

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券						
信託期間	無期限（2004年1月16日設定）						
運用方針	<p>主として円建ての外国投資信託であるピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジおよびピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジの投資信託証券への投資を通じて、世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等に実質的な投資を行います。ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数(BB-B、円ヘッジベース)×50%+ブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く、新興国除く)インデックス(円ヘッジベース)×50%の合成指数をベンチマークとします。</p> <p>各投資信託証券の組入比率は、それぞれ純資産総額の50%程度となるように調整します。</p> <p>実質的に投資する公社債は、原則として取得時においてB-格相当以上の格付を有しているものに限るものとし、ポートフォリオの実質的な平均格付は原則としてBB-B格相当以上を維持します。</p> <p>ポートフォリオの実質的な平均デュレーションは原則としてベンチマーク±2年以内で調整します。</p> <p>実質的な組入外貨建資産については、原則として投資する外国投資信託において為替ヘッジを行います。運用指図に関する権限は、ピムコジャパンリミテッドに委託します。</p>						
主要運用対象	<table border="1"> <tr> <td>ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド (為替ヘッジ付き)</td> <td>ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券、ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券を主要投資対象とします。</td> </tr> <tr> <td>ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ</td> <td>世界各国の社債等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。</td> </tr> <tr> <td>ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ</td> <td>世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。</td> </tr> </table>	ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド (為替ヘッジ付き)	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券、ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券を主要投資対象とします。	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ	世界各国の社債等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。
ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド (為替ヘッジ付き)	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券、ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ投資信託証券を主要投資対象とします。						
ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ	世界各国の社債等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。						
ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券(MBS)、資産担保証券(ABS)等を主要投資対象とします。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。						
主な組入制限	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。						
分配方針	経費等控除後の利子等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額とし、分配金額は、経費等を控除後の利子等収益等を中心に基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、基準価額水準、運用状況等によっては安定した分配とならないことがあります。						

運用報告書（全体版）

ピムコ ハイ・インカム
毎月分配型ファンド
(為替ヘッジ付き)

- 第253期（決算日：2025年2月17日）
 第254期（決算日：2025年3月17日）
 第255期（決算日：2025年4月15日）
 第256期（決算日：2025年5月15日）
 第257期（決算日：2025年6月16日）
 第258期（決算日：2025年7月15日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド（為替ヘッジ付き）」は、去る7月15日に第258期の決算を行いましたので、法令に基づいて第253期～第258期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用 フリーダイヤル	0120-151034 (受付時間：営業日の9:00～17:00、 土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)
お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。	

本資料の表記にあたって

- 原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- 一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決算期	基準価額 (分配額)	基準価額			合成指數	投資信託 組入比率	純資産額
		税分配	込み金	期騰落率			
229期(2023年2月15日)	円 6,980	円 10	% △1.0		184.96	% △1.1	% 99.2 百万円 1,451
230期(2023年3月15日)	6,894	10	△1.1		183.25	△0.9	99.4 1,433
231期(2023年4月17日)	6,962	10	1.1		185.20	1.1	99.2 1,447
232期(2023年5月15日)	6,933	10	△0.3		184.82	△0.2	98.1 1,431
233期(2023年6月15日)	6,897	10	△0.4		183.49	△0.7	99.1 1,403
234期(2023年7月18日)	6,888	10	0.0		183.76	0.1	99.1 1,388
235期(2023年8月15日)	6,820	10	△0.8		182.08	△0.9	99.3 1,383
236期(2023年9月15日)	6,809	10	△0.0		181.99	△0.0	99.4 1,376
237期(2023年10月16日)	6,660	10	△2.0		178.46	△1.9	99.3 1,309
238期(2023年11月15日)	6,768	10	1.8		181.44	1.7	99.0 1,304
239期(2023年12月15日)	6,989	10	3.4		187.52	3.4	99.3 1,327
240期(2024年1月15日)	6,985	10	0.1		187.60	0.0	99.0 1,279
241期(2024年2月15日)	6,900	10	△1.1		185.48	△1.1	98.8 1,341
242期(2024年3月15日)	6,908	5	0.2		185.83	0.2	99.1 1,348
243期(2024年4月15日)	6,846	5	△0.8		184.45	△0.7	98.3 1,312
244期(2024年5月15日)	6,854	5	0.2		184.75	0.2	99.3 1,267
245期(2024年6月17日)	6,878	5	0.4		185.86	0.6	99.1 1,258
246期(2024年7月16日)	6,906	5	0.5		186.72	0.5	99.2 1,241
247期(2024年8月15日)	6,961	5	0.9		188.70	1.1	99.1 1,237
248期(2024年9月17日)	7,030	5	1.1		190.73	1.1	99.1 1,246
249期(2024年10月15日)	6,943	5	△1.2		188.62	△1.1	99.5 1,221
250期(2024年11月15日)	6,945	5	0.1		187.47	△0.6	98.0 1,206
251期(2024年12月16日)	6,974	5	0.5		188.07	0.3	98.3 1,196
252期(2025年1月15日)	6,851	5	△1.7		184.90	△1.7	89.4 1,160
253期(2025年2月17日)	6,962	5	1.7		187.90	1.6	98.1 1,072
254期(2025年3月17日)	6,914	3	△0.6		186.80	△0.6	98.4 1,057
255期(2025年4月15日)	6,822	3	△1.3		185.27	△0.8	98.0 1,023
256期(2025年5月15日)	6,896	3	1.1		187.00	0.9	98.0 1,018
257期(2025年6月16日)	6,940	3	0.7		188.32	0.7	98.1 1,014
258期(2025年7月15日)	6,958	3	0.3		188.77	0.2	98.4 1,008

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 合成指数はICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（B B-B、円ヘッジベース）×50%+ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く、新興国除く）インデックス（円ヘッジベース）×50%の合成指数です。ただし、設定から2013年10月15日までは、B of Aメリルリンチ グローバル・ハイイールド・インデックス（B B-B、円ヘッジベース）×50%+バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ヘッジベース）×50%の合成指数、2013年10月16日から2019年10月15日までは、ICE BofAML 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（B B-B、円ヘッジベース）×50%+ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円ヘッジベース）×50%の合成指数です。ベンチマークはこれらを連続させて合成指数化したものです。ICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（B B-B、円ヘッジベース）とは、ICE Data Indices, LLCが算出する主な先進国のハイイールド債券の値動きを表す指数です。同指数は、ICE Data Indices, LLC、ICE Dataまたはその第三者の財産であり、三菱UFJアセットマネジメントは許諾に基づき使用しています。ICE Dataおよびその第三者は、使用に関して一切の責任を負いません。ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く、新興国除く）インデックス（円ヘッジベース）とは、ブルームバーグが算出する世界の投資適格債券（円建てのものを除く、新興国除く）の値動きを表す指数を円換算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、三菱UFJアセットマネジメントによる一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグの指数はブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグは、三菱UFJアセットマネジメントの関係会社ではなく、ブルームバーグは、三菱UFJアセットマネジメントが運用するファンドを承認し、是認し、レビューしましたは推奨するものではありません。ブルームバーグは、ブルームバーグの指数に関するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性または完全性を保証するものではありません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		合 成 指 数		投 資 信 託券組入比率	
		騰	落	率	騰	落	
第253期	(期首) 2025年1月15日	円	%	—	184.90	%	%
	1月末	6,851	—	1.3	187.24	1.3	89.4
	(期末) 2025年2月17日	6,942	1.3	1.7	187.90	1.6	98.3
		6,967	—	—	—	—	98.1
第254期	(期首) 2025年2月17日	6,962	—	—	187.90	—	98.1
	2月末	6,989	0.4	0.4	188.63	0.4	98.1
	(期末) 2025年3月17日	6,917	—	△0.6	186.80	△0.6	98.4
		6,914	—	—	186.80	—	98.4
第255期	3月末	6,922	0.1	0.1	187.05	0.1	98.4
	(期末) 2025年4月15日	6,825	—	△1.3	185.27	△0.8	98.0
		6,914	—	—	186.80	—	98.4
第256期	(期首) 2025年4月15日	6,822	—	—	185.27	—	98.0
	4月末	6,918	1.4	1.4	187.65	1.3	98.0
	(期末) 2025年5月15日	6,899	—	1.1	187.00	0.9	98.0
		6,896	—	—	187.00	—	98.0
第257期	(期首) 2025年5月15日	6,896	—	—	187.00	—	98.0
	5月末	6,927	0.4	0.4	187.74	0.4	98.1
	(期末) 2025年6月16日	6,943	0.7	0.7	188.32	0.7	98.1
		6,940	—	—	188.32	—	98.1
第258期	(期首) 2025年6月16日	6,940	—	—	188.32	—	98.1
	6月末	6,984	0.6	0.6	189.37	0.6	98.2
	(期末) 2025年7月15日	6,961	0.3	0.3	188.77	0.2	98.4

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

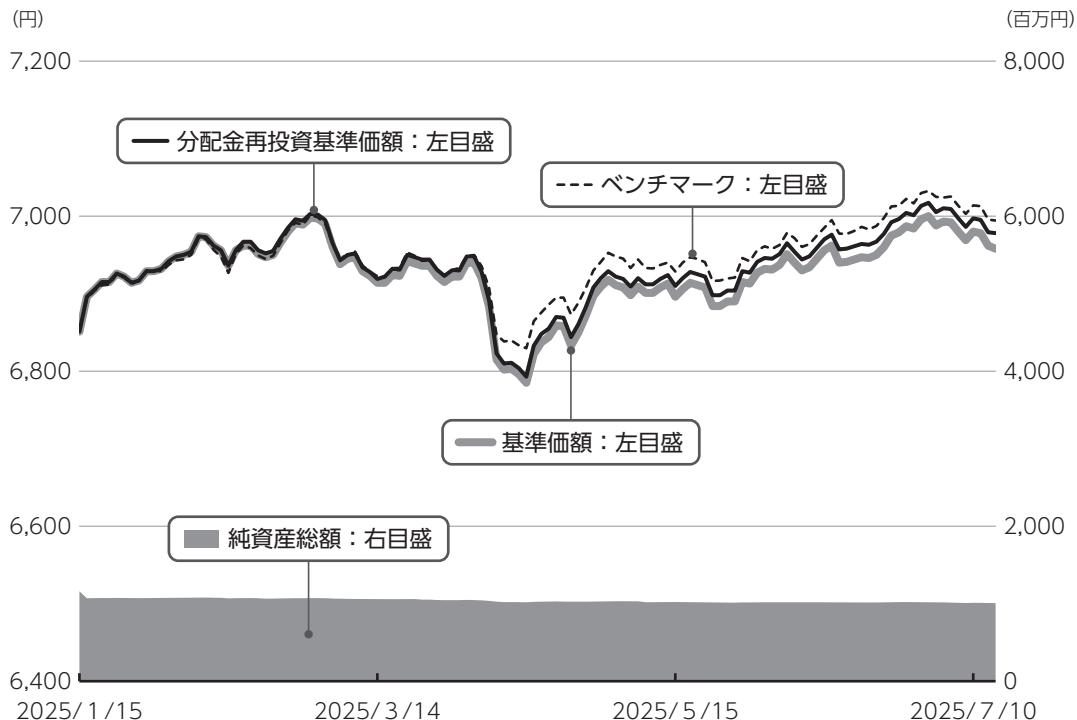
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

運用経過

第253期～第258期：2025年1月16日～2025年7月15日

〉当成期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第253期首	6,851円
第258期末	6,958円
既払分配金	20円
騰落率	1.9%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ1.9%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.1%）を0.2%下回りました。

》基準価額の主な変動要因

上昇要因

高利回り債券市況が上昇したこと、投資適格債券市況が上昇したこと等が基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

為替ヘッジコスト等が基準価額の下落要因となりました。

第253期～第258期：2025年1月16日～2025年7月15日

》投資環境について

▶ 高利回り債券市況

高利回り債券市況は上昇しました。

高利回り債券市況は、米トランプ政権による関税政策を背景に世界経済の悪化懸念が高まったこと等から一時下落しましたが、その後米中が互いに課した追加関税の大幅引き下げに合意したこと等を受けて投資家心理が改善したこと等から、期間を通じてみると上昇しました。

▶ 投資適格債券市況

投資適格債券市況は上昇しました。

米国の一連の経済指標の結果を受けてインフレの鈍化が確認されたことや、欧州中央銀行（ECB）が利下げを実施したこと等から、投資適格債券市況は上昇しました。

》当該投資信託のポートフォリオについて

▶ ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド（為替ヘッジ付き）

2本の円建外国投資信託への投資を通じて、日本を除く世界の高利回り債券と投資適格債券を概ね50%程度ずつ組み入れた運用を行いました。

なお、2025年6月末時点では、2本の円建外国投資信託を通じて投資した信用リスク管理上、政府機関の発行または保証する有価証券と同等と判断した銘柄の実質的な組入比率は、ファニーメイは10.2%、フレディ・マックは4.6%としました（ネットベース）。

▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイインカム ファンド JPYヘッジ

当期間では、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）水準が長期的な平均に比べ縮小しているなかで、インフレの再加速や地政学リスクの高まり等により投資家心理が悪化する場合には注視が必要であると見ておりました。一方で、高利回り債券を発行する企業の多くは2020年から2021年の低金利環境下で借り換えを行っており、十分な手元流動性を確保していることから、一部の脆弱な企業を除いてファンダメンタルズの健全性は維持されると見ておりました。

このような環境下、運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別

を行いました。

具体的には、コロナ禍後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空セクター等への投資を積極姿勢としました。一方、長期的な成長が見込みづらい固定通信や、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターへの投資を消極姿勢としました。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持し、為替変動リスクの低減を図りました。

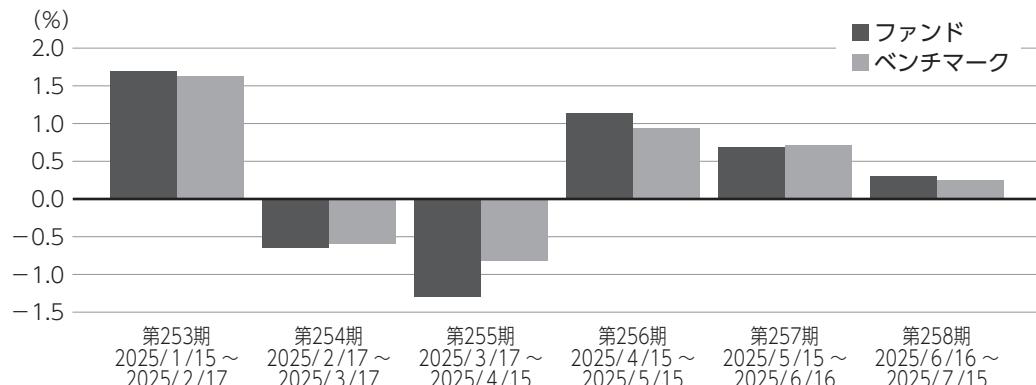
- ▶ **ピムコ ケイマン グローバル
アグリゲイト エクス・ジャパン
インカム ファンド JPYヘッジ**
- 当期間では、保護主義的な政策と財政支出の削減を背景に米国の景気が減速する一方、金融環境の緩和や財政政策の拡大を背景に米国以外の主要国では安定した経済成長が見込まれ、米国経済だけが強いこれまでの状況が変化するとみておりました。主要国のインフレ率は、金融危機後の平均を上回る水準で推移する可能性はあるものの、中央銀行の目標水準に近づいており、主要国では年内に追加利下げが実施されるとみておりました。このような環境下、金利戦略については、各国の金融政策の動向等を見極めながら、柔軟に調整しました。
- セクター戦略については、社債や資産担

保証券（ABS）のなかで、リスクを考慮しても魅力的と考えられる利回りを提供する銘柄に選択的に投資を行いました。外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持し、為替変動リスクの低減を図りました。

第253期～第258期：2025/1/16～2025/7/15

》当該投資信託のベンチマークとの差異について

基準価額（当ファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



※ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

▶ピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド（為替ヘッジ付き）

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（2.1%）を0.2%下回りました。

主な要因は以下の通りです。

外国投資信託保有以外の要因

信託報酬などの運用上の費用を計上したことなどがマイナス要因となりました。

外国投資信託保有による要因

**ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ
(プラス要因)**

通信セクターの銘柄選択効果がプラスに寄与したこと。

(マイナス要因)

