受取	支払	満期日 ⁽⁷⁾	受取通貨 の想定元 本 ⁽⁸⁾	引渡通貨 の想定元 本 ⁽⁸⁾	プレミ アム 支払額 （受取 額）	未実現評 価（損） 益	資産	負債
GLM	引渡通貨 の想定元 本に基づ く担保付 翌日物調 達金利に 相当する 変動金利	受取通貨 の想定元 本に基づ く5.340% に相当す る固定金 利	09/18/2029	PHP 36,403	\$ 619	\$ (2)	\$ (6)	\$ 0	\$ (8)

引渡の 本に く翌 達相 相当 変動 金利	通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	受取 通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	09/18/2029	2,390	41	0	0	0	0
JPM	引渡の 本に く翌 達相 相当 変動 金利	通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	09/18/2029	\$ 257	INR 21,539	1	1	2	0
MBC	引渡の 本に く翌 達相 相当 変動 金利	通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	09/18/2029	87	7,269	0	0	0	0
NGF	引渡の 本に く翌 達相 相当 変動 金利	通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	09/18/2029	526	44,080	2	1	3	0
SCX	引渡の 本に く翌 達相 相当 変動 金利	通貨 元づ つ保 付調 に る 固定 金利	09/18/2029			\$ 1	\$ (4)	\$ 5	\$ (8)

金利スワップ

スワップ契約（公正価
値）

取引 相手	変動金 利支 払/受 取	変動金利 イン デックス	イン 種別	固定金 利	満期日	想定元本	プレミアム 支 払額 (受取 額)	未実現 評価 (損 益)	資産	負債
BOA	支払	3-Month KLIBOR	MYR-	3.868%	12/20/2028	MYR 393	\$ 1	\$ 0	\$ 1	\$ 0
BOA	受取 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.750%	09/18/2029	1,610	(1)	(1)	0	(2)
BPS	支払 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.500%	09/18/2026	3,130	0	0	0	0
BPS	受取 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.500%	09/18/2029	2,670	4	0	4	0
BPS	支払 ⁽⁹⁾	7-Day Fixing Rate	China Repo	2.250%	09/18/2029	CNY 3,520	5	2	7	0
BPS	受取	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	5.960%	01/11/2029	COP 1,234,400	0	27	27	0
CBK	受取 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.500%	09/18/2029	MYR 410	1	0	1	0
CBK	受取	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	4.490%	07/05/2024	COP 283,900	0	1	1	0
CBK	受取	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	5.990%	01/14/2029	307,200	0	7	7	0
CBK	支払	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	5.770%	03/26/2029	378,300	0	(8)	0	(8)
CBK	支払	Average Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	3.763%	05/24/2029	CLP 19,300	0	(1)	0	(1)
DUB	支払	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	5.830%	04/23/2029	COP 51,800	0	(1)	0	(1)
GLM	支払	Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	5.880%	05/28/2029	330,800	0	(8)	0	(8)
GLM	支払	Average Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR	4.275%	08/24/2028	CLP 76,200	0	(4)	0	(4)
GST	支払	3-Month KLIBOR	MYR-	3.868%	12/20/2028	MYR 1,200	3	0	3	0
JPM	受取 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.500%	09/18/2029	410	1	0	1	0
JPM	受取 ⁽⁹⁾	3-Month KLIBOR	MYR-	3.750%	09/18/2029	770	(1)	0	0	(1)

		Colombia Overnight Interbank Reference Rate	IBR															
JPM	受取	5.630%	02/07/2026	COP	1,183,000	0	15	15	0									
JPM	受取	6.320%	12/10/2028		566,000	0	10	10	0									
SCX ⁽⁹⁾	受取	3.500%	09/18/2029	MYR	280	0	0	0	0									
											\$	13	\$	39	\$	77	\$	(25)
スワップ契約合計											\$	(23)	\$	39	\$	108	\$	(92)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2024年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

2024年6月30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従い、金融デリバティブ商品について\$10の現金が担保として差し入れられている。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバティブの市場価格	差入（受）担保	ネット・エクスポージャー ⁽¹⁰⁾
	外国為替先渡契約	買建オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替先渡契約	売建オプション	スワップ契約	店頭合計			
AZD	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2	\$ 0	\$ 2
BOA	87	3	7	97	(16)	(12)	(2)	(30)	67	0	67
BPS	47	25	38	110	(40)	0	(4)	(44)	66	0	66
BRC	44	2	4	50	(24)	0	(33)	(57)	(7)	0	(7)
CBK	53	8	10	71	(38)	(13)	(13)	(64)	7	0	7
DUB	68	0	0	68	(5)	(6)	(1)	(12)	56	0	56
FAR	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
GLM	94	18	0	112	(163)	(29)	(20)	(212)	(100)	0	(100)
GST	0	0	6	6	0	0	(8)	(8)	(2)	0	(2)
JPM	22	19	32	73	(51)	0	(6)	(57)	16	0	16
MBC	22	8	2	32	(26)	0	(0)	(26)	6	0	6
MSC	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
MYC	0	0	6	6	0	0	(5)	(5)	1	0	1
MYI	15	3	0	18	(33)	(4)	0	(37)	(19)	10	(9)
NGF	0	0	0	0	(1)	(7)	0	(8)	(8)	0	(8)
RBC	0	0	0	0	(2)	0	0	(2)	(2)	0	(2)
RYL	2	0	0	2	(1)	0	0	(1)	1	0	1
SCX	33	1	3	37	(20)	0	0	(20)	17	0	17
SOG	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
SSB	12	0	0	12	(1)	0	0	(1)	11	0	11
TOR	37	0	0	37	0	0	0	0	37	0	37
UAG	2	0	0	2	(5)	0	0	(5)	(3)	0	(3)
店頭合計	\$ 541	\$ 87	\$ 108	\$ 736	\$ (426)	\$ (71)	\$ (92)	\$ (589)			

- 想定元本は契約数を表す。
- 先物期日に決定された行使レベルおよび最終コストは、インプライド・ボラティリティの変数に基づく。
- ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの売り手からスワップの想定元本に等しい額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。
- ファンドがプロテクションの売り手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。
- インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
- 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
- 満期日において、受取通貨の想定元本は引渡通貨の想定元本に交換される。

(8) 受け取るまたは引き渡す想定元本は、クロス・カレンシー・スワップの効力発生日に基づき、決定され転換される。

(9) この金融商品の発効日は将来の特定の日に開始する。有価証券取引および投資利益に関しては財務諸表に対する注記を参照のこと。

(10) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金/未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネットイング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2024年6月30日現在）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品						合計
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約		
金融デリバティブ商品 - 資産							
上場または中央清算							
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 5	\$	5
スワップ契約	0	0	0	0	96		96
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 101	\$	101
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 541	\$ 0	\$	541
買建オプション	0	0	0	87	0		87
スワップ契約	0	26	0	5	77		108
	\$ 0	\$ 26	\$ 0	\$ 633	\$ 77	\$	736
	\$ 0	\$ 26	\$ 0	\$ 633	\$ 178	\$	837
金融デリバティブ商品 - 負債							
上場または中央清算							
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (3)	\$	(3)
スワップ契約	0	0	0	0	(101)		(101)
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (104)	\$	(104)
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (426)	\$ 0	\$	(426)
売建オプション	0	0	0	(7)	(1)		(7)
スワップ契約	0	(59)	0	(8)	(25)		(92)
	\$ 0	\$ (59)	\$ 0	\$ (504)	\$ (26)	\$	(589)
	\$ 0	\$ (59)	\$ 0	\$ (504)	\$ (130)	\$	(693)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2024年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品						合計
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約		
金融デリバティブ商品に係る実現純利益（損失）							
上場または中央清算							
売建オプション	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 8	\$	8
先物	0	0	0	0	13		13
スワップ契約	0	(6)	0	0	410		404
	\$ 0	\$ (6)	\$ 0	\$ 0	\$ 431	\$	425
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (231)	\$ 0	\$	(231)
買建オプション	0	0	0	15	0		15
売建オプション	0	0	0	103	47		150
スワップ契約	0	(26)	0	116	83		173
	\$ 0	\$ (26)	\$ 0	\$ 3	\$ 130	\$	107
	\$ 0	\$ (32)	\$ 0	\$ 3	\$ 561	\$	532
金融デリバティブ商品に係る未実現評価（損）益の純変動額							
上場または中央清算							
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (7)	\$	(7)
スワップ契約	0	(2)	0	0	(177)		(179)
	\$ 0	\$ (2)	\$ 0	\$ 0	\$ (184)	\$	(186)
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 380	\$ 0	\$	380
買建オプション	0	0	0	(21)	0		(21)
売建オプション	0	0	0	27	0		27
スワップ契約	0	18	0	(119)	(17)		(118)
	\$ 0	\$ 18	\$ 0	\$ 267	\$ (17)	\$	268
	\$ 0	\$ 16	\$ 0	\$ 267	\$ (201)	\$	82

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2024年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2024/06/30現在)
投資有価証券（公正価値）				
アゼルバイジャン社債等	\$ 0	\$ 298	\$ 0	\$ 298

ブラジル								
社債等	0	155	720	875				
仕組債	0	97	0	97				
英領バージン諸島								
社債等	0	0	8	8				
ケイマン諸島								
資産担保証券	0	3	0	3				
社債等	0	344	32	376				
チリ								
ソブリン債	0	1,222	0	1,222				
中国								
ソブリン債	0	500	0	500				
コロンビア								
社債等	0	229	0	229				
ソブリン債	0	588	0	588				
チェコ共和国								
ソブリン債	0	542	0	542				
ドミニカ共和国								
ソブリン債	0	922	0	922				
エクアドル								
ソブリン債	0	60	0	60				
ハンガリー								
ソブリン債	0	861	0	861				
インド								
社債等	0	240	0	240				
インドネシア								
ソブリン債	0	428	0	428				
アイルランド								
社債等	0	270	22	292				
イタリア								
ソブリン債	0	203	0	203				
コートジボワール								
ソブリン債	0	278	0	278				
ルクセンブルク								
社債等	0	0	12	12				
マレーシア								
ソブリン債	0	1,279	0	1,279				
メキシコ								
社債等	0	46	0	46				
ソブリン債	0	2,409	0	2,409				
パラグアイ								
ソブリン債	0	72	0	72				
ペルー								
社債等	0	796	0	796				
ソブリン債	0	1,602	0	1,602				
フィリピン								
ソブリン債	0	246	0	246				
ポーランド								
ソブリン債	0	242	0	242				
ルーマニア								
ソブリン債	0	910	0	910				
シンガポール								
ソブリン債	0	1,103	0	1,103				
南アフリカ								
社債等	0	500	0	500				
ソブリン債	0	3,397	0	3,397				
国際機関								
社債等	0	1,226	0	1,226				
ソブリン債	0	1,074	0	1,074				
タイ								
ソブリン債	0	72	0	72				
トルコ								
ソブリン債	0	669	0	669				
ウクライナ								
ソブリン債	0	49	0	49				
英国								
社債等	0	262	0	262				
モーゲージ証券	0	126	0	126				
米国								
資産担保証券	0	98	0	98				
モーゲージ証券	0	1,227	91	1,318				
米国政府機関債	0	3	0	3				
ウルグアイ								
ソブリン債	0	405	0	405				
ウズベキスタン								
ソブリン債	0	88	0	88				
ザンビア								
ソブリン債	\$	0	\$	74	\$	74		
短期金融商品	0	4,665	437	5,102				
投資合計	\$	0	\$	29,880	\$	1,322	\$	31,202
金融デリバティブ商品 - 資産								
上場または中央清算	0	101	0	101				
店頭	0	736	0	736				
	\$	0	\$	837	\$	0	\$	837
金融デリバティブ商品 - 負債								
上場または中央清算	0	(104)	0	(104)				
店頭	0	(589)	0	(589)				
	\$	0	\$	(693)	\$	0	\$	(693)
合計	\$	0	\$	30,024	\$	1,322	\$	31,346

以下は、2024年6月30日に終了した年度においてファンドのために重要な観察不能な情報(レベル3)を使用した公正価値の購入、発行および振替の要約である(該当する場合)。

カテゴリー	購入純額	発行	レベル3への振替	レベル3からの振替
投資有価証券(公正価値)				
ケイマン諸島 社債等	\$ 38	\$ 0	\$ 0	\$ 0
南アフリカ 社債等	0	0	0	(212)
米国 モーゲージ証券	0	0	5	0
短期金融商品	386	0	0	0
	\$ 424	\$ 0	\$ 5	\$ (212)

以下は公正価値ヒエラルキーのレベル3に分類される資産および負債の公正価値に使用した重要な観察不能な情報の要約である。

カテゴリー	2024年6月30日の期末残高	評価手法	観察不能な情報	価値情報(別途注記のない限り)
投資有価証券(公正価値)				
ブラジル 社債等	\$ 2	Indicative Market Quotation	Broker Quote	\$ 0.99
	718	Discounted Cash Flow	Discount Rate	11.05
英領バージン諸島 社債等	8	Expected Recovery	Recovery Rate	7.50
ケイマン諸島 社債等	32	Discounted Cash Flow	Discount Rate	3.71
アイルランド 社債等	22	Third Party Vendor	Expected Recovery	3.00
ルクセンブルク 社債等	12	Third Party Vendor	Expected Recovery	6.00
米国 モーゲージ証券	91	Fair Valuation of odd lot positions Other Valuation Techniques	Adjustment factor	2.50
短期金融商品	437	(1)	-	-
合計	\$ 1,322			

(1) 財務諸表に対する注記で定義されていない評価手法が含まれているのは、そのような評価方法を使用して評価される有価証券は当ファンドにとって重要とは見なされないためである。

投資明細表

PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド

(金額の単位は千*、ただし株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

2024年6月30日現在

	元本金額(単位:千)	評価額(単位:千)
投資有価証券123.9%		
オーストラリア3.5%		
社債等0.5%		
Santos Finance Ltd.		
3.649% due 04/29/2031	\$ 100	\$ 88
6.875% due 09/19/2033	500	529
Westpac Banking Corp.		
3.131% due 04/15/2031	EUR 700	746
		1,363
モーゲージ証券1.5%		
AFG Trust		
5.041% due 03/10/2053	AUD 230	153
5.541% due 11/10/2055	500	334
Bluestone Prime Trust		
5.546% due 07/14/2065	500	334
Bluestone Sapphire XXV		
5.350% due 09/21/2053	75	50
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4		
5.098% due 02/19/2053	286	189
IDOL Trust		
5.300% due 08/21/2054	1,000	668
La Trobe Financial Capital Markets Trust		
5.094% due 01/14/2053	194	130
Liberty PRIME		
4.999% due 01/25/2053	249	166
Lion Trust		
5.317% due 05/19/2055	1,000	668
Pepper I-Prime Trust		

4.995% due 07/15/2053	105	70
Pepper Residential Securities Trust No.30		
5.095% due 01/15/2063	150	100
PUMA		
5.278% due 09/23/2055	1,200	801
Resimac Premier		
4.971% due 02/13/2053	266	176
Westpac Securitisation Trust		
5.350% due 08/21/2055	798	534
		4,373

ソブリン債1.5%

Australia Government Bond		
3.250% due 04/21/2029	4,200	2,705
New South Wales Treasury Corp.		
4.750% due 02/20/2035	1,600	1,037
South Australian Government Financing Authority		
1.750% due 05/24/2032	100	53
Treasury Corp. of Victoria		
2.250% due 09/15/2033	1,100	585
4.250% due 12/20/2032	100	64
		4,444
オーストラリア合計		10,180
(取得原価 \$ 10,632)		

バミューダ0.2%**資産担保証券0.2%**

Symphony CLO 39 Ltd.		
6.914% due 04/25/2034	\$ 600	603

社債等0.0%

Bacardi Ltd.		
4.700% due 05/15/2028	100	97
バミューダ合計		700
(取得原価 \$ 699)		

カナダ0.4%**社債等0.3%**

Enbridge, Inc.		
5.700% due 03/08/2033	\$ 200	202
Fairfax Financial Holdings Ltd.		
6.350% due 03/22/2054	100	100
Toronto-Dominion Bank		
3.191% due 02/16/2029	EUR 700	749
		1,051

ソブリン債0.1%

Canada Government Bond		
3.750% due 05/01/2025	CAD 300	218
カナダ合計		1,269
(取得原価 \$ 1,272)		

ケイマン諸島3.3%**資産担保証券3.0%**

Anchorage Capital CLO 9 Ltd.		
6.730% due 07/15/2032	\$ 500	500
Anchorage Capital CLO Ltd.		
TBD% due 10/15/2031 (c)	500	500
Betony CLO 2 Ltd.		
6.671% due 04/30/2031	461	462
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.		
6.566% due 07/20/2031	229	229
CarVal CLO I Ltd.		
6.554% due 07/16/2031	500	500
Dryden 58 CLO Ltd.		
6.579% due 07/17/2031	472	472
Dryden Senior Loan Fund		
6.570% due 04/15/2028	256	256
Elmwood CLO VII Ltd.		
6.947% due 01/17/2034	600	602
Golub Capital Partners CLO 26B Ltd.		

6.606% due 04/20/2031 HERA Commercial Mortgage Ltd.		405	406
6.496% due 02/18/2038 LoanCore Issuer Ltd.		145	143
6.883% due 01/17/2037 Mountain View CLO LLC		498	499
6.629% due 01/16/2031 Mountain View CLO XVI Ltd.		345	345
6.789% due 04/15/2034 Northwoods Capital XIV-B Ltd.		700	701
6.574% due 11/13/2031 OZLM XVII Ltd.		500	502
6.475% due 07/20/2030 Rad CLO 4 Ltd.		500	500
0.000% due 04/25/2032 Regatta XV Funding Ltd.		500	501
6.523% due 10/25/2031 Sound Point CLO XXVIII Ltd.		600	601
6.604% due 01/25/2032 Vibrant CLO IV Ltd.		500	500
6.706% due 07/20/2032		500	500
			8,719

社債等0.3%

Gaci First Investment Co.			
5.000% due 01/29/2029	\$	1,000	988
ケイマン諸島合計 (取得原価 \$ 9,696)			9,707

チリ0.1%**ソブリン債0.1%**

Chile Government International Bond			
4.950% due 01/05/2036		269	258
チリ合計 (取得原価 \$ 266)			258

中国4.2%**ソブリン債4.2%**

China Government International Bond			
2.600% due 09/01/2032	CNY	8,400	1,190
2.620% due 06/25/2030		13,500	1,913
2.680% due 05/21/2030		8,600	1,222
2.750% due 02/17/2032		4,000	573
2.800% due 11/15/2032		18,000	2,589
3.020% due 05/27/2031		11,900	1,734
3.190% due 04/15/2053		6,600	1,046
3.270% due 11/19/2030		4,700	696
3.390% due 03/16/2050		900	145
3.530% due 10/18/2051		4,700	782
3.720% due 04/12/2051		1,200	205
3.810% due 09/14/2050		1,500	260
中国合計 (取得原価 \$ 11,931)			12,355

デンマーク5.5%**社債等5.5%**

Jyske Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2050	DKK	24	3
1.500% due 10/01/2050		123	14
1.500% due 10/01/2053		286	33
2.000% due 10/01/2050		7	1
2.500% due 10/01/2047		1	0
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab			
1.000% due 10/01/2050		26	3
1.500% due 10/01/2050		1,262	142
1.500% due 10/01/2053		387	43
2.000% due 10/01/2050		16	2
2.500% due 10/01/2047		4	1
3.000% due 10/01/2047		1	0
Nykredit Realkredit A/S			
1.000% due 10/01/2050		162	17
1.000% due 10/01/2053		92	10
1.500% due 10/01/2050		387	43

1.500% due 10/01/2052		1,250	142
2.000% due 10/01/2050		212	26
2.500% due 10/01/2047		2	0
3.000% due 10/01/2047		2	1
5.000% due 10/01/2053		10,657	1,552
Realkredit Danmark A/S			
1.000% due 04/01/2025		39,800	5,624
1.000% due 10/01/2050		71	8
1.000% due 10/01/2053		191	20
1.500% due 10/01/2053		1,753	193
2.500% due 04/01/2036		23	3
2.500% due 04/01/2047		8	1
3.000% due 07/01/2046		1	0
5.000% due 10/01/2053		57,527	8,352
6.000% due 10/01/2053		562	83
デンマーク合計			16,317
(取得原価 \$ 16,505)			

フランス1.3%**社債等0.7%**

BNP Paribas S.A.			
5.198% due 01/10/2030	\$	400	395
5.497% due 05/20/2030		700	697
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)		200	197
BPCE S.A.			
6.612% due 10/19/2027		500	508
Societe Generale S.A.			
6.691% due 01/10/2034		400	413
			2,210

ソブリン債0.6%**France Government Bond**

0.750% due 05/25/2052	EUR	1,120	601
2.000% due 05/25/2048		1,304	1,035
			1,636
フランス合計			3,846
(取得原価 \$ 4,456)			

ドイツ1.0%**社債等1.0%**

Deutsche Bank AG			
1.000% due 11/19/2025		800	848
3.035% due 05/28/2032 (g)	\$	600	504
3.961% due 11/26/2025		200	199
6.819% due 11/20/2029		600	624
7.146% due 07/13/2027		700	717
ドイツ合計			2,892
(取得原価 \$ 2,908)			

ハンガリー0.2%**ソブリン債0.2%**

Hungary Government International Bond			
0.125% due 09/21/2028	EUR	100	91
4.250% due 06/16/2031		600	642
ハンガリー合計			733
(取得原価 \$ 719)			

インドネシア0.1%**ソブリン債0.1%**

Indonesia Government International Bond			
3.700% due 10/30/2049	\$	300	229
インドネシア合計			229
(取得原価 \$ 229)			

アイルランド2.6%**資産担保証券2.6%**

Accunia European CLO I DAC			
4.856% due 07/15/2030	EUR	36	38
Arbour CLO XI DAC			
5.114% due 05/15/2038		1,200	1,286
Aurium CLO IV DAC			
4.653% due 01/16/2031		299	320

