

ブラックロック・ ワールド・インカム・ストラテジー (愛称) BR Win

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(設定日:2005年7月7日)
決算日	毎月20日(ただし休業日の場合は翌営業日)
運用方針	<p>①主として「ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド クラスJ 投資証券」および「ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドクラスX投資証券」(以下各々を「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)への投資を通じて、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行います。</p> <p>②外貨建資産については、原則為替ヘッジを行いません。</p>
主要運用対象	<p>当ファンドは、ブラックロック・グループが運用する「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」に投資します。「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」を主要投資対象ファンドとし、その組入比率を高位に保ちます。</p>
組入制限	<p>①投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>月1回の毎決算時(毎月20日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <ul style="list-style-type: none"> ■分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 ■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。 <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>

第38作成期 運用報告書(全体版)

第220期 (決算日:2024年1月22日)
 第221期 (決算日:2024年2月20日)
 第222期 (決算日:2024年3月21日)
 第223期 (決算日:2024年4月22日)
 第224期 (決算日:2024年5月20日)
 第225期 (決算日:2024年6月20日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金を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。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況
- ◇ 参考情報

◇基準価額の推移

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託証券 組入比率	純資産
		(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率		
第34 作成期		円	円	%	%	百万円
	196期(2022年1月20日)	9,932	20	0.2	99.8	1,592
	197期(2022年2月21日)	9,865	20	△ 0.5	99.2	1,572
	198期(2022年3月22日)	10,134	20	2.9	99.8	1,608
	199期(2022年4月20日)	10,844	20	7.2	98.9	1,744
	200期(2022年5月20日)	10,562	20	△ 2.4	99.2	1,665
第35 作成期	201期(2022年6月20日)	11,024	20	4.6	99.8	1,727
	202期(2022年7月20日)	11,205	20	1.8	99.1	1,764
	203期(2022年8月22日)	11,239	20	0.5	99.4	1,765
	204期(2022年9月20日)	11,509	20	2.6	98.9	1,936
	205期(2022年10月20日)	11,766	20	2.4	99.0	1,883
	206期(2022年11月21日)	11,107	20	△ 5.4	99.5	1,767
第36 作成期	207期(2022年12月20日)	10,766	20	△ 2.9	99.3	1,718
	208期(2023年1月20日)	10,426	20	△ 3.0	99.5	1,589
	209期(2023年2月20日)	10,758	20	3.4	99.4	1,642
	210期(2023年3月20日)	10,576	20	△ 1.5	98.8	1,566
	211期(2023年4月20日)	10,757	20	1.9	98.9	1,589
	212期(2023年5月22日)	10,962	20	2.1	98.9	1,571
第37 作成期	213期(2023年6月20日)	11,351	20	3.7	99.1	1,472
	214期(2023年7月20日)	11,194	20	△ 1.2	98.3	1,463
	215期(2023年8月21日)	11,496	20	2.9	98.7	1,498
	216期(2023年9月20日)	11,727	20	2.2	98.6	1,529
	217期(2023年10月20日)	11,685	20	△ 0.2	99.3	1,479
	218期(2023年11月20日)	11,942	20	2.4	99.1	1,514
第38 作成期	219期(2023年12月20日)	11,813	20	△ 0.9	96.9	1,498
	220期(2024年1月22日)	12,100	20	2.6	99.0	1,536
	221期(2024年2月20日)	12,281	20	1.7	98.8	1,562
	222期(2024年3月21日)	12,361	20	0.8	98.8	1,573
	223期(2024年4月22日)	12,538	20	1.6	99.3	1,596
	224期(2024年5月20日)	12,794	20	2.2	99.3	1,595
225期(2024年6月20日)	13,025	20	2.0	98.4	1,637	

(注1) 基準価額の騰落率は税込分配金込み。基準価額は1万口当り。

(注2) 当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定しておりません。

(注3) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当作成期中の基準価額と市況の推移

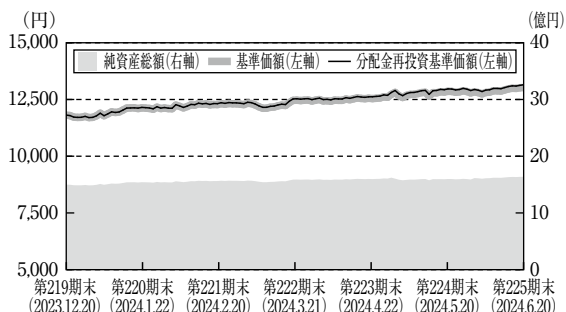
決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託証券 組入比率
			騰 落 率	
第220期	(期 首) 2023年12月20日	円 11,813	% -	% 96.9
	12月末	11,712	△0.9	99.0
	(期 末) 2024年1月22日	12,120	2.6	99.0
第221期	(期 首) 2024年1月22日	12,100	-	99.0
	1月末	12,126	0.2	98.9
	(期 末) 2024年2月20日	12,301	1.7	98.8
第222期	(期 首) 2024年2月20日	12,281	-	98.8
	2月末	12,311	0.2	98.8
	(期 末) 2024年3月21日	12,381	0.8	98.8
第223期	(期 首) 2024年3月21日	12,361	-	98.8
	3月末	12,432	0.6	97.0
	(期 末) 2024年4月22日	12,558	1.6	99.3
第224期	(期 首) 2024年4月22日	12,538	-	99.3
	4月末	12,727	1.5	99.2
	(期 末) 2024年5月20日	12,814	2.2	99.3
第225期	(期 首) 2024年5月20日	12,794	-	99.3
	5月末	12,791	△0.0	99.7
	(期 末) 2024年6月20日	13,045	2.0	98.4

(注1) 期末基準価額は税込分配金込み。基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。したがって当ファンドはベンチマークを設定していません。

■当作成期中の基準価額等の推移について

(第38作成期：2023年12月21日～2024年6月20日)



第220期首：11,813円

第225期末：13,025円(既払分配金120円)

騰落率：11.3%(分配金再投資ベース)

- * 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- * 分配金再投資基準価額は、前作成期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

米国では、当作成期間において金利は上昇となりました。期前半、FRB高官によるタカ派なコミュニケーションや強い経済指標等を受け目先の利下げ期待が後退し、金利上昇となりました。一方、5月以降はFOMCにおけるメッセージが市場予想を超えるほどのタカ派的なものではなかったこと、また、発表された経済指標が市場予想を下回ったことから、金利低下となったものの、前期末対比金利上昇で期を終えました。

12月、FOMCで市場予想通り政策金利据え置きが発表されたものの、政策金利見通しがハト派に傾いたことや2024年の利下げについて議論し始めたことなどを受けて金利低下となりました。1月、FRB高官のタカ派なコミュニケーションや、強い経済指標等を受け目先の利下げ期待の低下が進み金利上昇基調となっ

たものの、月末にかけてはリファンディングを受けた需給懸念の後退や、米地銀に対する懸念の再燃を受けた質への逃避の動きから金利は低下基調で月を終えました。2月、パウエル議長をはじめとするFRB高官のタカ派色のある発言や、雇用統計やCPI等が市場予想を上回ったことなどを背景に金利は上昇しました。3月、予想を上回る2月分CPI・PPIが一時的に金利上昇する局面があったものの、後半のFOMCにおいて発表されたDots(政策金利見通し)では引き続き年内3回の利下げが示唆されたほか、パウエル議長の記者会見においてもハト派色のある発言が目立ったことで、利下げ織り込みが拡大し、金利は低下しました。4月、ISM製造業、雇用統計、CPIといった主要な経済指標に加え、コアPCEデフレーターや雇用コスト指数などFRBが重視するインフレ指標も市場予想を上回ったことから、年内の利下げ期待が剥落し、金利上昇となりました。5月、月初のFOMCで市場想定を超えるほどのタカ派的なメッセージが示されなかったことに加え、雇用統計等の経済指標が市場予想を下回ったことから金利低下となりました。6月に入り、発表された5月分米雇用統計が市場予想を上回り、金利が上昇する局面も見られたものの、CPI等の経済指標が市場予想を下回っていたことから、金利は低下基調で推移し、米10年国債利回りは4.26%で当作成期を終えました。

欧州では、当作成期において金利は上昇しました。期の前半は、活況な起債市場、相次ぐ利下げ織り込みを牽制するECBメンバーの発言、市場予想を上回るインフレ指標等を背景に金利は上昇しました。その後、期半ばに開催されたECB会合においてコアインフレ見通しが引き下げられるハト派な内容となったことやフランスにおける政治的不透明感等から金利が低下する局面も見られたものの、前期末対比上昇で期を終えました。