運輸セクターの銘柄選択効果がマイナスに影響したこと。

**ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム
ファンド JPYヘッジ
(プラス要因)**

英国のデュレーション（平均回収期間や金利感応度）をオーバーウェイトとしたこと。

(マイナス要因)

日本の長期ゾーンのデュレーションをオーバーウェイトとしたこと。

》分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかつた利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項目	第253期 2025年1月16日～ 2025年2月17日	第254期 2025年2月18日～ 2025年3月17日	第255期 2025年3月18日～ 2025年4月15日	第256期 2025年4月16日～ 2025年5月15日	第257期 2025年5月16日～ 2025年6月16日	第258期 2025年6月17日～ 2025年7月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 (0.072%)	3 (0.043%)	3 (0.044%)	3 (0.043%)	3 (0.043%)	3 (0.043%)
当期の収益	5	—	—	3	3	3
当期の収益以外	—	3	3	—	—	—
翌期繰越分配対象額	354	351	348	351	354	355

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

(作成対象期間末での見解です。)

▶ ピムコ ハイ・インカム毎月分配型 ファンド（為替ヘッジ付き）

2本の円建外国投資信託への投資を通じて日本を除く世界の高利回り債券と投資適格債券を概ね50%程度ずつ組み入れた運用を維持し、毎月の安定した分配をめざす方針です。

▶ ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ

運用に関しては、リスクの取得には慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行う方針です。

具体的には、コロナ禍後の航空需要の回復の恩恵を受ける航空セクター等への投資を積極姿勢とします。一方、長期的な成長が見込みづらい固定通信や、Eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売等のセクターへの投資を消極姿勢とします。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持する方針です。

▶ ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ

金利戦略については、各国の金融政策の動向等を見極めながら、柔軟に調整する方針です。セクター戦略については、社債や資産担保証券（ABS）のなかで、リスクを考慮しても魅力的と考えられる利回りを提供する銘柄に選択的に投資を行う方針です。

外貨建て債券への投資に伴う為替変動リスクについては、為替予約取引を活用してほぼ100%ヘッジした状態を維持する方針です。

2025年1月16日～2025年7月15日

〉1万口当たりの費用明細

項目	第253期～第258期		項目の概要
	金額(円)	比率(%)	
(a)信託報酬	49	0.709	(a)信託報酬＝作成期中の平均基準価額×信託報酬率×(作成期中の日数÷年間日数)
(投信会社)	(28)	(0.409)	ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価
(販売会社)	(19)	(0.273)	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0.027)	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b)その他費用	0	0.002	(b)その他費用＝作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.002)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合計	49	0.711	

作成期中の平均基準価額は、6,927円です。

- (注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

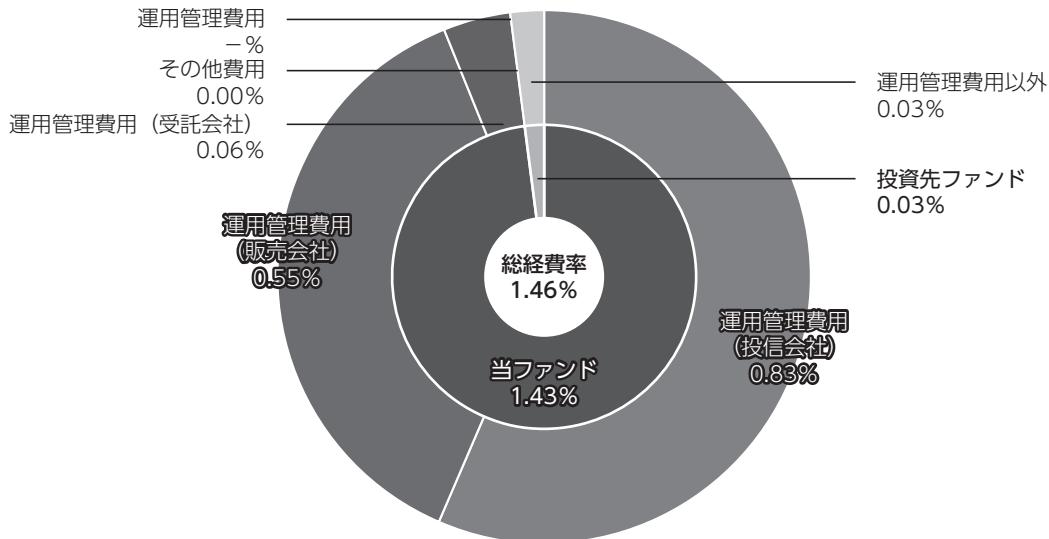
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は1.46%です。**



総経費率 (①+②+③)	(%)	1.46
①当ファンドの費用の比率	(%)	1.43
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	(%)	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	(%)	0.03

- (注) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- (注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
- (注) 各比率は、年率換算した値です。
- (注) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。
- (注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
- (注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。
- (注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。
- (注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、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。

○売買及び取引の状況

(2025年1月16日～2025年7月15日)

投資信託証券

銘柄	口数	第253期～第258期			
		買付		売付	
		金額	千円	金額	千円
国内 ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ	0.3283	2,950	千円	4	38,100
ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ	1	8,384	千円	5	38,100
合計	1	11,334	千円	9	76,200

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2025年1月16日～2025年7月15日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2025年7月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	口数	第252期末			第258期末	
		千円	口数	評価額	比率	%
ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ	56	52	千円	480,441	47.7	
ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ	81	76	千円	512,066	50.8	
合計	137	129	千円	992,508	98.4	

(注) 比率はピムコ ハイ・インカム毎月分配型ファンド（為替ヘッジ付き）の純資産総額に対する比率。

○投資信託財産の構成

(2025年7月15日現在)

項目	第258期末		
	評価額	比率	%
投資信託受益証券	992,508	992,508	98.3
コール・ローン等、その他	17,293	17,293	1.7
投資信託財産総額	1,009,801	1,009,801	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第253期末	第254期末	第255期末	第256期末	第257期末	第258期末
	2025年2月17日現在	2025年3月17日現在	2025年4月15日現在	2025年5月15日現在	2025年6月16日現在	2025年7月15日現在
(A) 資産	円	円	円	円	円	円
コール・ローン等	1,074,948,250	1,058,907,410	1,025,606,020	1,020,301,458	1,020,228,989	1,009,801,172
投資信託受益証券(評価額)	22,762,244	18,917,459	16,660,430	21,551,189	25,195,591	17,292,687
未収入金	1,052,185,718	1,039,989,711	1,003,745,379	998,749,996	995,033,079	992,508,265
未収利息	—	—	5,200,000	—	—	—
(B) 負債	2,642,279	1,631,961	1,653,899	1,663,982	5,633,429	1,629,392
未払収益分配金	770,061	458,784	450,280	443,162	438,595	434,670
未払解約金	475,750	—	13,922	9,840	3,914,609	36,781
未払信託報酬	1,391,983	1,169,410	1,185,873	1,207,089	1,276,114	1,154,221
その他未払費用	4,485	3,767	3,824	3,891	4,111	3,720
(C) 純資産総額(A-B)	1,072,305,971	1,057,275,449	1,023,952,121	1,018,637,476	1,014,595,560	1,008,171,780
元本	1,540,122,295	1,529,280,550	1,500,934,912	1,477,209,200	1,461,984,358	1,448,902,428
次期繰越損益金	△ 467,816,324	△ 472,005,101	△ 476,982,791	△ 458,571,724	△ 447,388,798	△ 440,730,648
(D) 受益権総口数	1,540,122,295口	1,529,280,550口	1,500,934,912口	1,477,209,200口	1,461,984,358口	1,448,902,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,962円	6,914円	6,822円	6,896円	6,940円	6,958円

○損益の状況

項目	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期	第258期
	2025年1月16日～ 2025年2月17日	2025年2月18日～ 2025年3月17日	2025年3月18日～ 2025年4月15日	2025年4月16日～ 2025年5月15日	2025年5月16日～ 2025年6月16日	2025年6月17日～ 2025年7月15日
(A) 配当等収益	円	円	円	円	円	円
受取配当金	905,018	972,726	956,838	1,016,253	935,536	694,865
受取利息	896,192	965,055	949,685	1,008,019	927,486	687,851
8,826	7,671	7,153	8,234	8,050	7,014	
(B) 有価証券売買損益	18,099,052	△ 6,846,679	△ 13,088,639	11,474,392	7,214,799	3,525,657
売買益	18,206,023	13,130	125,797	11,864,627	7,264,161	3,587,332
売買損	△ 106,971	△ 6,859,809	△ 13,214,436	△ 390,235	△ 49,362	△ 61,675
(C) 信託報酬等	△ 1,396,468	△ 1,173,177	△ 1,189,697	△ 1,210,980	△ 1,280,225	△ 1,157,941
(D) 当期損益金（A+B+C）	17,607,602	△ 7,047,130	△ 13,321,498	11,279,665	6,870,110	3,062,581
(E) 前期繰越損益金	△218,865,760	△200,364,455	△203,845,327	△214,052,992	△201,027,842	△192,541,901
(F) 追加信託差損益金	△265,788,105	△264,134,732	△259,365,686	△255,355,235	△252,792,471	△250,816,658
(配当等相当額)	(38,280,211)	(38,028,188)	(37,332,628)	(36,748,829)	(36,375,308)	(36,073,074)
(売買損益相当額)	(△304,068,316)	(△302,162,920)	(△296,698,314)	(△292,104,064)	(△289,167,779)	(△286,889,732)
(G) 計（D+E+F）	△467,046,263	△471,546,317	△476,532,511	△458,128,562	△446,950,203	△440,295,978
(H) 収益分配金	△ 770,061	△ 458,784	△ 450,280	△ 443,162	△ 438,595	△ 434,670
次期繰越損益金（G+H）	△467,816,324	△472,005,101	△476,982,791	△458,571,724	△447,388,798	△440,730,648
追加信託差損益金	△265,788,105	△264,134,732	△259,365,686	△255,355,235	△252,792,471	△250,816,658
(配当等相当額)	(38,280,211)	(38,028,188)	(37,332,628)	(36,748,829)	(36,375,308)	(36,073,074)
(売買損益相当額)	(△304,068,316)	(△302,162,920)	(△296,698,314)	(△292,104,064)	(△289,167,779)	(△286,889,732)
分配準備積立金	16,251,174	15,685,203	14,983,667	15,247,142	15,459,006	15,387,668
繰越損益金	△218,279,393	△223,555,572	△232,600,772	△218,463,631	△210,055,333	△205,301,658

(注) (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

①作成期首（前作成期末）元本額 1,693,229,865円

作成期中追加設定元本額 7,551,083円

作成期中一部解約元本額 251,878,520円

また、1口当たり純資産額は、作成期末0.6958円です。

②純資産総額が元本額を下回っており、その差額は440,730,648円です。

③分配金の計算過程

項目	2025年1月16日～ 2025年2月17日	2025年2月18日～ 2025年3月17日	2025年3月18日～ 2025年4月15日	2025年4月16日～ 2025年5月15日	2025年5月16日～ 2025年6月16日	2025年6月17日～ 2025年7月15日
費用控除後の配当等収益額	838,546円	－円	－円	917,679円	788,566円	504,268円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	－円	－円	－円	－円	－円	－円
収益調整金額	38,280,211円	38,028,188円	37,332,628円	36,748,829円	36,375,308円	36,073,074円
分配準備積立金額	16,182,689円	16,143,987円	15,433,947円	14,772,625円	15,109,035円	15,318,070円
当ファンドの分配対象収益額	55,301,446円	54,172,175円	52,766,575円	52,439,133円	52,272,909円	51,895,412円
1万口当たり収益分配対象額	359円	354円	351円	354円	357円	358円
1万口当たり分配金額	5円	3円	3円	3円	3円	3円
収益分配金金額	770,061円	458,784円	450,280円	443,162円	438,595円	434,670円

④信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用として、信託財産の純資産総額に対し年10,000分の50以内の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しております。

〇分配金のお知らせ

	第253期	第254期	第255期	第256期	第257期	第258期
1万口当たり分配金（税込み）	5円	3円	3円	3円	3円	3円

- 分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、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）」に分かれます。
- 分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- 元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

*三義UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

[お 知 ら せ]

①投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、記載変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

（2025年4月1日）

②2025年4月に使用開始の交付目論見書、請求目論見書記載の「代表的な資産クラスの騰落率の平均値」について誤りがございました。

誤記載の内容および訂正内容については、下記の通りです。

記

＜誤記載の箇所＞

交付目論見書、請求目論見書の「ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較」のグラフのうち、「新興国債」の騰落率の「平均値」（2020年2月末～2025年1月末）

＜訂正内容＞

正：6.7

誤：6.6

<参考>投資する投資信託証券およびその概要

ファンド名	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド JPYヘッジ	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド JPYヘッジ
運用方針	ベンチマークであるICE BofA 先進国ハイ・イールド・コンストレインド指数（BB-B、円ヘッジベース）を上回る投資成果をめざします。	ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く、新興国除く）インデックス（円ヘッジベース）を上回る投資成果をめざします。
主要運用対象	世界各国の社債等	世界各国の国債、政府機関債、社債、モーゲージ証券（MBS）、資産担保証券（ABS）等
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> 通常、ファンドの80%以上をBB-B格相当未満の格付けを取得している公社債に投資します。 投資する公社債は原則として取得時においてB格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。 投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてB格相当以上に維持します。 ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。 エマージング債への投資は行いません。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。 	<ul style="list-style-type: none"> 投資する公社債は原則として取得時においてBB-B格相当以上の格付けを取得しているものに限ります。 投資する公社債の平均格付けは、ポートフォリオ全体で原則としてAA格相当以上に維持します。 ポートフォリオの平均デュレーションは、原則としてベンチマーク±2年の範囲で調整します。 同一の発行体が発行する銘柄への投資比率は、取得時において純資産総額の3%以内とします（国債や政府機関債等を除きます。）。 エマージング債への投資は行いません。 原則として、円に対して為替ヘッジを行います。
決算日	原則として毎年2月28日	
分配方針	原則として毎月経費控除後の利子収益および売買益より分配を行う方針です。ただし、適正な分配水準を維持するために必要と認められる場合は、分配原資をこれらに限定しません。なお、分配原資が少額の場合は、分配を行わないことがあります。	

運用計算書、純資産変動計算書、投資有価証券明細表はPIMCO Cayman Trust Annual Report February 29, 2024版から抜粋して作成しています。なお、開示情報につきましては、アニュアルレポートがシェアクラス分けされていないため「ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド」と「ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド」で掲載しています。

(1) 運用計算書

(2023年3月1日～2024年2月29日)

	ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド
	千米ドル	千米ドル
投資収入 :		
受取利息（外国税額控除後＊）	25,956	7,158
雑収入	184	336
収入合計	26,140	7,494
費用 :		
支払利息	288	39
費用合計	288	39
投資純収入	25,852	7,455
実現純利益（損失）:		
投資有価証券	(15,437)	(7,073)
マスターファンド	0	0
為替取引、中央清算金融派生商品	2,192	(2,484)
店頭金融派生商品	(388)	5,231
外貨	(204)	(165)
実現純利益（損失）	(13,837)	(4,491)
未実現評価益（評価損）の純変動 :		
投資有価証券	37,263	5,733
マスターファンド	0	0
為替取引、中央清算金融派生商品	341	4,002
店頭金融派生商品	44	197
外貨建資産および負債の換算に係る外貨	72	(183)
未実現評価益（評価損）の純変動	37,720	9,749
純利益（損失）	23,883	5,258
運用による純資産の純増（減）額	49,735	12,713
* 外国税	18	0

(注) 現時点入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入しております。

(2) 純資産変動計算書

(2023年3月1日～2024年2月29日)

ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド	ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド
千米ドル	千米ドル

純資産の増加（減少）：**運用：**

投資純収入（費用）	25,852	7,455
実現純利益（損失）	(13,837)	(4,491)
未実現評価益（評価損）の純変動	37,720	9,749
運用による純資産の純増（減）額	49,735	12,713

分配：

JPY	(31,775)	(9,117)
JPY Hedged	(116)	(1)
分配金額合計	(31,891)	(9,118)