Blackrock European CLO IV DAC			
4.756% due 07/15/2030		415	444
Carlyle Euro CLO DAC			
4.718% due 08/15/2032		500	535
CIFC European Funding CLO III DAC			
4.956% due 01/15/2034		500	536
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC			
4.424% due 12/15/2032		666	716
Contego CLO IV DAC			
4.532% due 01/23/2030		100	107
Cumulus Static CLO DAC			
5.499% due 04/25/2033		600	643
Dryden 35 Euro CLO DAC			
4.868% due 01/17/2033		250	268
GoldenTree Loan Management EUR CLO 1 DAC			
4.627% due 10/20/2030		193	207
Harvest CLO XXII DAC			
4.756% due 01/15/2032		200	214
Invesco Euro CLO I DAC			
4.556% due 07/15/2031		200	213
Jubilee CLO XI DAC			
4.516% due 04/15/2030		80	86
OCP Euro CLO DAC			
4.777% due 09/22/2034		500	534
Palmer Square European Loan Funding DAC			
4.686% due 04/15/2031		352	377
5.123% due 08/15/2033		1,000	1,071
			<u>7,595</u>

社債等0.0%

AerCap Ireland Capital DAC			
2.450% due 10/29/2026	\$	200	187
アイルランド合計			<u>7,782</u>
(取得原価 \$ 7,975)			

イスラエル0.9%**ソブリン債0.9%**

Israel Government International Bond			
1.500% due 01/18/2027	EUR	500	497
3.375% due 01/15/2050	\$	700	448
5.000% due 10/30/2026	EUR	1,200	1,306
5.500% due 03/12/2034	\$	300	286
イスラエル合計			<u>2,537</u>
(取得原価 \$ 2,664)			

イタリア1.2%**ソブリン債1.2%**

Cassa Depositi e Prestiti SpA			
5.750% due 05/05/2026		280	279
Italy Buoni Poliennali del Tesoro			
2.800% due 03/01/2067	EUR	46	35
4.350% due 11/01/2033		3,000	3,311
イタリア合計			<u>3,625</u>
(取得原価 \$ 3,558)			

日本1.0%**社債等0.7%**

Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
2.309% due 07/20/2032		400	329
2.852% due 01/19/2033		400	338
3.741% due 03/07/2029		200	189
5.242% due 04/19/2029		500	502
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
5.350% due 03/07/2034	\$	600	602
			<u>1,960</u>

ソブリン債0.3%

Japan Government International Bond			
1.800% due 03/20/2054	¥	180,000	1,033
日本合計			<u>2,993</u>
(取得原価 \$ 3,179)			

ルクセンブルク0.5%			
資産担保証券0.5%			
Compartment Driver UK Eight			
5.801% due 09/25/2031	GBP	1,100	1,394
ルクセンブルク合計			1,394
(取得原価 \$ 1,385)			
<hr/>			
メキシコ0.5%			
ソブリン債0.5%			
Mexico Government International Bond			
2.659% due 05/24/2031	\$	1,000	823
4.490% due 05/25/2032	EUR	300	318
6.350% due 02/09/2035	\$	200	202
メキシコ合計			1,343
(取得原価 \$ 1,365)			
<hr/>			
多国籍0.2%			
社債等0.2%			
Bacardi Ltd.			
5.250% due 01/15/2029		300	296
Delta Air Lines, Inc.			
4.750% due 10/20/2028		300	292
NXP BV			
5.000% due 01/15/2033		100	98
多国籍合計			686
(取得原価 \$ 714)			
<hr/>			
オランダ1.2%			
資産担保証券0.3%			
Mila BV			
4.379% due 09/16/2041	EUR	750	807
<hr/>			
社債等0.5%			
Enel Finance International NV			
3.500% due 04/06/2028	\$	400	374
7.500% due 10/14/2032		200	222
ING Groep NV			
4.550% due 10/02/2028		200	195
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)		200	174
JT International Financial Services BV			
3.875% due 09/28/2028		200	191
OCI NV			
6.700% due 03/16/2033		300	296
			1,452
<hr/>			
モーゲージ証券0.4%			
Domi BV			
4.419% due 06/15/2056	EUR	1,000	1,073
Dutch Property Finance BV			
4.514% due 07/28/2058		62	67
			1,140
オランダ合計			3,399
(取得原価 \$ 3,453)			
<hr/>			
ノルウェー0.1%			
社債等0.1%			
Variable Energi ASA			
7.500% due 01/15/2028	\$	200	211
<hr/>			
ソブリン債0.0%			
Norway Government Bond			
1.750% due 03/13/2025	NOK	600	55
ノルウェー合計			266
(取得原価 \$ 278)			
<hr/>			
ポーランド0.3%			
ソブリン債0.3%			
Poland Government International Bond			
5.125% due 09/18/2034	\$	550	542
5.500% due 03/18/2054		200	194

ポーランド合計 (取得原価 \$ 743)			736
ポルトガル0.3% 社債等0.3%			
Banco BPI S.A. 3.250% due 03/22/2030	EUR	700	745
ポルトガル合計 (取得原価 \$ 751)			745
カタール0.2% 社債等0.1%			
Qatar Energy 3.125% due 07/12/2041	\$	300	224
ソブリン債0.1% Qatar Government International Bond			
4.625% due 06/02/2046		200	183
5.103% due 04/23/2048		300	293
			476
カタール合計 (取得原価 \$ 846)			700
ルーマニア0.7% ソブリン債0.7%			
Romania Government International Bond			
1.750% due 07/13/2030	EUR	300	263
2.000% due 04/14/2033		500	402
3.875% due 10/29/2035		818	740
5.375% due 03/22/2031		400	426
6.625% due 09/27/2029		200	230
ルーマニア合計 (取得原価 \$ 2,029)			2,061
サウジアラビア0.5% 社債等0.1%			
Saudi Arabian Oil Co. 2.250% due 11/24/2030	\$	400	337
ソブリン債0.4% Saudi Government International Bond			
3.750% due 01/21/2055		1,100	779
4.875% due 07/18/2033 (i)		500	489
			1,268
サウジアラビア合計 (取得原価 \$ 1,659)			1,605
シンガポール0.4% ソブリン債0.4%			
Singapore Government Bond			
2.250% due 08/01/2036	SGD	300	200
2.625% due 08/01/2032		300	212
3.250% due 06/01/2054		1,000	765
シンガポール合計 (取得原価 \$ 1,186)			1,177
韓国2.9% ソブリン債2.9%			
Korea Treasury Bond			
2.000% due 06/10/2031	KRW	680,250	456
2.125% due 06/10/2027		1,070,300	755
2.375% due 12/10/2027		270,000	191
2.375% due 12/10/2028		1,523,200	1,069
2.375% due 12/10/2031		472,800	324
2.625% due 06/10/2028		1,220,400	868
3.250% due 06/10/2033		64,240	47
3.500% due 09/10/2028		3,313,700	2,460
4.250% due 12/10/2032		3,011,120	2,348
韓国合計 (取得原価 \$ 9,036)			8,518
スペイン0.9%			

ソブリン債0.9%			
Spain Government Bond			
1.450% due 04/30/2029	EUR	980	977
1.450% due 10/31/2071		397	203
3.250% due 04/30/2034		700	742
3.450% due 07/30/2066		790	751
スペイン合計			2,673
(取得原価 \$ 3,064)			
スイス1.2%			
社債等1.2%			
UBS Group AG			
3.750% due 03/26/2025	\$	900	888
3.869% due 01/12/2029		400	378
4.194% due 04/01/2031		500	467
4.282% due 01/09/2028		500	480
6.442% due 08/11/2028		300	307
9.016% due 11/15/2033		300	362
UBS Switzerland AG			
3.304% due 03/05/2029	EUR	600	645
スイス合計			3,527
(取得原価 \$ 3,569)			
アラブ首長国連邦0.5%			
社債等0.4%			
Abu Dhabi Developmental Holding Co. PJSC			
5.375% due 05/08/2029	\$	500	508
5.500% due 05/08/2034		400	411
DAE Sukuk Dific Ltd.			
3.750% due 02/15/2026		200	193
			1,112
ソブリン債0.1%			
Abu Dhabi Government International Bond			
3.875% due 04/16/2050		400	319
アラブ首長国連邦合計			1,431
(取得原価 \$ 1,547)			
英国6.5%			
社債等2.1%			
Barclays PLC			
5.501% due 08/09/2028		200	200
5.690% due 03/12/2030		600	602
6.490% due 09/13/2029		400	414
7.385% due 11/02/2028		400	422
HSBC Holdings PLC			
2.804% due 05/24/2032		200	167
2.848% due 06/04/2031		200	173
4.583% due 06/19/2029		500	483
Imperial Brands Finance PLC			
3.500% due 07/26/2026		300	288
Lloyds Banking Group PLC			
5.679% due 01/05/2035		500	498
5.871% due 03/06/2029		500	507
Nationwide Building Society			
6.557% due 10/18/2027		500	510
NatWest Group PLC			
4.445% due 05/08/2030		300	287
5.076% due 01/27/2030		200	197
5.778% due 03/01/2035		600	602
Santander UK Group Holdings PLC			
6.534% due 01/10/2029		200	206
Standard Chartered PLC			
1.456% due 01/14/2027		400	375
Weir Group PLC			
2.200% due 05/13/2026		300	282
			6,213
モーゲージ証券2.9%			
Atlas Funding PLC			
0.000% due 09/20/2061	GBP	800	1,013
Auburn 15 PLC			

0.000% due 07/20/2045		500	633
Canada Square Funding PLC			
6.154% due 06/17/2058		55	70
Eurosail PLC			
3.959% due 12/15/2044	EUR	125	133
Finsbury Square PLC			
6.033% due 12/16/2071	GBP	105	132
Holmes Master Issuer PLC			
5.776% due 10/15/2072		600	760
Hops Hill No.4 PLC			
0.000% due 04/21/2056		600	760
Lanebrook Mortgage Transaction PLC			
0.000% due 03/15/2061		300	380
5.883% due 07/20/2058		70	89
London Wall Mortgage Capital PLC			
5.984% due 05/15/2051		118	149
Pierpont Btl PLC			
6.302% due 09/21/2054		354	450
Pierpont BTL PLC			
6.034% due 12/22/2053		140	177
PMF PLC			
6.184% due 07/16/2060	\$	497	631
Polaris PLC			
6.000% due 12/23/2058		41	51
Towd Point Mortgage Funding Granite 6 PLC			
0.000% due 07/20/2053		1,000	1,266
Tower Bridge Funding PLC			
6.014% due 11/20/2063		80	101
Trinity Square PLC			
6.098% due 07/15/2059		400	507
Twin Bridges PLC			
6.055% due 03/12/2055		131	166
6.155% due 06/12/2055		435	552
6.396% due 05/15/2056		408	519
			8,539

ソブリン債1.5%

United Kingdom Gilt			
1.125% due 01/31/2039		200	163
1.750% due 09/07/2037		150	140
3.750% due 01/29/2038		400	473
4.250% due 12/07/2040		3,002	3,678
			4,454
英国合計			19,206
(取得原価 \$ 19,876)			

米国59.4%**資産担保証券0.9%**

Lendmark Funding Trust			
2.000% due 04/20/2032		700	634
Mariner Finance Issuance Trust			
2.100% due 11/20/2036		700	641
Navient Private Education Refi Loan Trust			
2.120% due 01/15/2069		38	35
Navient Student Loan Trust			
6.600% due 03/25/2066		391	393
Ready Capital Mortgage Financing LLC			
6.410% due 07/25/2036		103	103
SMB Private Education Loan Trust			
1.600% due 09/15/2054		355	324
Synchrony Card Funding LLC			
5.040% due 03/15/2030		600	599
			2,729

社債等12.6%

AbbVie, Inc.			
3.200% due 11/21/2029		1,100	1,010
AES Corp.			
1.375% due 01/15/2026		300	281
2.450% due 01/15/2031		300	247
American Tower Corp.			
2.100% due 06/15/2030		600	503

2.900% due 01/15/2030	200	176
5.900% due 11/15/2033	100	102
Angen, Inc.		
3.350% due 02/22/2032	100	89
4.200% due 03/01/2033	400	371
5.150% due 03/02/2028	300	300
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
5.550% due 01/23/2049	100	101
Arizona Public Service Co.		
5.700% due 08/15/2034	300	300
Ashtead Capital, Inc.		
5.950% due 10/15/2033	400	401
AT&T, Inc.		
2.300% due 06/01/2027	600	555
4.350% due 03/01/2029	400	388
5.400% due 02/15/2034	100	100
Aviation Capital Group LLC		
4.125% due 08/01/2025	100	98
5.500% due 12/15/2024	100	100
Bank of America Corp.		
3.419% due 12/20/2028	415	390
4.571% due 04/27/2033	500	472
4.948% due 07/22/2028	1,500	1,488
5.288% due 04/25/2034	400	396
BAT Capital Corp.		
6.343% due 08/02/2030	100	104
Becton Dickinson & Co.		
2.823% due 05/20/2030	400	354
Berkshire Hathaway, Inc.		
0.907% due 04/20/2026	¥ 100,000	621
Black Hills Corp.		
2.500% due 06/15/2030	\$ 100	84
6.150% due 05/15/2034	200	204
Boeing Co.		
3.600% due 05/01/2034	100	81
3.625% due 02/01/2031	50	44
5.150% due 05/01/2030	300	288
British Airways 2018-1 Class A Pass-Through Trust		
4.125% due 09/20/2031	61	57
Broadcom, Inc.		
2.450% due 02/15/2031	50	42
3.419% due 04/15/2033	100	86
3.469% due 04/15/2034	200	171
4.300% due 11/15/2032	48	45
Centene Corp.		
2.500% due 03/01/2031	200	164
3.375% due 02/15/2030	200	178
Charter Communications Operating LLC		
2.250% due 01/15/2029	300	257
3.850% due 04/01/2061	24	14
3.900% due 06/01/2052	24	15
3.950% due 06/30/2062	150	89
Cheniere Energy Partners LP		
4.000% due 03/01/2031	200	182
Citigroup, Inc.		
2.976% due 11/05/2030	100	89
3.070% due 02/24/2028	600	566
4.412% due 03/31/2031	200	191
4.658% due 05/24/2028	700	689
CNA Financial Corp.		
5.125% due 02/15/2034	300	291
Comcast Corp.		
2.937% due 11/01/2056	131	79
Constellation Brands, Inc.		
2.250% due 08/01/2031	800	657
Constellation Energy Generation LLC		
6.125% due 01/15/2034	200	209
Crown Castle, Inc.		
2.250% due 01/15/2031	400	329
3.650% due 09/01/2027	200	190
CVS Health Corp.		
5.125% due 02/21/2030	300	297
5.875% due 06/01/2053	200	192

Duke Energy Florida LLC			
5.875% due 11/15/2033		200	208
Elevance Health, Inc.			
2.250% due 05/15/2030		400	343
5.375% due 06/15/2034		300	302
Energy Transfer LP			
5.300% due 04/01/2044		50	45
6.000% due 06/15/2048		138	133
6.100% due 12/01/2028		400	412
Entergy Arkansas LLC			
5.450% due 06/01/2034		300	301
Essential Utilities, Inc.			
3.351% due 04/15/2050		36	24
Evergy Kansas Central, Inc.			
5.900% due 11/15/2033		200	206
Evergy Metro, Inc.			
2.250% due 06/01/2030		100	85
Eversource Energy			
5.950% due 02/01/2029		500	511
Ford Motor Co.			
4.346% due 12/08/2026 (i)		400	388
Ford Motor Credit Co. LLC			
4.000% due 11/13/2030		500	447
Global Payments, Inc.			
4.950% due 08/15/2027		200	198
Goldman Sachs Group, Inc.			
1.250% due 02/07/2029	EUR	100	97
2.383% due 07/21/2032	\$	200	164
2.615% due 04/22/2032		100	84
3.691% due 06/05/2028 (i)		200	191
4.482% due 08/23/2028		2,100	2,053
HCA, Inc.			
3.500% due 09/01/2030		300	271
3.625% due 03/15/2032		200	176
4.125% due 06/15/2029		100	95
4.500% due 02/15/2027		250	244
5.900% due 06/01/2053		100	97
JPMorgan Chase & Co.			
2.522% due 04/22/2031		650	562
2.739% due 10/15/2030		100	89
2.963% due 01/25/2033		300	256
4.586% due 04/26/2033		300	286
4.851% due 07/25/2028		1,600	1,584
Mileage Plus Holdings LLC			
6.500% due 06/20/2027		120	120
Monongahela Power Co.			
5.850% due 02/15/2034		400	408
Morgan Stanley			
1.512% due 07/20/2027		200	185
5.123% due 02/01/2029		500	498
5.424% due 07/21/2034		200	199
6.296% due 10/18/2028		1,500	1,548
MSCI, Inc.			
3.625% due 09/01/2030		200	180
3.625% due 11/01/2031		200	176
NVR, Inc.			
3.000% due 05/15/2030		700	621
Occidental Petroleum Corp.			
8.875% due 07/15/2030		200	231
ONEOK, Inc.			
5.800% due 11/01/2030		100	102
Oracle Corp.			
3.950% due 03/25/2051 (g)		100	74
Pacific Gas & Electric Co.			
3.150% due 01/01/2026		100	96
3.250% due 06/01/2031		200	172
4.550% due 07/01/2030		100	95
5.450% due 06/15/2027		300	300
PacifiCorp			
5.450% due 02/15/2034		300	296
Revvity, Inc.			
1.900% due 09/15/2028		700	613
San Diego Gas & Electric Co.			

1.700% due 10/01/2030	300	246
Santander Holdings USA, Inc.		
4.500% due 07/17/2025	200	197
Southern California Edison Co.		
3.600% due 02/01/2045	50	37
3.650% due 06/01/2051	100	71
5.450% due 06/01/2052	300	282
Southern California Gas Co.		
2.550% due 02/01/2030	150	131
Sysco Corp.		
5.750% due 01/17/2029	700	717
T-Mobile USA, Inc.		
3.300% due 02/15/2051	126	85
3.600% due 11/15/2060	176	119
3.875% due 04/15/2030	400	374
UMass Memorial Health Care Obligated Group		
5.363% due 07/01/2052	200	191
United Airlines 2019-2 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 05/01/2028	80	72
Vistra Operations Co. LLC		
6.950% due 10/15/2033	300	321
VMware LLC		
2.200% due 08/15/2031	100	81
4.700% due 05/15/2030	100	97
Volkswagen Group of America Finance LLC		
6.200% due 11/16/2028	500	516
Wells Fargo & Co.		
2.393% due 06/02/2028	200	184
2.572% due 02/11/2031	100	87
3.526% due 03/24/2028	300	286
3.584% due 05/22/2028	100	95
4.808% due 07/25/2028	1,600	1,578
5.389% due 04/24/2034	400	396
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.		
3.200% due 06/15/2025	300	293
		36,949

モーゲージ証券0.9%

Adjustable Rate Mortgage Trust		
5.600% due 09/25/2035	7	6
Alternative Loan Trust		
6.000% due 04/25/2037	115	51
Banc of America Funding Trust		
5.020% due 01/20/2047	12	10
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.000% due 05/25/2034	6	5
5.416% due 11/25/2034	3	3
5.503% due 02/25/2034	1	1
5.892% due 10/25/2033	5	5
5.979% due 07/25/2033	7	6
6.640% due 05/25/2033	25	22
6.997% due 05/25/2034	17	16
Bear Stearns Alternative-A Trust		
4.531% due 02/25/2036	20	13
5.306% due 01/25/2036	74	68
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust		
4.200% due 12/26/2046	11	8
Benchmark Mortgage Trust		
4.470% due 07/15/2055	600	567
BSREP Commercial Mortgage Trust		
6.393% due 08/15/2038	474	444
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.		
6.466% due 09/25/2035	10	10
7.560% due 09/25/2035	18	17
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
4.712% due 11/25/2034	20	18
6.040% due 04/25/2035	4	4
6.100% due 03/25/2035	44	38
7.884% due 02/20/2036	8	7
7.940% due 02/20/2036	25	22
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
5.559% due 07/25/2037	177	114

Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
5.973% due 08/19/2045	4	3
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust		
6.231% due 08/25/2035	8	5
Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates		
3.600% due 01/25/2029	200	190
GMACM Mortgage Loan Trust		
3.651% due 11/19/2035	5	5
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates		
6.724% due 10/25/2033	1	1
GSR Mortgage Loan Trust		
6.750% due 03/25/2033	2	2
HarborView Mortgage Loan Trust		
5.111% due 07/19/2035	6	4
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
4.767% due 12/25/2034	8	7
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust		
3.723% due 03/15/2050	100	95
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust		
3.694% due 03/15/2050	100	94
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust		
2.812% due 01/16/2037	100	89
JPMorgan Mortgage Trust		
5.266% due 07/25/2035	18	17
5.571% due 11/25/2033	9	9
5.643% due 02/25/2035	5	5
Lehman Asset-Backed Securities Mortgage Loan Trust		
5.550% due 06/25/2037	22	14
Long Beach Mortgage Loan Trust		
6.020% due 10/25/2034	38	37
Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust		
5.883% due 12/15/2030	23	22
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
6.208% due 02/25/2033	9	9
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
3.102% due 11/15/2049	100	94
Morgan Stanley Capital I Trust		
3.530% due 06/15/2050	100	94
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust		
4.769% due 10/25/2035	14	12
Residential Asset Securitization Trust		
5.500% due 06/25/2033	34	31
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust		
5.590% due 05/25/2037	273	202
Sequoia Mortgage Trust		
6.597% due 04/20/2035	4	4
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
5.900% due 05/25/2037	24	20
6.814% due 04/25/2034	3	3
7.282% due 02/25/2034	8	8
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
5.880% due 05/25/2036	40	26
6.153% due 03/19/2034	5	5
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
6.944% due 04/25/2035	3	3
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust		
5.618% due 03/25/2033	46	43
6.031% due 03/25/2034	32	31
6.080% due 01/25/2045	6	5
6.292% due 06/25/2033	6	6
		2,650

地方債0.1%

Illinois, Electric Agency Revenue Bonds, Series 2009

6.832% due 02/01/2035		190	201
Oklahoma Development Finance Authority, Revenue Bonds, Series 2022			
5.087% due 02/01/2052		100	98
			299

仕組債0.1%**JPMorgan Chase Bank N.A.**

6.375% due 04/19/2032	IDR	5,922,000	348
-----------------------	-----	-----------	-----

米国政府機関債32.8%**Fannie Mae**

4.000% due 12/01/2025	\$	3	3
4.000% due 02/01/2026		4	4
4.000% due 06/01/2048		30	28
4.000% due 09/01/2048		52	48
4.500% due 06/01/2038		35	34
6.000% due 12/01/2037		6	6
6.000% due 11/01/2053		2,204	2,212
6.000% due 01/01/2054		432	433
6.287% due 02/01/2036		19	19
6.500% due 09/01/2053		3,343	3,411
6.500% due 12/01/2053		3,459	3,523

Fannie Mae, TBA (c)

2.500% due 08/01/2054		2,380	1,946
3.000% due 08/01/2054		2,700	2,299
3.500% due 07/01/2054		1,400	1,239
4.000% due 07/01/2054		3,450	3,157
4.500% due 08/01/2054		21,800	20,558
5.000% due 07/01/2054		6,900	6,669
5.000% due 08/01/2054		9,300	8,988
5.000% due 09/01/2054		1,000	967
5.500% due 08/01/2054		1,500	1,479
6.000% due 08/01/2054		2,300	2,306
6.500% due 07/01/2054		12,100	12,316
6.500% due 08/01/2054		11,450	11,648

Freddie Mac

5.000% due 02/01/2053		1,504	1,456
5.000% due 09/01/2053		692	672
5.000% due 12/01/2053		1,412	1,365
6.000% due 12/01/2033		41	41
6.000% due 04/15/2036		68	70
6.000% due 10/01/2053		9,033	9,063
6.000% due 12/01/2053		237	238

Ginnie Mae

3.000% due 04/20/2047		135	119
3.500% due 01/20/2048		145	131
5.000% due 02/15/2039		70	70

96,518**米国財務省証券12.0%****Treasury Inflation Protected Securities (d)**

0.375% due 07/15/2027		513	487
0.625% due 07/15/2032		216	193
0.750% due 02/15/2045 (k)		115	86
1.125% due 01/15/2033		2,842	2,631
1.625% due 10/15/2027		5,292	5,207
2.375% due 10/15/2028		10,134	10,270

U.S. Treasury Bonds

1.625% due 11/15/2050		232	127
1.875% due 02/15/2041		7,500	5,135
1.875% due 11/15/2051		400	232
2.000% due 11/15/2041		300	206
2.250% due 02/15/2052		300	191
2.375% due 02/15/2042		3,200	2,330
2.500% due 02/15/2045		134	96
2.875% due 05/15/2043		1	1
2.875% due 05/15/2052		900	660
3.625% due 08/15/2043		321	279
3.875% due 02/15/2043		220	199
4.000% due 11/15/2042		4,200	3,872
4.375% due 05/15/2041		237	232

米国短期国債

4.250% due 02/28/2031	2,800	2,784
		35,218
		174,711

米国合計
(取得原価 \$ 178,028)

短期金融商品22.1%

短期債券0.2%

Toyota Motor Credit Corp.		
5.783% due 08/22/2024 (e)	500	500

コマーシャルペーパー1.2%

Alimentation Couche-Tard, Inc.		
5.543% due 07/02/2024 (e)	300	300
Constellation Brands, Inc.		
5.679% due 07/30/2024 (e)	300	298
Crown Castle, Inc.		
5.880% due 07/11/2024 (e)	400	399
Intercontinental Exchange, Inc. (e)		
5.523% due 07/11/2024	250	250
5.534% due 07/22/2024	250	249
L3Harris Technologies, Inc.		
5.549% due 07/24/2024 (e)	500	498
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.		
5.620% due 08/12/2024 (e)	400	397
Parker-Hannifin Corp.		
5.585% due 08/28/2024 (e)	400	396
Penske Truck Leasing Co. LP		
5.516% due 07/09/2024 (e)	250	250
Southern California Edison Co.		
5.610% due 07/12/2024 (e)	500	499
		3,536

レボ契約(h)5.8%

17,200

定期預金0.7%

Australia and New Zealand Banking Group Ltd.