12月、経済指標の鈍化やECB主要メンバーから利上げサイクルの終了を示唆するコメントが見られていた

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

ことを背景に金利低下となりました。1月、活況な起債市場、相次ぐECBメンバーから利下げ織り込みを牽制する発言を受け欧州金利は上昇しました。2月、ラガルド総裁を始めとするECBメンバーの発言が依然として慎重姿勢であることやユーロ圏のCPIが市場予想を上回ったこと等を背景に金利は上昇しました。3月、月前半に開催されたECB会合においては市場予想通り政策金利の据え置きが発表されたものの、2025年、2026年のコアインフレ見通しが引き下げられるハト派な内容となったことから金利は低下しました。4月、ECB会合においては市場予想通り政策金利の据え置きが発表され、声明文で利下げへのヒントが示されたものの、強い経済指標を背景とする米国金利上昇に追随し、金利は上昇しました。5月、米国金利の低下に追随し、欧州金利も低下する局面も見られたものの、予想を上回るユーロ圏製造業・総合PMI、欧州の妥結賃金やユーロ圏HICP等を背景に金利上昇となりました。6月、月初のECB会合において市場予想通り25bpsの利下げが行われたものの、スタッフのインフレ見通しがタカ派であったことから、金利が上昇する局面もみられたものの、その後フランスにおける政治的不透明感の高まりを背景に金利が大きく低下し、独10年国債利回りは2.43%で当作成期を終えました。

ポートフォリオについて

当作成期を通じて、当ファンドでは、「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」を高位に、「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」を低位に組み入れた運用を行いました。

<BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド>

金利リスクについては、柔軟な投資戦略に基づき、ポートフォリオのデュレーションは、3~4年の間で機動的に調整しました。当作成期、グローバルにおける

インフレの低下や労働市場をはじめマクロ環境に緩やかな減速を見られており、利上げサイクルの終了が近いと判断し、日々のボラティリティを鑑みてデュレーションを機動的に調整しました。クレジット資産においては、インフレの低下や景気は減速するものの、深刻なリセッションに陥る可能性は低いと考える中、堅調な需給環境や魅力的な利回り水準を鑑み、クオリティの高い資産クラス中心にリスクを追加しました。新興国においてはインフレの低下がみられていること、一部の中央銀行がすでに金融緩和に転じていること、また高い利回り水準を評価し、機動的に調整しました。

なお、当作成期におけるパフォーマンスの変動要因は以下のとおりです。

(主なプラス要因)

- ・ 欧州クレジットや米国投資適格社債、ハイ・イールド社債の保有
- ・ 証券化商品の保有

(主なマイナス要因)

- ・ デュレーションのポジショニング

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

主に米ドル建ての短期の投資適格社債に投資することで、トータル・リターンを最大化を目指した運用を行いました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+11.3%となりました。当作成期、主要投資対象である「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」が0.3%と上昇したことに加え、当該ファンドが米ドル建てのため、米ドルが円に対して上昇したことがプラス要因となりました。

■主要投資対象ファンドの当作成期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	0.3%

ベンチマークとの差異について

当ファンドは、特定のベンチマークに連動する運用、あるいはそれを上回る運用を目指すものではありません。したがって当ファンドはベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	第220期	第221期	第222期	第223期	第224期	第225期
	2023年12月21日 ～2024年1月22日	2024年1月23日 ～2024年2月20日	2024年2月21日 ～2024年3月21日	2024年3月22日 ～2024年4月22日	2024年4月23日 ～2024年5月20日	2024年5月21日 ～2024年6月20日
当期分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.17%	0.16%	0.16%	0.16%	0.16%	0.15%
当期の収益	20円	20円	20円	20円	20円	20円
当期の収益以外	-	-	-	-	-	-
翌期繰越分配対象額	3,845	4,026	4,106	4,283	4,539	4,770

(注1)「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針について

引き続き、主要投資対象ファンドである「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」を高位に組入れ、世界の様々な種類の債券に幅広く分散投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行う方針です。

投資先ファンドにおける今後の運用方針は以下の通りです。

<BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド>

市場は、年後半の利下げや景気のソフトランディングに対する見方を維持しています。しかし、足元インフレ率が予想を上回る伸びを示したこと、労働市場も逼

分配金について

収益分配金は基準価額水準、市場動向等を勘案して、220期(1万口あたり20円)、221期(1万口あたり20円)、222期(1万口あたり20円)、223期(1万口あたり20円)、224期(1万口あたり20円)、225期(1万口あたり20円)とさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行っております。

迫していることから先行きが不透明な状況が続いています。FRBの政策に関しては、今後も経済指標次第の姿勢を維持すると予想しており、インフレや米国経済が唐突に減速した場合は早期に利下げに踏み切り、一方、減速が見られない場合は2024年内に利下げに転じない可能性があると考えています。米国経済の底堅さを鑑みると、金融緩和サイクルへの移行としての利下げではなく、調整的な利下げになると考えています。

足元の市場環境においては、引き続き高クオリティの短期債に加え、利回り低下による利益を得るためイールドカーブの中期ゾーンのリデュレーションリスクやクレジットリスクを選好しています。クレジット資産の利回りは、金利部分が魅力的な水準かつ、ダウンサイド・プロテクションともなることから、投資妙味がある

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

と考えています。ポートフォリオでは、インフレの低下や経済成長率の減速を背景に、追加利上げのリスクは低下していると考えていることから、投資機会を見極め、米国、欧州および英国のデュレーションへの長期化を検討しています。短期的には、金融政策を巡る不透明感を背景にデュレーションリスクをやや削減し、クレジットリスクを選好しています。新興国債券においては、メキシコなど格付けが高いファンダメンタルズが良好で欧米の主要中央銀行に先駆けて利下げに踏み切っている国を選別的に保有する方針です。

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

当ファンドは、引き続き主に米ドル建ての短期の投資適格社債に投資することで、トータル・リターンを最大化を目指した運用を行う方針です。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第220期～第225期		項目の概要
	(2023.12.21～2024.6.20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	98	0.792	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,398円です。
(投信会社)	(44)	(0.358)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(51)	(0.413)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	10	0.082	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.027)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(印刷費用・監査費用等)	(7)	(0.055)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	108	0.874	

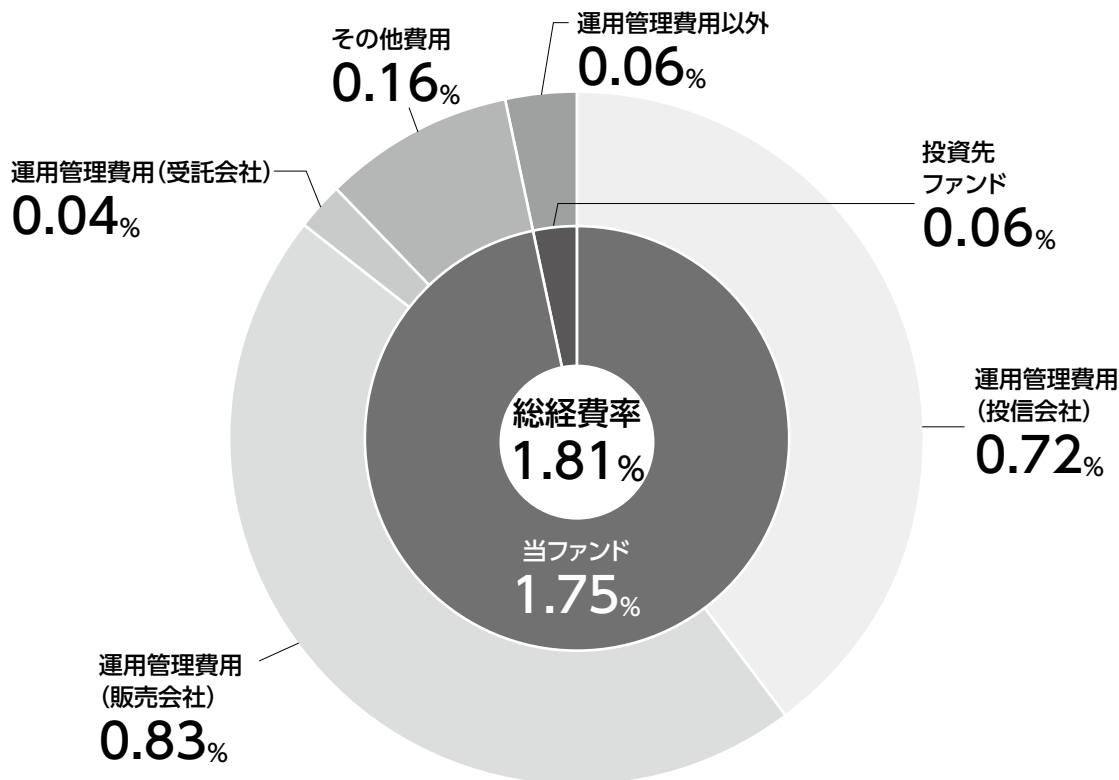
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当りのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