ファンデュニット取引：

ファンデュニット取引による純資産の純増（減）額	(29,229)	(8,131)
-------------------------	----------	---------

純資産の増（減）額合計

	(11,385)	(4,536)
--	----------	---------

純資産：

期首	423,089	219,731
期末	411,704	215,195

(注) 現時点で入手し得る直近の決算期分を掲載しています。

(注) 各項目ごとに千米ドル未満は四捨五入しております。

(3) 投資有価証券明細表 (the Schedule of Investments)

(A) ピムコ ケイマン グローバル ハイ インカム ファンド
(2024年2月29日現在)

額面金額 (単位: 千)		時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)		時価 (単位: 千)	
INVESTMENTS IN SECURITIES 101.5%							
AUSTRIA 0.5%				Parkland Corp.		GERMANY 5.1%	
Convertible Bonds & Notes 0.2%				4.625% due 05/01/2030	\$ 900	\$ 823	BANK LOAN OBLIGATIONS 0.8%
ams-OSRAM AG						19,027	
2.125% due 11/03/2027 (a)	EUR	900	\$ 725	Total Canada		29,014	
CORPORATE BONDS & NOTES 0.3%				(Cost \$20,432)			
ams-OSRAM AG							GERMANY 5.1%
10.500% due 03/30/2029		500	547				BANK LOAN OBLIGATIONS 0.8%
12.250% due 03/30/2029	\$	700	711	BK LC Lux SPV Sarl		6.905% due 04/28/2028	EUR 1,000 \$ 1,081
				CTEC III GmbH		7.452% due 03/16/2029	1,000 1,068
				Nidda Healthcare Holding GmbH		7.446% due 08/21/2026	1,000 1,077
				CORPORATE BONDS & NOTES 4.3%			3,226
				Bayer AG		7.000% due 09/25/2083	3,000 3,266
				Chephapharm Arzneimittel GmbH		3.500% due 02/11/2027	2,800 2,939
						7.500% due 05/15/2030	300 344
				CT Investment GmbH		5.500% due 04/15/2026	1,200 1,296
				Deutsche Bank AG		4.000% due 06/24/2032	900 929
						6.750% due 10/30/2028 (a)(b)	200 199
				IHO Verwaltungen GmbH (c)		3.750% due 09/15/2026	200 213
						8.750% due 05/15/2028	1,400 1,645
				Nidda Healthcare Holding GmbH		7.500% due 08/21/2026	3,243 3,637
				Schaeffler AG		3.375% due 10/12/2028	1,400 1,459
						4.500% due 08/14/2026	100 109
						4.750% due 08/14/2029	200 219
				TUI AG		5.875% due 03/15/2029	500 537
				ZF Finance GmbH		3.750% due 09/21/2028	800 831
				Total Germany		17,623	
				(Cost \$20,749)			
						20,849	
				GUERNSEY 0.3%			
				BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%			
				AI Silk Midco Ltd.		8.932% due 02/20/2031	1,200 1,265
				Total Guernsey		1,265	
				(Cost \$1,221)			
				IRELAND 0.0%			
				CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%			
				Jazz Securities DAC		4.375% due 01/15/2029	\$ 200 184
				Total Ireland		184	
				(Cost \$185)			
				ITALY 5.8%			
				CORPORATE BONDS & NOTES 5.8%			
				Banca Monte dei Paschi di Siena SpA		2.625% due 04/28/2025	EUR 2,200 2,326
						6.750% due 03/02/2026	900 992
				Cerved Group SpA		6.000% due 02/15/2029	900 890
				FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA		5.625% due 08/01/2027	900 942

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Inter Media & Communication SpA				Albion Financing 2 Sarl			Energizer Gamma Acquisition BV	
6.750% due 02/08/2027	EUR 1,000	\$ 1,057		8.750% due 04/15/2027	\$ 600	\$ 603	3.500% due 05/30/2029	EUR 800
Intesa Sanpaolo SpA				Altice Financing S.A.			GTCR W-2 Merger Sub LLC	
4.198% due 06/01/2032	\$ 2,450	2,011		2.250% due 01/15/2025	EUR 850	894	8.500% due 01/15/2031	GBP 200
7.700% due 09/17/2025 (alb)	500	496		3.000% due 01/15/2028	1,200	1,148	LeasePlan Corp. NV	
7.750% due 01/11/2027 (alb)	EUR 250	278		5.750% due 08/15/2029	\$ 550	474	7.375% due 05/29/2024 (alb)	EUR 1,000
Italmatch Chemicals SpA				Camelot Finance S.A.			OI European Group BV	
9.933% due 02/06/2028	800	869		4.500% due 11/01/2026	750	717	6.250% due 05/15/2028	200
10.000% due 02/06/2028	100	114		Cidron Aida Fincos Sarl			OP Park Holding I BV	
Mundys SpA				5.000% due 04/01/2028	EUR 2,600	2,732	3.500% due 02/01/2025	1,100
4.750% due 01/24/2029	1,600	1,749		6.250% due 04/01/2028	GBP 100	122	Sunrise HoldCo IV BV	
Nexi SpA				Cirsa Finance International Sarl			3.875% due 06/15/2029	600
1.625% due 04/30/2026	733	751		4.500% due 03/15/2027	EUR 2,400	2,543	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	
2.125% due 04/30/2029 (g)	4,000	3,838		6.500% due 03/15/2029	200	220	1.875% due 03/31/2027	200
Telecom Italia SpA				8.412% due 07/31/2028	150	166	4.375% due 05/09/2030	1,000
1.625% due 01/18/2028	1,200	1,122		CPI Property Group S.A.			7.375% due 09/15/2029	700
6.875% due 02/15/2028	2,900	3,337		1.750% due 01/14/2030	200	151	United Group BV	
7.875% due 07/31/2028	500	597		Cullinan Holden Sesp			3.125% due 02/15/2026	1,200
UniCredit SpA				6.425% due 10/15/2026	1,200	1,162	4.000% due 11/15/2027	1,000
5.375% due 04/16/2034	200	219		Ephios Subco 3 Sarl			Wintershall Dea Finance 2 BV	
5.459% due 06/30/2035	\$ 2,400	2,220		7.875% due 01/31/2031	700	809	2.499% due 04/20/2026 (b)	1,600
7.296% due 04/02/2034	200	204		Intelsat Jackson Holdings S.A.			ZF Europe Finance BV	
Total Italy	24,012			6.500% due 03/15/2030	\$ 1,050	979	6.125% due 03/13/2029	1,200
(Cost \$23,434)				Leare Investments Sarl			Ziggo BV	
JAPAN 0.1%				6.500% due 05/15/2029	EUR 2,300	2,492	4.875% due 01/15/2030	\$ 225
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%				Logicor Financing Sarl			Total Netherlands	18,995
Rakuten Group, Inc.				0.625% due 11/17/2025	2,300	2,332	(Cost \$18,452)	
11.250% due 02/15/2027	500	532		2.250% due 05/13/2025	1,900	2,004	NORWAY 0.1%	
Total Japan	532			Summer BC Holdco B SARL			CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%	
(Cost \$489)				5.750% due 10/31/2026	400	428	Variable Energi ASA	
JERSEY, CHANNEL ISLANDS 1.4%							7.862% due 11/15/2083	EUR 300
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%								342
Adient Global Holdings Ltd.				MULTINATIONAL 1.4%			Total Norway	342
7.000% due 04/15/2028	100	102		CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%			(Cost \$321)	
8.250% due 04/15/2031 (g)	500	527		American Airlines, Inc.			PANAMA 0.7%	
G City Europe Ltd.				5.500% due 04/20/2026	\$ 666	651	Carnival Corp.	
4.250% due 09/11/2025	EUR 300	306		5.750% due 04/20/2029	3,500	3,426	4.000% due 08/01/2028	\$ 3,200
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				Ardagh Packaging Finance PLC			Total Panama	2,954
3.250% due 11/12/2025 (g)	4,700	4,765		2.125% due 08/15/2026	EUR 700	685	(Cost \$3,098)	
Total Jersey, Channel Islands	5,700			4.125% due 08/15/2026	\$ 1,250	1,155	SPAIN 3.2%	
(Cost \$5,586)				Total Multinational	5,917		CORPORATE BONDS & NOTES 3.2%	
LIBERIA 1.3%				(Cost \$6,299)			Aedas Homes Opc O SL	
CORPORATE BONDS & NOTES 1.3%				NETHERLANDS 4.6%			4.000% due 08/15/2026	EUR 3,200
Royal Caribbean Cruises Ltd.				CORPORATE BONDS & NOTES 4.6%				3,398
5.500% due 08/31/2026	\$ 5,200	5,146		AerCap Holdings NV			Grifols S.A.	
Total Liberia	5,146			5.875% due 10/10/2079	1,250	1,239	3.200% due 05/01/2025	1,200
(Cost \$4,700)				Ashland Services BV			Grupo Antolin-Irausa S.A.	
LUXEMBOURG 5.1%				2.000% due 01/30/2028	EUR 1,700	1,684	3.375% due 04/30/2026	300
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.1%				Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV			3.500% due 04/30/2028	1,100
Albion Financing 3 Sarl				7.250% due 02/15/2031	\$ 1,400	1,454	Locra Telecom Bondco S.A.	
9.208% due 08/17/2026	550	595		Boels Topholding BV			4.000% due 09/18/2027	4,400
CORPORATE BONDS & NOTES 5.0%				6.250% due 02/15/2029	EUR 100	113	Via Celere Desarrollos Inmobiliarios S.A.	
Albion Financing 1 SARL				6.500% due 03/06/2029 (d)	200	218	5.250% due 04/01/2026	2,400
6.125% due 10/15/2026	400	396		Dufry One BV				2,565
				2.000% due 02/15/2027	2,600	2,627	Total Spain	13,106
				(Cost \$13,533)				

額面金額 (単位:千)		時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)		時価 (単位:千)							
SWEDEN 0.6%													
CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%													
Castellum AB													
3.125% due 12/02/2026 (b)	EUR	2,600	\$ 2,408										
Samhällsbyggnadsbolaget i Norden AB													
2.250% due 08/12/2027		300	221										
Total Sweden			2,629										
(Cost \$2,486)													
SWITZERLAND 0.0%													
CORPORATE BONDS & NOTES 0.0%													
UBS Group AG													
9.250% due 11/13/2028 (a)(b)	\$	100	107										
Total Switzerland			107										
(Cost \$100)													
UNITED KINGDOM 4.8%													
BANK LOAN OBLIGATIONS 0.3%													
BCP V Modular Services Holdings IV Ltd.													
8.350% due 12/15/2028		100	106										
Market Bidco Ltd.													
8.651% due 11/04/2027		1,000	1,059										
			1,165										
CORPORATE BONDS & NOTES 4.5%													
BCP V Modular Services Finance II PLC													
4.750% due 11/30/2028	EUR	1,300	1,333										
Bellis Acquisition Co. PLC													
3.250% due 02/16/2026	GBP	1,550	1,860										
Deutsche Fincos PLC													
5.500% due 06/15/2027		1,000	1,191										
Heathrow Finance PLC													
3.875% due 03/01/2027		400	478										
4.125% due 09/01/2029		1,000	1,187										
INEOS Finance PLC													
6.375% due 04/15/2029	EUR	400	433										
7.500% due 04/15/2029	\$	1,200	1,193										
INEOS Quattro Finance 2 PLC													
8.500% due 03/15/2029	EUR	200	227										
9.625% due 03/15/2029	\$	800	843										
Market Bidco Fincos PLC													
5.500% due 11/04/2027	GBP	400	462										
Marks & Spencer PLC													
3.750% due 05/19/2026		100	122										
Pinnacle Bidco PLC													
8.250% due 10/11/2028	EUR	1,200	1,362										
10.000% due 10/11/2028	GBP	800	1,065										
Thames Water Kemble Finance PLC													
4.625% due 05/19/2026		400	187										
Virgin Media Secured Finance PLC													
5.000% due 04/15/2027		1,000	1,235										
Vmed O2 UK Financing I PLC													
3.250% due 01/31/2031	EUR	1,800	1,736										
4.000% due 01/31/2029	GBP	1,700	1,871										
4.250% due 01/31/2031	\$	1,500	1,274										
Zenith Fincos PLC													
6.500% due 06/30/2027	GBP	400	399										
			18,458										
Total United Kingdom			19,623										
(Cost \$19,829)													
UNITED STATES 52.9%													
BANK LOAN OBLIGATIONS 1.7%													
BK LC Lux SPV Sarl													
8.827% due 04/28/2028		\$ 350	\$ 351										
Boost Newco Borrower LLC													
8.326% due 01/31/2031		300	301										
Caesars Entertainment, Inc.													
8.040% due 02/06/2031		1,900	1,901										
Carnival Corp.													
7.605% due 06/30/2025	EUR	965	1,048										
Cotiviti Holdings, Inc.													
7.750% due 02/21/2031		\$ 400	402										
8.571% due 02/21/2031		700	698										
DIRECTV Financing LLC													
10.830% due 08/02/2029		352	352										
Discovery Energy Corp.													
9.083% due 01/30/2031		400	393										
Embecta Corp.													
8.326% due 03/30/2029		81	74										
LifePoint Health, Inc.													
11.087% due 11/16/2028		200	200										
Mauser Packaging Solutions Holding Co.													
9.328% due 08/14/2026		99	100										
Polaris Newco LLC													
9.574% due 06/02/2028		98	96										
TransDigm, Inc.													
8.598% due 02/22/2027		566	568										
Triton Water Holdings, Inc.													
9.320% due 03/31/2028		100	99										
United Airlines, Inc.													
8.076% due 02/15/2031		400	400										
			6,983										
CORPORATE BONDS & NOTES 45.7%													
AAR Escrow Issuer LLC													
6.750% due 03/15/2029 (d)		300	303										
ADT Security Corp.													
4.125% due 08/01/2029		2,000	1,809										
Albertsons Cos., Inc.													
4.625% due 01/15/2027		400	386										
5.875% due 02/15/2028		600	592										
Allegiant Travel Co.													
7.250% due 08/15/2027		1,400	1,365										
Aliant Holdings Intermediate LLC													
7.000% due 01/15/2031		725	723										
Amer Sports Co.													
6.750% due 02/16/2031		325	324										
AmWINS Group, Inc.													
6.375% due 02/15/2029		825	826										
Antero Midstream Partners LP													
5.750% due 03/01/2027		700	685										
AT&T, Inc.													
2.875% due 03/02/2025 (b)	EUR	1,000	1,053										
Beacon Roofing Supply, Inc.													
6.500% due 08/01/2030		\$ 225	226										
Berry Global, Inc.													
4.500% due 02/15/2026		892	866										
Block, Inc.													
2.750% due 06/01/2026		900	841										
Blue Racer Midstream LLC													
7.625% due 12/15/2025		\$ 650	\$ 656										
Booz Allen Hamilton, Inc.													
4.000% due 07/01/2029		200	185										
Brandywine Operating Partnership LP													
7.800% due 03/15/2028		75	74										
Buckeye Partners LP													
4.500% due 03/01/2028		1,100	1,024										
Builders FirstSource, Inc.													
4.250% due 02/01/2032		575	506										
6.375% due 03/01/2034		125	125										
Burford Capital Global Finance LLC													
6.250% due 04/15/2028		400	385										
9.250% due 07/01/2031		825	867										
Cable One, Inc.													
4.000% due 11/15/2030		1,800	1,362										
Caesars Entertainment, Inc.													
6.500% due 02/15/2032		800	807										
Calpine Corp.													
3.750% due 03/01/2031		2,900	2,489										
4.625% due 02/01/2029		300	276										
Cantor Fitzgerald LP													
7.200% due 12/12/2028		300	308										
Capstone Borrower, Inc.													
8.000% due 06/15/2030		400	414										
Cargo Aircraft Management, Inc.													
4.750% due 02/01/2028		1,300	1,151										
Catalent Pharma Solutions, Inc.													
2.375% due 03/01/2028	EUR	1,850	1,928										
CCO Holdings LLC													
4.250% due 02/01/2031		\$ 1,500	1,208										
4.500% due 08/15/2030		2,000	1,661										
4.750% due 03/01/2030		800	681										
5.125% due 05/01/2027		900	852										
5.375% due 06/01/2029		1,000	905										
CD&R Smokey Buyer, Inc.													
6.750% due 07/15/2025		200	199										
Central Parent LLC													
8.000% due 06/15/2029		500	513										
Champions Financing, Inc.													
8.750% due 02/15/2029		100	102										
Chesapeake Energy Corp.													
5.500% due 02/01/2026		100	99										
5.875% due 02/01/2029		100	99										
6.750% due 04/15/2029		2,700	2,713										
Churchill Downs, Inc.													
6.750% due 05/01/2031		1,000	1,002										
Cinemark USA, Inc.													
8.000% due 06/15/2026		600	592										
CITGO Petroleum Corp.													
8.375% due 01/15/2029		575	604										
Civitas Resources, Inc.													
8.750% due 07/01/2031		325	346										
Clarivate Science Holdings Corp.													
3.875% due 07/01/2028		300	274										
Clearway Energy Operating LLC													
3.750% due 01/15/2032		600	503										
Cloud Software Group, Inc.													
6.500% due 03/31/2029		2,175	2,027										