3.360% due 07/01/2024	AUD	39	26
3.930% due 07/02/2024	HKD	11	1
4.400% due 07/01/2024	GBP	13	17
4.830% due 07/01/2024	\$	38	38
Bank of Nova Scotia			
3.770% due 07/02/2024	CAD	45	33
4.830% due 07/01/2024	\$	8	8
BNP Paribas Bank			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	518	3
0.320% due 07/01/2024	CHF	14	16
2.600% due 07/01/2024	SGD	54	40
3.360% due 07/01/2024	AUD	1	1
3.380% due 07/01/2024	NOK	727	68
3.930% due 07/02/2024	HKD	68	9
4.090% due 07/01/2024	NZD	85	52
Brown Brothers Harriman & Co.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	100	1
2.500% due 07/01/2024	DKK	2	0
4.400% due 07/01/2024	GBP	1	2
4.830% due 07/01/2024	\$	2	2
Citibank N.A.			
2.840% due 07/01/2024	EUR	4	4
4.830% due 07/01/2024	\$	482	482
DBS Bank Ltd.			
3.930% due 07/02/2024	HKD	5	1
4.830% due 07/01/2024	\$	77	77
DnB Bank ASA			
2.760% due 07/01/2024	SEK	3	0
2.840% due 07/01/2024	EUR	6	7
3.360% due 07/01/2024	AUD	10	7
HSBC Bank			
2.600% due 07/01/2024	SGD	105	77
3.930% due 07/02/2024	HKD	174	22
HSBC Bank PLC			
2.840% due 07/01/2024	EUR	183	197
4.400% due 07/01/2024	GBP	59	75

JPMorgan Chase Bank N.A. 4.830% due 07/01/2024	\$	88	88
MUFG Bank Ltd. (0.140%) due 07/01/2024	¥	6,649	41
Royal Bank of Canada 3.770% due 07/02/2024	CAD	128	93
4.400% due 07/01/2024	GBP	1	2
4.830% due 07/01/2024	\$	19	19
Sumitomo Mitsui Banking Corp. (0.140%) due 07/01/2024	¥	934	6
2.840% due 07/01/2024	EUR	6	7
4.400% due 07/01/2024	GBP	2	2
4.830% due 07/01/2024	\$	69	69
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. (0.140%) due 07/01/2024	¥	32,866	204
2.840% due 07/01/2024	EUR	41	44
4.400% due 07/01/2024	GBP	127	160
4.830% due 07/01/2024	\$	68	68
			2,069

日本短期国債14.2%

(0.024%) due 07/01/2024 (f)	¥	400,000	2,487
(0.003%) due 07/08/2024 (e)		690,000	4,289
(0.003%) due 07/22/2024 (e)		390,000	2,424
0.002% due 07/29/2024 (e)		84,000	522
0.004% due 09/17/2024 (e)		396,000	2,462
0.005% due 07/16/2024 (e)		530,000	3,295
0.009% due 09/09/2024 (e)		1,650,000	10,257
0.011% due 09/30/2024 (f)		400,000	2,486
0.018% due 08/05/2024 (e)		160,000	995
0.028% due 09/02/2024 (e)		420,000	2,611
0.036% due 08/26/2024 (e)		1,580,000	9,822
			41,650

短期金融商品合計

(取得原価 \$ 66,391)

64,955

投資有価証券合計123.9%

(取得原価 \$ 372,609)

\$ 364,556

金融デリバティブ商品(j)(l) 0.5%

(取得原価あるいはプレミアム(純額) \$ 19)

1,410

その他の資産および負債(純額)(24.4%)

純資産100.0%

(71,847)

\$ 294,119

投資明細表に対する注記:

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

- (a) 偶発転換社債
 (b) 永久債(記載日は次回の契約上の償還日)である。
 (c) 発行日前取引証券
 (d) 当有価証券の元本金額は、インフレの状況にあわせて調整される。
 (e) クーボンは最終利回りである。
 (f) クーボンは加重平均最終利回りである。

(g) 制限証券:

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価額の対 純資産比率
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/27/2021	\$ 573	\$ 504	0.17%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	07/27/2021	110	74	0.03%
制限証券合計				\$ 683	\$ 578	0.20%

借入およびその他の金融取引

(h) レボ契約:

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受入担保 (公正価値)	レボ契約 (公正価値)	レボ契約に係る未収金 ⁽¹⁾
SAL レボ契約 合計	5.400%	06/28/2024	07/01/2024	\$ 17,200	U.S. Treasury Notes 0.750% due 03/31/2026	\$ (17,568)	\$ 17,200	\$ 17,208
						\$ (17,568)	\$ 17,200	\$ 17,208

リバース・レボ契約：

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽²⁾	リバース・レボ契約に係る未払金
BOS	5.000%	06/14/2024	07/11/2024	\$ (181)	\$ (182)
BOS	5.150%	06/14/2024	07/11/2024	(292)	(292)
BRC	5.050%	02/15/2024	TBD ⁽³⁾	(294)	(299)
リバース・レボ契約合計				\$	(773)

担保付借入として会計処理される振替

	契約の残存期間				合計
	翌日物および継続	30日以下	31～90日	90日超	
リバース・レボ契約 U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (474)	\$ 0	\$ 0	\$ (474)
Non-U.S. Government Debt	0	0	0	(299)	(299)
リバース・レボ契約合計	\$ 0	\$ (474)	\$ 0	\$ (299)	\$ (773)
借入合計	\$ 0	\$ (474)	\$ 0	\$ (299)	\$ (773)
リバース・レボ契約に係る未払金				\$	(773)

売建有価証券：

取引相手	種別	クーポン	満期日	元本金額	手取金	売建に係る未払金
GSC	Fannie Mae, TBA	2.000%	08/01/2054	\$ 14,340	\$ (11,292)	\$ (11,228)
売建有価証券合計 (3.8%)				\$	(11,292)	\$ (11,228)

借入およびその他の金融取引要約

以下は、2024年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

(i) 2024年6月30日現在、以下のマスター契約の条件に基づき、市場価格合計 \$ 873の有価証券が担保として差し入れられている。

取引相手	レボ契約に係る未収金	リバース・レボ契約に係る未払金	セール・バイバック取引に係る未払金	売建に係る未払金	借入およびその他の金融取引合計	差入（受入）担保	ネット・エクスポージャー ⁽⁴⁾
グローバル・マスター・レボ契約							
BOS	\$ 0	\$ (474)	\$ 0	\$ 0	\$ (474)	\$ 580	\$ 106
BRC	0	(299)	0	0	(299)	293	(6)
SAL	17,208	0	0	0	17,208	(17,568)	(360)
マスター有価証券先渡取引契約書							
GSC	0	0	0	(11,228)	(11,228)	0	(11,228)
借入およびその他の金融取引合計	\$ 17,208	\$ (773)	\$ 0	\$ (11,228)	\$ 5,207		

(1) 未収利息を含む。

(2) 2024年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は \$ 492で、加重平均金利は5.132%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レボ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(3) 満期の定めがないリバース・レボ契約

(4) ネット・エクスポージャーはデフォルト発生時の取引相手に対する未収金 / 未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引から発生するエクスポージャーは、同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネットティング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(j) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

変動証拠金

詳細	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	資産	負債
3-Month SOFR December Futures	売建	03/2025	72	\$ 47	\$ 0	\$ (1)
3-Month SOFR June Futures	買建	09/2025	7	4	0	0
3-Month SOFR March Futures	売建	06/2025	157	194	0	(4)
3-Month SOFR September Futures	買建	12/2024	51	(61)	1	0
3-Month SOFR September Futures	買建	12/2025	78	(81)	1	0
Australia Government 3- Year Bond September Futures	売建	09/2024	66	15	0	(3)
Australia Government 10- Year Bond September Futures	売建	09/2024	52	0	0	0
Canada Government 10-Year Bond September Futures	買建	09/2024	73	44	0	(17)
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	売建	09/2024	22	(27)	3	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	買建	09/2024	36	(37)	0	(25)
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	買建	09/2024	20	7	0	(4)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	買建	09/2024	7	23	0	(9)
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	買建	09/2024	35	(23)	0	(25)
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	買建	09/2024	39	19	0	(1)
Japan Government 10-Year Bond September Futures	売建	09/2024	42	61	99	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	売建	09/2024	67	(41)	1	0
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	売建	09/2024	66	(21)	11	0
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	買建	09/2024	28	(20)	9	0
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	売建	09/2024	10	(7)	15	0
U.S. Treasury Ultra 10- Year Note September Futures	売建	09/2024	20	6	15	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September Futures	売建	09/2024	38	(15)	19	0
先物契約合計				\$ 87	\$ 174	\$ (89)

スワップ契約:

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定 金利	満期日	インフラ イデ・ク レジット ト・スワ ップ レド (2024年 6月30日 現在) ⁽³⁾	想定元本 (4)	市場価 格	未実現評 価(損) 益	変動証拠金	
							資産	負債
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	0.399%	\$ 100	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	\$ 0
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2028	0.564%	100	2	2	0	0
					\$ 3	\$ 1	\$ 0	\$ 0

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの買い⁽²⁾

指数 / トラン シェ	受取固定 金利	満期日	想定元本 (4)	市場価 格 ⁽⁵⁾	未実現評 価(損) 益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.IG-41 Index	(1.000%)	12/20/2033	\$ 1,000	\$ (7)	\$ (10)	\$ 0	\$ 0
CDX.IG-42 Index	(1.000%)	06/20/2034	3,800	(19)	5	2	0
				\$ (26)	\$ (5)	\$ 2	\$ 0

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

指数 / トラン シェ	受取固定 金利	満期日	想定元本 (4)	市場価 格 ⁽⁵⁾	未実現評 価(損) 益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.IG-40 Index	1.000%	06/20/2028	\$ 200	\$ 4	\$ 1	\$ 0	\$ 0

CDX. IG-41									
Index	1.000%	12/20/2028	2,000	43	3	0	0		
CDX. IG-42									
Index	1.000%	06/20/2029	36,100	750	(20)	0	(6)		
				\$ 797	\$ (16)	\$ 0	\$ (6)		

金利スワップ

変動金利支取/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	通貨	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金	
								資産	負債
支払 ⁽⁶⁾	3-Month EURIBOR	2.000%	03/19/2026	EUR	14,500	\$ (138)	\$ (136)	\$ 0	\$ (3)
	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024	NZD	2,800	(37)	23	2	0
支払	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	3.750%	06/15/2027		900	(15)	(9)	0	0
支払	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.750%	06/19/2029		1,300	10	0	0	(2)
受取 ⁽⁶⁾	3-Month THOR	2.250%	09/18/2029	THB	155,300	40	31	0	(2)
受取 ⁽⁶⁾	3-Month THOR	2.500%	09/18/2029		335,190	(22)	(45)	0	(6)
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	AUD	400	(42)	(42)	0	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032		200	(22)	(4)	1	0
支払 ⁽⁶⁾	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	09/15/2032		600	(3)	(2)	0	0
支払 ⁽⁶⁾	6-Month Australian Bank Bill	4.500%	09/15/2032		11,500	16	82	0	0
支払	6-Month Australian Bank Bill	4.000%	06/21/2033		8,300	(182)	101	1	0
支払 ⁽⁶⁾	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	12/20/2033		19,500	71	229	0	(15)
支払	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	EUR	200	(3)	(3)	0	0
受取 ⁽⁶⁾	6-Month EURIBOR	3.000%	09/18/2026		1,900	3	13	0	0
支払	6-Month EURIBOR	0.500%	12/15/2026		460	(29)	(45)	0	(1)
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027		1,050	(80)	(68)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027		800	(60)	(52)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	3.415%	12/18/2028		2,300	94	66	0	(1)
支払	6-Month EURIBOR	2.770%	04/16/2029		300	(2)	(2)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	2.860%	04/24/2029		200	(1)	(1)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	2.780%	05/02/2029		300	(2)	(2)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	2.827%	05/06/2029		300	(1)	(1)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	2.950%	06/12/2029		200	1	1	0	0
受取	6-Month EURIBOR	2.818%	06/26/2029		300	1	1	0	0
支払 ⁽⁶⁾	6-Month EURIBOR	2.750%	09/18/2029		34,800	(100)	(511)	0	(32)
支払	6-Month EURIBOR	2.547%	03/09/2033		550	(15)	(15)	0	(1)
支払	6-Month EURIBOR	1.750%	03/15/2033		100	(9)	1	0	0
受取 ⁽⁶⁾	6-Month EURIBOR	3.000%	03/15/2033		2,800	(38)	(16)	5	0
支払	6-Month EURIBOR	(0.175%)	03/17/2033		800	(206)	(130)	0	(1)
支払	6-Month EURIBOR	2.760%	03/04/2034		200	(2)	(2)	0	0
支払	6-Month EURIBOR	2.750%	03/05/2034		200	(2)	(2)	0	(1)
支払	6-Month EURIBOR	2.770%	04/29/2034		200	(1)	(1)	0	0
支払 ⁽⁶⁾	6-Month EURIBOR	2.750%	09/18/2034		19,600	(81)	(438)	0	(46)
受取	6-Month EURIBOR	0.000%	03/17/2053		300	166	166	0	0
受取 ⁽⁶⁾	6-Month EURIBOR	2.500%	09/18/2054		6,500	5	342	22	0
	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate								
受取	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.350%	03/21/2026	¥	110,000	0	2	1	0
	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate								
受取 ⁽⁶⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.500%	06/18/2026		2,310,000	10	8	5	0
	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate								
受取 ⁽⁶⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.400%	09/18/2026		2,190,000	23	0	7	0
	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate								
受取 ⁽⁶⁾	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	0.600%	09/18/2029		1,420,000	53	10	14	0
	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate								
支払	Canadian Overnight Repo Rate Average	0.700%	06/19/2031		4,610,000	(240)	3	0	(61)
支払 ⁽⁶⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	5.000%	10/04/2025	CAD	10,100	60	43	1	0
支払 ⁽⁶⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	12/18/2025		10,700	(35)	(27)	1	0
支払 ⁽⁶⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	06/19/2026		18,600	(12)	36	1	0
支払 ⁽⁶⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.898%	06/19/2026		10,100	20	22	1	0
支払 ⁽⁶⁾	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.925%	06/19/2026		10,300	23	23	1	0

支払	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.250%	12/20/2028	CAD	800	(5)	20	0	0
支払	Canadian Overnight Repo Rate Average	1.900%	12/18/2029		2,000	(110)	14	5	0
受取	Canadian Overnight Repo Rate Average	3.500%	06/01/2032		4,200	(19)	34	7	0
支払	Canadian Overnight Repo Rate Average	2.200%	12/18/2049		350	(53)	4	1	0
支払	Canadian Overnight Repo Rate Average	1.750%	06/17/2050		20	(4)	0	0	0
支払 ⁽⁶⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	09/18/2029	INR	283,850	(21)	(5)	2	0
支払	IBMEXID	8.450%	01/24/2028	MXN	6,900	(15)	(15)	1	0
支払	IBMEXID	5.970%	05/06/2030		2,800	(25)	(22)	0	0
受取 ⁽⁶⁾	KRW-CD-KSDA-Bloomberg Secured Overnight Financing Rate	3.250%	09/18/2029	KRW	3,679,220	(16)	(2)	0	(4)
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.050%	12/15/2024	\$	1,000	43	9	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.200%	05/10/2025		6,200	120	48	0	0
受取 ⁽⁶⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/18/2025		7,900	77	71	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	4.250%	12/20/2025		20,400	281	182	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	4.000%	06/12/2026		2,700	32	50	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	4.000%	06/20/2026		3,000	35	12	0	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.196%	02/28/2027		3,250	121	121	1	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2027		1,300	94	6	0	(5)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	03/10/2028		100	2	4	0	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.665%	01/12/2029		1,900	(220)	(220)	0	(3)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.940%	04/10/2029		9,600	93	(99)	16	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029		800	(111)	(38)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2030		8,600	(332)	(43)	0	(27)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2031		3,300	(50)	(89)	0	(12)
受取	Secured Overnight Financing Rate	2.750%	09/21/2032		1,500	158	118	6	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.650%	07/10/2033		200	(8)	(8)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	07/12/2033		210	(7)	(7)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.435%	11/01/2033		70	2	2	0	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	11/01/2033		2,430	78	(9)	0	(14)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033		1,700	(78)	(25)	0	(10)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.620%	01/31/2034		100	(3)	(3)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.783%	02/07/2034		200	(4)	(4)	0	(1)
支払	Secured Overnight Financing Rate	3.860%	02/21/2034		200	(3)	(3)	0	(1)
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2034		7,500	130	108	46	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	1.842%	09/19/2053		3,100	1,122	(14)	43	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	12/20/2053		1,100	110	8	18	0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	06/20/2054		2,500	110	54	43	0
受取 ⁽⁶⁾	Singapore Overnight Average Index	3.000%	09/18/2026	SGD	9,800	12	19	2	0
受取 ⁽⁶⁾	Singapore Overnight Average Index	2.750%	09/18/2029		7,510	53	5	8	0
受取 ⁽⁶⁾	Singapore Overnight Average Index	3.000%	09/18/2034		280	(1)	0	1	0
支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.160%	12/18/2028	GBP	4,100	(8)	(56)	0	(4)
支払 ⁽⁶⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.000%	09/18/2029		12,600	62	(135)	0	(19)
支払 ⁽⁶⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.750%	09/18/2034		8,450	(84)	(174)	0	(36)

支払	Sterling Overnight Interbank Average Rate	3.750%	09/18/2054	300	(12)	(18)	0	(3)				
支払	Swiss Overnight Rate Average	1.750%	03/20/2034	CHF	500	41	6	0	0			
					\$	803	\$	(445)	\$	263	\$	(316)
スワップ 契約 合計					\$	1,577	\$	(465)	\$	265	\$	(322)

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2024年6月30日現在の市場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

(k) 2024年6月30日現在、合計市場価格\$18の有価証券と\$6,085の現金が上場および中央清算金融デリバティブ商品の担保として差し入れられている。マスター・ネットイング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

上場ま たは中 央清算 合計	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債											
	市場価格 買建 オプション	変動証拠金資産		合計	市場価格 売建 オプション	変動証拠金資産		合計								
		先物	スワップ 契約			先物	スワップ 契約									
	\$	0	\$	174	\$	265	\$	439	\$	0	\$	(89)	\$	(322)	\$	(411)

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの売り手からスワップの想定元本に等しい額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。

(3) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(4) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(5) クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務（または利益）の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(6) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(I) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨	引渡額	受取通貨	受取額	未実現評価（損）益			
						資産	負債		
AZD	07/2024	NZD	166	\$	102	\$	1	\$	0
AZD	08/2024	\$	102	NZD	166		0		0
BOA	07/2024	EUR	829	\$	892		4		0
BOA	07/2024	KRW	1,875,390		1,372		10		0
BOA	07/2024	SGD	126		93		0		0
BOA	07/2024	\$	93	SGD	126		0		0
BOA	08/2024	SGD	126	\$	93		0		0
BOA	02/2025	CNH	527		74		0		0
BPS	07/2024	AUD	975		650		0		(1)
BPS	07/2024	CNY	27,824		3,911		82		0
BPS	07/2024	DKK	276		40		1		0
BPS	07/2024	EUR	1,101		1,186		6		0
BPS	07/2024	GBP	918		1,167		7		0
BPS	07/2024	JPY	690,000		4,617		324		0
BPS	07/2024		530,000		3,562		260		0