■総経費率



※当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に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1.81%です。

総経費率(①+②+③)	1.81%
①当ファンドの費用の比率	1.75%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1)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2)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3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5)①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)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7)上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。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2023年12月21日から2024年6月20日まで)

投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ	BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 46	千米・ドル 462	千口 39	千米・ドル 385

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2023年12月21日から2024年6月20日まで)

投資信託証券

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 46	千円 69,097	円 1,486	BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 39	千円 59,364	円 1,521

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2023年12月21日から2024年6月20日まで)

当作成期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2023年12月21日から2024年6月20日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 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

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当 作 成 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	千口 1,013	千米・ドル 10,082	百万円 1,594	% 97.4
BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	6	109	17	1.1
合 計	1,019	10,191	1,611	98.4

(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数、評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2024年6月20日現在

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 証 券	1,611,894	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	30,401	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,642,296	100.0

(注1) 第225期末における外貨建資産(1,611,903千円)の投資信託財産総額(1,642,296千円)に対する比率は、98.1%です。

(注2) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=158.16円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	2024年1月22日現在	2024年2月20日現在	2024年3月21日現在
	第 220 期 末	第 221 期 末	第 222 期 末
(A) 資 産	1,541,830,399 円	1,566,847,052 円	1,578,105,895 円
コール・ローン等	20,147,125	22,770,190	23,557,014
投資証券(評価額)	1,521,683,274	1,544,076,862	1,554,548,881
その他未収収益	-	-	-
(B) 負 債	4,892,253	4,623,733	4,712,028
未払収益分配金	2,540,420	2,544,190	2,545,660
未払解約金	51,836	216	831
未払信託報酬	2,150,655	1,944,316	2,024,928
その他未払費用	149,342	135,011	140,609
(C) 純資産総額(A-B)	1,536,938,146	1,562,223,319	1,573,393,867
元 本	1,270,210,005	1,272,095,437	1,272,830,062
次期繰越損益金	266,728,141	290,127,882	300,563,805
(D) 受益権総口数	1,270,210,005 口	1,272,095,437 口	1,272,830,062 口
1万口当り基準価額(C/D)	12,100 円	12,281 円	12,361 円

項 目	2024年4月22日現在	2024年5月20日現在	2024年6月20日現在
	第 223 期 末	第 224 期 末	第 225 期 末
(A) 資 産	1,601,734,805 円	1,599,688,801 円	1,642,296,292 円
コール・ローン等	16,677,928	15,566,827	30,401,592
投資証券(評価額)	1,585,056,868	1,584,121,974	1,611,894,700
その他未収収益	9	-	-
(B) 負 債	4,907,622	4,572,408	4,830,185
未払収益分配金	2,547,266	2,493,515	2,514,362
未払解約金	321	7,008	312
未払信託報酬	2,206,795	1,937,353	2,165,163
その他未払費用	153,240	134,532	150,348
(C) 純資産総額(A-B)	1,596,827,183	1,595,116,393	1,637,466,107
元 本	1,273,633,211	1,246,757,590	1,257,181,489
次期繰越損益金	323,193,972	348,358,803	380,284,618
(D) 受益権総口数	1,273,633,211 口	1,246,757,590 口	1,257,181,489 口
1万口当り基準価額(C/D)	12,538 円	12,794 円	13,025 円

(注記事項)

期首元本額	1,268,874,827円
期中追加設定元本額	23,017,922円
期中一部解約元本額	34,711,260円

■損益の状況

第220期 自 2023年12月21日 至 2024年 1月22日

第221期 自 2024年 1月23日 至 2024年 2月20日

第222期 自 2024年 2月21日 至 2024年 3月21日

項 目	第 220 期	第 221 期	第 222 期
(A) 配 当 等 収 益	4,153,362 円	5,408,098 円	4,703,882 円
受 取 配 当 金	4,137,239	5,399,566	4,699,746
受 取 利 息	16,123	8,532	4,136
そ の 他 収 益 金	-	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	37,177,195	22,357,594	10,346,315
売 買 益	43,482,849	22,357,733	10,458,957
売 買 損	△ 6,305,654	△ 139	△ 112,642
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,302,024	△ 2,221,548	△ 2,236,202
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	39,028,533	25,544,144	12,813,995
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	259,197,324	295,625,100	318,571,017
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 28,957,296	△ 28,497,172	△ 28,275,547
(配 当 等 相 当 額)	(192,767,580)	(193,554,942)	(193,904,935)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 221,724,876)	(△ 222,052,114)	(△ 222,180,482)
(G) 合 計 (D + E + F)	269,268,561	292,672,072	303,109,465
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,540,420	△ 2,544,190	△ 2,545,660
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	266,728,141	290,127,882	300,563,805
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 28,957,296	△ 28,497,172	△ 28,275,547
(配 当 等 相 当 額)	(192,767,580)	(193,554,942)	(193,904,935)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 221,724,876)	(△ 222,052,114)	(△ 222,180,482)
分 配 準 備 積 立 金	295,685,437	318,625,054	328,839,352

第223期 自 2024年 3月22日 至 2024年 4月22日

第224期 自 2024年 4月23日 至 2024年 5月20日

第225期 自 2024年 5月21日 至 2024年 6月20日

項 目	第 223 期	第 224 期	第 225 期
(A) 配 当 等 収 益	5,092,759 円	6,295,576 円	6,197,328 円
受 取 配 当 金	5,089,089	6,293,038	6,188,459
受 取 利 息	3,661	2,538	8,869
そ の 他 収 益 金	9	-	-
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	22,323,801	30,328,206	27,724,437
売 買 益	41,475,612	30,463,794	27,727,681
売 買 損	△ 19,151,811	△ 135,588	△ 3,244
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,430,304	△ 2,146,884	△ 2,390,810
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	24,986,256	34,476,898	31,530,955
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	328,780,343	343,573,514	373,776,154
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 28,025,361	△ 27,198,094	△ 22,508,129
(配 当 等 相 当 額)	(194,294,028)	(190,429,255)	(196,942,777)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 222,319,389)	(△ 217,627,349)	(△ 219,450,906)
(G) 合 計 (D + E + F)	325,741,238	350,852,318	382,798,980
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,547,266	△ 2,493,515	△ 2,514,362
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	323,193,972	348,358,803	380,284,618
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 28,025,361	△ 27,198,094	△ 22,508,129
(配 当 等 相 当 額)	(194,294,028)	(190,429,255)	(196,942,777)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 222,319,389)	(△ 217,627,349)	(△ 219,450,906)
分 配 準 備 積 立 金	351,219,333	375,556,897	402,792,747

(注1) 損益の状況の中で有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

■当作成期の分配金

	第220期 2024年1月22日	第221期 2024年2月20日	第222期 2024年3月21日
1万口当り分配金	20円	20円	20円
	第223期 2024年4月22日	第224期 2024年5月20日	第225期 2024年6月20日
1万口当り分配金	20円	20円	20円