額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 6.625% due 04/15/2029	\$ 200	\$ 199	Gray Television, Inc. 7.000% due 05/15/2027	\$ 100	\$ 91
CNX Resources Corp. 7.250% due 03/01/2032	325	324	Greystar Real Estate Partners LLC 7.750% due 09/01/2030	175	182
Coherent Corp. 5.000% due 12/15/2029	200	187	GTCR W-2 Merger Sub LLC 7.500% due 01/15/2031	700	731
Community Health Systems, Inc. 4.750% due 02/15/2031	1,000	762	GYP Holdings III Corp. 4.625% due 05/01/2029	400	373
5.625% due 03/15/2027	1,625	1,489	HAT Holdings I LLC 3.375% due 06/15/2026	650	609
6.000% due 01/15/2029	350	301	3.750% due 09/15/2030	700	577
8.000% due 03/15/2026	223	221	8.000% due 06/15/2027	2,025	2,105
Credit Acceptance Corp. 9.250% due 12/15/2028	225	238	HealthEquity, Inc. 4.500% due 10/01/2029	300	276
CSC Holdings LLC 11.750% due 01/31/2029	400	418	Hertz Corp. 4.625% due 12/01/2026	300	286
Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC 8.875% due 09/01/2031	250	261	Hilcorp Energy I LP 5.750% due 02/01/2029	175	169
DaVita, Inc. 3.750% due 02/15/2031	1,675	1,377	6.000% due 02/01/2031	100	97
Delek Logistics Partners LP 8.625% due 03/15/2029 (d)	200	200	6.250% due 11/01/2028	300	298
Directv Financing LLC 5.875% due 08/15/2027	900	850	6.250% due 04/15/2032	500	484
DISH DBS Corp. 5.250% due 12/01/2026	1,500	1,201	8.375% due 11/01/2033	275	296
5.750% due 12/01/2028	1,400	972	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC 5.000% due 06/01/2029	1,400	1,298
Embecta Corp. 5.000% due 02/15/2030 (g)	1,200	958	Howard Hughes Corp. 4.125% due 02/01/2029	600	533
EMRLD Borrower LP 6.625% due 12/15/2030	875	879	4.375% due 02/01/2031	540	461
EnLink Midstream LLC 6.500% due 09/01/2030	1,200	1,231	Howard Midstream Energy Partners LLC 8.875% due 07/15/2028	850	897
EQM Midstream Partners LP 4.500% due 01/15/2029	1,250	1,173	HUB International Ltd. 7.250% due 06/15/2030	600	612
4.750% due 01/15/2031	2,550	2,374	Hudson Pacific Properties LP 5.950% due 02/15/2028	100	90
6.500% due 07/01/2027	600	606	Icahn Enterprises LP 5.250% due 05/15/2027	100	92
6.500% due 07/15/2048	100	102	6.250% due 05/01/2026	500	488
Fiesta Purchaser, Inc. 7.875% due 03/01/2031	225	232	Imola Merger Corp. 4.750% due 05/15/2029	2,675	2,481
First Student Bideo, Inc. 4.000% due 07/31/2029	2,000	1,743	Jefferson Capital Holdings LLC 5.500% due 02/15/2029	300	303
Fortrea Holdings, Inc. 7.500% due 07/01/2030	200	205	Kinetik Holdings LP 6.625% due 12/15/2028	600	608
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6.500% due 10/01/2025	573	574	Kodiak Gas Services LLC 7.250% due 02/15/2029	300	306
Freedom Mortgage Corp. 12.000% due 10/01/2028	1,525	1,654	Kronos International, Inc. 3.750% due 09/15/2025	EUR 284	305
Frontier Communications Holdings LLC 6.000% due 01/15/2030	750	642	9.500% due 03/15/2029	1,713	1,962
Gap, Inc. 3.625% due 10/01/2029	1,700	1,438	LABL, Inc. 5.875% due 11/01/2028	\$ 1,725	1,548
3.875% due 10/01/2031	300	242	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.750% due 06/15/2029	2,700	2,427
Genesis Energy LP 7.750% due 02/01/2028	400	400	Las Vegas Sands Corp. 3.900% due 08/08/2029	3,000	2,715
GN Bondco LLC 9.500% due 10/15/2031	950	942	Legacy LifePoint Health LLC 4.375% due 02/15/2027	525	488
Graphic Packaging International LLC 3.750% due 02/01/2030	2,500	2,227	LFS Topco LLC 5.875% due 10/15/2026	100	93
			Life Time, Inc. 5.750% due 01/15/2026	25	25

	額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)		額面金額 (単位: 千)	時価 (単位: 千)
Olympus Water U.S. Holding Corp.			SCIL IV LLC			Venture Global Calcasieu Pass LLC		
3.875% due 01/01/2028	EUR 2,600	\$ 2,634	9.500% due 07/15/2028 (g)	EUR 325	\$ 383	3.875% due 08/15/2029	\$ 500	\$ 449
4.250% due 10/01/2028	\$ 350	314				3.875% due 11/01/2033	1,800	1,511
7.125% due 10/01/2027	400	398	6.125% due 02/01/2028	\$ 800	798	4.125% due 08/15/2031	350	307
OneMain Finance Corp.			Sirius XM Radio, Inc.			Venture Global LNG, Inc.		
3.500% due 01/15/2027	3,525	3,249	3.875% due 09/01/2031	225	186	8.125% due 06/01/2028	1,200	1,220
OrganoN & Co.			4.000% due 07/15/2028	1,000	902	8.375% due 06/01/2031	1,300	1,316
2.875% due 04/30/2028	EUR 4,200	4,220	5.000% due 08/01/2027	600	572	9.500% due 02/01/2029	500	533
5.125% due 04/30/2031 (g)	\$ 900	772	Southwestern Energy Co.			9.875% due 02/01/2032	350	369
Owens-Brockway Glass Container, Inc.			4.750% due 02/01/2032	200	182	Viavi Solutions, Inc.		
7.250% due 05/15/2031	450	457	5.375% due 02/01/2029	845	817	3.750% due 10/01/2029	275	239
Oxford Finance LLC			Spirit AeroSystems, Inc.			Vistra Operations Co. LLC		
6.375% due 02/01/2027	410	386	9.750% due 11/15/2030	1,425	1,528	7.750% due 10/15/2031	900	932
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC			Standard Industries, Inc.			Wand NewCo 3, Inc.		
4.375% due 10/15/2028	600	557	2.250% due 11/12/2026	EUR 1,900	1,927	7.625% due 01/30/2032	700	720
PBF Holding Co. LLC			4.375% due 07/15/2030	\$ 1,375	1,227	WESCO Distribution, Inc. (d)		
7.875% due 09/15/2030	100	103	Star Parent, Inc.			6.375% due 03/15/2029	600	601
PDC Energy, Inc.			9.000% due 10/01/2030	800	845	6.625% due 03/15/2032	550	551
5.750% due 05/15/2026	1,000	999	Starwood Property Trust, Inc.			Williams Scotsman, Inc.		
PennyMac Financial Services, Inc.			3.625% due 07/15/2026	250	233	7.375% due 10/01/2031	900	934
4.250% due 02/15/2029	2,600	2,347	Station Casinos LLC			Wynn Las Vegas LLC		
5.750% due 09/15/2031	900	828	4.625% due 12/01/2031	300	267	5.250% due 05/15/2027	1,000	980
Permian Resources Operating LLC			Tallgrass Energy Partners LP			Wynn Resorts Finance LLC		
7.000% due 01/15/2032	1,300	1,336	6.000% due 12/31/2030	800	745	7.125% due 02/15/2031	650	672
7.750% due 02/15/2026	50	51	7.375% due 02/15/2029	1,600	1,598	XPO, Inc.		
PetSmart, Inc.			Tapestry, Inc.			7.125% due 06/01/2031	400	409
4.750% due 02/15/2028	600	563	7.700% due 11/27/2030	625	663	ZF North America Capital, Inc.		
Post Holdings, Inc.			TEGNA, Inc.			6.875% due 04/14/2028	250	255
4.625% due 04/15/2030	2,400	2,186	5.000% due 09/15/2029	750	661	7.125% due 04/14/2030	250	261
PRA Group, Inc.			TerraForm Power Operating LLC			ZipRecruiter, Inc.		
7.375% due 09/01/2025	3,000	2,997	4.750% due 01/15/2030	500	453	5.000% due 01/15/2030	400	353
8.375% due 02/01/2028	850	831	TopBuild Corp.					188,371
Prime Healthcare Services, Inc.			4.125% due 02/15/2032	400	351	U.S. TREASURY OBLIGATIONS 5.5%		
7.250% due 11/01/2025	100	100	TransDigm, Inc.			U.S. Treasury Notes		
Prime Security Services Borrower LLC			4.625% due 01/15/2029	1,100	1,010	2.250% due 11/15/2024 (i)	23,000	22,534
3.375% due 08/31/2027	2,000	1,833	6.375% due 03/01/2029	400	402	Total United States		217,888
PTC, Inc.			6.625% due 03/01/2032	500	504	(Cost \$224,195)		
4.000% due 02/15/2028	300	280	7.125% due 12/01/2031	325	334	SHORT-TERM INSTRUMENTS 1.8%		
Raising Cane's Restaurants LLC			Travel + Leisure Co.			REPURCHASE AGREEMENTS (f) 1.5%		
9.375% due 05/01/2029	125	133	4.500% due 12/01/2029 (g)	2,750	2,521			6,100
Rand Parent LLC			TriNet Group, Inc.			TIME DEPOSITS 0.3%		
8.500% due 02/15/2030 (g)	1,500	1,459	7.125% due 08/15/2031	600	612	Bank of Nova Scotia		
Ranger Resources Corp.			9.000% due 03/15/2028	500	523	4.080% due 03/01/2024	CAD 1	0
4.750% due 02/15/2030	100	93	6.375% due 03/01/2026	1,375	1,246	4.830% due 03/01/2024	\$ 20	20
Resorts World Las Vegas LLC			U.S. Foods, Inc.			BNP Paribas Bank		
8.450% due 07/21/2030	300	320	4.625% due 06/01/2030	600	550	4.400% due 03/01/2024	GBP 3	4
Ritchie Bros Holdings, Inc.			4.750% due 02/15/2029	600	564	Brown Brothers Harriman & Co.		
7.750% due 03/15/2031	500	526	Uber Technologies, Inc.			(0.420%) due 03/01/2024	¥ 1	0
RLJ Lodging Trust LP			4.500% due 08/15/2029	4,575	4,292	0.520% due 03/01/2024	CHF 1	1
3.750% due 07/01/2026	300	283	UGI International LLC			4.400% due 03/01/2024	GBP 1	1
ROBLOX Corp.			2.500% due 12/01/2029	EUR 1,600	1,545	4.830% due 03/01/2024	\$ 2	2
3.875% due 05/01/2030	300	263	United Airlines, Inc.			Citibank N.A.		
Rockcliff Energy II LLC			6.875% due 02/01/2031	\$ 1,200	1,213	4.830% due 03/01/2024	98	98
5.500% due 10/15/2029	200	184	UKG, Inc.			DBS Bank Ltd.		
Rocket Mortgage LLC			6.875% due 02/01/2031	2,500	2,308	4.830% due 03/01/2024	51	51
3.625% due 03/01/2029	700	622	Univision Communications, Inc.			HSBC Bank PLC		
Sabre GLBL, Inc.			8.000% due 08/15/2028	1,675	1,685	3.070% due 03/01/2024	EUR 243	263
8.625% due 06/01/2027	1,685	1,485				4.400% due 03/01/2024	GBP 11	14

額面金額 時価 (単位:千) (単位:千)			
JPMorgan Chase Bank N.A.			
4.830% due 03/01/2024	\$ 58	\$ 58	
MUFG Bank Ltd.			
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 24	0	
Royal Bank of Canada			
3.070% due 03/01/2024	EUR 1	1	
Sumitomo Mitsui Banking Corp.			
10.420% due 03/01/2024	¥ 196	1	
3.070% due 03/01/2024	EUR 12	13	
4.400% due 03/01/2024	GBP 3	4	
4.830% due 03/01/2024	\$ 213	213	
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
10.420% due 03/01/2024	¥ 9	0	
3.070% due 03/01/2024	EUR 175	189	
4.400% due 03/01/2024	GBP 31	40	
4.830% due 03/01/2024	\$ 376	376	
		1,349	
Total Short-Term Instruments		7,449	
(Cost \$7,449)			
Total Investments in Securities 101.5%	\$ 417,865		
(Cost \$422,412)			
Financial Derivative Instruments (Nil) (0.0%)		(45)	
(Cost or Premiums, net \$ (15))			
Other Assets and Liabilities, net (1.5%)		(6,116)	
Net Assets 100.0%	\$ 411,704		

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Contingent convertible security.
- (b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (c) Payment in-kind security.
- (d) When-issued security.

(e) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Alice France S.A.	11.500%	02/01/2027	12/20/2023	\$ 2,344	\$ 2,426	0.59%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS**(f) REPURCHASE AGREEMENTS:**

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	担保受取価値	レポ価値	レポ契約の受取 ⁽¹⁾
SAL	5.330%	02/29/2024	03/01/2024	\$ 6,100	U.S. Treasury Notes 0.875% due 09/30/2026	\$ (6,249)	\$ 6,100	\$ 6,101
Total Repurchase Agreements						\$ (6,249)	\$ 6,100	\$ 6,101

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	借入金利 ⁽²⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽²⁾	リバースレポの支払
BOS	5.300%	02/02/2024	03/22/2024	\$ (1,899)	\$ (1,907)
BOS	5.100%	02/02/2024	03/22/2024	(589)	(592)
BOS	5.050%	02/02/2024	03/22/2024	(406)	(407)
BOS	4.750%	02/02/2024	03/22/2024	(1,159)	(1,163)

REVERSE REPURCHASE AGREEMENTS (Cont.):

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 の支払
BOS	4.750%	02/14/2024	03/06/2024	\$ (642)	\$ (643)
BRG	2.500%	09/22/2023	TBD ⁽³⁾	EUR (507)	\$ (555)
BRG	2.500%	01/11/2024	TBD ⁽³⁾	(436)	\$ (473)
JML	2.750%	08/24/2023	TBD ⁽³⁾	(598)	\$ (657)
JML	2.250%	11/14/2023	TBD ⁽³⁾	(179)	\$ (195)
JML	1.000%	03/01/2024	TBD ⁽³⁾	(275)	\$ (297)
MYI	2.750%	08/02/2023	TBD ⁽³⁾	(333)	\$ (366)
Total Reverse Repurchase Agreements				\$ (7,255)	

CERTAIN TRANSFERS ACCOUNTED FOR AS SECURED BORROWINGS

	オーバーナイト取引	満期までの残存期間			合計
		30日以内	31-90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
Non - U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (407)	\$ 0	\$ (1,880)	\$ (2,287)
U.S. Corporate Debt	0	(4,305)	0	(366)	(4,671)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ (2,246)	\$ (6,958)
Total Borrowings	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ (2,246)	\$ (6,958)
Payable for Reverse Repurchase Agreements⁽⁴⁾					\$ (6,958)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/received) as of February 29, 2024:

- (g) **Securities with an aggregate market value of \$8,390 have been pledged as collateral under the terms of the following master agreements as of February 29, 2024.**

取引相手	レボ契約 の受取	リバースレボ の支払	売付買戻 取引の支払	空売りの 支払	合計借入 その他金融取引	担保の (受取)/差入れ	ネットエクス ポージャー ⁽⁵⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BOS	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 0	\$ 0	\$ (4,712)	\$ 6,072	\$ 1,360
BRG	0	(1,028)	0	0	(1,028)	1,055	27
JML	0	(1,149)	0	0	(1,149)	698	(451)
MYI	0	(366)	0	0	(366)	383	17
SAL	6,101	0	0	0	6,101	(6,249)	(148)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 6,101	\$ (7,255)	\$ 0	\$ 0			

⁽³⁾ Includes accrued interest.