BPS	07/2024		316			2	0	0
BPS	07/2024	KRW	1,862,245			1,357	4	0
BPS	07/2024	PLN	231				0	0
BPS	07/2024	SGD	57				0	0
BPS	07/2024	\$	3,877	AUD		5,819	9	0
BPS	07/2024		1,231	CAD		1,680	0	(3)
BPS	07/2024		23	CHF		21	0	0
BPS	07/2024		3,911	CNH		28,352	0	(28)
BPS	07/2024		955	CNY		6,798	0	(3)
BPS	07/2024		3,527			25,093	0	(18)
BPS	07/2024		3,904			27,824	0	(75)
BPS	07/2024		16	CZK		374	0	0
BPS	07/2024		115	GBP		90	0	(1)
BPS	07/2024		156	KRW		215,915	1	0
BPS	07/2024		18	NOK		186	0	0
BPS	07/2024		1,532	PLN		6,201	10	0
BPS	07/2024		595	SGD		806	0	0
BPS	08/2024	AUD	5,819	\$		3,881	0	(9)
BPS	08/2024	CAD	245			179	0	0
BPS	08/2024	DKK	748			108	0	0
BPS	08/2024	EUR	95			102	0	0
BPS	08/2024	GBP	89			113	0	0
BPS	08/2024	JPY	16,291			102	0	0
BPS	08/2024	SEK	394			37	0	0
BPS	08/2024	SGD	805			595	0	0
BPS	08/2024	\$	152	AUD		227	0	0
BPS	08/2024		30	CHF		27	0	0
BPS	08/2024	\$	15	NZD		25	0	0
BPS	08/2024		29	SGD		39	0	0
BPS	09/2024	CNH	32,318	\$		4,509	55	0
BPS	09/2024	TWD	25,677			798	5	0
BPS	09/2024	CNH	10,202			1,425	15	0
BPS	10/2024	\$	1,435	CNH		10,342	0	(6)
BPS	12/2024		134			961	0	(1)
BPS	01/2025	CNH	1,007	\$		141	1	0
BRC	07/2024	AUD	2,064			1,366	0	(12)
BRC	07/2024	CNH	30,983			4,282	35	0
BRC	07/2024	CNY	270			38	1	0
BRC	07/2024	DKK	27,590			4,017	52	0
BRC	07/2024	EUR	1,364	CHF		1,294	0	(22)
BRC	07/2024	JPY	84,000	\$		552	28	0
BRC	07/2024		400,000			2,679	193	0
BRC	07/2024	\$	38	CNY		270	0	(1)
BRC	07/2024		38			270	0	0
BRC	07/2024		256			1,819	0	(3)
BRC	07/2024		44	MYR		208	0	0
BRC	07/2024		128	NOK		1,349	0	(2)
BRC	07/2024		294	RON		1,357	0	(2)
BRC	07/2024		0	THB		14	0	0
BRC	08/2024	AUD	263	\$		175	0	(1)
BRC	09/2024	JPY	400,000			2,516	0	(6)
BRC	09/2024		396,000			2,561	69	0
BRC	09/2024	\$	5,695	CNH		41,019	0	(41)
BRC	09/2024		2,345	MXN		43,943	28	0
BRC	10/2024		11	CNH		77	0	0
BRC	02/2025		74			527	0	0
CBK	07/2024	AUD	781	\$		515	0	(7)
CBK	07/2024	CHF	95			105	0	(1)
CBK	07/2024	CNY	6,773			951	18	0
CBK	07/2024		30,511			4,286	21	0
CBK	07/2024	GBP	581			739	5	0
CBK	07/2024	IDR	17,871,911			1,087	0	(5)
CBK	07/2024	KRW	147,367			107	0	0
CBK	07/2024	\$	310	CAD		426	1	0
CBK	07/2024		4,286	CNH		31,074	0	(28)
CBK	07/2024		353	CNY		2,513	0	(1)
CBK	07/2024		952			6,773	0	(20)
CBK	07/2024		16			112	0	0
CBK	07/2024		334	GBP		261	0	(4)
CBK	07/2024		432	SEK		4,591	1	0
CBK	07/2024		982	THB		35,925	0	(1)
CBK	08/2024	CAD	228	\$		167	0	0
CBK	09/2024	TWD	9,790			304	1	0
CBK	09/2024	\$	1,538	INR		128,547	0	0
CBK	01/2025		141	CNH		1,007	0	(1)
DUB	07/2024	KRW	757,579	\$		551	0	0
DUB	07/2024	\$	153	CLP		141,953	0	(3)
DUB	07/2024		260	MYR		1,228	0	0
FAR	07/2024	AUD	2,869	\$		1,911	0	(5)
FAR	07/2024	NZD	320			195	0	0
FAR	07/2024	\$	45,693	EUR		41,952	0	(730)
FAR	07/2024		1,323	JPY		210,812	0	(13)
FAR	07/2024		449	NZD		729	0	(5)
FAR	08/2024	JPY	209,823	\$		1,323	12	0
FAR	08/2024	\$	195	NZD		320	0	0
FAR	09/2024		176	PEN		659	0	(4)
GLM	07/2024	CNY	109	\$		15	0	0
GLM	07/2024	SEK	7,347			692	0	(2)
GLM	07/2024	SGD	813			604	4	0
GLM	07/2024	\$	15	CNY		109	0	0
GLM	07/2024		8			56	0	0
GLM	07/2024		884	MYR		4,164	0	(1)
GLM	08/2024	DKK	84	\$		12	0	0
GLM	10/2024	\$	1,379	CNH		9,875	0	(14)
GLM	04/2025	DKK	17,200	\$		2,555	42	0

IND	07/2024	CNY	5,241		736	14	0
IND	07/2024	\$	736	CNY	5,243	0	(1)
IND	07/2024		735		5,241	0	(14)
IND	10/2024		1,073	CNH	7,730	0	(5)
JPM	07/2024	CNY	10,069	\$	1,412	15	0
JPM	07/2024	GBP	128		162	0	0
JPM	07/2024	KRW	934,956		678	0	(1)
JPM	07/2024	SEK	6,713	EUR	584	0	(8)
JPM	07/2024	\$	519	AUD	779	1	0
JPM	07/2024		1,200	CHF	1,077	0	(2)
JPM	07/2024		21	CNY	151	0	0
JPM	07/2024		6,004	DKK	41,843	9	0
JPM	07/2024		2,182	IDR	35,391,205	0	(19)
JPM	07/2024		47	SGD	64	0	0
JPM	08/2024	AUD	779	\$	520	0	(1)
JPM	08/2024	CHF	1,073		1,200	1	0
JPM	08/2024	DKK	41,769		6,004	0	(10)
JPM	08/2024	SEK	6,637	EUR	584	0	(1)
JPM	08/2024	\$	1,412	CNY	10,076	0	0
JPM	08/2024		337	DKK	2,345	0	0
JPM	09/2024	TWD	16,655	\$	517	3	0
JPM	09/2024	\$	209	INR	17,528	1	0
JPM	10/2024	CNH	20,078	\$	2,806	31	0
JPM	12/2024		962		134	1	0
MBC	07/2024	CAD	7,961		5,814	0	(3)
MBC	07/2024	CNH	28,280		3,907	33	0
MBC	07/2024	DKK	71		10	0	0
MBC	07/2024	EUR	1,349		1,468	22	0
MBC	07/2024	IDR	474,468		29	0	0
MBC	07/2024	JPY	210,676		1,347	38	0
MBC	07/2024	NOK	1,194		112	0	0
MBC	07/2024	\$	61	AUD	91	0	0
MBC	07/2024		4,296	CAD	5,850	0	(21)
MBC	07/2024		398	CZK	9,168	0	(5)
MBC	07/2024		696	EUR	644	0	(6)
MBC	07/2024		1,614	GBP	1,276	0	(1)
MBC	07/2024		234	HUF	87,234	3	0
MBC	07/2024		702	PLN	2,811	0	(3)
MBC	08/2024	GBP	1,276	\$	1,615	1	0
MBC	08/2024	\$	5,814	CAD	7,955	4	0
MBC	08/2024		112	NOK	1,193	0	0
MBC	09/2024	JPY	1,650,000	\$	10,739	369	0
MBC	09/2024	\$	10,858	CNH	78,184	0	(82)
MBC	04/2025	DKK	22,600	\$	3,362	61	0
MY I	07/2024	CHF	1,295	EUR	1,349	4	0
MY I	07/2024	NOK	341	\$	32	0	0
MY I	07/2024	\$	2,005	CNY	14,274	0	(10)
MY I	07/2024		4,114	DKK	28,718	13	0
MY I	07/2024		297	EUR	277	0	0
MY I	07/2024		28	PLN	113	0	0
MY I	07/2024		261	SEK	2,759	0	(1)
MY I	08/2024	DKK	28,667	\$	4,114	0	(13)
MY I	08/2024	EUR	1,349	CHF	1,293	0	(4)
MY I	08/2024	JPY	1,580,000	\$	10,198	290	0
MY I	08/2024		160,000		1,039	39	0
MY I	08/2024	SEK	2,755		261	1	0
MY I	08/2024	\$	32	NOK	341	0	0
MY I	09/2024	TWD	6,626	\$	207	2	0
MY I	09/2024	\$	19	CLP	17,963	0	0
MY I	09/2024		140	INR	11,704	0	0
NGF	07/2024	JPY	390,000	\$	2,585	153	0
SCX	07/2024	CNY	28,599		4,013	77	0
SCX	07/2024	EUR	39,433		42,249	0	(14)
SCX	07/2024	KRW	1,186,478		870	8	0
SCX	07/2024	MXN	47		3	0	0
SCX	07/2024	\$	4,018	CNY	28,599	0	(82)
SCX	07/2024		1,138		8,092	0	(15)
SCX	08/2024		42,311	EUR	39,433	15	0
SCX	09/2024	CNH	14,045	\$	1,958	22	0
SCX	09/2024	TWD	9,631		299	1	0
SCX	09/2024	\$	949	INR	79,421	1	0
SCX	10/2024		351	CNH	2,531	0	(1)
SSB	09/2024	JPY	420,000	\$	2,717	80	0
TOR	07/2024	NZD	242		148	1	0
TOR	08/2024	\$	367	COP	1,473,999	0	(14)
TOR	08/2024		148	NZD	242	0	(1)
UAG	07/2024	CHF	1,003	\$	1,110	0	(6)
UAG	07/2024	DKK	42,708		6,202	65	0
UAG	07/2024	\$	386	ILS	1,429	0	(6)
UAG	08/2024	EUR	15	CHF	14	0	0
外国為替先渡契約合計						\$ 2,685	\$ (1,430)

買建オプション:

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払/受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
BOA	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.930%	06/23/2025	800 \$	29 \$	35

	Put - OTC Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate							
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	受取	0.450%	07/12/2024	880,000		46	62
BRC	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.005%	09/25/2025	200		7	9
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.065%	06/24/2025	800		24	29
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	3.960%	06/25/2025	1,100		38	47
DUB	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	受取	4.005%	09/25/2025	300		12	14
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	受取	0.850%	07/18/2024	330,000		40	40
								\$ 196	\$ 236

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	CNH 7.275	12/06/2024	33 \$	4 \$	8
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.325	12/06/2024	28	4	5
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.350	12/06/2024	34	3	6
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.400	12/06/2024	39	4	6
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.325	01/14/2025	33	3	6
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.400	01/14/2025	39	3	5
BPS	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.400	01/23/2025	39	4	5
BRC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.300	02/14/2025	19	2	3
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.300	01/14/2025	39	4	7
CBK	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.450	02/14/2025	39	4	5
MBC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.300	02/14/2025	1	0	0
MBC	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.375	02/14/2025	44	4	6
SCX	Call - OTC U.S. dollar versus Chinese renminbi (Offshore)	7.300	02/14/2025	13	1	2
					\$ 40	\$ 64
					\$ 236	\$ 300

買建オプション合計

売建オプション：

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金支払 / 金受取	行使レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム（受取額）	市場価格
AZD	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month Australian Bank Bill	受取	4.350%	07/01/2024	2,800 \$	(4) \$	0
AZD	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month Australian Bank Bill	支払	4.950%	07/01/2024	2,800	(4)	0
BOA	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.250%	06/23/2025	3,100	(29)	(34)
BRC	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR Sterling Overnight Interbank Average Rate	受取	2.700%	07/04/2024	300	0	0
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.700%	07/05/2024	200	(1)	0
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.000%	07/04/2024	300	0	0
BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	支払	0.650%	07/12/2024	1,760,000	(49)	(26)

BRC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.350%	09/25/2025	800	(8)	(9)
BRC	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Sterling Overnight Interbank Average Rate	支払	4.070%	07/05/2024	200	(1)	0
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.400%	06/24/2025	3,100	(24)	(28)
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.280%	06/25/2025	800	(8)	(9)
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.300%	06/25/2025	3,500	(31)	(37)
DUB	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	支払	4.330%	09/25/2025	1,200	(13)	(14)
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.550%	07/15/2024	100	0	0
GLM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.550%	07/18/2024	200	(1)	0
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.880%	07/15/2024	100	0	0
GLM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.890%	07/18/2024	200	(1)	(1)
JPM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.610%	07/15/2024	200	0	0
JPM	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Sterling Overnight Interbank Average Rate	受取	3.800%	07/03/2024	100	0	0
JPM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.940%	07/15/2024	200	0	0
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Sterling Overnight Interbank Average Rate	支払	4.150%	07/03/2024	100	0	0
JPM	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	支払	1.150%	07/18/2024	660,000	(33)	(5)
MYC	Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.820%	07/11/2024	200	0	(1)
MYC	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.120%	07/11/2024	200	0	0
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.740%	07/15/2024	200	0	0
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.630%	07/17/2024	300	(1)	0
RYL	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.630%	07/22/2024	300	(1)	0
RYL	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	3.040%	07/15/2024	200	0	0
RYL	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.970%	07/17/2024	300	(1)	(1)
RYL	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.940%	07/22/2024	300	(1)	(1)
UAG	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	受取	2.570%	07/25/2024	200	(1)	0
UAG	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	支払	2.900%	07/25/2024	200	(1)	(1)
売建オプション合計							\$ (213)	\$ (167)

スワップ契約：

金利スワップ

取引相手	変動金利イ ンデックス	固定金利	満期日	想定元 本	プレミア ム支払 額/(受 取額)	未実現 評価 (損 益)	スワップ契約(公正価 値)	
							資産	負債
	変動金利イ ンデックス	固定金利	満期日	想定元 本	プレミア ム支払 額/(受 取額)	未実現 評価 (損 益)	資産	負債

BPS	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.500%	09/18/2029	MYR	6,880	\$	12	\$	(2)	\$	10	\$	0
JPM	受取	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	09/18/2029		14,550		(16)		0		0		(16)
スワップ契約合計														
							\$	(4)	\$	(2)	\$	10	\$	(16)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2024年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバティブの純市場価格	差入（受取）担保	ネット・エクスポージャー ⁽³⁾
	外国為替先渡契約	買建オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替先渡契約	売建オプション	スワップ契約	店頭合計			
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ 0	\$ 1
BOA	14	35	0	49	0	(34)	0	(34)	15	0	15
BPS	780	41	10	831	(145)	0	0	(145)	686	(610)	76
BRC	406	74	0	480	(90)	(35)	0	(125)	355	(230)	125
CBK	47	12	0	59	(68)	0	0	(68)	(9)	(60)	(69)
DUB	0	90	0	90	(3)	(88)	0	(91)	(1)	0	(1)
FAR	12	0	0	12	(757)	0	0	(757)	(745)	0	(745)
GLM	46	0	0	46	(17)	(1)	0	(18)	28	0	28
IND	14	0	0	14	(20)	0	0	(20)	(6)	0	(6)
JPM	62	40	0	102	(42)	(5)	(16)	(63)	39	0	39
MBC	531	6	0	537	(121)	0	0	(121)	416	(390)	26
MYC	0	0	0	0	0	(1)	0	(1)	(1)	0	(1)
MYI	349	0	0	349	(28)	0	0	(28)	321	(310)	11
NGF	153	0	0	153	0	0	0	0	153	0	153
RYL	0	0	0	0	0	(2)	0	(2)	(2)	0	(2)
SCX	124	2	0	126	(112)	0	0	(112)	14	0	14
SSB	80	0	0	80	0	0	0	0	80	0	80
TOR	1	0	0	1	(15)	0	0	(15)	(14)	0	(14)
UAG	65	0	0	65	(12)	(1)	0	(13)	52	0	52
店頭合計	\$ 2,685	\$ 300	\$ 10	\$ 2,995	\$ (1,430)	\$ (167)	\$ (16)	\$ (1,613)			

(1) 想定元本は契約件数を表す。

(2) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(3) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネットイング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2024年6月30日現在）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品						合計
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約		
金融デリバティブ商品 - 資産							
上場または中央清算							
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 174	\$ 174	
スワップ契約	0	2	0	0	263	265	
	\$ 0	\$ 2	\$ 0	\$ 0	\$ 437	\$ 439	
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,685	\$ 0	\$ 2,685	
買建オプション	0	0	0	64	236	300	
スワップ契約	0	0	0	0	10	10	
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,749	\$ 246	\$ 2,995	
	\$ 0	\$ 2	\$ 0	\$ 2,749	\$ 683	\$ 3,434	
金融デリバティブ商品 - 負債							
上場または中央清算							
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (89)	\$ (89)	
スワップ契約	0	(6)	0	0	(316)	(322)	
	\$ 0	\$ (6)	\$ 0	\$ 0	\$ (405)	\$ (411)	
店頭							
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1,430)	\$ 0	\$ (1,430)	

売建オプション	0	0	0	0	(167)	(167)					
スワップ契約	0	0	0	0	(16)	(16)					
\$	0	\$	0	\$	(1,430)	\$	(1,613)				
\$	0	\$	(6)	\$	0	\$	(1,430)	\$	(588)	\$	(2,024)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2024年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品						金利契約	合計				
	商品契約	クレジット ト契約	エクイ ティ契約	外国為替 契約								
金融デリバティブ商品に係る実現純利益（損失）												
上場または中央清算												
売建オプション	\$	0	\$	0	\$	0	\$	4	\$	4		
先物	0	0	0	0	0	0	72	72				
スワップ契約	0	310	0	0	0	395	705					
\$	0	\$	310	\$	0	\$	0	\$	471	\$	781	
店頭												
外国為替先渡契約	\$	0	\$	0	\$	0	\$	4,596	\$	0	\$	4,596
買建オプション	0	0	0	0	0	(18)	(18)					
売建オプション	0	0	0	0	13	105	118					
スワップ契約	0	(1)	0	0	0	(69)	(70)					
\$	0	\$	(1)	\$	0	\$	4,609	\$	18	\$	4,626	
\$	0	\$	309	\$	0	\$	4,609	\$	489	\$	5,407	

金融デリバティブ商品に係る未実現評価（損）益の純変動額

上場または中央清算												
売建オプション	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(1)	\$	(1)		
先物	0	0	0	0	0	0	(59)	(59)				
スワップ契約	0	(99)	0	0	0	741	642					
\$	0	\$	(99)	\$	0	\$	0	\$	681	\$	582	
店頭												
外国為替先渡契約	\$	0	\$	0	\$	0	\$	743	\$	0	\$	743
買建オプション	0	0	0	0	24	40	64					
売建オプション	0	0	0	0	0	44	44					
スワップ契約	0	0	0	0	0	24	24					
\$	0	\$	0	\$	0	\$	767	\$	108	\$	875	
\$	0	\$	(99)	\$	0	\$	767	\$	789	\$	1,457	

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2024年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2024/06/30現在)				
投資有価証券（公正価値）								
オーストラリア								
社債等	\$	0	\$	1,363	\$	0	\$	1,363
モーゲージ証券	0	4,373	0	4,373				
ソブリン債	0	4,444	0	4,444				
バミューダ								
資産担保証券	0	603	0	603				
社債等	0	97	0	97				
カナダ								
社債等	0	1,051	0	1,051				
ソブリン債	0	218	0	218				
ケイマン諸島								
資産担保証券	0	8,719	0	8,719				
社債等	0	988	0	988				
チリ								
ソブリン債	0	258	0	258				
中国								
ソブリン債	0	12,355	0	12,355				
デンマーク								
社債等	0	16,317	0	16,317				
フランス								
社債等	0	2,210	0	2,210				
ソブリン債	0	1,636	0	1,636				
ドイツ								
社債等	0	2,892	0	2,892				
ハンガリー								
ソブリン債	0	733	0	733				
インドネシア								
ソブリン債	0	229	0	229				
アイルランド								
資産担保証券	0	7,595	0	7,595				
社債等	0	187	0	187				
イスラエル								
ソブリン債	0	2,537	0	2,537				
イタリア								
ソブリン債	0	3,625	0	3,625				
日本								
社債等	0	1,960	0	1,960				
ソブリン債	0	1,033	0	1,033				
ルクセンブルク								
資産担保証券	0	1,394	0	1,394				
メキシコ								
ソブリン債	0	1,343	0	1,343				
多国籍								

社債等	0	686	0	686
オランダ				
資産担保証券	0	807	0	807
社債等	0	1,452	0	1,452
モーゲージ証券	0	1,140	0	1,140
ノルウェー				
社債等	0	211	0	211
ソブリン債	0	55	0	55
ポーランド				
ソブリン債	0	736	0	736
ポルトガル				
社債等	0	745	0	745
カタール				
社債等	0	224	0	224
ソブリン債	0	476	0	476
ルーマニア				
ソブリン債	0	2,061	0	2,061
サウジアラビア				
社債等	0	337	0	337
ソブリン債	0	1,268	0	1,268
シンガポール				
ソブリン債	0	1,177	0	1,177
韓国				
ソブリン債	0	8,518	0	8,518
スペイン				
ソブリン債	0	2,673	0	2,673
スイス				
社債等	0	3,527	0	3,527
アラブ首長国連邦				
社債等	0	1,112	0	1,112
ソブリン債	0	319	0	319
英国				
社債等	0	6,213	0	6,213
モーゲージ証券	0	8,539	0	8,539
ソブリン債	0	4,454	0	4,454
米国				
資産担保証券	0	2,729	0	2,729
社債等	0	36,949	0	36,949
モーゲージ証券	0	2,521	129	2,650
地方債	0	299	0	299
仕組債	0	348	0	348
米国政府機関債	0	96,518	0	96,518
米国財務省証券	0	35,218	0	35,218
短期金融商品	0	64,955	0	64,955
投資合計	\$	0	\$	364,427
			\$	129
			\$	364,556
売建有価証券(公正価値)	\$	0	\$	(11,228)
金融デリバティブ商品 - 資産				
上場または中央清算	121	318	0	439
店頭	0	2,995	0	2,995
	\$	121	\$	3,313
			\$	0
			\$	3,434
金融デリバティブ商品 - 負債				
上場または中央清算	(84)	(327)	0	(411)
店頭	0	(1,613)	0	(1,613)
	\$	(84)	\$	(1,940)
			\$	0
			\$	(2,024)
合計	\$	37	\$	354,572
			\$	129
			\$	354,738

2024年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

投資明細表

PIMCOグローバルハイールドストラテジーファンド

(金額の単位は千*、ただし、株式、契約、受益証券およびオンス(もしあれば)の数を除く)

2024年6月30日現在

	元本金額(単位: 千)	評価額(単位: 千)
投資有価証券101.6%		
オーストリア 0.6%		
社債等0.6%		
ams-OSRAM AG		
10.500% due 03/30/2029	EUR 100	\$ 113
12.250% due 03/30/2029	\$ 200	207
オーストリア合計		320
(取得原価 \$ 307)		
ベルギー 0.2%		
社債等0.2%		
Manuchar Group Sarl		
7.250% due 06/30/2027	EUR 100	105
ベルギー合計		105
(取得原価 \$ 106)		
バミューダ 0.7%		
社債等0.7%		
NCL Corp. Ltd.		