- (注1) 分配金は、分配落ち後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、普通分配金と元本払戻金(特別分配金)に分かれます。分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。
- (注2) 普通分配金は次の税率で課税されます。
2037年12月31日までは、個人の受益者の場合は配当所得として、20.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。原則として、申告は不要です。また、確定申告を行うことにより総合課税(配当控除なし)と申告分離課税20.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税5%)のいずれかを選択することができます。法人の受益者の場合、15.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。)の税率による源泉徴収が行われます。
※なお、税法が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。
- (注3) 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。
- (注4) 累積投資コースの税引き後分配金は、販売会社がお客様との累積投資契約に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。なお、第220期末の再投資は2024年1月22日現在の基準価額(1万口当り12,100円)、第221期末の再投資は2024年2月20日現在の基準価額(1万口当り12,281円)、第222期末の再投資は2024年3月21日現在の基準価額(1万口当り12,361円)、第223期末の再投資は2024年4月22日現在の基準価額(1万口当り12,538円)、第224期末の再投資は2024年5月20日現在の基準価額(1万口当り12,794円)、第225期末の再投資は2024年6月20日現在の基準価額(1万口当り13,025円)に基づいて行いました。
- (注5) 第220期計算期末における、費用控除後の配当等収益(3,922,009円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(19,116,752円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(192,767,580円)、分配準備積立金(275,187,096円)により、分配対象収益は490,993,437円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,540,420円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注6) 第221期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,975,340円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(20,568,804円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,554,942円)、分配準備積立金(295,625,100円)により、分配対象収益は514,724,186円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,544,190円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注7) 第222期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,005,069円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,808,926円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(193,904,935円)、分配準備積立金(318,571,017円)により、分配対象収益は525,289,947円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,545,660円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

- (注8) 第223期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,641,209円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(20,345,047円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(194,294,028円)、分配準備積立金(328,780,343円)により、分配対象収益は548,060,627円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,547,266円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注9) 第224期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,926,527円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(28,550,371円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(190,429,255円)、分配準備積立金(343,573,514円)により、分配対象収益は568,479,667円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,493,515円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注10) 第225期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,760,527円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(25,770,428円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(196,942,777円)、分配準備積立金(373,776,154円)により、分配対象収益は602,249,886円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,514,362円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

<参考情報>

**ブラックロック・グローバル・ファンズ
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの運用状況について
(計算期間:2022年9月1日～2023年8月31日)**

ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人)フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」)はブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年8月末日)です。従って、入手可能な直前の計算期間(決算)である2023年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	
形 態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および投資態度	ファンドはトータル・リターンを最大化を目指します。ファンドは、少なくとも純資産の70%を世界各国の政府、政府関連機関、企業が様々な通貨建てで発行する譲渡性のある債券に投資をします。非投資適格債を含むあらゆる種別の有価証券を投資対象とし、これらを有効利用します。通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。また、ファンドは、投資適格、非投資適格に係わらず、資産担保証券(ABS、MBS)に純資産の100%を上限として投資を行うことができます。なお、ファンドは中国の規制により許容される方法により、中国本土に流通する債券に純資産の20%を上限として投資することができます。
設 定 日	2007年1月31日
存 続 期 間	無期限
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・ 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管 理 報 酬	ありません。(注)
そ の 他 費 用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決 算 日	年1回(原則として8月末日)に決算を行います。
収益分配方針	毎月(原則として毎月末営業日)に分配を行います。
申 込 手 数 料	ありません。
管 理 会 社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク、ブラックロック(シンガポール)リミテッド(副投資顧問会社:ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド)
保 管 会 社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌ・ブイ

(注) 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

■損益及び純資産変動計算書

※ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーは、BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドのクラスJ投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2022年9月1日から2023年8月31日までの期間

BGF フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	
米ドル	
期首純資産	8,997,090,506
収益	
現金および現金同等物に係る利息	20,874,791
債券利息、源泉徴収税控除後	333,722,271
スワップ利息	270,285,382
差金決済契約に係る受取利息	10,020
短期金融商品預け入れによる利息	5,372,523
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	113,466
配当金、源泉徴収税控除後	4,074,224
有価証券貸付による収益	1,763,685
投資運用報酬リベート	2,622
その他の払戻し	17,576
収益合計	636,236,560
費用	
スワップ利息	315,080,895
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	4,645
年間サービス費用	5,120,816
ローン・コミットメント・フィー	27,226
保管および預託報酬	1,320,104
販売報酬	2,415,202
税金	1,662,367
投資運用報酬	29,603,139
費用合計	355,234,394
純利益	281,002,166
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(571,144,910)
事後通告証券契約	21,161,236
差金決済取引	(158,833)
上場先物取引	143,870,732
オプション／スワップション契約	18,474,648
スワップ取引	6,890,679
先渡為替予約	(78,707,383)
その他の取引に係る外国通貨	(9,915,572)
当期実現純評価損	(469,529,403)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	370,946,736
事後通告証券契約	(21,228,168)
差金決済取引	356,476
上場先物取引	(34,502,408)
オプション／スワップション契約	6,151,932
スワップ取引	(42,391,859)
先渡為替予約	20,723,954
その他の取引に係る外国通貨	5,033,581
当期末実現純評価益／(損)の純変動	305,090,244
運用成績による純資産の増加	116,563,007
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	781,310,305
投資証券買戻しによる正味支払額	(2,622,225,777)
資本の変動による純資産の(減少)／増加	(1,840,915,472)
配当金宣言額	(48,303,128)
期末純資産	7,224,434,913

BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2023年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
77,376	アイルランド iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	3,444,006	0.05
122,600	ルクセンブルグ BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund	14,724,260	0.20
ファンド合計		18,168,266	0.25
普通株式およびワラント			
29,959	ベルギー Azelis	657,878	0.01
90,595	カナダ Lions Gate Entertainment*	701,205	0.01
99,749	Northern Graphite	22,119	0.00
		723,324	0.01
97,700	ケイマン諸島 Alibaba	1,123,622	0.01
32,600	Baidu	579,428	0.01
25,300	JD.com	415,485	0.01
38,370	Lavoro (Wts 27/12/2027)	29,929	0.00
44,600	Meituan	730,730	0.01
26,500	NetEase	553,450	0.01
27,700	Tencent	1,147,842	0.02
54,500	Wuxi Biologics Cayman	306,793	0.01
211,800	Xiaomi	333,783	0.00
		5,221,062	0.08
1,128,000	中国 Bank of China	382,569	0.00
44,000	BYD	1,378,966	0.02
988,000	China Construction Bank	529,085	0.01
56,000	China Merchants Bank	221,345	0.00
1,097,000	Industrial & Commercial Bank of China	503,533	0.01
85,500	Ping An Insurance of China	511,824	0.01
		3,527,322	0.05
16,979	キュラソー島 Schlumberger	999,044	0.01
3,902	フランス Accor	140,636	0.00
14,167	BNP Paribas	922,994	0.02
66	Hermes International	137,298	0.00
2,595	Unibail-Rodamco-Westfield	139,476	0.00
		1,340,404	0.02
14,295	ドイツ Covestro	763,057	0.01
50,051	Fresenius	1,613,873	0.02
15,255	Mercedes-Benz	1,123,968	0.02
864	Siemens	130,616	0.00
		3,631,514	0.05
240,983	ガーンジー Genius Sports	1,607,357	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
719	アイルランド Eaton	166,240	0.01
28,817	イタリア UniCredit	711,432	0.01
493,120	日本 Mitsubishi UFJ Financial*	3,925,594	0.06
176,960	Mizuho Financial*	2,917,955	0.04
83,760	Sumitomo Mitsui Financial	3,828,817	0.05
		10,672,366	0.15
185,521	ルクセンブルグ ADLER	102,854	0.00
33,760	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	366	0.00
		103,220	0.00
1,101	オランダ ASML	733,319	0.01
742	ASML*	493,689	0.01
10,076	ING Groep*	144,673	0.00
1,133	NXP Semiconductors	233,704	0.00
		1,605,385	0.02
7,864	パナマ Carnival	124,330	0.00
18,559	スペイン Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	147,915	0.00
8,015	スウェーデン Swedbank	143,229	0.00
3,674	スイス ABB	140,186	0.00
229	Swisscom*	139,857	0.00
410,825	Transocean*	3,376,981	0.05
		3,657,024	0.05
3,209	台湾 Taiwan Semiconductor Manufacturing	301,229	0.01
197,415	英国 Babcock International	960,471	0.01
916,528	Barclays	1,726,722	0.03
524,089	Mobico	562,714	0.01
2,236	Shell*	139,012	0.00
43,738	Shell*	1,360,013	0.02
		4,748,932	0.07
12,858	米国 Activision Blizzard	1,182,936	0.02
269	Adobe	150,027	0.00
8,548	Advanced Micro Devices	918,055	0.01
14,015	Alphabet	1,931,687	0.03
1,113	Alphabet	152,192	0.00
3,437	Applied Materials	522,252	0.01
303,507	Astra Space	80,278	0.00
12,672	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	6,616	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
697	Autodesk	154,985	0.00
49	Booking	152,017	0.00
788	Broadcom	718,475	0.01
9,936	Caesars Entertainment	543,797	0.01
41,620	California Resources*	2,314,904	0.03
50,290	Cano Health (Wts 3/6/2026)	2,565	0.00
56,134	Cano Health (Wts 6/7/2025)	2,863	0.00
559	Caterpillar	158,052	0.00
5,833	Chesapeake Energy*	514,179	0.01
2,827	Cisco Systems	161,945	0.00
7,508	Constellation Brands	1,954,408	0.03
342	Deere*	141,591	0.00
51,159	Delta Air Lines	2,197,279	0.03
1,168	Dexcom	120,316	0.00
151,511	DiamondRock Hospitality*	1,230,269	0.02
1,774	Edwards Lifesciences	137,609	0.00
59,890	Element Solutions*	1,245,712	0.02
2,710	Eli Lilly	1,487,790	0.02
183	Equinix	144,420	0.00
6,865	Equitrans Midstream	66,316	0.00
60,140	EVgo (Wts 15/9/2025)	34,851	0.00
2,361	First Solar	445,261	0.01
89,996	Ford Motor	1,093,451	0.01
22,932	Forestar	659,295	0.01
28,639	Freeport-McMoRan	1,154,152	0.02
32,518	General Motors	1,090,654	0.01
59,822	Green Plains*	1,864,652	0.03
23,025	Halliburton	895,212	0.01
4,655	HCA Healthcare	1,302,841	0.02
30,237	Informatica	631,953	0.01
454	Intuitive Surgical	145,353	0.00
3,184	KLA	1,596,935	0.02
7,289	Las Vegas Sands	403,446	0.01
6,113	Lennar	726,897	0.01
387	Lululemon Athletica	147,602	0.00
13,880	M/I Homes	1,355,660	0.02
10,314	Marathon Petroleum	1,461,081	0.02
785	Marsh & McLennan	154,268	0.00
8,328	Meritage Homes*	1,151,429	0.02
2,812	Microchip Technology*	231,765	0.00
17,310	Micron Technology	1,216,201	0.02
440	Microsoft	144,786	0.00
154	Morgan Stanley	13,144	0.00
22,338	Mr Cooper	1,265,224	0.02
5,051	NVIDIA	2,511,307	0.04
92,223	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	1,844	0.00
2,205	ONEOK	144,075	0.00
71,219	Park Hotels & Resorts	920,862	0.01
32,025	Pear Therapeutics (Wts 4/2/2026)	3	0.00
14,785	Phillips 66	1,673,514	0.02
15,563	Pivotal Investment III (Wts 31/12/2027)	17	0.00
6,623	Rockwell Automation	2,067,701	0.03
4,439	RXO*	82,077	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
25,799	Sarcos Technology & Robotics	28,379	0.00
375,884	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	9,435	0.00
150,040	Service Properties Trust	1,255,835	0.02
254	ServiceNow	150,541	0.00
325,291	Sonder	162,645	0.00
520	Stryker	150,303	0.00
64,560	Sunstone Hotel Investors	582,977	0.01
6,313	Tesla	1,623,893	0.02
38,800	Uber Technologies	1,815,064	0.03
29,195	United Airlines	1,456,831	0.02
57,792	United States Steel*	1,783,461	0.02
11,639	Valero Energy	1,506,087	0.02
82,846	Xenia Hotels & Resorts	988,353	0.01
6,000	Yum China	319,777	0.00
		<hr/>	
		56,814,629	0.77
		<hr/>	
普通株式およびワラント合計		96,903,836	1.34
		<hr/>	
債券			
	アンゴラ		
USD 846,000	Angolan Government International Bond 8.75% 14/4/2032*	696,973	0.01
		<hr/>	
	アルゼンチン		
USD 2,371,000	Argentine Republic Government International Bond 3.625% 9/7/2035	711,383	0.01
USD 2,004,000	Argentine Republic Government International Bond 4.25% 9/1/2038	706,520	0.01
USD 2,723,936	Generacion Mediterranea SA / Central Termica Roca 9.875% 1/12/2027	2,410,683	0.04
USD 814,000	YPF 6.95% 21/7/2027	688,396	0.01
USD 1,665,150	YPF 7% 30/9/2033	1,285,979	0.02
USD 1,337,000	YPF 7% 15/12/2047	919,836	0.01
USD 263,000	YPF 8.5% 27/6/2029	223,730	0.00
		<hr/>	
		6,946,527	0.10
		<hr/>	
	オーストラリア		
EUR 1,500,000	BHP Billiton Finance 5.625% 22/10/2079	1,641,975	0.02
USD 1,217,000	FMG Resources August 2006 4.375% 1/4/2031	1,019,697	0.02
USD 3,310,000	FMG Resources August 2006 6.125% 15/4/2032*	3,082,089	0.04
USD 187,500	Linc Energy 0% 10/4/2018	1,078	0.00
EUR 2,700,000	Origin Energy Finance 1% 17/9/2029	2,723,466	0.04
EUR 720,000	Transurban Finance 4.225% 26/4/2033	774,025	0.01
		<hr/>	
		9,242,330	0.13
		<hr/>	
	オーストリア		
EUR 2,000,000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	1,822,133	0.02
EUR 2,400,000	ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	1,848,408	0.03
EUR 746,000	ams-OSRAM 6% 31/7/2025	750,132	0.01
EUR 1,200,000	Erste Bank 4.25% 30/5/2030	1,303,575	0.02
USD 1,457,000	Klabing Austria 3.2% 12/1/2031	1,167,756	0.02
EUR 3,300,000	Lenzing 5.75% 7/9/2025*	3,220,998	0.04
USD 1,517,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	1,196,670	0.02
USD 758,000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	704,099	0.01
		<hr/>	
		12,013,771	0.17
		<hr/>	
	バハマ		
USD 602,000	Intercorp Peru 3.875% 15/8/2029	510,984	0.01
		<hr/>	
	バーレーン		
USD 1,457,000	Bahrain Government International Bond 5.45% 16/9/2032*	1,311,060	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	バーレーン(続き)		
USD 989,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047*	913,455	0.01
		2,224,515	0.03
	ベルギー		
GBP 1,000,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1,229,711	0.02
GBP 5,612,000	Anheuser-Busch InBev 9.75% 30/7/2024	7,354,863	0.10
EUR 693,000	Azelis Finance 5.75% 15/3/2028*	766,457	0.01
EUR 2,100,000	Elia 2.75% 2/10/2023	2,270,411	0.03
GBP 1,000,000	KBC 1.25% 21/9/2027	1,091,859	0.01
EUR 600,000	Solvay 2.5% 2/12/2025	604,983	0.01
		13,318,284	0.18
	ベナン		
EUR 473,000	Benin Government International Bond 4.875% 19/1/2032*	384,710	0.01
EUR 473,000	Benin Government International Bond 6.875% 19/1/2052	354,722	0.00
		739,432	0.01
	バミューダ		
USD 1,508,540	Digicel 8% 1/4/2025	354,507	0.00
USD 517,000	Inkia Energy 5.875% 9/11/2027	498,132	0.00
USD 1,668,000	Luye Pharma 6.25% 6/7/2028	1,498,427	0.02
USD 25,710,000	PF2022-9 7.587% 19/8/2035	25,665,661	0.36
USD 655,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	576,325	0.01
		28,593,052	0.39
	ブラジル		
USD 1,740,000	Banco do Brasil 6.25% 18/4/2030	1,728,081	0.02
USD 1,236,000	Banco Votorantim 4.5% 24/9/2024	1,210,810	0.02
BRL 27,171,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	5,474,235	0.08
BRL 86,435,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	17,665,267	0.24
USD 1,942,000	BRF 4.875% 24/1/2030	1,680,539	0.02
		27,758,932	0.38
	英領バージン諸島		
USD 300,000	Champion Path 4.85% 27/1/2028	241,853	0.00
USD 338,000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	223,959	0.00
USD 400,000	Fortune Star BVI 5.95% 19/10/2025	314,320	0.01
EUR 852,000	Global Switch 2.25% 31/5/2027	860,472	0.01
HKD 8,000,000	Link CB 4.5% 12/12/2027	1,014,477	0.01
USD 282,000	New Metro Global 4.8% 15/12/2024	110,961	0.00
USD 242,000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	112,530	0.00
USD 369,000	RKPF Overseas 2019 A 6.7% 30/9/2024*	246,593	0.00
USD 486,480	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	474,508	0.00