⁽⁴⁾ The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 29, 2024 was \$8,425 at a weighted average interest rate of 2.920%. Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

⁽⁵⁾ Open maturity repurchase agreement.

⁽⁶⁾ Unsettled reverse repurchase agreements liability of \$1297 is outstanding at period end.

⁽⁷⁾ Net exposure represents the net receivable/(payable) that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

(h) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益		変動評価金	
				資産	負債	資産	負債
Euro-Bobl 5-Year Note March Futures	Short	03/2024	86	\$ 261	\$ (261)	0	\$ (12)
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	06/2024	10	\$ (9)	0	0	\$ (9)
Euro-Bux 30-Year Bond March Futures	Short	03/2024	1	\$ (3)	0	0	\$ (2)
Euro-Schatz 2-Year Note June Futures	Short	06/2024	17	0	0	0	0
Euro-Schatz 2-Year Note March Futures	Short	03/2024	244	\$ 139	0	0	\$ (22)
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Long	06/2024	96	26	5	0	0
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Long	06/2024	53	14	15	0	0
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2024	28	10	4	0	0

FUTURES CONTRACTS (Cont.):

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価		変動証拠金	
				(損)益	資産	負債	
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note June Futures	Long	06/2024	11	\$ 8	\$ 3	\$ 0	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Long	06/2024	8	3	8	0	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2024	1	(1)	0	(1)	
Total Futures Contracts				\$ 448	\$ 35	\$ (46)	

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽ⁱ⁾

リファレンス・エンティティ	固定受取金利	満期日	2024年2月29日時点の インフラット・スプレッド ^(j)		想定元本 ^(k)	市場価格	未実現評価 (損)益		変動証拠金	
			スプレッド ^(j)	想定元本 ^(k)			資産	負債		
Cellnex Telecom S.A.	5.000%	12/20/2030	1.715%	EUR	3,600	\$ 796	\$ 229	\$ 19	\$ 0	0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	06/20/2028	2.255%		300	38	37	0	(1)	
Newell Brands, Inc.	1.000%	06/20/2028	0.000%	\$	300	(27)	17	0	0	
						\$ 807	\$ 283	\$ 19	\$ (1)	

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION^(l)

インデックス/トランシェ	固定受取金利	満期日	想定元本 ^(k)	市場価格 ^(m)	未実現評価 (損)益		変動証拠金	
					資産	負債		
CDX.HY-41 Index	5.000%	12/20/2028	\$ 7,425	\$ 545	\$ 93	\$ 12	\$ 0	0

INTEREST RATE SWAPS

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		
Receive ⁽ⁿ⁾	6-Month EURIBOR	3.500%	03/20/2026	EUR	900	\$ (6)	\$ (4)	\$ 0	\$ 0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/21/2025	\$	4,700	(119)	(110)	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.250%	12/20/2025		4,600	(40)	(52)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	06/21/2028		2,000	(92)	(77)	1	0
Pay ^(o)	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2052		500	(176)	(59)	3	0
	Sterling Overnight Interbank Average Rate	5.500%	03/20/2026	GBP	2,500	57	2	2	0
						\$ (378)	\$ (300)	\$ 7	\$ 0
Total Swap Agreements						\$ 974	\$ 76	\$ 38	\$ (1)

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 29, 2024:

- (i) **Securities with an aggregate market value of \$4,889 and cash of \$1,032 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 29, 2024. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.**

	金融派生商品資産				金融派生商品負債			
	市場価格	変動証拠金資産			市場価格	変動証拠金負債		
		買いオプション	先物	スワップ		売りオプション	先物	スワップ
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0 \$ 35 \$ 38 \$ 73				\$ 0 \$ (46) \$ (1) \$ (47)			

⁽ⁱ⁾ If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

^(j) Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

^(k) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

^(l) The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/ performance risk and represent the likelihood of an expected liability for profit for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/ sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

^(m) The instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

⑥ FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益			
				資産	4	\$	負債
BOA	03/2024	\$ 986	EUR 915	\$ 0	4	\$ 0	0
BPS	03/2024	EUR 929	\$ 995	0	0		(10)
BPS	03/2024	GBP 1,663	2,111	7	0		0
BPS	03/2024	\$ 3,581	EUR 3,303	0	0		(7)
BPS	03/2024	499	JPY 75,000	2	0		0
BPS	04/2024	2,111	GBP 1,663	0	0		(7)
CBK	03/2024	GBP 181	\$ 229	0	0		0
CBK	03/2024	\$ 316	EUR 294	2	0		0
DUB	03/2024	36,248	33,390	0	0		(115)
DUB	04/2024	EUR 33,390	\$ 36,292	115	0		0
MBC	03/2024	37,961	41,064	0	0		(16)
MBC	03/2024	\$ 3,801	CAD 5,102	0	0		(39)
MBC	03/2024	1,064	EUR 988	5	0		0
MBC	03/2024	3,540	GBP 2,790	0	0		(10)
MYI	03/2024	CAD 5,103	\$ 3,757	0	0		(5)
MYI	03/2024	\$ 267	JPY 40,000	0	0		0
MYI	04/2024	3,757	CAD 5,101	5	0		0
TOR	03/2024	GBP 459	\$ 585	3	0		0
UAG	03/2024	GBP 487	\$ 618	3	0		0
				\$ 146	\$ 0		(209)

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益			
				資産	4	\$	負債
BOA	03/2024	EUR 11	\$ 12	\$ 0	0	\$ 0	0
BOA	04/2024	\$ 30	EUR 28	0	0		0
BPS	03/2024	EUR 995	\$ 1,080	3	0		0
BPS	03/2024	GBP 117	148	1	0		0
BPS	03/2024	\$ 8	EUR 7	0	0		0
BPS	03/2024	148	GBP 117	0	0		(1)
BPS	04/2024	GBP 116	\$ 147	0	0		0
CBK	03/2024	1	1	0	0		0
CBK	03/2024	\$ 94	JPY 13,913	0	0		(1)
FAR	03/2024	1,085	EUR 999	0	0		(4)
FAR	03/2024	328	JPY 48,206	0	0		(6)
FAR	04/2024	EUR 999	\$ 1,086	4	0		0
GLM	03/2024	CAD 4	3	0	0		0
GLM	03/2024	\$ 1	GBP 1	0	0		0
MYI	03/2024	CAD 53	\$ 40	1	0		0
MYI	03/2024	JPY 231,597	1,537	0	0		(10)
MYI	03/2024	\$ 42	CAD 57	0	0		0
MYI	03/2024	22	EUR 20	0	0		0
MYI	03/2024	5	GBP 4	0	0		0
MYI	03/2024	1,425	JPY 209,602	0	0		(24)
MYI	04/2024	CAD 57	\$ 42	0	0		0
MYI	04/2024	\$ 1,507	JPY 226,048	10	0		0
RBC	03/2024	JPY 2,183	\$ 15	0	0		0
RBC	04/2024	\$ 15	JPY 2,173	0	0		0
SCX	03/2024	JPY 224,873	\$ 1,502	0	0		0
SCX	03/2024	\$ 1,418	JPY 206,329	0	0		(40)
SCX	04/2024	1,502	223,850	0	0		0
TOR	03/2024	JPY 228,066	\$ 1,506	0	0		(5)
TOR	03/2024	\$ 1,418	JPY 207,915	0	0		(28)
TOR	04/2024	1,506	225,033	5	0		0
				\$ 24	\$ 0		(119)
				\$ 170	\$ 0		(328)

Total Forward Foreign Currency Contracts

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽¹⁾

取引相手	リファレンス・エンティティ	2024年2月29日時点の インプライド・クレジット			想定元本 ⁽³⁾ 支払/ (受取)	未実現評価 (損) 益	スワップの価値	
		固定受取金利	満期日	スプレット ⁽²⁾			資産	負債
GST	EP Infrastructure A/S	5.000%	06/20/2028	2.294%	EUR 700	\$ (15)	\$ 102	\$ 87 \$ 0
Total Swap Agreements						\$ (15)	\$ 102	\$ 87 \$ 0

(B) ピムコ ケイマン グローバル アグリゲイト エクス・ジャパン インカム ファンド
(2024年2月29日現在)

額面金額 (単位:千)		時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)		時価 (単位:千)							
INVESTMENTS IN SECURITIES 115.0%													
AUSTRALIA 4.1%													
CORPORATE BONDS & NOTES 1.4%													
GAIF Bond Issuer Pty Ltd.				Bacardi Ltd.									
1.900% due 12/14/2028	AUD	1,300	\$ 726	4.700% due 05/15/2028	\$ 400	\$ 389							
Lendlease Finance Ltd.				Total Bermuda		389							
3.700% due 03/31/2031		500	269	(Cost \$395)									
Macquarie Bank Ltd.				CANADA 0.8%		FRANCE 1.8%							
6.798% due 01/18/2033 (a)	\$	400	422	CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%		CORPORATE BONDS & NOTES 0.6%							
Pacific National Finance Pty Ltd.				Province of Quebec									
4.750% due 03/22/2028		900	854	6.000% due 10/01/2029	CAD 1,000	812							
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd.				7.295% due 07/22/2026	\$ 900	944							
1.200% due 04/08/2024	AUD	500	325	Total Canada		1,756							
WSO Finance Pty Ltd.				(Cost \$2,129)									
4.500% due 03/31/2027		600	386	CAYMAN ISLANDS 1.4%		GERMANY 0.9%							
			2,982	ASSET-BACKED SECURITIES 0.5%		CORPORATE BONDS & NOTES 0.9%							
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 1.5%													
Bluestone Prime Trust				Gaci First Investment Co.									
5.044% due 06/21/2053		188	122	5.000% due 01/29/2029	800	789							
Bluestone Sapphire XXV				5.250% due 01/29/2034	400	393							
5.344% due 09/21/2053		220	143	Total Cayman Islands		2,909							
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4				(Cost \$2,912)									
5.025% due 09/24/2052		685	430	DENMARK 1.9%		IRELAND 2.9%							
5.098% due 02/19/2053		174	113	CORPORATE BONDS & NOTES 1.9%		ASSET-BACKED SECURITIES 2.4%							
La Trobe Financial Capital Markets Trust				Jyske Realkredit A/S									
5.095% due 01/14/2053		494	321	1.000% due 10/01/2050	DKK 130	14							
Liberty PRIME				1.500% due 10/01/2037	120	16							
4.995% due 01/25/2053		644	418	1.500% due 10/01/2053	575	66							
National RMBS Trust				2.000% due 10/01/2050	113	14							
5.568% due 12/20/2047		178	116	Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		ACQUISITION CLO I DAC							
Pepper I-Prime Trust				1.000% due 10/01/2050	172	19							
4.995% due 07/15/2053		257	167	1.500% due 10/01/2053	876	97							
Pepper Residential Securities Trust No.29				2.000% due 10/01/2050	248	30							
5.125% due 10/14/2062		225	146	Nykredit Realkredit A/S		ACQUISITION CLO II DAC							
Pepper Residential Securities Trust No.30				1.000% due 10/01/2050	50	6							
5.095% due 01/15/2063		262	170	1.000% due 10/01/2053	285	31							
RedZed Trust				1.500% due 10/01/2052	3,496	394							
5.105% due 06/09/2053		167	109	2.000% due 10/01/2047	980	119							
Resimac Bastille Trust				2.500% due 10/01/2047	34	5							
5.152% due 09/07/2052		122	80	4.000% due 10/01/2056	17,300	2,452							
RESIMAC Premier				5.000% due 10/01/2053	3,983	584							
4.972% due 02/13/2053		655	424	Realkredit Danmark A/S		ACQUISITION CLO III DAC							
5.602% due 02/07/2052		31	20	1.000% due 10/01/2050	4	0							
6.132% due 07/10/2052	\$	174	174	1.000% due 10/01/2053	94	10							
Westpac Securitisation Trust				1.500% due 10/01/2053	757	87							
5.046% due 07/22/2046	AUD	347	226	2.000% due 10/01/2053	99	11							
			3,179	2.500% due 04/01/2036	62	9							
SOVEREIGN ISSUES 1.2%				2.500% due 04/01/2047	16	2							
Australia Government Bond				5.000% due 01/01/2038	348	53							
0.250% due 11/21/2025		1,000	613	Total Denmark		4,019							
3.250% due 04/21/2029		1,800	1,143	(Cost \$4,291)									
South Australian Government Financing Authority				CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%		CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%							
1.750% due 05/24/2032		400	210	AerCap Ireland Capital DAC									
Treasury Corp. of Victoria				2.450% due 10/29/2026	\$ 500	461							
4.250% due 12/20/2032		1,100	693										
			2,659										
Total Australia													
(Cost \$10,447)			8,820										

額面金額 (単位:千)			時価 (単位:千)	
Perrigo Finance Unlimited Co.				
4.65% due 06/15/2030	\$ 600	\$ 538		
		999		
Total Ireland		6,200		
(Cost \$6,845)				
ISRAEL 0.1%				
SOVEREIGN ISSUES 0.1%				
Israel Government International Bond				
4.125% due 01/17/2048	200	157		
Total Israel		157		
(Cost \$204)				
ITALY 1.7%				
SOVEREIGN ISSUES 1.7%				
Cassa Depositi e Prestiti SpA				
5.750% due 05/05/2026	450	446		
Italy Buoni Poliennali del Tesoro				
2.800% due 03/01/2067	EUR 600	472		
4.350% due 11/01/2033	2,400	2,718		
Total Italy		3,638		
(Cost \$3,624)				
JAPAN 1.5%				
CORPORATE BONDS & NOTES 1.5%				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
2.952% due 01/19/2033	\$ 700	590		
3.195% due 07/18/2029	800	728		
Mizuho Financial Group, Inc.				
2.591% due 05/25/2031	500	426		
Nissan Motor Co. Ltd.				
3.201% due 09/17/2028	EUR 100	104		
4.810% due 09/17/2030	\$ 400	369		
Nomura Holdings, Inc.				
2.710% due 01/22/2029	300	265		
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
4.436% due 04/02/2024 (a)	700	699		
Total Japan		3,181		
(Cost \$3,453)				
NETHERLANDS 0.2%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%				
ING Groep NV				
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)	200	168		
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 0.1%				
Dutch Property Finance BV				
4.575% due 07/28/2058	EUR 196	212		
Total Netherlands		380		
(Cost \$428)				
NORWAY 0.7%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%				
SR-Boligkreditt A/S				
3.125% due 02/19/2032	1,000	1,080		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%				
Norway Government Bond				
1.750% due 03/13/2025	NOK 4,100	377		