5.875% due 02/15/2027 Seadrill Finance Ltd.	\$	100	99
8.375% due 08/01/2030 Valaris Ltd.		50	52
8.375% due 04/30/2030 パミュダ合計 (取得原価 \$ 327)		175	181
			332
<hr/>			
カナダ 5.1%			
社債等5.1%			
<hr/>			
Air Canada			
3.875% due 08/15/2026		400	381
Bausch + Lomb Corp.			
8.375% due 10/01/2028		150	154
Bausch Health Cos., Inc.			
4.875% due 06/01/2028		100	75
5.750% due 08/15/2027		75	60
6.125% due 02/01/2027		75	62
Bombardier, Inc.			
7.000% due 06/01/2032		125	127
7.250% due 07/01/2031		100	103
Garda World Security Corp.			
6.000% due 06/01/2029		500	457
GFL Environmental, Inc.			
6.750% due 01/15/2031		100	102
goeasy Ltd.			
7.625% due 07/01/2029		50	51
9.250% due 12/01/2028		100	106
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.			
6.000% due 09/15/2028		75	73
New Red Finance, Inc.			
3.500% due 02/15/2029 (g)		200	182
4.000% due 10/15/2030		250	220
Northriver Midstream Finance LP			
6.750% due 07/15/2032 (a)		25	25
Parkland Corp.			
4.625% due 05/01/2030		350	319
Strathcona Resources Ltd.			
6.875% due 08/01/2026		75	74
Taseko Mines Ltd.			
8.250% due 05/01/2030		25	26
カナダ合計 (取得原価 \$ 2,626)			2,597
<hr/>			
ケイマン諸島0.5%			
バンク・ローン債務0.2%			
<hr/>			
AAdvantage Loyalty IP Ltd.			
10.336% due 04/20/2028	\$	80	83
<hr/>			
社債等0.3%			
<hr/>			
Diamond Foreign Asset Co.			
8.500% due 10/01/2030		25	26
GGAM Finance Ltd.			
6.875% due 04/15/2029		25	25
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd.			
5.750% due 01/20/2026		25	24
Spirit Loyalty Cayman Ltd.			
8.000% due 09/20/2025		150	110
			185
ケイマン諸島合計 (取得原価 \$ 274)			268
<hr/>			
チェコ共和国0.2%			
社債等0.2%			
<hr/>			
EPH Financing International A/S			
5.875% due 11/30/2029	EUR	100	108
チェコ共和国合計 (取得原価 \$ 107)			108
<hr/>			
デンマーク 0.2%			
社債等 0.2%			
<hr/>			
Orsted A/S			

5.125% due 03/14/3024		100	108
デンマーク合計 (取得原価 \$ 108)			108
<hr/>			
フランス 3.7%			
社債等3.7%			
<hr/>			
Altice France S.A.			
2.500% due 01/15/2025		135	133
5.125% due 01/15/2029	\$	600	392
11.500% due 02/01/2027 (f)	EUR	100	88
CMA CGM S.A.			
5.500% due 07/15/2029 (a)		100	108
Electricite de France S.A.			
6.000% due 01/29/2026 (b)	GBP	100	124
ELO SACA			
5.875% due 04/17/2028	EUR	200	211
Eramet S.A.			
6.500% due 11/30/2029		200	216
7.000% due 05/22/2028		100	110
Eutelsat S.A.			
1.500% due 10/13/2028		100	87
iliad S.A.			
5.375% due 05/02/2031		200	216
Picard Groupe SAS			
6.375% due 07/01/2029 (a)		100	107
RCI Banque S.A.			
5.500% due 10/09/2034 (a)		100	107
フランス合計 (取得原価 \$ 2,001)			1,899
<hr/>			
ドイツ 3.0%			
社債等3.0%			
<hr/>			
Bayer AG			
7.000% due 09/25/2083		200	222
Cheplapharm Arzneimittel GmbH			
3.500% due 02/11/2027		125	129
7.500% due 05/15/2030		100	112
Deutsche Bank AG			
4.000% due 06/24/2032		200	209
Mahle GmbH			
6.500% due 05/02/2031		100	109
Nidda Healthcare Holding GmbH			
7.500% due 08/21/2026		400	441
Schaeffler AG			
3.375% due 10/12/2028		100	104
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH			
5.375% due 07/15/2029		100	108
TK Elevator Holdco GmbH			
6.625% due 07/15/2028		90	93
ドイツ合計 (取得原価 \$ 1,498)			1,527
<hr/>			
アイルランド 0.5%			
社債等0.5%			
<hr/>			
Flutter Treasury Designated Activity Co.			
6.375% due 04/29/2029	\$	100	101
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC			
5.000% due 07/15/2028		200	178
アイルランド合計 (取得原価 \$ 300)			279
<hr/>			
イタリア 4.2%			
社債等4.2%			
<hr/>			
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			
10.500% due 07/23/2029	EUR	200	257
Cerved Group SpA			
6.000% due 02/15/2029		200	197
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA			
5.625% due 08/01/2027		100	105
Inter Media & Communication SpA			
6.750% due 02/09/2027		100	106
Intesa Sanpaolo SpA			

4.198% due 06/01/2032	\$	400	339
Italmatch Chemicals SpA			
9.195% due 02/06/2028	EUR	150	164
Nexi SpA			
2.125% due 04/30/2029 (g)		500	485
UniCredit SpA			
5.459% due 06/30/2035	\$	300	281
Webuild SpA			
5.375% due 06/20/2029	EUR	200	213
イタリア合計			2,147
(取得原価 \$ 2,081)			

日本 0.6%			
社債等0.6%			
SoftBank Group Corp. (a)			
5.375% due 01/08/2029	EUR	100	107
6.750% due 07/08/2029	\$	200	199
日本合計			306
(取得原価 \$ 307)			

チャンネル諸島ジャージー島0.8%			
社債等0.8%			
Aston Martin Capital Holdings Ltd.			
10.000% due 03/31/2029		200	197
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			
3.250% due 11/12/2025	EUR	200	205
チャンネル諸島ジャージー島合計			402
(取得原価 \$ 405)			

リベリア 0.4%			
社債等0.4%			
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
5.500% due 08/31/2026	\$	200	198
リベリア合計			198
(取得原価 \$ 183)			

ルクセンブルク 5.4%

普通株0.4%			
Intelsat S.A. (f)		株数	
		5,622	209
		元本金額(単位:千)	
社債等5.0%			
Albion Financing 1 SARL			
6.125% due 10/15/2026	\$	200	198
Albion Financing 2 Sarl			
8.750% due 04/15/2027		100	101
Altice Financing S.A.			
3.000% due 01/15/2028	EUR	200	166
Cidron Aida Finco Sarl			
5.000% due 04/01/2028		175	174
Cirsa Finance International Sarl			
4.500% due 03/15/2027		200	211
ContourGlobal Power Holdings S.A.			
2.750% due 01/01/2026		100	104
3.125% due 01/01/2028		100	99
CPI Property Group S.A.			
4.875% due 07/16/2025 (b)		100	69
7.000% due 05/07/2029		100	105
Ephios Subco 3 Sarl			
7.875% due 01/31/2031		200	228
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6.500% due 03/15/2030	\$	422	394
LHMC Finco 2 Sarl			
7.250% due 10/02/2025 (c)	EUR	63	68
Lion/Polaris Lux 4 S.A.			
7.334% due 07/01/2029 (a)		100	107
Loarre Investments Sarl			
6.500% due 05/15/2029		300	325
Monitchem HoldCo 3 S.A.			
8.750% due 05/01/2028	EUR	100	\$ 111
Telecom Italia Capital S.A.			

7.200% due 07/18/2036	\$	125	120
			<u>2,580</u>
ルクセンブルク合計 (取得原価 \$ 3,000)			<u>2,789</u>
多国籍0.8%			
社債等0.8%			
American Airlines, Inc.			
5.500% due 04/20/2026		17	17
5.750% due 04/20/2029 (g)		300	292
Ardagh Packaging Finance PLC			
2.125% due 08/15/2026	EUR	100	89
多国籍合計 (取得原価 \$ 434)			<u>398</u>
オランダ 4.1%			
社債等4.1%			
Abertis Infraestructuras Finance BV			
2.625% due 01/26/2027 (b)		300	302
Alcoa Nederland Holding BV			
7.125% due 03/15/2031	\$	25	26
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV			
7.250% due 02/15/2031		200	208
Boels Topholding BV			
5.750% due 05/15/2030	EUR	100	109
Citycon Treasury BV			
6.500% due 03/08/2029		100	107
Dufry One BV			
2.000% due 02/15/2027		100	101
IPD 3 BV			
7.086% due 06/15/2031		100	107
Telefonica Europe BV			
5.752% due 01/15/2032 (b)		100	110
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV			
1.875% due 03/31/2027		400	400
4.375% due 05/09/2030		100	104
7.375% due 09/15/2029		100	119
United Group BV			
3.125% due 02/15/2026		100	105
Upfield BV			
6.875% due 07/02/2029 (a)		100	107
Wintershall Dea Finance 2 BV			
2.499% due 04/20/2026 (b)		200	201
Ziggo BV			
4.875% due 01/15/2030	\$	25	22
オランダ合計 (取得原価 \$ 2,068)			<u>2,128</u>
ノルウェー0.2%			
社債等0.2%			
Variable Energi ASA			
7.862% due 11/15/2083	EUR	100	116
ノルウェー合計 (取得原価 \$ 107)			<u>116</u>
パナマ 0.8%			
社債等0.8%			
Carnival Corp.			
4.000% due 08/01/2028	\$	200	188
7.000% due 08/15/2029		200	207
パナマ合計 (取得原価 \$ 400)			<u>395</u>
スペイン 1.0%			
社債等1.0%			
Grupo Antolin-Irausa S.A.			
3.500% due 04/30/2028	EUR	200	165
Lorca Telecom Bondco S.A.			
5.750% due 04/30/2029		300	330
スペイン合計 (取得原価 \$ 489)			<u>495</u>

スウェーデン 1.2%			
社債等 1.2%			
Castellum AB			
3.125% due 12/02/2026 (b)		200	191
Verisure Holding AB			
5.500% due 05/15/2030		375	409
スウェーデン合計			600
(取得原価 \$ 583)			
<hr/>			
スイス 0.2%			
社債等 0.2%			
UBS Group AG			
9.250% due 11/13/2028 (b)(d)	\$	100	108
スイス合計			108
(取得原価 \$ 100)			
<hr/>			
英国4.4%			
社債等4.4%			
BCP V Modular Services Finance II PLC			
4.750% due 11/30/2028	EUR	200	200
BCP V Modular Services Finance PLC			
6.750% due 11/30/2029		50	45
Deuce Finco PLC			
5.500% due 06/15/2027	GBP	100	121
Drax Finco PLC			
5.875% due 04/15/2029	EUR	100	108
Heathrow Finance PLC			
4.125% due 09/01/2029	GBP	168	193
INEOS Finance PLC			
6.375% due 04/15/2029	EUR	100	111
INEOS Quattro Finance 2 PLC			
8.500% due 03/15/2029		100	114
9.625% due 03/15/2029	\$	100	106
Macquarie Airfinance Holdings Ltd.			
6.400% due 03/26/2029		25	25
6.500% due 03/26/2031		25	26
Market Bidco Finco PLC			
5.500% due 11/04/2027	GBP	200	235
Marks & Spencer PLC			
7.125% due 12/01/2037	\$	25	27
Pinnacle Bidco PLC			
8.250% due 10/11/2028	EUR	200	228
Thames Water Kemble Finance PLC			
4.625% due 05/19/2026	GBP	100	9
Travis Perkins PLC			
3.750% due 02/17/2026		200	241
Vmed 02 UK Financing I PLC			
3.250% due 01/31/2031	EUR	200	189
4.000% due 01/31/2029	GBP	100	110
4.250% due 01/31/2031	\$	200	166
英国合計			2,254
(取得原価 \$ 2,290)			
<hr/>			
米国55.2%			
バンク・ローン債務3.4%			
Caesars Entertainment, Inc.			
8.097% due 02/06/2031		50	50
Cengage Learning, Inc.			
9.538% due 03/24/2031		100	100
Chromalloy Corp.			
9.058% due 03/27/2031		50	50
Cohesity, Inc.			
TBD% due 03/08/2031		221	221
CoreLogic, Inc.			
8.958% due 06/02/2028		75	74
Cotiviti, Inc.			
8.579% due 05/01/2031		175	174
Fortress Intermediate 3, Inc.			
TBD% due 06/27/2031		50	50
Global Medical Response, Inc.			
TBD% due 10/31/2028		75	73
Mitchell International, Inc.			

8.594% due 06/17/2031	100	99
Modena Buyer LLC		
TBD% due 07/01/2031	100	98
Sotera Health Holdings LLC		
8.594% due 05/30/2031	175	175
Syniverse Holdings LLC		
12.335% due 05/13/2027	125	122
TGP Holdings III LLC		
8.694% due 06/29/2028	150	143
Trans Union LLC		
TBD% due 11/16/2026	51	52
TBD% due 06/24/2031	49	49
TransDigm, Inc.		
TBD% due 08/24/2028	75	75
8.085% due 03/22/2030	50	50
United AirLines, Inc.		
8.094% due 02/22/2031	100	100
		1,755
	株数	
普通株0.0%		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	5,022	7
iHeartMedia, Inc. Class B	938	1
		8
	元本金額(単位:千)	
社債等51.8%		
AAR Escrow Issuer LLC		
6.750% due 03/15/2029	\$ 25	26
ADT Security Corp.		
4.125% due 08/01/2029	200	185
Advantage Sales & Marketing, Inc.		
6.500% due 11/15/2028	300	272
Ahead DB Holdings LLC		
6.625% due 05/01/2028	300	284
Albertsons Cos., Inc.		
4.875% due 02/15/2030	50	47
Allegiant Travel Co.		
7.250% due 08/15/2027	225	214
Alliant Holdings Intermediate LLC		
7.000% due 01/15/2031	100	101
Alta Equipment Group, Inc.		
9.000% due 06/01/2029	50	46
Amer Sports Co.		
6.750% due 02/16/2031	25	25
AmWINS Group, Inc.		
6.375% due 02/15/2029	100	100
Armor Holdco, Inc.		
8.500% due 11/15/2029	250	238
Avis Budget Car Rental LLC		
4.750% due 04/01/2028	50	46
5.375% due 03/01/2029	25	23
B&G Foods, Inc.		
8.000% due 09/15/2028	100	102
BCPE Empire Holdings, Inc.		
7.625% due 05/01/2027	275	267
Beacon Roofing Supply, Inc.		
6.500% due 08/01/2030	25	25
Block, Inc.		
6.500% due 05/15/2032	175	178
Blue Racer Midstream LLC		
7.000% due 07/15/2029	25	25
7.250% due 07/15/2032	25	26
Brandywine Operating Partnership LP		
4.550% due 10/01/2029	175	153
Buckeye Partners LP		
4.500% due 03/01/2028	100	94
Builders FirstSource, Inc.		
6.375% due 03/01/2034	50	50
Burford Capital Global Finance LLC		
6.250% due 04/15/2028	200	194
Cable One, Inc.		
4.000% due 11/15/2030	150	112
Calpine Corp.		

4.625% due 02/01/2029	300	279
Capstone Borrower, Inc.		
8.000% due 06/15/2030	50	52
Cargo Aircraft Management, Inc.		
4.750% due 02/01/2028	150	139
CCO Holdings LLC		
4.500% due 06/01/2033	450	355
5.125% due 05/01/2027	100	96
CD&R Smokey Buyer, Inc.		
6.750% due 07/15/2025	25	25
Champions Financing, Inc.		
8.750% due 02/15/2029	100	103
Chobani LLC		
7.625% due 07/01/2029	525	541
Churchill Downs, Inc.		
6.750% due 05/01/2031	250	252
Cinemark USA, Inc.		
5.250% due 07/15/2028	150	144
CITGO Petroleum Corp.		
8.375% due 01/15/2029	50	52
Clarivate Science Holdings Corp.		
3.875% due 07/01/2028	100	93
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		
7.875% due 04/01/2030	225	227
Clearway Energy Operating LLC		
3.750% due 01/15/2032	50	43
Cleveland-Cliffs, Inc.		
7.000% due 03/15/2032	100	99
Cloud Software Group, Inc.		
6.500% due 03/31/2029	225	216
9.000% due 09/30/2029	100	97
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.		
8.750% due 04/15/2030	575	563
CNX Midstream Partners LP		
4.750% due 04/15/2030	25	23
CNX Resources Corp.		
7.250% due 03/01/2032	25	26
Community Health Systems, Inc.		
4.750% due 02/15/2031	150	118
5.250% due 05/15/2030	100	83
5.625% due 03/15/2027	125	117
10.875% due 01/15/2032	25	26
CQP Holdco LP		
5.500% due 06/15/2031	150	142
Credit Acceptance Corp.		
9.250% due 12/15/2028	25	26
Crescent Energy Finance LLC		
7.375% due 01/15/2033	25	25
CSC Holdings LLC		
4.500% due 11/15/2031	25	16
4.625% due 12/01/2030	50	18
5.375% due 02/01/2028	25	19
5.500% due 04/15/2027	25	20
5.750% due 01/15/2030	50	19
6.500% due 02/01/2029	50	37
11.250% due 05/15/2028	25	22
11.750% due 01/31/2029	50	43
DaVita, Inc.		
3.750% due 02/15/2031	225	192
Delek Logistics Partners LP		
8.625% due 03/15/2029	50	51
Directv Financing LLC		
5.875% due 08/15/2027	100	94
DISH DBS Corp.		
5.125% due 06/01/2029	100	40
5.250% due 12/01/2026	100	79
5.750% due 12/01/2028	50	35
7.375% due 07/01/2028	100	43
Embecta Corp.		
5.000% due 02/15/2030	300	247
EMRLD Borrower LP		
6.625% due 12/15/2030	100	101
Encore Capital Group, Inc.		