USD 700,000	Studio City 7% 15/2/2027	664,548	0.01
USD 850,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	639,502	0.01
		4,903,723	0.05
	カナダ		
USD 1,442,129	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust 5% 15/12/2023	1,436,911	0.02
EUR 1,727,000	Alimentation Couche-Tard 1.875% 6/5/2026	1,771,236	0.02
USD 778,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	649,050	0.01
USD 1,159,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6.25% 15/9/2027	1,072,545	0.02
USD 1,500,000	Canadian Pacific Railway 1.35% 2/12/2024	1,421,984	0.02
USD 1,500,000	Canadian Pacific Railway 4% 1/6/2028	1,432,858	0.02
USD 1,055,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	1,038,231	0.02
USD 250,000	First Quantum Minerals 6.875% 15/10/2027	243,578	0.00
USD 1,150,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	1,149,293	0.02
USD 200,000	First Quantum Minerals 8.625% 1/6/2031	203,756	0.00
USD 343,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	342,489	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ(続き)			
USD 2,099,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,853,354	0.03
USD 1,748,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	1,645,544	0.02
USD 991,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	974,728	0.01
USD 3,000,000	Rogers Communications 2.95% 15/3/2025	2,863,614	0.04
USD 4,970,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	4,240,318	0.06
USD 325,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.8% 10/3/2027	297,758	0.00
GBP 1,000,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027	1,138,076	0.02
EUR 1,900,000	TotalEnergies Capital Canada 2.125% 18/9/2029	1,889,982	0.03
		25,665,305	0.36
ケイマン諸島			
USD 500,000	522 Funding CLO 2018-3A 7.638% 20/10/2031	489,799	0.01
USD 2,153,121	ABRA Global Finance 11.5% 2/3/2028	1,817,041	0.03
USD 2,609,706	ACAS CLO 2015-1 6.462% 18/10/2028	2,598,614	0.04
USD 500,000	ACAS CLO 2015-1 7.172% 18/10/2028	492,007	0.01
USD 3,870,000	ACAS CLO 2015-1 7.772% 18/10/2028	3,804,807	0.05
USD 250,000	AGL CLO 11 11.93% 15/4/2034	245,285	0.00
USD 375,000	AGL CLO 3 8.87% 15/1/2033	370,804	0.01
USD 410,000	AGL CLO 5 6.988% 20/7/2034	398,501	0.01
USD 4,700,000	AGL CLO 5 7.288% 20/7/2034	4,645,165	0.06
USD 1,460,000	AGL CLO 7 8.67% 15/7/2034	1,424,932	0.02
USD 250,000	AGL CLO 9 9.288% 20/1/2034	247,706	0.00
USD 1,030,000	AGL CLO 9 12.848% 20/1/2034	1,039,158	0.01
USD 400,000	Ahli United Sukuk 3.875% 17/6/2026	365,994	0.01
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2015-A 7.17% 17/10/2034	247,686	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2017-A 8.738% 20/4/2034	239,862	0.00
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S 7.745% 21/10/2028	1,556,885	0.02
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S 8.595% 21/10/2028	2,271,448	0.03
USD 370,000	Allegro CLO IV 7.12% 15/1/2030	366,604	0.01
USD 1,056,106	Allegro CLO VI 6.7% 17/1/2031	1,052,446	0.01
USD 500,000	Allegro CLO XI 7.432% 19/1/2033	494,944	0.01
USD 690,000	Allegro CLO XI 8.582% 19/1/2033	690,954	0.01
USD 477,768	AMMC CLO 21 6.877% 2/11/2030	476,511	0.01
USD 2,216,584	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 6.553% 13/4/2031	2,205,096	0.03
USD 695,020	Anchorage Capital CLO 2013-1 6.813% 13/10/2030	693,105	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 7.213% 13/10/2030	1,066,665	0.02
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 7.713% 13/10/2030	336,440	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 8.763% 13/10/2030	414,590	0.01
USD 680,206	Anchorage Capital CLO 3-R 6.677% 28/1/2031	677,430	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R 7.127% 28/1/2031	1,638,293	0.02
USD 1,178,929	Anchorage Capital CLO 4-R 6.677% 28/1/2031	1,170,920	0.02
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R 7.477% 28/1/2031	1,466,077	0.02
USD 697,947	Apidos CLO XII 6.65% 15/4/2031	694,203	0.01
USD 1,036,669	Apidos CLO XV 6.598% 20/4/2031	1,032,821	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 7.12% 15/4/2031	247,955	0.00
USD 250,000	Apidos CLO XXXII 7.988% 20/1/2033	250,594	0.00
USD 300,000	Apidos CLO XXXII 9.088% 20/1/2033	296,409	0.00
USD 375,000	Apidos CLO XXXV 11.338% 20/4/2034	360,486	0.01
USD 820,000	Apidos CLO XXXVII 11.907% 22/10/2034	816,026	0.01
USD 1,798,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2022-FL2 7.16% 15/5/2037	1,785,411	0.02
USD 375,000	ARES XLV CLO 7.62% 15/10/2030	372,958	0.01
USD 1,417,894	Ares XXXVII CLO 6.74% 15/10/2030	1,416,651	0.02
USD 245,076	ASSURANT CLO 6.628% 20/4/2031	243,959	0.00
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 6.662% 19/7/2031	1,782,486	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 2,740,000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 8.707% 24/7/2034	2,617,913	0.04
USD 430,000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 6.758% 20/10/2034	426,668	0.01
USD 250,000	Ballyrock CLO 14 7.888% 20/1/2034	247,246	0.00
USD 1,410,000	Ballyrock CLO 2020-2 11.738% 20/10/2031	1,349,408	0.02
USD 1,060,000	Bardot CLO 8.607% 22/10/2032	1,038,249	0.01
USD 933,026	Barings CLO 2015-II 6.778% 20/10/2030	930,645	0.01
USD 295,106	Barings CLO 2018-III 6.538% 20/7/2029	294,120	0.00
USD 750,000	Benefit Street Partners CLO V-B 6.678% 20/4/2031	747,258	0.01
USD 1,892,390	Benefit Street Partners CLO VIII 6.688% 20/1/2031	1,887,427	0.03
USD 2,181,328	BlueMountain CLO 2013-2 6.787% 22/10/2030	2,173,847	0.03
USD 509,893	BlueMountain CLO 2015-3 6.588% 20/4/2031	508,198	0.01
USD 250,000	Canyon CLO 2018-1 6.64% 15/7/2031	249,015	0.00
USD 370,000	Canyon CLO 2020-3 12.82% 15/1/2034	354,458	0.01
USD 460,766	Carbone CLO 6.728% 20/1/2031	460,191	0.01
USD 2,006,738	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 6.54% 17/4/2031	1,998,609	0.03
USD 4,237,874	CARLYLE US CLO 2017-4 6.75% 15/1/2030	4,228,446	0.06
USD 750,000	CarVal CLO I 8.46% 16/7/2031	731,178	0.01
USD 350,000	Cayuga Park CLO 7.22% 17/7/2034	345,611	0.01
USD 6,231,520	CBAM 2017-1 6.838% 20/7/2030	6,229,028	0.09
USD 750,000	CBAM 2017-1 7.988% 20/7/2030	744,007	0.01
USD 850,000	CIFC Funding 2013-III-R 7.457% 24/4/2031	833,632	0.01
USD 246,496	CIFC Funding 2014 6.672% 18/1/2031	245,989	0.00
USD 710,000	CIFC Funding 2014-III 6.807% 22/10/2031	708,757	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014-II-R 8.407% 24/4/2030	247,535	0.00
USD 3,530,000	CIFC Funding 2017-I 7.295% 23/4/2029	3,519,797	0.05
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-1 8.045% 23/4/2029	2,753,831	0.04
USD 968,690	CIFC Funding 2017-II 6.538% 20/4/2030	965,072	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2017-IV 7.157% 24/10/2030	248,201	0.00
USD 232,767	CIFC Funding 2017-V 6.75% 16/11/2030	232,535	0.00
USD 600,000	CIFC Funding 2017-V 8.42% 16/11/2030	587,953	0.01
USD 5,640,000	CIFC Funding 2018-II 6.628% 20/4/2031	5,616,010	0.08
USD 250,000	CIFC Funding 2018-II 7.188% 20/4/2031	248,063	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 8.57% 15/1/2032	247,169	0.00
USD 480,000	CK Hutchison International 23 4.75% 21/4/2028	467,918	0.01
USD 405,000	CK Hutchison International 23 4.875% 21/4/2033*	390,460	0.01
USD 178,436	Clear Creek CLO 6.788% 20/10/2030	177,744	0.00
USD 1,400,000	Clear Creek CLO 8.538% 20/10/2030	1,393,591	0.02
USD 3,268,454	Deer Creek CLO 2017-1 6.768% 20/10/2030	3,254,967	0.05
USD 500,000	Deer Creek CLO 2017-1 7.238% 20/10/2030	495,690	0.01
USD 500,000	Deer Creek CLO 2017-1 11.938% 20/10/2030	485,881	0.01
USD 1,488,000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	1,481,948	0.02
USD 10,274,446	Dryden 53 CLO 6.69% 15/1/2031	10,247,840	0.14
USD 413,006	Dryden XXVI Senior Loan Fund 6.47% 15/4/2029	411,638	0.01
USD 5,774,491	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 6.833% 15/8/2030	5,760,387	0.08
USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 7.77% 15/10/2030	983,401	0.01
USD 925,000	Fantasia 6.95% 17/12/2021	51,953	0.00
USD 1,781,000	Fantasia 7.95% 5/7/2022	85,381	0.00
USD 794,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	39,700	0.00
USD 2,580,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022	129,000	0.00
USD 411,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	20,550	0.00
USD 2,865,000	Gaci First Investment 4.75% 14/2/2030	2,785,138	0.04
USD 3,258,000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	3,222,097	0.05
USD 250,000	Galaxy XXII CLO 6.77% 16/4/2034	246,648	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 327,755	Galaxy XXIII CLO 6.477% 24/4/2029	326,149	0.00
USD 245,556	Generate CLO 2 6.757% 22/1/2031	244,160	0.00
USD 642,194	Generate CLO 2 6.838% 20/10/2029	639,301	0.01
USD 5,995,000	Generate CLO 2 7.338% 20/10/2029	5,970,221	0.08
USD 4,240,000	Generate CLO 2 9.188% 20/10/2029	4,221,337	0.06
USD 1,520,000	Generate CLO 2 11.988% 20/10/2029	1,443,878	0.02
USD 730,000	Generate CLO 2 12.838% 20/10/2029	680,477	0.01
USD 2,090,000	Gilbert Park CLO 7.52% 15/10/2030	2,069,865	0.03
USD 2,717,000	Gilbert Park CLO 8.52% 15/10/2030	2,617,565	0.04
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6.608% 20/4/2034	496,407	0.01
USD 460,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 7.138% 20/10/2032	458,750	0.01
USD 350,513	GoldenTree Loan Opportunities IX 6.741% 29/10/2029	348,122	0.01