額面金額 (単位:千)			時価 (単位:千)	
Total Norway			\$ 1,457	
(Cost \$1,577)				
QATAR 0.2%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%				
Qatar Energy				
3.125% due 07/12/2041	\$ 100	74		
3.300% due 07/12/2051	100	69		
		143		
SOVEREIGN ISSUES 0.1%				
Qatar Government International Bond				
4.400% due 04/16/2050	200	175		
Total Qatar		318		
(Cost \$431)				
SAUDI ARABIA 0.3%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%				
Saudi Arabian Oil Co.				
3.250% due 11/24/2050	200	133		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%				
Saudi Government International Bond				
4.625% due 10/04/2047	300	255		
4.875% due 07/18/2033	200	196		
		451		
Total Saudi Arabia		584		
(Cost \$754)				
SINGAPORE 0.4%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.2%				
DBS Bank Ltd.				
3.209% due 08/19/2026	EUR 500	539		
SOVEREIGN ISSUES 0.2%				
Singapore Government Bond				
2.250% due 08/01/2036	SGD 600	407		
Total Singapore		946		
(Cost \$955)				
SPAIN 1.8%				
SOVEREIGN ISSUES 1.8%				
Spain Government Bond				
1.450% due 10/31/2071	EUR 400	211		
3.250% due 04/30/2034	600	647		
3.450% due 07/30/2043	700	727		
3.450% due 07/30/2066	640	628		
5.250% due 04/06/2029	GBP 1,200	1,551		
Total Spain		3,764		
(Cost \$4,659)				
SWEDEN 0.1%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.1%				
Sveriges Säkerställda Obligationer AB				
2.000% due 06/17/2026	SEK 3,000	281		
Total Sweden		281		
(Cost \$344)				
SWITZERLAND 0.5%				
CORPORATE BONDS & NOTES 0.5%				
UBS Group AG				
3.869% due 01/12/2029	\$ 500	470		
4.194% due 04/01/2031	500	460		
4.932% due 01/16/2026	EUR 200	218		
Total Switzerland		1,148		
(Cost \$1,222)				
UNITED KINGDOM 7.0%				
CORPORATE BONDS & NOTES 1.8%				
Barclays PLC				
5.746% due 08/09/2033	\$ 500	496		
HSBC Holdings PLC				
5.710% due 03/04/2035 (c)	400	399		
Lloyds Banking Group PLC				
5.871% due 03/06/2029	800	808		
Nationwide Building Society				
3.960% due 07/18/2030	200	183		
6.557% due 10/18/2027	600	614		
NatWest Group PLC				
4.892% due 05/18/2029	600	585		
5.076% due 01/27/2030	800	782		
		3,867		
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 2.9%				
Canada Square Funding PLC				
6.164% due 06/17/2058	GBP 408	517		
Finsbury Square PLC				
6.021% due 12/16/2071		135	171	
Great Hall Mortgages No.1 PLC				
5.745% due 06/18/2039	\$ 5	5	5	
Holmes Master Issuer PLC				
0.000% due 10/15/2072	GBP 400	507		
Lanbrook Mortgage Transaction PLC				
5.871% due 07/20/2058		215	271	
Mansard Mortgages PLC				
5.990% due 12/15/2049		1,666	2,081	
Newgate Funding PLC				
4.525% due 12/15/2050	EUR 36	38		
Paragon Mortgages No.12 PLC				
5.789% due 11/15/2038	\$ 19	18		
Pierpoint BTI PLC				
6.021% due 12/22/2053	GBP 376	475		
Polaris PLC				
5.989% due 12/23/2058		178	225	
Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC				
5.490% due 06/12/2044		27	33	
Stratton Mortgage Funding PLC				
6.116% due 03/12/2052		229	290	
Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC				
6.365% due 10/20/2051		209	265	
Tower Bridge Funding PLC				
6.001% due 11/20/2063		170	215	
Trinity Square PLC				
6.071% due 07/15/2059		587	743	

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Twin Bridges PLC				CVS Health Corp.			Amortizing Residential Collateral Trust	
6.065% due 03/12/2055	GBP	268	\$ 340	5.875% due 06/01/2053	\$ 100	\$ 100	6.135% due 10/25/2031	\$ 2 \$ 2
				Energy Transfer LP			Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust	
				4.950% due 05/15/2028	300	296	5.515% due 05/25/2037	26 18
SOVEREIGN ISSUES 2.3%				5.150% due 03/15/2045	100	89	Banc of America Funding Trust	
United Kingdom Gilt				EPR Properties			5.724% due 02/20/2036	5 5
0.625% due 07/31/2035		1,150	989	4.500% due 06/01/2027	100	95	Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust	
1.125% due 01/31/2039		600	490	Equinix, Inc.			4.000% due 05/25/2034	16 13
3.250% due 01/22/2044		700	738	2.150% due 07/15/2030	300	249	5.562% due 05/25/2034	44 40
3.500% due 01/22/2045		1,320	1,437	3.000% due 07/15/2050	250	163	5.594% due 02/25/2034	4 4
3.750% due 01/29/2038		600	712	Essential Utilities, Inc.			5.664% due 10/25/2033	14 13
4.250% due 03/07/2036		250	317	3.351% due 04/15/2050	200	138	Bear Stearns Alternative-A Trust	
4.250% due 12/07/2040		220	272	Goldman Sachs Group, Inc.			4.267% due 08/25/2036	12 6
4.500% due 09/07/2034		100	131	3.615% due 03/15/2028	800	763	4.431% due 04/25/2035	4 3
				3.814% due 04/23/2029	600	567	4.537% due 11/25/2035	10 7
Total United Kingdom				HCA, Inc.			4.872% due 09/25/2035	429 250
(Cost \$17,996)				4.125% due 06/15/2029	700	659	Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust	
UNITED STATES 59.1%				JPMorgan Chase & Co.			5.011% due 01/26/2036	237 179
ASSET-BACKED SECURITIES 0.6%				2.522% due 04/22/2031	700	599	Citigroup Mortgage Loan Trust	
Navient Private Education Refi Loan Trust				2.580% due 04/22/2032	900	753	5.310% due 08/25/2035	3 3
2.120% due 01/15/2069		\$ 376	345	2.739% due 10/15/2030	350	307	5.495% due 07/25/2045	243 171
VMC Finance LLC				4.457% due 11/13/2031	EUR 350	394	7.780% due 10/25/2035	6 6
7.224% due 02/18/2039		1,000	976	Morgan Stanley			Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.	
				5.173% due 01/16/2030	\$ 800	795	5.937% due 09/25/2035	40 39
CORPORATE BONDS & NOTES 9.8%				3.950% due 03/25/2051	100	75	6.440% due 09/25/2035	2 1
AbbVie, Inc.				4.100% due 03/25/2061	200	147	Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust	
3.200% due 11/21/2029		600	549	Pacific Gas & Electric Co.			4.117% due 09/20/2036	118 101
3.850% due 06/15/2024		200	199	3.500% due 08/01/2050	400	270	4.711% due 11/25/2034	69 62
American Airlines 2019-1 Class AA Pass-Through Trust				3.750% due 08/15/2042	600	439	5.895% due 05/25/2035	318 270
3.150% due 02/15/2032		626	557	Sabine Pass Liquefaction LLC			6.015% due 04/25/2035	14 12
American Tower Corp.				4.500% due 05/15/2030	300	287	6.075% due 03/25/2035	7 7
4.000% due 06/01/2025		200	196	5.000% due 03/15/2027	700	695	6.095% due 02/25/2035	45 41
AT&T, Inc.				5.750% due 05/15/2024	223	223	6.195% due 09/25/2034	15 13
3.550% due 09/15/2055		608	415	Southern California Edison Co.			CS First Boston Mortgage Securities Corp.	
Bank of America Corp.				3.600% due 02/01/2045	300	222	6.500% due 04/25/2033	1 1
3.419% due 12/20/2028		1,158	1,082	Starbucks Corp.			CS First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates	
3.974% due 02/07/2030		1,000	940	3.500% due 11/15/2050	300	220	4.739% due 07/25/2033	1 1
BAT Capital Corp.				Stryker Corp.			First Horizon Mortgage Pass-Through Trust	
4.540% due 08/15/2047		200	150	1.950% due 06/15/2030	800	670	5.463% due 08/25/2035	26 18
Black Hills Corp.				T-Mobile USA, Inc.			First NLC Trust	
2.500% due 06/15/2030		600	500	2.550% due 02/15/2031	300	253	5.505% due 08/25/2037	70 36
Boeing Co.				3.600% due 11/15/2060	200	139	Freddie Mac Multifamily Structured Pass-Through Certificates	
3.625% due 02/01/2031		300	269	5.150% due 04/15/2034	400	394	3.600% due 01/25/2029	900 854
Broadcom, Inc.				VMware LLC			Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates	
2.450% due 02/15/2031		320	267	4.700% due 05/15/2030	200	193	5.716% due 09/25/2031	71 72
4.300% due 11/15/2032		300	278	Wells Fargo & Co.			6.281% due 10/25/2044	161 146
Charter Communications Operating LLC				3.526% due 03/24/2028	700	664	6.281% due 02/25/2045	150 139
3.850% due 04/01/2061		150	87	4.150% due 01/24/2029	1,000	958	GreenPoint Mortgage Funding Trust	
3.900% due 06/01/2052		180	113	4.478% due 04/04/2031	600	571	5.795% due 01/25/2037	205 179
3.950% due 06/30/2062		200	118	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.			Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates	
4.400% due 12/01/2061		100	64	3.200% due 06/15/2025	500	485	5.921% due 10/25/2033	3 2
Citigroup, Inc.							GSR Mortgage Loan Trust	
3.785% due 03/17/2033 (gl)		400	354				5.076% due 09/25/2035	45 42
4.658% due 05/24/2028		1,200	1,179				6.780% due 03/25/2033	6 6
Comcast Corp.				Adjustable Rate Mortgage Trust			HarborView Mortgage Loan Trust	
2.937% due 11/01/2056		294	181	4.816% due 09/25/2035	25	21	4.238% due 07/19/2035	24 17
Crown Castle, Inc.				Alternative Loan Trust			5.914% due 03/19/2036	18 16
2.250% due 01/15/2031		600	491	5.835% due 06/25/2037	11	9		
3.700% due 06/15/2026		200	193	5.681% due 11/25/2035	76	64		
				7.121% due 11/25/2035	76	65		
MORTGAGE-BACKED SECURITIES 4.7%								

額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Home Equity Asset Trust				Thornburg Mortgage Securities Trust	
6.035% due 11/25/2032	\$ 1 \$ 1			5.466% due 10/25/2043	\$ 74 \$ 65
IndyMac INDEX Mortgage Loan Trust				WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust	
4.693% due 12/25/2034	23	21		4.376% due 02/27/2034	3 3
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				4.390% due 12/25/2046	856 710
2.812% due 01/16/2037	600	515		4.830% due 06/25/2033	17 16
JP Morgan Mortgage Trust				5.238% due 08/25/2034	115 108
4.785% due 11/25/2033	25	23		5.676% due 03/25/2034	65 63
JPMCC Commercial Mortgage Securities Trust				6.015% due 10/25/2045	97 93
3.723% due 03/15/2050	1,000	940		6.055% due 01/25/2045	32 31
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust				6.281% due 11/25/2042	95 86
3.694% due 03/15/2050	1,000	935		6.481% due 06/25/2042	2 1
Long Beach Mortgage Loan Trust				6.481% due 08/25/2042	31 29
5.995% due 10/25/2034	407	389			10,169
Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust					MUNICIPAL BONDS & NOTES 0.6%
5.872% due 12/15/2030	15	14			Macoupin, Illinois, Pasadena Public Financing Authority Revenue Bonds, Series 2010
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				7.148% due 03/01/2043	1,140 1,349
5.595% due 09/25/2037	29	6			U.S. GOVERNMENT AGENCIES 33.8%
5.675% due 02/25/2037	9	3			Fannie Mae
5.857% due 02/25/2033	24	21		2.500% due 02/01/2043	1,264 1,077
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				2.500% due 01/01/2051	87 71
3.102% due 11/15/2049	500	465		2.500% due 09/01/2051	606 499
Morgan Stanley Capital I Trust				2.500% due 10/01/2051	200 165
3.530% due 06/15/2050	400	374		2.500% due 04/01/2052	1,895 1,560
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				2.500% due 07/01/2053	91 75
5.485% due 11/25/2036	22	7		3.000% due 02/01/2046	57 50
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust				3.000% due 10/01/2046	611 537
4.610% due 10/25/2035	144	111		3.000% due 01/01/2052	4,720 4,046
Reperforming Loan REMIC Trust				3.500% due 04/01/2048	1,146 1,039
5.775% due 06/25/2035	41	38		3.500% due 06/01/2048	831 753
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				3.500% due 02/01/2050	425 384
5.795% due 06/25/2046	99	23		4.000% due 01/01/2041	2 2
5.855% due 04/25/2046	1,439	394		4.000% due 10/01/2041	57 54
Residential Asset Mortgage Products Trust				4.000% due 03/01/2048	916 863
8.500% due 10/25/2031	107	106		4.000% due 08/01/2048	47 45
Residential Funding Mortgage Securities I Trust				4.000% due 09/01/2048	569 533
5.121% due 09/25/2035	99	64		4.000% due 10/01/2048	348 326
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				4.000% due 04/01/2049	172 160
5.565% due 05/25/2037	37	27		4.000% due 10/01/2052	1,955 1,800
Sequoia Mortgage Trust				4.000% due 04/01/2053	297 274
6.134% due 10/19/2026	9	8		5.000% due 05/01/2053	993 964
Soundview Home Loan Trust				5.000% due 07/01/2053	983 955
5.555% due 11/25/2036	33	10		5.038% due 10/01/2035	7 7
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				5.221% due 05/25/2035	15 15
6.717% due 04/25/2034	11	11		5.347% due 07/25/2037	3 3
6.912% due 02/25/2034	28	26		5.414% due 03/25/2036	2 2
Structured Asset Mortgage Investments II Trust				5.579% due 03/25/2034	4 4
5.815% due 06/25/2036	37	36		5.620% due 12/01/2034	14 14
5.875% due 05/25/2036	1,187	924		5.738% due 01/01/2036	8 8
5.875% due 09/25/2047	24	20		5.786% due 09/25/2042	6 6
5.895% due 05/25/2045	78	69		5.786% due 03/25/2044	13 13
5.934% due 07/19/2035	295	285		5.836% due 06/25/2039	3 3
6.014% due 07/19/2034	1	1		6.000% due 04/25/2043	41 41
6.094% due 10/19/2034	105	97		6.000% due 02/25/2044	33 33
6.134% due 03/19/2034	4	4		6.000% due 11/01/2053	10,707 10,758
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust				6.029% due 07/01/2035	7 7
6.943% due 04/25/2035	43	42		6.030% due 11/01/2035	6 6
				6.258% due 07/01/2044	87 86
				6.386% due 11/01/2034	80 83
				6.500% due 06/25/2044	31 31
				6.500% due 12/01/2053	2,819 2,870
					Fannie Mae, TBA (c)
				3.500% due 04/01/2054	\$ 2,600 \$ 2,315
				4.000% due 04/01/2054	4,000 3,682
				4.500% due 04/01/2054	13,200 12,500
				5.000% due 05/01/2042	1,900 1,843
				5.500% due 03/01/2054	12,900 12,762
				Freddie Mac	
				2.500% due 09/01/2050	64 52
				2.500% due 01/01/2052	617 507
				3.000% due 10/01/2052	488 417
				4.000% due 09/01/2039	52 50
				4.000% due 09/01/2048	150 141
				4.000% due 12/01/2048	191 179
				4.000% due 12/01/2051	602 556
				4.000% due 06/01/2052	32 29
				4.000% due 09/01/2052	24 22
				5.000% due 04/01/2053	967 939
				5.000% due 07/01/2053	972 944
				5.000% due 09/01/2053	1,093 1,063
				5.560% due 06/01/2035	12 12
				5.981% due 08/01/2035	9 9
				6.000% due 04/15/2036	12 12
				6.000% due 02/01/2053	489 492
				6.000% due 11/01/2053	1,941 1,950
				6.021% due 09/01/2035	2 2
				6.350% due 01/01/2034	19 20
				Ginnie Mae	
				3.000% due 11/20/2046	359 319
				3.000% due 04/20/2047	80 71
				3.500% due 12/20/2047	1,102 1,009
				3.750% due 11/20/2030	2 2
				5.500% due 08/20/2035	536 542
				Small Business Administration	
				4.625% due 02/01/2025	2 2
				4.760% due 09/01/2025	29 28
				5.090% due 10/01/2025	9 9
					72,706
				U.S. TREASURY OBLIGATIONS 9.6%	
				Treasury Inflation Protected Securities (d)	
				0.375% due 07/15/2027 (j)	1,003 954
				0.625% due 07/15/2032	633 573
				1.000% due 02/15/2049	244 192
				1.125% due 01/15/2033	1,545 1,446
				1.625% due 10/15/2027 (j)	4,246 4,209
				U.S. Treasury Bonds	
				1.625% due 11/15/2050	3,050 1,714
				1.875% due 02/15/2041	5,900 4,068
				2.000% due 11/15/2041	4,300 2,978
				2.500% due 02/15/2045	2,600 1,886
				2.875% due 08/15/2045	1,600 1,236
				3.125% due 08/15/2044	400 325
				4.375% due 05/15/2041	1,100 1,089
					20,670
				Total United States	
				(Cost \$140,092)	127,269
				SHORT-TERM INSTRUMENTS 27.2%	
				COMMERCIAL PAPER 2.8%	
				Alimentation Couche-Tard, Inc.	
				5.534% due 03/08/2024 (e)	600 599
				American Electric Power Co., Inc.	
				5.579% due 03/21/2024 (e)	400 399
				Campbell Soup Co.	
				5.621% due 03/25/2024 (e)	400 399