8.500% due 05/15/2030	75	76
9.250% due 04/01/2029	125	130
Endo Finance Holdings, Inc.		
8.500% due 04/15/2031	25	26
EnLink Midstream LLC		
6.500% due 09/01/2030	125	128
EQM Midstream Partners LP		
4.500% due 01/15/2029	175	165
4.750% due 01/15/2031	150	140
Esab Corp.		
6.250% due 04/15/2029	25	25
Fertitta Entertainment LLC		
6.750% due 01/15/2030	75	66
Fiesta Purchaser, Inc.		
7.875% due 03/01/2031	25	26
Fortrea Holdings, Inc.		
7.500% due 07/01/2030	25	25
Fortress Intermediate 3, Inc.		
7.500% due 06/01/2031	100	103
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC		
7.000% due 05/01/2031	75	77
Foundation Building Materials, Inc.		
6.000% due 03/01/2029	250	222
Freedom Mortgage Corp.		
12.000% due 10/01/2028	150	161
Freedom Mortgage Holdings LLC		
9.125% due 05/15/2031	75	73
9.250% due 02/01/2029	25	25
Frontier Communications Holdings LLC		
5.875% due 10/15/2027	25	24
6.000% due 01/15/2030	25	22
6.750% due 05/01/2029	25	23
8.625% due 03/15/2031	25	26
Full House Resorts, Inc.		
8.250% due 02/15/2028	100	96
Gap, Inc.		
3.625% due 10/01/2029	225	195
Genesee & Wyoming, Inc.		
6.250% due 04/15/2032	100	100
Genesis Energy LP		
7.875% due 05/15/2032	25	25
8.000% due 01/15/2027	25	26
Global Atlantic Finance Co.		
4.700% due 10/15/2051	25	23
Global Infrastructure Solutions, Inc.		
7.500% due 04/15/2032	275	270
Global Medical Response, Inc.		
10.000% due 10/31/2028 (c)	11	11
GN Bondco LLC		
9.500% due 10/15/2031	125	117
Graham Packaging Co., Inc.		
7.125% due 08/15/2028	275	260
Gray Television, Inc.		
10.500% due 07/15/2029	25	25
Greystar Real Estate Partners LLC		
7.750% due 09/01/2030	25	26
HAT Holdings I LLC		
3.375% due 06/15/2026	100	94
8.000% due 06/15/2027	125	130
HealthEquity, Inc.		
4.500% due 10/01/2029	100	94
Herc Holdings, Inc.		
6.625% due 06/15/2029	25	25
Hilcorp Energy I LP		
6.250% due 11/01/2028	50	49
6.250% due 04/15/2032	75	72
8.375% due 11/01/2033	25	27
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC		
5.000% due 06/01/2029	60	56
Howard Hughes Corp.		
4.125% due 02/01/2029	100	90
4.375% due 02/01/2031	60	52

Howard Midstream Energy Partners LLC			
7.375% due 07/15/2032		75	76
8.875% due 07/15/2028		25	26
HUB International Ltd.			
7.250% due 06/15/2030		200	205
Hudson Pacific Properties LP			
3.950% due 11/01/2027		25	21
Icahn Enterprises LP			
6.250% due 05/15/2026		50	50
Illuminate Buyer LLC			
9.000% due 07/01/2028		100	101
Ingevity Corp.			
3.875% due 11/01/2028		75	68
Insight Enterprises, Inc.			
6.625% due 05/15/2032		25	25
IWG U.S. Finance LLC			
6.500% due 06/28/2030	EUR	100	107
Jane Street Group			
4.500% due 11/15/2029	\$	150	141
7.125% due 04/30/2031		100	103
Jefferson Capital Holdings LLC			
9.500% due 02/15/2029		25	26
JELD-WEN, Inc.			
4.875% due 12/15/2027		25	24
Kinetik Holdings LP			
6.625% due 12/15/2028		50	51
Kodiak Gas Services LLC			
7.250% due 02/15/2029		25	26
Kronos International, Inc.			
3.750% due 09/15/2025	EUR	100	106
9.500% due 03/15/2029		170	198
LABL, Inc.			
5.875% due 11/01/2028	\$	225	206
Ladder Capital Finance Holdings LLLP			
7.000% due 07/15/2031 (a)		50	50
Las Vegas Sands Corp.			
3.900% due 08/08/2029		275	252
Leeward Renewable Energy Operations LLC			
4.250% due 07/01/2029		375	335
Legacy LifePoint Health LLC			
4.375% due 02/15/2027		25	24
LFS Topco LLC			
5.875% due 10/15/2026		100	92
LifePoint Health, Inc.			
5.375% due 01/15/2029		75	66
10.000% due 06/01/2032		25	26
11.000% due 10/15/2030 (g)		200	221
Lindblad Expeditions LLC			
6.750% due 02/15/2027		200	198
Madison IAQ LLC			
5.875% due 06/30/2029		25	23
MajorDrive Holdings IV LLC			
6.375% due 06/01/2029		350	330
Match Group Holdings II LLC			
5.000% due 12/15/2027		25	24
McAfee Corp.			
7.375% due 02/15/2030		175	162
Medline Borrower LP			
3.875% due 04/01/2029		150	138
6.250% due 04/01/2029		50	51
Merlin Entertainments Group U.S. Holdings, Inc.			
7.375% due 02/15/2031		100	102
MGM Resorts International			
6.500% due 04/15/2032		100	100
Michaels Cos., Inc.			
5.250% due 05/01/2028		50	40
Miter Brands Acquisition Holdco, Inc.			
6.750% due 04/01/2032		25	25
Molina Healthcare, Inc.			
3.875% due 05/15/2032		25	22
4.375% due 06/15/2028		25	24
Moog, Inc.			
4.250% due 12/15/2027		25	24

Murphy Oil USA, Inc. 3.750% due 02/15/2031		25	22
Nabors Industries, Inc. 9.125% due 01/31/2030		50	52
Nationstar Mortgage Holdings, Inc. 7.125% due 02/01/2032		100	101
NCR Atleos Corp. 9.500% due 04/01/2029		200	216
Neptune Bidco U.S., Inc. 9.290% due 04/15/2029		50	48
NESCO Holdings II, Inc. 5.500% due 04/15/2029		25	23
New Fortress Energy, Inc. 6.500% due 09/30/2026		25	23
6.750% due 09/15/2025		17	17
8.750% due 03/15/2029		25	23
Newfold Digital Holdings Group, Inc. 6.000% due 02/15/2029		200	145
11.750% due 10/15/2028		100	104
Newmark Group, Inc. 7.500% due 01/12/2029		225	231
NextEra Energy Operating Partners LP 4.500% due 09/15/2027		100	95
7.250% due 01/15/2029		50	51
NGL Energy Operating LLC 8.125% due 02/15/2029		50	51
Noble Finance II LLC 8.000% due 04/15/2030		150	156
Nordstrom, Inc. 4.250% due 08/01/2031		25	22
4.375% due 04/01/2030		25	23
5.000% due 01/15/2044		25	20
Novelis Corp. 3.250% due 11/15/2026		100	94
Olympus Water U.S. Holding Corp. 5.375% due 10/01/2029	EUR	100	97
7.250% due 06/15/2031	\$	25	25
9.750% due 11/15/2028		300	318
OneMain Finance Corp. 3.500% due 01/15/2027		275	258
7.500% due 05/15/2031		100	101
Open Text Holdings, Inc. 4.125% due 02/15/2030		50	45
Organon & Co. 2.875% due 04/30/2028	EUR	200	202
5.125% due 04/30/2031	\$	175	157
7.875% due 05/15/2034		50	51
Oxford Finance LLC 6.375% due 02/01/2027		100	96
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC 4.375% due 10/15/2028		100	93
Panther Escrow Issuer LLC 7.125% due 06/01/2031		300	304
Park Intermediate Holdings LLC 4.875% due 05/15/2029		50	47
PennyMac Financial Services, Inc. 4.250% due 02/15/2029		300	273
7.125% due 11/15/2030		25	25
Post Holdings, Inc. 4.625% due 04/15/2030		200	184
PRA Group, Inc. 7.375% due 09/01/2025		300	301
8.375% due 02/01/2028		125	125
Prime Security Services Borrower LLC 3.375% due 08/31/2027		200	185
PTC, Inc. 4.000% due 02/15/2028		150	141
Raising Cane's Restaurants LLC 9.375% due 05/01/2029		25	27
Rand Parent LLC 8.500% due 02/15/2030		175	177
Resorts World Las Vegas LLC 4.625% due 04/16/2029		25	22

Rockcliff Energy II LLC			
5.500% due 10/15/2029		400	375
Rocket Mortgage LLC			
3.625% due 03/01/2029		50	45
Sabre GLBL, Inc.			
8.625% due 06/01/2027		13	12
11.250% due 12/15/2027		75	73
SCIH Salt Holdings, Inc.			
4.875% due 05/01/2028		75	70
Service Properties Trust			
8.375% due 06/15/2029		100	98
Sirius XM Radio, Inc.			
3.875% due 09/01/2031		75	61
4.000% due 07/15/2028		200	181
Sotera Health Holdings LLC			
7.375% due 06/01/2031		100	100
Southwestern Energy Co.			
4.750% due 02/01/2032		100	92
SS&C Technologies, Inc.			
6.500% due 06/01/2032		100	101
Standard Industries, Inc.			
2.250% due 11/21/2026		300	305
4.375% due 07/15/2030	EUR	125	113
	\$		
Star Parent, Inc.			
9.000% due 10/01/2030		100	105
Station Casinos LLC			
4.625% due 12/01/2031		100	89
6.625% due 03/15/2032		75	75
Sunoco LP			
7.000% due 05/01/2029		25	26
7.250% due 05/01/2032		50	52
Surgery Center Holdings, Inc.			
7.250% due 04/15/2032		100	101
Tallgrass Energy Partners LP			
7.375% due 02/15/2029		225	226
Tenneco, Inc.			
8.000% due 11/17/2028		50	46
Thor Industries, Inc.			
4.000% due 10/15/2029		300	264
TopBuild Corp.			
3.625% due 03/15/2029		50	45
4.125% due 02/15/2032		100	88
TransDigm, Inc.			
6.625% due 03/01/2032		100	101
7.125% due 12/01/2031		75	77
Travel + Leisure Co.			
4.500% due 12/01/2029		250	230
Trident TPI Holdings, Inc.			
12.750% due 12/31/2028		250	273
Triton Water Holdings, Inc.			
6.250% due 04/01/2029		75	72
Triumph Group, Inc.			
9.000% due 03/15/2028		80	84
UKG, Inc.			
6.875% due 02/01/2031		100	101
United Rentals North America, Inc.			
6.125% due 03/15/2034		25	25
Univision Communications, Inc.			
6.625% due 06/01/2027		200	192
8.000% due 08/15/2028		25	24
USA Compression Partners LP			
7.125% due 03/15/2029		50	50
USI, Inc.			
7.500% due 01/15/2032		25	25
Vail Resorts, Inc.			
6.500% due 05/15/2032		100	101
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3.875% due 08/15/2029		100	91
4.125% due 08/15/2031		100	90
Venture Global LNG, Inc.			
8.375% due 06/01/2031		325	337
9.875% due 02/01/2032		25	27
Vertiv Group Corp.			

4.125% due 11/15/2028		25	23
VFH Parent LLC			
7.500% due 06/15/2031		25	25
Victoria's Secret & Co.			
4.625% due 07/15/2029		175	146
Vistra Operations Co. LLC			
6.875% due 04/15/2032		100	102
7.750% due 10/15/2031		100	104
Vital Energy, Inc.			
7.875% due 04/15/2032		50	51
Vornado Realty LP			
2.150% due 06/01/2026		25	23
3.400% due 06/01/2031		150	118
Wand NewCo 3, Inc.			
7.625% due 01/30/2032		100	103
White Cap Parent LLC			
8.250% due 03/15/2026 (c)		175	175
Williams Scotsman, Inc.			
7.375% due 10/01/2031		100	103
WMG Acquisition Corp.			
3.750% due 12/01/2029		100	91
Wynn Resorts Finance LLC			
7.125% due 02/15/2031		150	156
XPO, Inc.			
7.125% due 06/01/2031		100	102
ZF North America Capital, Inc.			
6.750% due 04/23/2030		150	153
6.875% due 04/14/2028		100	102
6.875% due 04/23/2032		100	103
7.125% due 04/14/2030		200	207
ZipRecruiter, Inc.			
5.000% due 01/15/2030		100	87
			26,574
米国合計			28,337
(取得原価 \$ 28,503)			

短期金融商品7.6%**定期預金1.0%**

Australia and New Zealand Banking Group Ltd.			
4.830% due 07/01/2024		21	21
Bank of Nova Scotia			
3.770% due 07/02/2024	CAD	2	1
4.830% due 07/01/2024	\$	4	4
Brown Brothers Harriman & Co.			
4.830% due 07/01/2024		1	1
Citibank N.A.			
2.840% due 07/01/2024	EUR	1	1
4.830% due 07/01/2024	\$	267	267
DBS Bank Ltd.			
4.830% due 07/01/2024		43	43
DnB Bank ASA			
2.840% due 07/01/2024	EUR	1	1
HSBC Bank PLC			
2.840% due 07/01/2024		30	32
4.400% due 07/01/2024	GBP	1	2
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 07/01/2024	\$	49	49
MUFG Bank Ltd.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	1	0
Royal Bank of Canada			
3.770% due 07/02/2024	CAD	4	3
4.830% due 07/01/2024	\$	11	11
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
2.840% due 07/01/2024	EUR	1	1
4.830% due 07/01/2024	\$	38	38
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
(0.140%) due 07/01/2024	¥	5	0
2.840% due 07/01/2024	EUR	7	7
4.400% due 07/01/2024	GBP	3	4
4.830% due 07/01/2024	\$	37	37
			523

米国短期国債(e) 6.6%

5.312% due 08/15/2024	700	695
5.313% due 09/12/2024	900	891
5.318% due 10/01/2024	600	592
5.324% due 09/17/2024	600	593
5.328% due 08/20/2024	600	596
		3,367
短期金融商品合計 (取得原価 \$ 3,890)		3,890
投資有価証券合計101.6% (取得原価 \$ 52,494)	\$	52,106
金融デリバティブ商品(h)(i) (0.3%) (取得原価あるいはプレミアム(純額) \$ (2))		(174)
その他の資産および負債(純額) (1.3%)		(634)
純資産100.0%	\$	51,298

投資明細表に対する注記：

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

- (a) 発行日前取引証券
 (b) 永久債（記載日は次回の契約上の償還日）である。
 (c) 現物配当証券
 (d) 偶発転換社債
 (e) クーボンは最終利回りである。

(f) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価格の対 純資産比率
Altice France S.A.	11.500%	02/01/2027	12/20/2023	\$ 107	\$ 88	0.17%
Intelsat S.A.	N/A	N/A	09/06/2019	433	209	0.41%
制限証券合計				\$ 540	\$ 297	0.58%

借入およびその他の金融取引

リバース・レボ契約：

取引相手	借入金利 ⁽¹⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽¹⁾	リバース・レボ 契約に係る 未払金
BOS	5.250%	06/14/2024	07/11/2024	\$ (525)	\$ (526)
BRC	0.500%	06/17/2024	TBD ⁽²⁾	EUR (182)	(195)
リバース・レボ契 約合計				\$	(721)

担保付借入として会計処理される振替

契約の残存期 間 翌日物および 継続	30日以下			31~90日		90日超		合計
リバース・レボ契 約								
米国以外の社債	\$ 0	\$ (137)	\$ 0	\$ (195)	\$ 0	\$ (332)		
米国社債	0	(389)	0	0	0	(389)		
リバース・レボ契 約合計	\$ 0	\$ (526)	\$ 0	\$ (195)	\$ 0	(721)		
借入合計	\$ 0	\$ (526)	\$ 0	\$ (195)	\$ 0	(721)		
リバース・レボ契 約に係る未払金						\$ (721)		

借入およびその他の金融取引要約

以下は、2024年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

(g) 2024年6月30日現在、以下のマスター契約の条件に基づき、市場価格合計 \$ 889の有価証券が担保として差し入れられている。

取引相手	レボ契 約に係 る未収 金	リバース・ レボ契 約に係 る未払 金	セール・ バイバ ック契 約に係 る未払 金	売込に 係る 未払金	借入およ びその 他の金 融取引 合計	差入（受入） 担保	ネット・ エクス ポージャー ⁽³⁾
グローバル ノーマ ル・レボ 契約							
BOS	\$ 0	\$ (526)	\$ 0	\$ 0	\$ (526)	\$ 695	\$ 169

BRC	0	(195)	0	0	(195)
借入および その他の金融 取引合計	\$ 0	\$ (721)	\$ 0	\$ 0	\$ (721)

(1) 2024年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は\$258で、加重平均金利は2.174%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(2) 満期の定めがないリバース・レポ契約。

(3) ネット・エクスポージャーはデフォルト発生時の取引相手に対する未収金/未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引から発生するエクスポージャーは、同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネットリング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(h) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

詳細	種類	限月	契約数	未実現評価（損） 益	変動証拠金		
					資産	負債	
Euro-Bobl 5-Year Note September	買建	09/2024	19	\$ 24	\$ 0	\$ (2)	
Futures Euro-Bund Bond September	買建	09/2024	2	0	0	0	
Futures Euro-Schatz Note September	買建	09/2024	66	32	0	(2)	
Futures U.S. Treasury 2-Year Note September	売建	09/2024	16	(1)	0	0	
Futures U.S. Treasury 5-Year Note September	売建	09/2024	28	(11)	5	0	
Futures U.S. Treasury 10- Year Note September	売建	09/2024	17	(14)	7	0	
Futures U.S. Treasury 20- Year Bond September	売建	09/2024	1	(1)	1	0	
Futures U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September	買建	09/2024	3	0	1	0	
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September	買建	09/2024	1	0	0	(1)	
先物契約合計				\$ 29	\$ 14	\$ (5)	

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定 金利	満期日	インフラ イデ・ク レジット ト・スワ ップ レッド (2024年 6月30日 現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	市場価 格	未実現評 価（損） 益	変動証拠金	
							資産	負債
Newell Brands, Inc.	1.000%	06/20/2028	2.862%	\$ 100	\$ (7)	\$ 8	\$ 0	\$ 0

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

指数 / トラン シェ	受取固定 金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価 格 ⁽⁴⁾	未実現評 価（損） 益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-42 Index	5.000%	06/20/2029	\$ 400	\$ 25	\$ 0	\$ 0	\$ (1)
iTraxx Europe Crossover Series 41 Index	5.000%	06/20/2029	EUR 200	17	1	0	0
				\$ 42	\$ 1	\$ 0	\$ (1)

金利スワップ

変動金利 支取 / 受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金	
							資産	負債
支払 ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR Secured Overnight Financing Rate	2.750%	09/18/2029	EUR 100	\$ 0	\$ (2)	\$ 0	\$ 0
受取	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	12/20/2028	\$ 1,600	37	7	2	0
支払	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052	120	(41)	(5)	0	(1)
支払 ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.250%	09/18/2026	GBP 500	(1)	(2)	0	0
支払 ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	4.000%	09/18/2029	100	0	(2)	0	0
					\$ (5)	\$ (4)	\$ 2	\$ (1)
スワップ 契約 合計					\$ 30	\$ 5	\$ 2	\$ (2)

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2024年6月30日現在の上場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

2024年6月30日現在、上場および中央清算金融デリバティブ商品について\$473の現金が担保として差し入れられている。マスター・ネットリング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

上場 または 中央 清算 合計	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	市場価格 買建 オプション	変動証拠金資産		合計	市場価格 売建 オプション	変動証拠金負債		合計
		先物	スワップ 契約			先物	スワップ 契約	
	\$ 0	\$ 14	\$ 2	\$ 16	\$ 0	\$ (5)	\$ (2)	\$ (7)

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(3) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(4) クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(5) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

(i) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BOA	07/2024	EUR 77	\$ 83	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2024	\$ 177	EUR 162	0	(3)
BPS	07/2024	EUR 105	\$ 113	1	0
BPS	07/2024	GBP 7	\$ 9	0	0
BPS	07/2024	\$ 1,768	GBP 1,384	0	(18)
FAR	07/2024	EUR 11,154	EUR 10,241	0	(178)

GLM	07/2024	EUR	92	\$	100	1	0		
JPM	07/2024	\$	78	EUR	73	0	0		
MBC	07/2024	GBP	11	\$	14	0	0		
MBC	07/2024	\$	300	EUR	278	0	(2)		
MBC	07/2024		67	GBP	53	0	0		
MYI	07/2024	EUR	144	\$	154	0	0		
RBC	07/2024	GBP	1,419		1,799	6	0		
RBC	08/2024	\$	1,800	GBP	1,419	0	(6)		
SCX	07/2024	EUR	10,170	\$	10,897	0	(3)		
SCX	08/2024	\$	10,699	EUR	9,971	4	0		
SSB	07/2024	EUR	166	\$	180	2	0		
外国為替先渡契約合計						\$	14	\$	(210)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

スワップ契約（公正価値）

取引相手	参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・クレジット・スプレッド (2024年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	プレミアム支払額 / (受取額)	未実現評価 (損) 益	資産	負債
GST	Infrastructure A/S	5.000%	06/20/2028	1.858%	EUR 100	\$ (2)	\$ 15	\$ 13	\$ 0
スワップ契約合計						\$ (2)	\$ 15	\$ 13	\$ 0

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2024年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた（受領した）担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭デリバティブの市場価格	差入 (受) 担保	ネット・エクスポージャー ⁽⁴⁾
	外国為替先渡契約	買建オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替先渡契約	売建オプション	スワップ契約	店頭合計			
BOA	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (3)	\$ 0	\$ 0	\$ (3)	\$ (3)	\$ 0	\$ (3)
BPS	1	0	0	1	(18)	0	0	(18)	(17)	0	(17)
FAR	0	0	0	0	(178)	0	0	(178)	(178)	0	(178)
GLM	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
GST	0	0	13	13	0	0	0	0	13	0	13
JPM	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
MBC	0	0	0	0	(2)	0	0	(2)	(2)	0	(2)
MYI	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RBC	6	0	0	6	(6)	0	0	(6)	0	0	0
SCX	4	0	0	4	(3)	0	0	(3)	1	0	1
SSB	2	0	0	2	0	0	0	0	2	0	2
店頭合計	\$ 14	\$ 0	\$ 13	\$ 27	\$ (210)	\$ 0	\$ 0	\$ (210)			

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払 / 履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建 / 売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(3) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(4) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金 / 未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下

で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。マスター・ネットング契約に関する詳細情報については財務諸表に対する注記を参照。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。主なりリスクおよびその他のリスクについては財務諸表に対する注記を参照。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値（2024年6月30日現在）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					合計
	商品契約	クレジット ト契約	エクイ ティ契約	外国為替 契約	金利契約	
金融デリバティブ商品						
- 資産						
上場または中央清算						
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 14	\$ 14
スワップ契約	0	0	0	0	2	2
	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 16	\$ 16
店頭						
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 14	\$ 0	\$ 14
スワップ契約	0	13	0	0	0	13
	\$ 0	\$ 13	\$ 0	\$ 14	\$ 0	\$ 27
	\$ 0	\$ 13	\$ 0	\$ 14	\$ 16	\$ 43
金融デリバティブ商品						
- 負債						
上場または中央清算						
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (5)	\$ (5)
スワップ契約	0	(1)	0	0	(1)	(2)
	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ (6)	\$ (7)
店頭						
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (210)	\$ 0	\$ (210)
	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ (210)	\$ (6)	\$ (217)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響（2024年6月30日に終了した年度）：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					合計
	商品契約	クレジット ト契約	エクイ ティ契約	外国為替 契約	金利契約	
金融デリバティブ商品に						
係る実現純利益（損失）						
上場または中央清算						
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 42	\$ 42
スワップ契約	0	228	0	0	20	248
	\$ 0	\$ 228	\$ 0	\$ 0	\$ 62	\$ 290
店頭						
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 28	\$ 0	\$ 28
スワップ契約	0	5	0	0	0	5
	\$ 0	\$ 5	\$ 0	\$ 28	\$ 0	\$ 33
	\$ 0	\$ 233	\$ 0	\$ 28	\$ 62	\$ 323
金融デリバティブ商品に						
係る未実現評価（損）益						
の純変動額						
上場または中央清算						
先物	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 13	\$ 13
スワップ契約	0	(60)	0	0	33	(27)
	\$ 0	\$ (60)	\$ 0	\$ 0	\$ 46	\$ (14)
店頭						
外国為替先渡契約	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (284)	\$ 0	\$ (284)
スワップ契約	0	11	0	0	0	11
	\$ 0	\$ 11	\$ 0	\$ (284)	\$ 0	\$ (273)
	\$ 0	\$ (49)	\$ 0	\$ (284)	\$ 46	\$ (287)

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2024年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2024/06/30現在)
投資有価証券（公正価値）				
オーストリア				
社債等	\$ 0	\$ 320	\$ 0	\$ 320
ベルギー				
社債等	0	105	0	105
バミューダ				
社債等	0	332	0	332
カナダ				
社債等	0	2,597	0	2,597
ケイマン諸島				
バンク・ローン債務	0	83	0	83
社債等	0	185	0	185
チェコ共和国				