USD 1,166,000	Goldentree Loan Opportunities X 6.708% 20/7/2031	1,163,717	0.02
USD 1,166,038	Goldentree Loan Opportunities XI 6.642% 18/1/2031	1,163,573	0.02
USD 2,610,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10.938% 20/10/2034	2,457,372	0.03
USD 2,650,000	Golub Capital Partners CLO 55B 12.148% 20/7/2034	2,664,324	0.04
USD 224,682	Grippen Park CLO 6.848% 20/1/2030	224,472	0.00
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 6.822% 18/7/2031	315,341	0.00
USD 2,552,901	HPS Loan Management 6-2015 6.631% 5/2/2031	2,535,208	0.04
USD 1,668,000	IHS 5.625% 29/11/2026	1,440,385	0.02
USD 916,000	IHS 6.25% 29/11/2028	737,192	0.01
USD 3,000,000	iQIYI 6.5% 15/3/2028	2,647,500	0.04
USD 750,000	LCM XIV 6.628% 20/7/2031	742,998	0.01
USD 759,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	763,592	0.01
USD 2,529,257	Loanpal Solar Loan 2021-1 2.29% 20/1/2048	1,871,229	0.03
USD 600,000	Madison Park Funding XIII 7.482% 19/4/2030	596,718	0.01
USD 397,464	Madison Park Funding XLI 6.437% 22/4/2027	396,159	0.01
USD 1,385,000	Madison Park Funding XLI 7.257% 22/4/2027	1,378,825	0.02
USD 700,000	Madison Park Funding XXX 10.52% 15/4/2029	663,266	0.01
USD 991,000	MAF Global 6.375% 20/3/2026*	964,555	0.01
USD 250,000	Marble Point CLO XVII 9.338% 20/4/2033	238,375	0.00
USD 256,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	214,403	0.00
USD 200,000	Melco Resorts Finance 5.625% 17/7/2027*	180,417	0.00
USD 448,000	MGM China 4.75% 1/2/2027*	405,032	0.00
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7.076% 20/1/2035	838,593	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 12.788% 20/1/2032	250,688	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 46 7.238% 20/1/2036	247,512	0.00
USD 250,000	Ocean Trails CLO X 7.37% 15/10/2034	245,258	0.00
USD 457,099	OCP CLO 2014-5 6.692% 26/4/2031	456,177	0.01
USD 1,320,000	OCP CLO 2014-5 8.512% 26/4/2031	1,216,058	0.02
USD 1,170,000	OCP CLO 2014-7 5.106% 20/7/2029	1,065,230	0.01
USD 1,100,000	OCP CLO 2014-7 7.238% 20/7/2029	1,096,251	0.02
USD 360,000	OCP CLO 2017-14 7.591% 20/11/2030	353,342	0.01
USD 250,000	Octagon Investment Partners 18-R 6.53% 16/4/2031	248,835	0.00
USD 250,000	Octagon Loan Funding 7.341% 18/11/2031	245,906	0.00
USD 1,422,582	OHA Loan Funding 2013-2 6.679% 23/5/2031	1,413,695	0.02
USD 290,000	OZLM Funding IV 7.307% 22/10/2030	287,315	0.00
USD 3,200,000	OZLM VI 0% 17/4/2031	199,565	0.00
USD 500,000	OZLM VII 7.17% 17/7/2029	493,915	0.01
USD 815,000	OZLM VIII 8.72% 17/10/2029	814,950	0.01
USD 250,000	OZLM XX 7.238% 20/4/2031	244,943	0.00
USD 461,281	Palmer Square CLO 2014-1 6.7% 17/1/2031	460,716	0.01
USD 1,738,464	Palmer Square CLO 2018-1 6.602% 18/4/2031	1,731,946	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 500,000	Palmer Square CLO 2018-2 7.22% 16/7/2031	497,328	0.01
USD 460,000	Palmer Square CLO 2020-3 7.226% 15/11/2031	456,280	0.01
USD 145,468	Parallel 2015-1 7.338% 20/7/2027	145,608	0.00
USD 1,049,714	Pearl II 6% 2/10/2023	28,877	0.00
USD 836,000	Pearl III 9% 22/10/2025	260,201	0.00
USD 500,000	Pikes Peak CLO 1 6.787% 24/7/2031	496,842	0.01
USD 375,000	Pikes Peak CLO 4 8.82% 15/7/2034	370,021	0.01
USD 500,000	Pikes Peak CLO 6 12.071% 18/5/2034	495,086	0.01
USD 978,356	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4% 24/8/2049	953,534	0.01
USD 9,164,792	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	8,213,545	0.11
USD 1,000,000	Regatta IX Funding 7.37% 17/4/2030	998,965	0.01
USD 2,180,000	Regatta IX Funding 8.02% 17/4/2030	2,193,154	0.03
USD 500,000	Regatta IX Funding 9.47% 17/4/2030	497,128	0.01
USD 1,230,000	Regatta VIII Funding 7.27% 17/10/2030	1,230,118	0.02
USD 910,000	Regatta VIII Funding 8.77% 17/10/2030	900,396	0.01
USD 250,000	Regatta XVI Funding 7.62% 15/1/2033	249,376	0.00
USD 500,000	Regatta XVI Funding 9.47% 15/1/2033	499,000	0.01
USD 10,235,903	Rockford Tower CLO 2017-3 6.778% 20/10/2030	10,223,108	0.14
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 7.361% 20/5/2031	1,234,407	0.02
USD 341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 6.748% 20/10/2031	339,892	0.00
USD 1,500,000	RR 19 12.07% 15/10/2035	1,507,253	0.02
USD 224,946	RR 3 6.66% 15/1/2030	224,558	0.00
USD 2,000,000	RR 4 7.12% 15/4/2030	1,990,078	0.03
USD 467,000	Sands China 4.3% 8/1/2026	437,486	0.01
USD 519,000	Sands China 4.875% 18/6/2030	453,570	0.01
USD 1,003,000	Sands China 5.65% 8/8/2028	944,600	0.01
USD 1,024,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	1,075,966	0.02
USD 1,006,000	Seagate HDD Cayman 8.5% 15/7/2031	1,054,596	0.01
USD 2,485,000	Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	2,755,082	0.04
USD 300,000	Seazen 6% 12/8/2024*	159,000	0.00
USD 2,365,069	Shackleton 2013-III CLO 6.69% 15/7/2030	2,344,881	0.03
USD 220,000	Shelf Drilling 8.875% 15/11/2024	220,825	0.00
USD 2,184,000	Shelf Drilling North Sea 10.25% 31/10/2025	2,192,996	0.03
USD 1,938,938	Silver Creek CLO 6.828% 20/7/2030	1,937,080	0.03
USD 750,000	Silver Creek CLO 8.938% 20/7/2030	747,179	0.01
USD 309,430	Steele Creek CLO 2017-1 6.82% 15/10/2030	307,837	0.00
USD 2,213,000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	1,034,299	0.01
USD 410,000	Strata CLO I 12.65% 15/1/2031	387,366	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 7.57% 15/1/2034	485,012	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 11.72% 15/1/2034	477,102	0.01
USD 237,976	Tiaa CLO III 6.72% 16/1/2031	237,490	0.00
USD 750,000	Tiaa CLO III 7.07% 16/1/2031	739,810	0.01
USD 2,486,619	TICP CLO IX 6.728% 20/1/2031	2,480,484	0.03
USD 500,000	TICP CLO XI 6.768% 20/10/2031	499,244	0.01
GBP 800,000	Trafford Centre Finance 6.128% 28/7/2035	725,096	0.01
USD 611,800	Transocean 8.75% 15/2/2030	628,715	0.01
USD 609,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	626,510	0.01
USD 351,000	TRESTLES CLO II 7.283% 25/7/2031	349,399	0.01
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 5.949% 3/3/2039	14,799	0.00
USD 950,000	TRINITAS CLO IV 6.972% 18/10/2031	932,489	0.01
USD 590,000	Trinitas CLO XIV 7.613% 25/1/2034	583,220	0.01
USD 625,000	Trinitas CLO XIV 8.613% 25/1/2034	623,716	0.01
USD 1,769,440	Voya CLO 2013-2 6.583% 25/4/2031	1,757,945	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 1,040,000	Voya CLO 2016-1 8.238% 20/1/2031	911,010	0.01
USD 2,925,567	Voya CLO 2017-4 6.7% 15/10/2030	2,915,728	0.04
USD 234,000	Wynn Macau 5.125% 15/12/2029	191,720	0.00
USD 280,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026	262,809	0.00
USD 200,000	Wynn Macau 5.5% 1/10/2027	179,360	0.00
USD 1,296,000	Wynn Macau 5.625% 26/8/2028	1,138,478	0.02
		242,463,160	3.36
チリ			
USD 2,341,000	Chile Government International Bond 4.34% 7/3/2042	2,013,330	0.03
USD 1,711,000	Empresa Nacional del Petroleo 3.75% 5/8/2026	1,609,598	0.02
USD 840,000	Empresa Nacional del Petroleo 6.15% 10/5/2033	831,457	0.01
USD 1,446,000	Engie Energia Chile 3.4% 28/1/2030	1,211,994	0.02
		5,666,379	0.08
中国			
CNY 48,000,000	China Development Bank 3.3% 1/2/2024	6,619,531	0.09
コロンビア			
USD 4,713,000	Colombia Government International Bond 3.125% 15/4/2031	3,634,901	0.05
EUR 566,000	Colombia Government International Bond 3.875% 22/3/2026	591,515	0.01
USD 1,869,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,724,825	0.02
USD 2,031,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051	1,220,631	0.02
USD 3,126,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	3,016,871	0.04
USD 3,349,000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	3,462,063	0.05
COP 32,940,600,000	Colombian TES 5.75% 3/11/2027	6,905,542	0.10
COP 29,709,900,000	Colombian TES 6.25% 26/11/2025	6,769,683	0.09
COP 39,895,000,000	Colombian TES 7.5% 26/8/2026	9,154,335	0.13
USD 2,666,000	Ecopetrol 4.125% 16/1/2025	2,583,221	0.04
USD 1,440,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	1,007,129	0.01
USD 5,301,000	Ecopetrol 6.875% 29/4/2030	4,931,255	0.07
USD 3,648,000	Ecopetrol 8.875% 13/1/2033*	3,693,600	0.05
USD 1,024,000	Oleoducto Central 4% 14/7/2027*	917,104	0.01
USD 1,343,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029	1,132,821	0.01
USD 1,930,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024	1,908,780	0.03
		52,654,276	0.73
コスタリカ			
USD 2,140,000	Costa Rica Government International Bond 6.125% 19/2/2031	2,139,272	0.03
USD 1,069,000	Costa Rica Government International Bond 6.55% 3/4/2034	1,078,573	0.01
		3,217,845	0.04
コートジボワール			
EUR 346,000	Ivory Coast Government International Bond 4.875% 30/1/2032*	290,404	0.00
EUR 687,000	Ivory Coast Government International Bond 5.875% 17/10/2031*	624,923	0.01
USD 2,984,000	Ivory Coast Government International Bond 6.125% 15/6/2033*	2,558,825	0.04
USD 4,291,000	Ivory Coast Government International Bond 6.375% 3/3/2028	4,066,967	0.06
EUR 383,000	Ivory Coast Government International Bond 6.625% 22/3/2048	291,352	0.00
EUR 345,000	Ivory Coast Government International Bond 6.875% 17/10/2040*	282,509	0.00
		8,114,980	0.11
キプロス			
EUR 725,000	Bank of Cyprus 2.5% 24/6/2027	701,791	0.01
チェコ共和国			
CZK 155,210,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	6,406,032	0.09
CZK 34,780,000	Czech Republic Government Bond 4.2% 4/12/2036	1,537,977	0.02
CZK 238,490,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	11,176,417	0.16
		19,120,426	0.27