	額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)		額面金額 (単位:千)	時価 (単位:千)
Constellation Brands, Inc.				JPMorgan Chase Bank N.A.	
5.589% due 03/04/2024 (e)	\$ 250	\$ 250		4.830% due 03/01/2024	\$ 20 \$ 20
Constellation Energy Generation LLC				MUFG Bank Ltd.	
5.548% due 03/12/2024 (e)	700	699		(0.420%) due 03/01/2024	¥ 1,810 12
CVS Health Corp.				Sumitomo Mitsui Banking Corp.	
5.629% due 04/01/2024 (e)	400	398		(0.420%) due 03/01/2024	14,778 99
Dominion Energy, Inc.				4.400% due 03/01/2024	GBP 6 7
5.545% due 03/08/2024 (e)	300	300		4.830% due 03/01/2024	\$ 73 73
Entergy Corp.				Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.	
5.640% due 03/08/2024 (e)	600	599		(0.420%) due 03/01/2024	¥ 686 5
Equifax, Inc.				4.400% due 03/01/2024	GBP 53 67
5.574% due 03/11/2024 (e)	300	299		4.830% due 03/01/2024	\$ 128 128
Intercontinental Exchange, Inc.					1,136
5.547% due 03/05/2024 (e)	400	400		JAPAN TREASURY BILLS 13.3%	
Keurig Dr Pepper, Inc.				(0.245%) due 03/04/2024 (e)	¥ 1,130,000 7,550
5.656% due 03/28/2024 (e)	600	597		(0.228%) due 04/15/2024 (e)	1,580,000 10,558
L3Harris Technologies, Inc. (e)				(0.203%) due 04/22/2024 (f)	1,580,000 10,558
5.621% due 03/11/2024	300	299			28,666
5.679% due 03/25/2024	300	299			
VW Credit, Inc.				Total Short-Term Instruments	58,640
5.578% due 03/06/2024 (e)	500	500		(Cost \$59,124)	
		6,037		Total Investments in Securities 115.0%	\$ 247,372
				(Cost \$269,675)	
REPURCHASE AGREEMENTS (h) 10.3%				Financial Derivative	
		22,100		 Instruments (i)(k) 0.3%	647
				(Cost or Premiums, net \$(16))	
SHORT-TERM NOTES 0.3%				Other Assets and Liabilities, net (15.3%)	(32,824)
Toyota Motor Credit Corp.				Net Assets 100.0%	\$ 215,195
5.905% due 08/22/2024 (e)	700	701			
TIME DEPOSITS 0.5%					
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.					
3.350% due 03/01/2024	AUD 128	83			
Bank of Nova Scotia					
4.080% due 03/01/2024	CAD 355	262			
4.830% due 03/01/2024	\$ 7	7			
BNP Paribas Bank					
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 1	0			
2.810% due 03/01/2024	SGD 57	42			
3.250% due 03/01/2024	HKD 305	39			
3.350% due 03/01/2024	AUD 82	53			
3.500% due 03/01/2024	NZD 24	15			
4.400% due 03/01/2024	GBP 5	6			
Brown Brothers Harriman & Co.					
(0.420%) due 03/01/2024	¥ 43	0			
0.520% due 03/01/2024	CHF 9	10			
3.570% due 03/01/2024	NOK 495	47			
4.400% due 03/01/2024	GBP 1	1			
4.830% due 03/01/2024	\$ 1	1			
Citibank N.A.					
4.830% due 03/01/2024	33	33			
DBS Bank Ltd.					
4.830% due 03/01/2024	17	17			
DnB Bank ASA					
2.950% due 03/01/2024	SEK 279	27			
3.350% due 03/01/2024	AUD 59	39			
HSBC Bank					
2.810% due 03/01/2024	SGD 23	17			
3.250% due 03/01/2024	HKD 20	3			
HSBC Bank PLC					
4.400% due 03/01/2024	GBP 18	23			

NOTES TO SCHEDULE OF INVESTMENTS:

- * A zero balance may reflect actual amounts rounding to less than one thousand.
- (a) Contingent convertible security.
- (b) Perpetual maturity; date shown, if applicable, represents next contractual call date.
- (c) When-issued security.
- (d) Principal amount of security is adjusted for inflation.
- (e) Coupon represents a yield to maturity.
- (f) Coupon represents a weighted average yield to maturity.

(g) RESTRICTED SECURITIES:

銘柄	クーポン	満期日	取得日	コスト	市場価格	対純資産比率
Citigroup, Inc.	3.785%	03/17/2033	03/17/2022	\$ 405	\$ 354	0.16%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	09/01/2021	446	414	0.19%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	09/01/2021	111	75	0.04%
Oracle Corp.	4.100%	03/25/2051	04/15/2021	212	147	0.07%
Total Restricted Securities				\$ 1,174	\$ 990	0.46%

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS

(h) REPURCHASE AGREEMENTS:

取引相手	貸出金利	決済日	満期日	額面金額	担保	担保受取価値		レポ価値	レポ契約の受取 ⁽¹⁾
						担保受取価値	レポ価値		
SAL	5.300%	02/29/2024	03/01/2024	\$ 600	U.S. Treasury Notes 0.750% due 04/30/2026	\$ (614)	\$ 600	\$ 600	\$ 600
SAL	5.330%	02/29/2024	03/01/2024	21,500	U.S. Treasury Notes 5.000% due 09/30/2025	(22,394)	21,500		21,503
Total Repurchase Agreements						\$ (23,008)	\$ 22,100	\$ 22,103	

SHORT SALES:

取引相手	銘柄	クーポン	満期日	額面金額	収益	ショートによる支払
JPS	Fannie Mae, TBA	3.000%	04/01/2054	\$ 1,900	\$ (1,640)	\$ (1,627)
MSC	Fannie Mae, TBA	3.000%	04/01/2054	1,900	(1,619)	(1,627)
SAL	Fannie Mae, TBA	2.000%	04/01/2054	7,000	(5,451)	(5,510)
Total Short Sales (4.1%)					\$ (8,710)	\$ (8,764)

BORROWINGS AND OTHER FINANCING TRANSACTIONS SUMMARY

The following is a summary by counterparty of the market value of Borrowings and Other Financing Transactions and collateral pledged/received as of February 29, 2024:

取引相手	レポ契約の受取	リバースレポの支払	売買戻取引の支払	空売りの支払	合計借入	担保の(受取)/差入れ	ネットエクスposure ⁽²⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
SAL	\$ 22,103	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 22,103	\$ (23,008)	\$ (905)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
JPS	0	0	0	(1,627)	(1,627)	0	(1,627)
MSC	0	0	0	(1,627)	(1,627)	0	(1,627)
SAL	0	0	0	(5,510)	(5,510)	0	(5,510)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 22,103	\$ 0	\$ 0	\$ (8,764)			

⁽¹⁾ Includes accrued interest.

⁽²⁾ Net exposure represents the net receivable/payable that would be due from/to the counterparty in the event of default. Exposure from borrowings and other financing transactions can only be netted across transactions governed under the same master agreement with the same legal entity. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.

The average amount of borrowings outstanding during the period ended February 29, 2024 was \$30 at a weighted average interest rate of (2.962%). Average borrowings may include sale-buyback transactions and reverse repurchase agreements, if held during the period.

(i) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED

FUTURES CONTRACTS:

銘柄	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
3-Month EURIBOR Interest Rate March Futures	Long	03/2024	82	\$ (18)	\$ 0	\$ 0
3-Month EURIBOR Interest Rate March Futures	Long	03/2025	82	(85)	0	0
3-Month EURIBOR Interest Rate September Futures	Short	09/2024	164	151	0	(4)
3-Month SOFR December Futures	Short	03/2025	112	144	0	(3)
3-Month SOFR June Futures	Long	09/2024	28	(26)	1	0
3-Month SOFR June Futures	Long	09/2025	28	(33)	1	0
3-Month SOFR March Futures	Long	06/2024	71	(31)	1	0
3-Month SOFR March Futures	Short	06/2025	120	38	0	(5)
3-Month SOFR September Futures	Long	12/2024	17	(5)	0	0
3-Month SOFR September Futures	Long	12/2025	88	(42)	3	0
Australia Government 3-Year Bond March Futures	Short	03/2024	68	(8)	0	(3)
Australia Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	53	(17)	2	0
Canada Government 10-Year Bond June Futures	Long	06/2024	66	9	9	0
Euro-Bobl 5-Year Note March Futures	Long	03/2024	19	(26)	3	0
Euro-BTP 10-Year Bond March Futures	Long	03/2024	23	13	9	0
Euro-Bund 10-Year Bond June Futures	Short	06/2024	6	(5)	0	(5)
Euro-OAT 10-Year Bond June Futures	Short	06/2024	3	(1)	0	(2)
Euro-Schatz 2-Year Note March Futures	Short	03/2024	77	57	0	(2)
Japan Government 10-Year Bond March Futures	Short	03/2024	10	21	14	0
U.S. Treasury 2-Year Note June Futures	Short	06/2024	27	(4)	0	(1)
U.S. Treasury 5-Year Note June Futures	Short	06/2024	7	(1)	0	(1)
U.S. Treasury 10-Year Note June Futures	Long	06/2024	43	14	6	0
U.S. Treasury 20-Year Bond June Futures	Short	06/2024	36	(56)	0	(19)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note June Futures	Short	06/2024	88	(15)	0	(25)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond June Futures	Short	06/2024	2	(6)	0	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt June Futures	Short	06/2024	40	(37)	0	(29)
Total Futures Contracts				\$ 31	\$ 49	\$ (99)

SWAP AGREEMENTS:

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CORPORATE, SOVEREIGN, AND U.S. MUNICIPAL ISSUES - SELL PROTECTION⁽ⁱ⁾

リファレンス・エンティティ	固定受取金利	満期日	インプライド クレジット スプレッド ⁽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
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	0.663%	EUR 200	\$ 4	\$ 1	\$ 0	\$ 0
General Electric Co.	1.000%	06/20/2026	0.223%	\$ 500	9	1	0	0
					\$ 13	\$ 2	\$ 0	\$ 0

CREDIT DEFAULT SWAPS ON CREDIT INDICES - SELL PROTECTION⁽ⁱ⁾

インデックス/トランシェ	固定受取金利	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.IG-35 Index	1.000%	12/20/2030	\$ 100	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 0
CDX.IG-36 Index	1.000%	06/20/2031	300	5	1	0	0
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2032	100	2	1	0	0
CDX.IG-41 Index	1.000%	12/20/2028	13,500	305	40	6	0
				\$ 313	\$ 42	\$ 6	\$ 0

INTEREST RATE SWAPS

変動金利の 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
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	0.900%	03/10/2024	CAD 4,200	\$ (70)	\$ (50)	\$ 0	\$ 0
Pay ⁽⁵⁾	3-Month EURIBOR	2.000%	03/19/2026	EUR 11,300	(74)	(42)	1	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	0.528%	03/17/2024	NZD 700	(4)	(1)	0	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.000%	06/14/2024	7,300	(36)	(7)	2	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024	12,600	(325)	(46)	10	0
Receive	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	0.500%	12/16/2025	600	32	2	0	(3)

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 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(換)益	変動証拠金		
							資産	負債	資産
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	3.750%	06/15/2027	NZD 900	\$ (17)	\$ (5)	\$ 3	\$ 0	0
Pay ^(S)	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.250%	03/18/2030	7,800	15	27	21	0	0
Receive	6-Month Australian Bank Bill	3.500%	06/17/2025	AUD 200	2	0	0	0	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	900	(87)	4	1	0	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032	1,900	(186)	10	2	0	0
Pay ^(S)	6-Month Australian Bank Bill	4.250%	09/15/2032	800	(5)	3	0	0	0
Pay ^(S)	6-Month Australian Bank Bill	4.500%	09/15/2032	11,100	(7)	38	2	0	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	4.000%	06/21/2033	7,200	(135)	40	3	0	0
Pay ^(S)	6-Month Australian Bank Bill	4.750%	12/20/2033	14,600	15	45	2	0	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.550%	08/10/2024	EUR 500	(7)	3	0	0	0
Receive ^(S)	6-Month EURIBOR	3.500%	03/20/2026	100	0	1	0	0	0
Pay	6-Month EURIBOR	3.415%	12/18/2028	1,900	52	(17)	4	0	0
Pay ^(S)	6-Month EURIBOR	3.250%	03/20/2029	32,400	749	(285)	58	0	0
Pay	6-Month EURIBOR	2.547%	03/09/2033	1,020	(9)	5	5	0	0
Receive ^(S)	6-Month EURIBOR	3.000%	03/15/2033	2,640	(49)	(14)	0	(10)	0
Pay	6-Month EURIBOR	(0.175%)	03/17/2033	2,600	(706)	(48)	15	0	0
Pay ^(S)	6-Month EURIBOR	2.780%	03/04/2034	200	1	1	1	0	0
Pay ^(S)	6-Month EURIBOR	3.000%	03/20/2034	14,800	389	(45)	90	0	0
Receive	6-Month EURIBOR	0.000%	03/17/2053	900	502	5	0	(15)	0
Receive ^(S)	6-Month EURIBOR	2.750%	03/20/2054	3,500	(251)	(40)	0	(66)	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.000%	12/14/2024	¥ 930,000	6	2	0	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.100%	05/25/2025	910,000	4	2	0	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.143%	02/19/2031	300,000	81	2	1	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.850%	09/20/2033	360,000	(9)	(4)	4	0	0
Pay ^(S)	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	1.000%	03/21/2034	330,000	24	11	0	(4)	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.350%	03/17/2051	70,000	124	(1)	2	0	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.450%	06/16/2051	10,000	16	0	0	0	0
Pay	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.400%	12/15/2051	179,000	(298)	0	0	(5)	0
Receive	Bank of Japan Uncollateralized								
	Overnight Call Rate	0.800%	06/15/2052	90,000	92	(2)	4	0	0
Pay	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	4.550%	03/14/2024	CAD 2,600	(5)	(3)	0	0	0
Pay ^(S)	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	3.500%	05/10/2025	30,900	(223)	(40)	7	0	0
Pay ^(S)	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	5.000%	10/04/2025	11,100	67	(21)	1	0	0
Pay ^(S)	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	3.500%	12/18/2025	2,200	(6)	(4)	0	0	0
Pay	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	3.250%	12/20/2028	100	(2)	(1)	0	0	0
Pay	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	1.900%	12/18/2029	1,300	(84)	(3)	5	0	0
Receive ^(S)	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	3.500%	06/01/2032	4,200	(3)	15	0	(6)	0
Pay	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	2.200%	12/18/2049	1,200	(189)	7	9	0	0
Pay	Canadian Overnight Repo Rate								
	Average	3.300%	06/28/2053	100	(1)	0	1	0	0
Pay	Euro Short-Term Rate	2.750%	06/21/2024	EUR 10,900	(129)	(68)	3	0	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/19/2025	\$ 1,600	10	8	0	0	0
Receive	Secured Overnight Financing Rate	4.250%	12/20/2025	11,900	103	107	0	(1)	0
Receive ^(S)	Secured Overnight Financing Rate	4.000%	06/12/2026	7,900	43	72	0	(1)	0
Receive	Secured Overnight Financing Rate	3.196%	02/28/2027	2,850	84	21	0	(4)	0
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.750%	06/15/2027	9,400	940	301	0	(75)	0
Receive	Secured Overnight Financing Rate	3.800%	03/10/2028	4,300	104	96	0	(6)	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.665%	01/12/2029	4,300	(515)	(54)	2	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2030	8,100	(230)	(108)	9	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.655%	05/04/2032	500	(92)	(18)	1	0	0

INTEREST RATE SWAPS (Cont.)