社債等	0	108	0	108
デンマーク	0	108	0	108
社債等	0	1,899	0	1,899
フランス	0	1,527	0	1,527
社債等	0	279	0	279
ドイツ	0	2,147	0	2,147
社債等	0	306	0	306
アイルランド	0	402	0	402
社債等	0	198	0	198
イタリア	0	0	209	209
社債等	0	2,580	0	2,580
日本	0	398	0	398
社債等	0	2,128	0	2,128
チャンネル諸島ジャージー島	0	116	0	116
社債等	0	395	0	395
リベリア	0	495	0	495
社債等	0	600	0	600
ルクセンブルク	0	108	0	108
普通株	0	2,254	0	2,254
社債等	0	1,484	271	1,755
多国籍	7	0	1	8
社債等	0	26,574	0	26,574
オランダ	0	3,890	0	3,890
社債等	0	7	0	7
ノルウェー	0	51,618	481	52,106
社債等	0	0	0	0
パナマ	0	0	0	0
社債等	0	0	0	0
スペイン	0	0	0	0
社債等	0	0	0	0
スウェーデン	0	0	0	0
社債等	0	0	0	0
スイス	0	0	0	0
社債等	0	0	0	0
英国	0	0	0	0
社債等	0	0	0	0
米国	0	0	0	0
バンク・ローン債務	0	0	0	0
普通株	7	0	1	8
社債等	0	26,574	0	26,574
短期金融商品	0	3,890	0	3,890
投資合計	\$	7	\$	51,618
金融デリバティブ商品 - 資産			\$	481
上場または中央清算	0	16	0	16
店頭	0	27	0	27
	\$	0	\$	43
金融デリバティブ商品 - 負債				
上場または中央清算	(5)	(2)	0	(7)
店頭	0	(210)	0	(210)
	\$	(5)	\$	(212)
合計	\$	2	\$	51,449
			\$	481
			\$	51,932

2024年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

財務諸表に対する注記

2024年6月30日

重要な会計方針

以下は、ピムコ・バミューダ・トラストIV（以下「トラスト」という）が米国において一般に公正受当と認められる会計原則（以下「米国GAAP」という）に準拠した財務諸表を作成するにあたって、継続して従っている重要な会計方針の要約である。各ファンドは米国GAAPの報告規定に該当する投資会社として扱われている。米国GAAPに従い財務諸表を作成するにあたって、経営陣は、財務報告日現在の資産および負債の報告金額ならびに偶発資産および負債の開示事項、ならびに報告期間中における運用による純資産の増加および減少の報告金額に影響を与える見積りおよび仮定を行う必要がある。実際の結果は、このような見積りとは異なることがある。

(a) 被取得ファンド

受託会社およびマネージャーは、(i)PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド A、およびPIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド C、(ii)PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド A、およびPIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド B、(iii)PIMCOバミューダエマージングマーケットインフラストラクチャーボンドファンド A、およびPIMCOバミューダエマージングマーケットインフラストラクチャーボンドファンド B（これらは他のファンドに投資を行うもので、以下それぞれ「ファンド・オブ・ファンズ」または「取得ファンド」という）の資産の全部または一部を、それぞれ(i)PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド (M)、(ii) PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド (M)、(iii) PIMCOバミューダエマージングマーケットインフラストラクチャーボンドファンド (M)（以下それぞれ「取得ファンド」という）に振り替えることができる。そのように振り替えられた資産は当該被取得ファンドにおいて直接受領されたかのように保有される。資産がそのように振り替えられた場合、被取得ファンドは、対応する取得ファンドへの受益証券の発行を当該受益証券の1口当たりの発行価格で計上し、当該受益証券の買戻し時には、受益証券1口当たり買戻価格で当該受益証券の買戻しを行う。財務ハイ

ライトに記載の比率には被取得ファンドの費用は含まれていない。ファンドの報酬に関しては、「注記9 報酬および費用」を適宜参照のこと。

(b) 有価証券取引および投資収益

有価証券取引は、財務報告上、約定日基準で計上される。発行日取引または遅延引渡基準で売買された有価証券は、約定日後かかる有価証券の標準決済期間以上の期間が経過した後で決済されることがある。有価証券売却に係る実現損益は個別原価法で計上されている。受取配当金は配当落ち日に計上される。ただし、外国有価証券からの配当で配当落ち日を過ぎたと思われる一部配当金については、ファンドが配当落ち日の通知を受領次第計上される。受取利息は、ディスカウントの増額およびプレミアムの償却が反映され、決済日から発生基準で計上される。例外は先日付の効力発生日を有する有価証券で、この場合の受取利息は効力発生日から発生基準で計上される。転換型証券の転換権に係るプレミアムは償却されない。特定の外国有価証券に係る見積税金負債は発生基準で計上され、損益計算書において場合に応じて受取利息または投資に係る未実現評価(損)益の純変動額の構成要素として反映される。かかる有価証券売却の結果実現する税金債務は損益計算書において投資に係る実現純損益の構成要素として反映される。モーゲージ証券およびその他の資産担保証券の元本返済による損益があれば、損益計算書において受取利息の構成要素として計上される。

継続して適用している手続きに基づき利息の全部または一部の回収が疑わしくなった場合、債務証券は不良債権に分類することができ、関連する受取利息は、経過利息の計上を停止し、未収利息を償却することによって減額できる。発行体が利払いを再開した場合または利息の回収可能性が高まった場合、債務証券は不良債権から正常債権に再分類される。一定の状況において、債務証券には、合意された支払日以降に支払われることが予想される利息の支払いについて、契約上または非契約上の猶予が与えられる。

(c) 現金および外国通貨

各ファンドの財務諸表は、主たる営業の場所において使用されている通貨(以下「機能通貨」という)で表示されている。各ファンドの機能通貨は下記の表に列挙されている。

外国有価証券、保有通貨ならびにその他の資産および負債の市場価格は、各営業日現在の為替レートに基づき各ファンドの機能通貨に換算される。外貨建ての有価証券の売買または外貨建ての収益もしくは費用の項目があれば、取引日に有効な為替レートで各ファンドの機能通貨に換算される。ファンドでは、為替レートの変動による影響と保有有価証券の市場価格の変動による影響は分けて報告されない。かかる変動は、損益計算書において投資に係る実現純損益および未実現評価損益の純変動額に含まれる。ファンドは、為替市場でその時の実勢レートによるスポット(直物)取引または外国為替先渡契約により、外貨建て有価証券への投資および外国為替取引を行うことがある。スポットでの外貨の売却から生じる実現為替損益、有価証券取引の約定日と決済日との間に実現した為替損益、ならびに配当、受取利息および外国の源泉徴収税の計上額と実際に受領した、または支払った額の機能通貨換算額との差は、損益計算書における外国為替取引に係る実現純損益に含まれる。報告期間末日現在に保有する証券投資以外の外貨建て資産および負債に関し、外国為替レートの変動から生じる外国為替の未実現純損益は、損益計算書における外貨建て資産および負債に係る未実現評価損益の純変動額に含まれる。

特定のファンド(あるいは、該当する場合はそのクラス)の純資産価額およびトータル・リターンは、各ファンドの目論見書(以下、「目論見書」という)に詳述されているとおり、純資産価額が報告される通貨(以下、「報告通貨」という)で表示されている。純資産価額およびトータル・リターンの報告通貨による表示目的のため、期首および期末の純資産価額は期首と期末日それぞれの為替レートで換算され、分配額は分配日の為替レートで換算される。各ファンドの報告通貨は下表のとおり。

ファンド/クラス	報告通貨	機能通貨
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド A	日本円	米ドル
・ J (日本円)		
・ J (米ドル)		
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド C	日本円	米ドル
・ J (C-米ドル)		
PIMCOバミューダエマージングカレンシーハイインカムファンド	日本円	米ドル
・ N (米ドル)		
・ S (日本円)		
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド A	日本円	米ドル
・ J (日本円)		
・ J (米ドル)		
・ N (米ドル)		
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド B	日本円	米ドル
・ J (豪ドル)		

・ J (ブラジル・リアル)		
・ J (インドネシア・ルピア)		
・ J (インド・ルピー)		
・ J (韓国ウォン)		
・ J (メキシコ・ペソ)		
・ J (トルコ・リラ)		
・ J (南アフリカ・ランド)		
PIMCOバミューダエマージングマーケットアンドインフラストラクチャーボンドファンド (M)	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケットアンドインフラストラクチャーボンドファンド A		
・ J (日本円)	日本円	米ドル
・ J (米ドル)	日本円	米ドル
・ 米ドル	米ドル	米ドル
PIMCOバミューダエマージングマーケットアンドインフラストラクチャーボンドファンド B	日本円	米ドル
・ J (豪ドル)		
・ J (ブラジル・リアル)		
・ J (人民元)		
・ J (インドネシア・ルピア)		
・ J (インド・ルピー)		
・ J (南アフリカ・ランド)		
PIMCOバミューダトレンドズマネージドフューチャーズストラテジーファンド		
・ 米ドル	米ドル	米ドル
・ (日本円、為替ヘッジあり) 機関	日本円	米ドル
・ (日本円、為替ヘッジあり) 小売	日本円	米ドル
・ (日本円、為替ヘッジなし) 小売	日本円	米ドル
PIMCOバミューダ米国コアファンド	日本円	米ドル
・ J (日本円、為替ヘッジあり)		
・ 米ドル		
PIMCOクレジットバイアンドホールドファンド2021-06		
・ J (日本円)	日本円	米ドル
・ 米ドル	米ドル	米ドル
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド	日本円	米ドル
・ J (日本円)		
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド	日本円	米ドル
・ C (日本円、為替ヘッジあり)*		
・ J (日本円)		
・ S (日本円)		
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド	日本円	米ドル
・ J (日本円)		

* 当クラスは決算期間中に清算された。

(d) 複数のクラスによる運用

トラストが募集するそれぞれのファンドの各クラスは、該当する場合為替ヘッジに関連するクラスに割り当てられた特定の資産ならびにキャピタル・ゲインおよびキャピタル・ロスを除き、同じファンドの他のクラスがファンドに対して有する権利と同じ権利を有する。収益、クラス特有ではない費用、実現および未実現のキャピタル・ゲインおよびキャピタル・ロスは、該当する場合、それぞれのファンドの各クラスの純資産価額に応じて受益証券の各クラスに按分される。クラス特有の費用は現在、場合に応じて、運用報酬、投資顧問報酬、管理報酬、販売会社報酬などである。

(e) 分配方針

次の表は、各ファンドの予定分配頻度を表示している。各ファンドからの分配は、マネージャーにより承認された場合のみ公表されかつ受益者に分配され、また、マネージャーの裁量により承認が保留されることもある。

毎月分配

PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド A	
・ J (日本円)	
・ J (米ドル)	
PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド C	
・ J (C-米ドル)	
PIMCOバミューダエマージングカレンシーハイインカムファンド	
・ N (米ドル)	
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド A	
・ J (日本円)	
・ J (米ドル)	
・ N (米ドル)	
PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド B	
・ J (豪ドル)	

- ・ J (ブラジル・リアル)
 - ・ J (インドネシア・ルピア)
 - ・ J (インド・ルピー)
 - ・ J (韓国ウォン)
 - ・ J (メキシコ・ペソ)
 - ・ J (トルコ・リラ)
 - ・ J (南アフリカ・ランド)
- PIMCOバミューダエマージングマーケットツアンドインフラストラクチャーボンドファンド A
- ・ J (日本円)
 - ・ J (米ドル)
 - ・ 米ドル
- PIMCOバミューダエマージングマーケットツアンドインフラストラクチャーボンドファンド B
- ・ J (豪ドル)
 - ・ J (ブラジル・リアル)
 - ・ J (人民元)
 - ・ J (インドネシア・ルピア)
 - ・ J (インド・ルピー)
 - ・ J (南アフリカ・ランド)
- PIMCOバミューダトレンドズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
- ・ (日本円、為替ヘッジあり) 小売
 - ・ (日本円、為替ヘッジなし) 小売
- PIMCOバミューダ米国コア債券ファンド
- ・ J (日本円、為替ヘッジあり)
 - ・ 米ドル
- PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド
- ・ J (日本円)
- PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド
- ・ J (日本円)
- PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンド
- ・ J (日本円)
- 半年毎の分配**
- PIMCOバミューダトレンドズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
- ・ (日本円、為替ヘッジあり) 機関
- 毎年分配**
- PIMCOクレジットバイアンドホールドファンド2021-06
- ・ J (日本円)
 - ・ 米ドル

マネージャーは下記ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）について分配の公表を予定していない。ただし、その裁量でいつでも受益者に分配することができる。

- PIMCOバミューダキャピタルセキュリティーズファンド (M)
 - PIMCOバミューダエマージングマーケットハイイールドコーポレートボンドファンド (M)
 - PIMCOバミューダエマージングマーケットツアンドインフラストラクチャーボンドファンド (M)
 - PIMCOバミューダトレンドズマネージドフューチャーズストラテジーファンド
 - ・ 米ドル
 - PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド
 - ・ C (日本円、為替ヘッジあり)*
 - ・ S (日本円)
- * 当クラスは決算期間中に清算された。

分配（もしあれば）は、通常、関連したファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の投資純利益から行われる。また、マネージャーは、分配に使用可能な実現純キャピタル・ゲインの支払いを認めることもある。追加分配は、マネージャーが適切と考えた場合に公表されることがある。ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）に関連して支払われた分配は、ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の純資産価額を減少させる。受益証券保有者はその裁量で、ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）からの分配金をファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の受益証券に追加して再投資するか、あるいは現金で受領することができる。現金による支払いは、ファンドの報告通貨にて行われる。各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）が、ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の受当な分配水準を維持するため必要と考えた場合は、追加分配を公表することができる。目論見書により要求されているファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の分配金を支払うのに十分な純利益および実現純キャピタル・ゲインがない場合、マネージャーは、そのファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の資本金の一部を分配金として支払うことができる。分配期日から6年以内に受取が行われなかった分配金については無効となり、当該ファンド（あるいは、該当する場合にはそのクラス）の利益として計上される。

(f) 受益証券の発行および買戻し

ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の運用開始後は、マネージャーは各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の受益証券を、その発行時におけるファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の受益証券1口当たりの純資産価額で継続的に発行することができる（ただし、マネージャーまたはその指定代理人が、マネージャー単独の裁量により、当該発行を一時的に停

止できる権利が付されている）。関連する目論見書に別に記載がある場合を除き、各ファンド（あるいは、該当する場合はそのクラス）の当該受益証券の受益証券1口当たりの発行価格は、各取引日に決定された受益証券1口当たりの純資産価額（後述の「純資産価額の決定」に基づき算定）とされる（ただし、仮にBBHが許容できる形での受益証券の購入依頼が正午12時（東部時間）までにBBHに受領されなかった場合、関連ファンド（あるいは、該当する場合はクラス）の受益証券1口当たりの発行価格は、翌取引日に決定された受益証券1口当たりの純資産価額とされる）。

受益証券が買い戻される場合または日本での直接分配のために日本で登録されたトラストの各ファンドが終了した場合、当該各ファンドの受益証券は現金で受益者から買い戻される。当該各ファンドにおいて、現物での買い戻しは認められない。

関連する目論見書に別に記載されている場合を除き、買戻金額の支払いは、通常、BBHが買戻通知を受領した、または受領したとみなされる取引日から2営業日以内に、受託会社またはその指定代理人により銀行振込で支払われる（ただし、一定の状況下では、支払われるまでに当該取引日から最大8営業日を要する可能性がある）。

関連する目論見書に別に記載されている場合を除き、各ファンドは申込または買戻手数料が発生しない（ただし、ファンドが販売される司法管轄区域の指定販売代理業者は、マネージャーおよび受託会社と合意した金額で申込または買戻手数料を請求することができる）。

(g) 新しい会計原則および規制上のアップデート

2020年3月、米国財務会計基準審議会（以下、「FASB」という）は、会計基準アップデート（以下、「ASU」という）ASU 2020-04「金利指標改革（トピック848）」を発行した。これは、廃止される予定のロンドン銀行間取引金利（LIBOR）などから金利指標が移行することに関連する、会計処理の潜在的な負担を軽減するための任意のガイダンスを提供するものである。ASU 2020-04は、2020年3月12日から2024年12月31日までの間に発生した、または発生する、特定の金利指標関連の契約修正に対して効力を持つ。2021年1月および2022年12月、FASBは、トピック848への追加修正を含む、ASU 2021-01およびASU 2022-06を発行した。経営陣はLIBORの停止がファンドの投資に与え得る潜在的影響を継続的に評価しており、ASUの採用がファンドの財務諸表に重大な影響を与える可能性は低いと結論付けた。

2022年6月、FASBは、契約上の売却制限が付された公正価値で測定される持分証券に投資するすべての事業体に影響を及ぼすASU 2022-03「公正価値測定（トピック820）」を発行した。ASU 2022-03の修正は、持分証券に関する契約上の売却制限は当該持分証券の会計単位の一部とみなされず、したがってその公正価値測定において考慮されないことを明確化している。また、同修正は、契約上の売却制限が付されたトピック820に基づき公正価値で測定される持分証券について追加の開示を要求している。ASU 2022-03の修正の効力発生日は、2024年12月15日より後に開始する会計年度および当該会計年度内の中間期間となる。現在、経営陣は、当該変更による財務諸表への影響について評価している。

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 9月17日現在	2025年 3月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	67,327,994	55,830,611
コール・ローン	10,001,281	10,001,322
株式	2,946,428,599	3,979,959,221
投資証券	95,285,881	28,143,762
派生商品評価勘定	19,052	-
未収入金	9,099,044	-
未収配当金	6,058,718	6,381,724
未収利息	64	132
流動資産合計	3,134,220,633	4,080,316,772
資産合計	3,134,220,633	4,080,316,772
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,932	2,415

	2024年 9月17日現在	2025年 3月17日現在
未払金	21,488,915	-
未払解約金	38,812,728	996,425
流動負債合計	60,333,575	998,840
負債合計	60,333,575	998,840
純資産の部		
元本等		
元本	698,846,933	872,009,859
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,375,040,125	3,207,308,073
元本等合計	3,073,887,058	4,079,317,932
純資産合計	3,073,887,058	4,079,317,932
負債純資産合計	3,134,220,633	4,080,316,772

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「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)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 9月17日現在	2025年 3月17日現在
1. 期首	2024年 3月16日	2024年 9月18日
期首元本額	747,414,917円	698,846,933円
期首からの追加設定元本額	- 円	186,805,655円
期首からの一部解約元本額	48,567,984円	13,642,729円
元本の内訳		
日興スリートップ(隔月分配型)	698,846,933円	872,009,859円
計	698,846,933円	872,009,859円
2. 受益権の総数	698,846,933口	872,009,859口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2024年 3月16日 至 2024年 9月17日	自 2024年 9月18日 至 2025年 3月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2024年 3月16日 至 2024年 9月17日	自 2024年 9月18日 至 2025年 3月17日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 9月17日現在	2025年 3月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
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

(有価証券に関する注記)

(2024年 9月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	259,962,181
投資証券	9,349,528
合計	269,311,709

(2025年 3月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,463,773
投資証券	3,521,778
合計	1,058,005

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2024年 9月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,413,271	-	3,394,028	19,243
	ユーロ	2,520,726	-	2,506,126	14,600
	英ポンド	293,752	-	292,097	1,655
	スイスフラン	319,740	-	317,959	1,781
	スウェーデンクローナ	279,053	-	277,846	1,207
	売建	42,225,608	-	42,219,245	6,363
米ドル	42,225,608	-	42,219,245	6,363	
合計		45,638,879	-	45,613,273	12,880

(2025年 3月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	996,293	-	998,708	2,415
	米ドル	996,293	-	998,708	2,415
合計		996,293	-	998,708	2,415

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 9月17日現在		2025年 3月17日現在	
1口当たり純資産額	4.3985円	1口当たり純資産額	4.6781円
(1万口当たり純資産額)	(43,985円)	(1万口当たり純資産額)	(46,781円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES CO	9,712	42.84	416,062.08	
	CHEVRON CORP	2,800	157.02	439,656.00	

CONOCOPHILLIPS	2,701	98.95	267,263.95
EXXON MOBIL CORP	4,209	111.90	470,987.10
DOW INC	3,027	36.97	111,908.19
SHIN-ETSU CHEM-UNSPON ADR	19,562	15.06	294,603.72
EATON CORP PLC	870	293.61	255,440.70
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	918	209.47	192,293.46
OTIS WORLDWIDE CORP	5,454	100.62	548,781.48
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,528	347.80	531,438.40
BRIDGESTONE CORP-UNSPONS ADR	8,359	20.28	169,520.52
MCDONALD'S CORP	2,315	299.83	694,106.45
YUM! BRANDS INC	1,801	155.05	279,245.05
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,890	607.60	1,148,364.00
OMNICOM GROUP	2,031	80.83	164,165.73
THE WALT DISNEY CO.	3,623	98.64	357,372.72
WARNER MUSIC GROUP CORP-CL A	4,656	32.91	153,228.96
BEST BUY CO INC	1,650	71.49	117,958.50
LOWE'S COS INC	1,014	224.44	227,582.16
ROSS STORES INC	1,747	124.21	216,994.87
COCA-COLA CO/THE	3,334	69.16	230,579.44
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,517	64.31	161,868.27
KENVUE INC	6,000	22.81	136,860.00
PROCTER & GAMBLE CO	1,716	167.97	288,236.52
ABBOTT LABORATORIES	2,928	126.71	371,006.88
UNITEDHEALTH GROUP INC	707	488.65	345,475.55
ABBVIE INC	2,751	211.77	582,579.27
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,610	59.01	213,026.10
JOHNSON & JOHNSON	2,610	162.81	424,934.10
MERCK & CO. INC.	2,387	94.57	225,738.59
BANK OF AMERICA CORP	11,713	40.89	478,944.57
TRUIST FINANCIAL CORP	5,275	40.55	213,901.25
US BANCORP	2,663	42.02	111,899.26
WELLS FARGO & CO	2,806	70.85	198,805.10
BLACKROCK INC	259	928.70	240,533.30
CME GROUP INC	1,972	258.68	510,116.96
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	9,394	70.89	665,940.66
MORGAN STANLEY	3,831	115.34	441,867.54
MARSH & MCLENNAN COS	1,286	231.53	297,747.58
TOKIO MARINE HOLDINGS-ADR	6,572	38.14	250,656.08
ACCENTURE PLC-CL A	838	318.82	267,171.16
MICROSOFT CORP	3,393	388.56	1,318,384.08
SALESFORCE INC	897	279.40	250,621.80
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,001	87.90	263,787.90

	AT&T INC	9,566	26.58	254,264.28	
	DOMINION ENERGY INC	4,411	54.68	241,193.48	
	NEXTERA ENERGY INC	6,818	73.55	501,463.90	
	SOUTHERN CO	6,039	90.38	545,804.82	
	ANALOG DEVICES INC	2,659	208.75	555,066.25	
	BROADCOM INC	4,137	195.54	808,948.98	
	DISCO CORP-UNSPONSORED-ADR	3,286	24.60	80,835.60	
	LAM RESEARCH CORP	2,337	78.69	183,898.53	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,576	53.50	137,816.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	587	206.16	121,015.92	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	5,350	174.09	931,381.50	
	TOKYO ELECTRON LTD-UNSP ADR	1,287	73.63	94,768.24	
米ドル小計		211,380		20,004,113.50	(2,977,412,253)
加ドル	TC ENERGY CORP	4,601	67.71	311,533.71	
加ドル小計		4,601		311,533.71	(32,262,431)
ユーロ	SAFRAN SA	495	250.70	124,096.50	
	VINCI SA	1,683	117.30	197,415.90	
	AENA SA	957	215.20	205,946.40	
	MICHELIN (CGDE)	4,896	34.05	166,708.80	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	805	605.10	487,105.50	
	PERNOD-RICARD SA	1,319	96.08	126,729.52	
	ERSTE GROUP BANK AG	2,351	68.20	160,338.20	
	NORDEA BANK ABP	18,680	13.03	243,400.40	
	UNICREDIT SPA	6,040	52.70	318,308.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	932	270.00	251,640.00	
	ALLIANZ SE-REG	677	351.60	238,033.20	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	856	579.00	495,624.00	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,533	33.70	253,862.10	
	KONINKLIJKE KPN NV	50,136	3.75	188,110.27	
	ENGIE	8,176	17.23	140,913.36	
	IBERDROLA SA	15,343	13.93	213,727.99	
ASML HOLDING NV	292	655.70	191,464.40		
ユーロ小計		121,171		4,003,424.54	(648,114,398)
英ポンド	RELX PLC	6,500	37.83	245,895.00	
	ASTRAZENECA PLC	1,718	119.94	206,056.92	
	SSE PLC	7,355	15.24	112,090.20	
英ポンド小計		15,573		564,042.12	(108,566,827)
スウェーデンクローナ	VOLVO AB-B SHS-B	15,706	314.40	4,937,966.40	

スウェーデンクローナ小計		15,706		4,937,966.40 (72,588,106)
豪ドル	RIO TINTO LTD	1,999	117.10	234,082.90
	QBE INSURANCE GROUP LTD	14,823	20.84	308,911.32
豪ドル小計		16,822		542,994.22 (51,160,915)
シンガポールドル	DBS GROUP HOLDINGS LTD	11,830	44.25	523,477.50
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	22,000	12.79	281,380.00
シンガポールドル小計		33,830		804,857.50 (89,854,291)
合 計		419,083		3,979,959,221 (3,979,959,221)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	WELLTOWER INC	1,279	189,087.36	
米ドル小計			1,279	189,087.36 (28,143,762)	
合 計				28,143,762 (28,143,762)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 56銘柄	99.1%		74.3%
	投資証券 1銘柄		0.9%	0.7%
加ドル	株式 1銘柄	100.0%		0.8%
ユーロ	株式 17銘柄	100.0%		16.2%
英ポンド	株式 3銘柄	100.0%		2.7%
スウェーデンクローナ	株式 1銘柄	100.0%		1.8%
豪ドル	株式 2銘柄	100.0%		1.3%
シンガポールドル	株式 2銘柄	100.0%		2.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2025年 3月31日現在です。

【日興スリートップ（隔月分配型）】

【純資産額計算書】

資産総額	21,927,960,811円
負債総額	93,388,234円
純資産総額（ - ）	21,834,572,577円
発行済口数	32,732,502,607口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6671円

（参考）

グローバル高配当株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	4,063,086,202円
負債総額	35,263円
純資産総額（ - ）	4,063,050,939円
発行済口数	871,623,675口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6615円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（4）受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2025年3月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2025年3月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2025年3月末現在）

- 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
- 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
- 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
- トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
- 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- 「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、証券投資信託の設定を行なうとともに「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）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- 委託会社の運用する、2025年3月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	762	292,649
株式投資信託	718	255,883
単位型	258	6,473
追加型	460	249,410
公社債投資信託	44	36,765
単位型	31	852
追加型	13	35,913

3【委託会社等の経理状況】

- 当社の財務諸表は、「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）

並びに同規則第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)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」並びに同規則第282条及び第306条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第65期事業年度(2023年4月1日から2024年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第66期中間会計期間(2024年4月1日から2024年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第64期 (2023年3月31日)		第65期 (2024年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,036		31,198
金銭の信託		-		3,899
有価証券		1,025		1
前払費用		908		814
未収入金	4	410		179
未収委託者報酬		21,336		21,592
未収収益	3	589	3	647
関係会社短期貸付金		3,318		-
立替金		1,015		1,089
その他	2	1,233	2	2,011
流動資産合計		71,875		61,434
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	245	1	233
器具備品	1	122	1	134
有形固定資産合計		367		368
無形固定資産				
ソフトウェア		390		438
無形固定資産合計		390		438
投資その他の資産				
投資有価証券		23,274		28,465
関係会社株式		22,366		37,647
長期差入保証金		375		285
繰延税金資産		448		-
投資その他の資産合計		46,465		66,398
固定資産合計		47,224		67,205
資産合計		119,099		128,640

(単位：百万円)

	第64期 (2023年3月31日)		第65期 (2024年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		433		451
未払金		7,557		9,211

未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		6,586		8,330
その他未払金		892		803
未払費用	3	4,227	3	4,082
未払法人税等		-		1,644
未払消費税等		-	4	620
賞与引当金		2,563		2,619
役員賞与引当金		218		232
その他		647		683
流動負債合計		15,648		19,547
固定負債				
退職給付引当金		1,424		1,448
賞与引当金		437		565
役員賞与引当金		16		56
繰延税金負債		-		295
その他		181		251
固定負債合計		2,059		2,617
負債合計		17,708		22,165
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		79,307		82,591
利益剰余金合計		79,307		82,591
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		99,823		103,107
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,056		4,523
繰延ヘッジ損益		488		1,155
評価・換算差額等合計		1,567		3,367
純資産合計		101,391		106,475
負債純資産合計		119,099		128,640

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第64期		第65期	
	(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	73,998		75,874	
その他営業収益	3,479	1	3,714	
営業収益合計	77,477		79,588	
営業費用				
支払手数料	30,699		32,917	
広告宣伝費	755		711	
公告費	3		3	

調査費	17,479	17,736
調査費	1,170	1,266
委託調査費	16,282	16,445
図書費	26	23
委託計算費	581	610
営業雑経費	948	881
通信費	139	135
印刷費	309	308
協会費	56	48
諸会費	16	11
その他	427	375
営業費用計	50,469	52,860
一般管理費		
給料	9,818	10,550
役員報酬	314	459
役員賞与引当金繰入額	234	273
給料・手当	6,544	6,791
賞与	147	277
賞与引当金繰入額	2,577	2,747
交際費	56	71
寄付金	24	22
旅費交通費	205	260
租税公課	433	389
不動産賃借料	938	906
退職給付費用	383	388
退職金	155	36
固定資産減価償却費	183	199
福利費	1,097	1,208
諸経費	4,291	4,661
一般管理費計	17,588	18,694
営業利益	9,420	8,033

(単位：百万円)

	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		107		4
受取配当金	2	9,255	2	4,946
有価証券評価益		-	3	1,113
金銭の信託運用益		-		399
時効成立分配金・償還金		1		2
その他		236		50
営業外収益合計		9,601		6,517
営業外費用				
支払利息		407		569
デリバティブ費用		389		3,494
有価証券償還損		6		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		1
為替差損		342		165
その他		15		0
営業外費用合計		1,163		4,231
経常利益		17,858		10,319

特別利益			
投資有価証券売却益		427	815
訴訟損失引当金戻入額	4	4,481	-
特別利益合計		4,909	815
特別損失			
投資有価証券売却損		347	174
固定資産処分損		0	52
損害賠償損失		-	167
特別損失合計		347	394
税引前当期純利益		22,420	10,740
法人税、住民税及び事業税		1,340	2,415
法人税等調整額		3,252	51
法人税等合計		4,593	2,364
当期純利益		17,826	8,376

(3) 【株主資本等変動計算書】

第64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		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	10,406	10,406	-	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	2,350	731	1,618	91,035
当期変動額				
剰余金の配当				7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	294	242	51	51
当期変動額合計	294	242	51	10,355
当期末残高	2,056	488	1,567	101,391

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本	
	資本剰余金	利益剰余金

	<p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額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、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（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>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p>
	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしてあります。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価してあります。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

（重要な会計上の見積り）

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)								
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>1,437百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>879百万円</td> </tr> </table>	建物	1,437百万円	器具備品	879百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>1,482百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>920百万円</td> </tr> </table>	建物	1,482百万円	器具備品	920百万円
建物	1,437百万円								
器具備品	879百万円								
建物	1,482百万円								
器具備品	920百万円								
<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>2 信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>								

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,778百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大448百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 248百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,873百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
-	1 営業収益合計には、成功報酬212百万円が含まれております。
2 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 9,241百万円	2 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,889百万円
-	3 有価証券評価益 保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額1,113百万円を営業外収益に計上しております。
4 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。	-

(株主資本等変動計算書関係)

第64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

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	当事業年度末残高(百万円)
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	-	784,000	752,000	-
合計		2,440,000	-	1,471,000	969,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

- 2 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 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5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(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	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

第65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

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	217,000	-	96,000	121,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	752,000	-	406,000	346,000	-
合計		969,000	-	502,000	467,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

- 2 2016年度ストックオプション(2)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 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5月26日 取締役会	普通株式	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

(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	効力発生日
2024年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25日

(リース取引関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 899百万円	1年内 891百万円
1年超 3,425百万円	1年超 2,613百万円
合計 4,324百万円	合計 3,505百万円

(金融商品関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、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。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」5「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(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

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

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

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格

のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下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。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券 其他有価証券 投資信託	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連 (*2) 通貨関連 (*3)	246 - -	- 352 -	- - -	246 352 599
デリバティブ取引計	246	352	-	599

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、 で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 246百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。
- (3) 通貨関連のデリバティブ取引の 352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）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、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性にに基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株価指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 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

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

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、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(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

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関して、定期的継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

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

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰り予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下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。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券	-	3,899	-	3,899

その他有価証券 投資信託	7,785	18,141	-	25,927
資産計	7,785	22,041	-	29,827
デリバティブ取引(*1)				
株式関連 (*2)	309	-	-	309
通貨関連 (*3)	-	367	-	367
デリバティブ取引計	309	367	-	677

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。

(2) 株式関連のデリバティブ取引の 309百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。

(3) 通貨関連のデリバティブ取引の 367百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）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、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株価指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

3 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

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,198			
未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	169	2,483	-
合計	53,440	169	2,483	-

(有価証券関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	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	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,063	7,459	395
	小計	7,063	7,459	395
合計		24,283	21,319	2,963

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	11,194	1,349	221
合計	11,194	1,349	221

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	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	24,313	17,701	6,611
	小計	24,313	17,701	6,611
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,613	1,769	156
	小計	1,613	1,769	156
合計		25,927	19,471	6,455

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額2,540百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	8,145	1,057	167
合計	8,145	1,057	167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	3,899	399

（デリバティブ取引関係）

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 株価指数先物取引 売建	10,970	-	246	246
合計	10,970	-	246	246

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引 為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,275	-	24	24
合計	3,275	-	24	24

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建 米ドル 豪ドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	6,132	-	280
			105	-	0
			699	-	34
			5,822	-	1
			234	-	10
			合計	12,994	-

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第65期(2024年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 株価指数先物取引 売建	15,077	-	309	309
合計	15,077	-	309	309

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

該当事項はありません。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,465	-	268
	豪ドル		84	-	2
	香港ドル		542	-	17
	人民元		2,979	-	17
	ユーロ		2,172	-	60
	合計		12,243	-	367

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 5,326	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,342
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 17,691
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,185	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,474

(退職給付関係)

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

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)
退職給付債務の期首残高	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	16
退職給付の支払額	107
退職給付債務の期末残高	1,366

(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

退職給付債務	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1

確定給付制度に係る退職給付費用	136
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
 割引率 0.6%

3 確定拠出制度
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要
 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

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)
退職給付債務の期首残高	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	110
退職給付債務の期末残高	1,407

(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

退職給付債務	1,407
未積立退職給付債務	1,407
未認識数理計算上の差異	40
貸借対照表に計上された負債の額	1,448
退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の費用処理額	7
確定給付制度に係る退職給付費用	134

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
 割引率 0.7%

3 確定拠出制度
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、253百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 4,437,000株	普通株式 4,409,000株
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日

権利確定条件	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2018年7月15日から 2026年7月31日まで	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,422,000株
付与日	2018年4月27日
権利確定条件	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	599,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	217,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日

権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	558	553
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	694
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 344百万円

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	217,000	752,000
付与	0	0
失効	96,000	406,000
権利確定	0	0
権利未確定残	121,000	346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 104百万円

(税効果会計関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)

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	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
(単位：百万円)	(単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 918	賞与引当金 975
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 8
関係会社株式評価損 52	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 436	退職給付引当金 443
固定資産減価償却費 83	固定資産減価償却費 80
繰延ヘッジ損益 215	繰延ヘッジ損益 510
その他 672	その他 679
繰延税金資産小計 2,478	繰延税金資産小計 2,750
評価性引当金 52	評価性引当金 52
繰延税金資産合計 2,425	繰延税金資産合計 2,697
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 1,028	その他有価証券評価差額金 2,044
その他 948	その他 948
繰延税金負債合計 1,977	繰延税金負債合計 2,992
繰延税金資産の純額 448	繰延税金負債の純額 295
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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 12.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%
その他 0.8%	その他 1.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 20.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.0%

(関連当事者情報)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貸建)(注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注2)	3 (USD 26千)	未収収益	-

子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接100.00	-	配当の受取	7,795 (USD 58,000千)	-	-
-----	-------------------------------------	----	---------------------------	---------------------	----------	---	-------	---------------------------	---	---

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定してあります(決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております)。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2022年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,828百万円
負債合計	5,655百万円
純資産合計	29,173百万円
営業収益	15,864百万円
税引前当期純利益	4,191百万円
当期純利益	3,159百万円

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	資金の返済 (シンガポールドル貸建) (注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貸建) (注1)	22 (SGD 223千)	未収収益	-
							関係会社 株式の取得 (注2)	13,412	-	-
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,950 (USD 20,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	3,378	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注4)	1,828	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management Berhadの20%の株式を、2023年4月19日に13,412百万円で取得しました。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
4. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

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

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2023年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	41,322百万円
負債合計	8,314百万円
純資産合計	33,008百万円

営業収益	18,682百万円
税引前当期純利益	6,005百万円
当期純利益	4,538百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

(収益認識関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる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) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる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) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	522円22銭	548円41銭
1株当たり当期純利益金額	91円81銭	43円14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、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載していません。

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。

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	17,826	8,376
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-

普通株式に係る当期純利益（百万円）	17,826	8,376
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション（2）217,000株、2017年度ストックオプション（1）752,000株	2016年度ストックオプション（2）121,000株、2017年度ストックオプション（1）346,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	101,391	106,475
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	101,391	106,475
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

中間財務諸表等

（1）中間貸借対照表

（単位：百万円）

第66期中間会計期間
(2024年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,631
金銭の信託		13,876
有価証券		10
未収委託者報酬		17,767
未収収益		1,082
その他	2	5,804
流動資産合計		60,173
固定資産		
有形固定資産	1	335
無形固定資産		470
投資その他の資産		
投資有価証券		20,253
関係会社株式		44,647
長期差入保証金		244
繰延税金資産		50
投資その他の資産合計		65,195
固定資産合計		66,001
資産合計		126,174

（単位：百万円）

第66期中間会計期間
(2024年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		8,826
未払費用		3,471
未払法人税等		2,272
未払消費税等	3	625
関係会社短期借入金		6,688
賞与引当金		1,764
役員賞与引当金		120
その他		700
流動負債合計		24,470
固定負債		
退職給付引当金		1,489
賞与引当金		358
役員賞与引当金		72
その他		158
固定負債合計		2,079
負債合計		26,549
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		76,524
利益剰余金合計		76,524
自己株式		2,067
株主資本合計		97,040
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		3,213
繰延ヘッジ損益		629
評価・換算差額等合計		2,583
純資産合計		99,624
負債純資産合計		126,174

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		40,928
その他営業収益		2,050
営業収益合計		42,979
営業費用及び一般管理費	1	38,534
営業利益		4,444
営業外収益	2	3,213

営業外費用	3	445
経常利益		7,212
特別利益	4	172
特別損失	5	50
税引前中間純利益		7,333
法人税等	6	2,217
中間純利益		5,116

(3) 中間株主資本等変動計算書

第66期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30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		自己株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107
当中間期変動額							
剰余金の配当				11,183	11,183		11,183
中間純利益				5,116	5,116		5,116
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	6,066	6,066	-	6,066
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	76,524	76,524	2,067	97,040

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	4,523	1,155	3,367	106,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				11,183
中間純利益				5,116
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	1,310	525	784	784
当中間期変動額合計	1,310	525	784	6,851
当中間期末残高	3,213	629	2,583	99,624

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 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、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額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、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>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中間会計期間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。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(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>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p>

<p>5 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

（中間貸借対照表関係）

<p>第66期中間会計期間 (2024年9月30日)</p>	
1	<p>有形固定資産の減価償却累計額 2,372百万円</p>
2	<p>信託資産 流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
3	<p>消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
4	<p>保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>

（中間損益計算書関係）

<p>第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)</p>	
--	--

1	減価償却実施額	
	有形固定資産	46百万円
	無形固定資産	48百万円
2	営業外収益のうち主要なもの	
	有価証券評価益	1,788百万円
	受取配当金	1,170百万円
	為替差益	132百万円
	デリバティブ収益	100百万円
	有価証券評価益について、保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額を営業外収益に計上しております。	
3	営業外費用のうち主要なもの	
	支払利息	420百万円
4	特別利益のうち主要なもの	
	投資有価証券売却益	172百万円
5	特別損失のうち主要なもの	
	投資有価証券売却損	42百万円
6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

(中間株主資本等変動計算書関係)

第66期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末
普通株式（株）	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	121,000	-	121,000	-	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	346,000	-	154,000	192,000	-
合計		467,000	-	275,000	192,000	-

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2017年度ストックオプション(1) 192,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 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
2024年5月29日 取締役会	普通株式	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25日

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	862百万円
1年超	2,187百万円
合計	3,049百万円

(金融商品関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下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。

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券 その他有価証券 投資信託	-	13,876	-	13,876
資産計	6,989	10,736	-	17,725
デリバティブ取引(1、2)	6,989	24,613	-	31,602
株式関連	257	-	-	257
通貨関連	-	845	-	845
デリバティブ取引計	257	845	-	587

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、 で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち257百万円は、中間貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち890百万円は、流動資産のその他に、 45百万円は流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、未払金、未払費用及び関係会社短期借入金は、短期間(1年以内)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、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株式指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	2,538
子会社株式	26,011
関連会社株式	18,635

(有価証券関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であり、(金融商品関係)金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項(注2)に記載のとおりであります。

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	16,629	11,861	4,767
	小計	16,629	11,861	4,767
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,096	1,294	198
	小計	1,096	1,294	198
合計		17,725	13,156	4,568

(注) 1 減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%~50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。当中間会計期間については、該当ございません。

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額2,538百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(金銭の信託関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

運用目的の金銭の信託

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	13,876	22

(デリバティブ取引関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
株価指数先物取引				

市場取引	売建	17,372	-	257	257
	合計	17,372	-	257	257

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 シンガポールドル	6,688	-	45	45
	合計	6,688	-	45	45

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,664	-	641
	豪ドル		186	-	9
	ユーロ		2,374	-	171
	香港ドル		769	-	61
	人民元		1,456	-	6
	合計		11,450	-	890

(持分法損益等)

第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,341百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,354百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,083百万円

(収益認識関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる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 4 . 収益の計上基準」に記載の通りです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第66期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

項目	第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
1株当たり純資産額	513円12銭
1株当たり中間純利益金額	26円35銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権等の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載しておりません。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
中間純利益（百万円）	5,116
普通株主に帰属しない金額（百万円）	-
普通株式に係る中間純利益（百万円）	5,116
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2017年度ストックオプション(1)192,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (2024年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	99,624
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	99,624
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,152

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
以下の変更について、2024年9月26日の臨時株主総会で決議されており、2025年9月1日付で定款の変更を行いません。
・商号の変更（アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社に変更）
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	
株式会社 S B I 証券	54,323百万円	
株式会社 スマートプラス	100百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
三菱UFJ eスマート証券株式会社	7,196百万円	
moomoo証券株式会社	3,500百万円 (2023年12月末現在)	
楽天証券株式会社	19,495百万円	

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額	事業の内容
S M B C グローバル・インベストメント & コンサルティング株式会社	1,499百万円 (2024年12月末現在)	資産運用に関する業務を営んでいます。
ピムコジャパンリミテッド	13,411,674.44米ドル (2024年9月末現在)	
キャピタル・インターナショナル株式会社	450百万円 (2024年6月末現在)	
J P モルガン・アセット・マネジメント (UK) リミテッド	24百万ポンド (2024年9月末現在)	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

(3) 投資顧問会社

・各資産の適切な配分比率についての投資助言

S M B C グローバル・インベストメント & コンサルティング株式会社

・委託会社から、投資対象ファンドの運用指図権限の委託を受け当該ファンドの運用(投資一任)を行ないます。

ピムコジャパンリミテッド

キャピタル・インターナショナル株式会社

・委託会社から、マザーファンドの運用指図権限の委託を受け当該ファンドの運用(投資一任)を行ないます。

J P モルガン・アセット・マネジメント (UK) リミテッド

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 9月30日	臨時報告書
2024年11月29日	臨時報告書
2024年12月17日	有価証券届出書
2024年12月17日	有価証券報告書

2025年 1月31日

臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

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」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65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、日興アセットマネジメント株式会社の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。

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が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年6月4日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwC Japan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 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

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」に掲げられている日興スリートップ（隔月分配型）の2024年9月18日から2025年3月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、日興スリートップ（隔月分配型）の2025年3月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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、日興アセットマネジメント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、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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

利害関係

日興アセットマネジメント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.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、日興アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績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、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、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。

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。

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な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、企業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、監査等委員会に対して、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

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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。