変動金利の 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
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.800%	08/26/2032	\$ 800	\$ (72)	\$ (16)	\$ 2	\$ 0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	2.750%	09/21/2032	600	\$ (56)	\$ (12)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.650%	07/10/2033	320	\$ (9)	\$ (6)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	07/12/2033	340	\$ (6)	\$ (6)	1	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.393%	10/25/2033	1,300	\$ 50	\$ (17)	3	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	10/31/2033	700	\$ 30	\$ (9)	2	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.435%	11/01/2033	100	\$ 4	\$ (1)	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	4.450%	11/01/2033	2,800	\$ 121	\$ (36)	6	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	12/20/2033	6,050	\$ (203)	\$ (73)	13	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.620%	01/31/2034	100	\$ (2)	\$ (2)	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.725%	02/07/2034	200	\$ (3)	\$ (3)	0	0
Pay	Secured Overnight Financing Rate	3.860%	02/21/2034	100	\$ 0	\$ 0	0	0
Receive ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.750%	06/20/2034	4,300	\$ 20	\$ 28	0	\$ (10)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.842%	09/19/2053	2,800	\$ 939	\$ 29	0	\$ (17)
Receive	Secured Overnight Financing Rate	3.250%	12/20/2053	1,100	\$ 80	\$ 0	0	\$ (8)
Receive ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	3.500%	06/20/2054	1,500	\$ 26	\$ (9)	0	\$ (12)
Receive ⁽⁵⁾	Singapore Overnight Index Average	3.000%	09/18/2026	SGD	\$ 7,600	\$ (6)	0	1
Receive ⁽⁵⁾	Singapore Overnight Index Average	2.750%	03/20/2029		\$ 3,200	\$ 25	24	0
Pay	Sterling Overnight Interbank							
	Average Rate	4.160%	12/18/2028	GBP	3,900	15	\$ (78)	10
Pay ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank							
	Average Rate	5.000%	03/20/2029		7,000	392	\$ (137)	20
Pay ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank							
	Average Rate	4.500%	03/20/2034		5,100	354	\$ (89)	39
Pay ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank							
	Average Rate	4.250%	03/20/2054		400	39	\$ (1)	8
Pay ⁽⁵⁾	Swiss Overnight Rate Average	1.750%	03/20/2034	CHF	800	46	7	5
					\$ 1,485	\$ (506)	\$ 381	\$ (244)
					\$ 1,811	\$ (462)	\$ 387	\$ (244)
Total Swap Agreements								

FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: EXCHANGE-TRADED OR CENTRALLY CLEARED SUMMARY

The following is a summary of the market value and variation margin of Exchange-Traded or Centrally Cleared Financial Derivative Instruments as of February 29, 2024:

- (i) **Securities with an aggregate market value of \$5,037 and cash of \$756 have been pledged as collateral for exchange-traded and centrally cleared financial derivative instruments as of February 29, 2024. See Note 8, Master Netting Arrangements, in the Notes to Financial Statements for more information regarding master netting arrangements.**

市場価格 買い オプション	金融派生商品資産			金融派生商品負債		
	変動証拠金 資産		合計	変動証拠金 負債		合計
	先物	スワップ		市場価格 売り オプション	先物	
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 49	\$ 387	\$ 436	\$ 0	\$ (99)

(i) If the Fund is a seller of protection and a credit event occurs, as defined under the terms of that particular swap agreement, the Fund will either (i) pay to the buyer of protection an amount equal to the notional amount of the swap and take delivery of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index or (ii) pay a net settlement amount in the form of cash or securities equal to the notional amount of the swap less the recovery value of the referenced obligation or underlying securities comprising the referenced index.

(ii) Implied credit spreads, represented in absolute terms, utilized in determining the market value of credit default swap agreements on corporate issues, U.S. Municipal issues or sovereign issues as of period end serve as indicators of the current status of the payment/ performance risk and represent the likelihood or risk of default for the credit derivative. The implied credit spread of a particular referenced entity reflects the cost of buying/selling protection and may include upfront payments required to be made to enter into the agreement. Wider credit spreads represent a deterioration of the referenced entity's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

(iii) The maximum potential amount the Fund could be required to pay as a seller of credit protection or receive as a buyer of credit protection if a credit event occurs as defined under the terms of that particular swap agreement.

(iv) The prices and resulting values for credit default swap agreements serve as indicators of the current status of the payment/ performance risk and represent the likelihood of an expected liability (or profit) for the credit derivative should the notional amount of the swap agreement be closed/sold as of the period end. Increasing market values, in absolute terms when compared to the notional amount of the swap, represent a deterioration of the referenced underlying's credit soundness and a greater likelihood or risk of default or other credit event occurring as defined under the terms of the agreement.

(v) This instrument has a forward starting effective date. See Note 2, Securities Transactions and Investment Income, in the Notes to Financial Statements for further information.

(k) FINANCIAL DERIVATIVE INSTRUMENTS: OVER THE COUNTER

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益		
				資産	負債	
AZD	03/2024	CAD	176	\$ 131	\$ 1	\$ 0
AZD	03/2024	NZD	727	443	0	0
AZD	03/2024	\$ 303	AUD	462	0	(2)
AZD	04/2024	AUD	462	\$ 303	2	0
AZD	04/2024	\$ 443	NZD	727	0	0
BOA	03/2024	1,462	DKK	10,075	0	0
BOA	03/2024	538	NOK	5,600	0	(9)
BOA	03/2024	769	SEK	8,035	8	0
BOA	04/2024	DKK 10,060	\$ 1,462	0	0	0
BOA	04/2024	EUR 293		317	0	0
BPS	03/2024	AUD 867		563	0	(2)
BPS	03/2024	CHF 473		537	0	(1)
BPS	03/2024	EUR 810		868	0	(9)
BPS	03/2024	GBP 1,196		1,520	7	0
BPS	03/2024	JPY 568,569		3,862	63	0
BPS	03/2024	NOK 5,852		557	5	0
BPS	03/2024	SEK 5,861		562	0	(4)
BPS	03/2024	TWD 4,648		148	1	0
BPS	03/2024	\$ 319	EUR	295	0	0
BPS	03/2024	1,545	GBP	1,217	0	(5)
BPS	03/2024	166	JPY	25,004	1	0
BPS	03/2024	316	TWD	9,760	0	(7)
BPS	04/2024	AUD 372	\$ 242	0	0	0
BPS	04/2024	GBP 1,217		1,545	5	0
BPS	06/2024	TWD 21,443		691	7	0
BPS	06/2024	\$ 45	TWD	1,369	0	(1)
BPS	07/2024	16	PLN	64	0	0
BRK	03/2024	JPY 661,431	\$ 4,492	72	0	0
BRK	03/2024	NOK 332		31	0	0
BRK	03/2024	TWD 14,978		474	1	0
BRK	03/2024	\$ 474	TWD	14,970	0	(1)
BRK	04/2024	31	NOK	332	0	0
CBK	03/2024	CHF 867	\$ 984	0	0	(1)
CBK	03/2024	EUR 456		490	0	(4)
CBK	03/2024	GBP 114		144	0	0
CBK	03/2024	\$ 248	GBP	197	1	0
CBK	03/2024	597	JPY	89,700	2	0
CBK	03/2024	540	NZD	887	0	0
CBK	03/2024	481	TWD	14,970	0	(7)
CBK	04/2024	436	CHF	382	0	0
DUB	03/2024	EUR 42,255	\$ 45,872	146	0	0
DUB	03/2024	JPY 90,632		616	11	0
DUB	04/2024	\$ 45,928	EUR	42,255	0	(146)
GLM	03/2024	50	NOK	520	0	(1)
JPM	03/2024	CAD 7,738	\$ 5,732	27	0	0
JPM	03/2024	TWD 19,937		641	11	0
JPM	03/2024	\$ 191	SGD	254	0	(3)
JPM	03/2024	820	TWD	25,539	0	(13)
JPM	04/2024	5,732	CAD	7,734	0	(27)
JPM	06/2024	TWD 25,222	\$ 820	16	0	0
MBC	03/2024	AUD 4,434		2,924	37	0
MBC	03/2024	EUR 1,384		1,486	0	(11)
MBC	03/2024	TWD 463		15	0	0
MBC	03/2024	\$ 5,870	CAD	7,880	0	(61)
MBC	03/2024	47,649	EUR	44,044	14	0
MBC	04/2024	JPY 1,580,000	\$ 10,808	166	0	0
MBC	07/2024	\$ 551	PLN	2,207	1	0
MYI	03/2024	AUD 207	\$ 137	2	0	0
MYI	03/2024	CHF 38		44	1	0
MYI	03/2024	DKK 9,270		1,348	2	0
MYI	03/2024	GBP 104		132	1	0
MYI	03/2024	JPY 89,598		595	0	(4)
MYI	03/2024	SEK 2,173		211	1	0
MYI	03/2024	SGD 94		70	0	0

FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益		
				資産	負債	
MYI	03/2024	\$ 22	CAD	29	\$ 0	0
MYI	03/2024	616	EUR	566	0	(3)
MYI	03/2024	499	JPY	73,523	0	(7)
MYI	03/2024	267		40,004	0	0
MYI	03/2024	329	NOK	3,424	0	(6)
MYI	04/2024	AUD 26	\$	17	0	0
MYI	04/2024	EUR 130		141	0	0
MYI	04/2024	JPY 1,580,000		11,024	395	0
MYI	04/2024	NZD 42		26	0	0
MYI	04/2024	\$ 50	DKK	346	0	0
MYI	04/2024	15	GBP	12	0	0
MYI	04/2024	595	JPY	89,190	4	0
MYI	04/2024	211	SEK	2,171	0	(1)
NGF	03/2024	TWD 5,550	\$	177	1	0
RBC	04/2024	DKK 1,200		175	0	0
SCX	03/2024	5,574		811	2	0
SCX	03/2024	NZD 160		98	1	0
SCX	03/2024	\$ 1,604	CHF	1,378	0	(39)
SCX	03/2024	1,877	DKK	12,884	0	(6)
SCX	04/2024	DKK 12,865	\$	1,877	6	0
SOG	03/2024	TWD 4,942		157	1	0
TOR	03/2024	NOK 3,360		319	2	0
TOR	03/2024	\$ 3,060	AUD	4,673	0	(17)
TOR	03/2024	779	JPY	116,895	2	0
TOR	04/2024	AUD 4,673	\$	3,063	17	0
TOR	04/2024	JPY 116,361		779	0	(3)
TOR	04/2024	\$ 319	NOK	3,358	0	(2)
UAG	03/2024	DKK 9,318	\$	1,357	4	0
				\$ 1,047	\$ (403)	

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS:

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益		
				資産	負債	
AZD	03/2024	AUD 118	\$ 78	\$ 1	\$ 0	0
AZD	03/2024	\$ 333	JPY 49,017	0	0	(6)
AZD	03/2024	10	NZD 16	0	0	0
AZD	04/2024	NZD 16	\$ 10	0	0	0
BOA	03/2024	EUR 14		15	0	0
BOA	03/2024	SEK 247		24	0	0
BOA	03/2024	\$ 5	DKK 32	0	0	0
BOA	04/2024	DKK 32	\$ 5	0	0	0
BPS	03/2024	CHF 2		2	0	0
BPS	03/2024	EUR 1,147		1,244	3	0
BPS	03/2024	GBP 209		265	1	0
BPS	03/2024	\$ 25	AUD 39	0	0	0
BPS	03/2024	42	EUR 39	0	0	0
BPS	03/2024	244	GBP 193	0	0	(1)
BPS	03/2024	16	SGD 21	0	0	0
BPS	04/2024	AUD 39	\$ 25	0	0	0
BPS	04/2024	GBP 192		243	1	0
BPS	04/2024	SGD 21		16	0	0
BRK	03/2024	0		0	0	0
CBK	03/2024	CAD 3		2	0	0
CBK	03/2024	GBP 2		3	0	0
CBK	03/2024	JPY 4,751		33	1	0
CBK	03/2024	\$ 34	CHF 30	0	0	0
CBK	03/2024	51	JPY 7,631	0	0	0
CBK	04/2024	CHF 29	\$ 34	0	0	0
FAR	03/2024	\$ 1,319	EUR 1,215	0	0	(4)
FAR	04/2024	EUR 1,215	\$ 1,321	4	0	0
GLM	03/2024	CAD 17		13	0	0
GLM	03/2024	\$ 1	CAD 2	0	0	0
GLM	03/2024	23	GBP 18	0	0	0
MYI	03/2024	AUD 9	\$ 6	0	0	0
MYI	03/2024	CAD 220		164	2	0

JPY HEDGED CLASS FORWARD FOREIGN CURRENCY CONTRACTS (Cont.):

取引相手	決済月	受渡し通貨	受取通貨	未実現評価(損)益		
				資産	負債	
MYI	03/2024	EUR	94	\$ 102	\$ 0	\$ 0
MYI	03/2024	JPY	234,710	\$ 1,558	0	(10)
MYI	03/2024	SGD	21	16	0	0
MYI	03/2024	\$	175	CAD 238	0	0
MYI	03/2024		26	EUR 24	0	0
MYI	03/2024		8	GBP 6	0	0
MYI	03/2024		1,413	JPY 207,837	0	(24)
MYI	03/2024		26	SEK 266	0	0
MYI	04/2024	CAD	223	\$ 164	0	0
MYI	04/2024	SEK	265	26	0	0
MYI	04/2024	\$	1,462	JPY 219,227	10	0
RBC	03/2024	JPY	23,033	\$ 154	0	0
RBC	03/2024	\$	1	DKK 4	0	0
RBC	04/2024	DKK	4	\$ 1	0	0
RBC	04/2024	\$	154	JPY 22,928	0	0
RYL	03/2024	SGD	1	\$ 0	0	0
SCX	03/2024	CHF	28	32	1	0
SCX	03/2024	DKK	76	11	0	0
SCX	03/2024	JPY	217,583	1,454	0	0
SCX	03/2024	NZD	16	10	0	0
SCX	03/2024	\$	6	DKK 41	0	0
SCX	03/2024		1,458	JPY 212,150	0	(41)
SCX	04/2024	DKK	40	\$ 6	0	0
SCX	04/2024	\$	1,454	JPY 216,593	0	0
TOR	03/2024	JPY	210,572	\$ 1,403	0	(4)
TOR	03/2024	SEK	19	2	0	0
TOR	03/2024	\$	58	AUD 89	0	0
TOR	03/2024		1,393	JPY 204,316	0	(28)
TOR	04/2024	AUD	89	\$ 58	0	0
TOR	04/2024	\$	1,403	JPY 209,610	5	0
				\$ 29	\$ (118)	
				\$ 1,076	\$ (521)	

Total Forward Foreign Currency Contracts

WRITTEN OPTIONS:

INTEREST RATE SWAPTIONS

取引相手	銘柄	変動金利 インデックス	支払/受取 変動金利	権利行使 レート	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	2.420%	03/01/2024	200	\$ (1)	\$ 0
BPS	Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	2.490%	03/07/2024	200	(1)	0
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	2.750%	03/01/2024	200	(1)	0
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	2.810%	03/07/2024	200	(1)	0
CBK	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	2.540%	03/12/2024	100	0	0
CBK	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	2.880%	03/12/2024	100	0	0
GLM	Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	2.450%	03/05/2024	300	0	0
GLM	Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	2.800%	03/05/2024	300	0	(1)
						\$ (4)	\$ (1)	

FOREIGN CURRENCY OPTIONS

取引相手	銘柄	ストライクプライス	行使期限	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取)	市場価格
CBK	Put - OTC U.S. dollar versus Taiwan Dollar	TWD 31,000	03/01/2024	1,090	\$ (12)	\$ 0
Total Written Options					\$ (16)	\$ (1)

⁽¹⁾ Notional amount represents the number of contracts.