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
デンマーク			
GBP 1,600,000	Danske Bank 2.25% 14/1/2028	1,750,034	0.02
ドミニカ共和国			
USD 1,116,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6.75% 30/3/2029	1,091,548	0.02
USD 2,821,000	Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030	2,466,852	0.04
USD 4,473,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	3,794,625	0.05
USD 4,073,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	3,455,289	0.05
USD 298,000	Dominican Republic International Bond 5.3% 21/1/2041	233,905	0.00
USD 2,471,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	2,419,072	0.03
USD 1,760,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	1,774,238	0.03
USD 895,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031*	889,303	0.01
		16,124,832	0.23
エジプト			
EUR 581,000	Egypt Government International Bond 6.375% 11/4/2031	346,571	0.01
USD 1,923,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	974,836	0.01
USD 1,447,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	733,535	0.01
USD 5,820,000	Egypt Government International Bond 7.625% 29/5/2032*	3,353,688	0.05
USD 659,000	Egypt Government International Bond 7.903% 21/2/2048	337,052	0.00
USD 632,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	336,885	0.00
USD 986,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	525,582	0.01
		6,608,149	0.09
エルサルバドル			
USD 1,270,000	El Salvador Government International Bond 7.65% 15/6/2035	901,090	0.01
フィンランド			
EUR 1,859,000	Ahlstrom 3 Oy 3.625% 4/2/2028	1,690,879	0.02
USD 600,000	Ahlstrom 3 Oy 4.875% 4/2/2028	500,548	0.01
EUR 1,525,000	Finnair 4.25% 19/5/2025	1,570,764	0.02
EUR 200,000	SBB Treasury 0.75% 14/12/2028*	121,742	0.00
EUR 700,000	SBB Treasury 1.125% 26/11/2029	421,615	0.01
		4,305,548	0.06
フランス			
EUR 700,000	Accor 4.375% 31/1/2024	751,354	0.01
EUR 23,845	Air France-KLM 0.125% 25/3/2026	453,665	0.01
EUR 1,700,000	Air France-KLM 7.25% 31/5/2026*	1,893,007	0.03
EUR 400,000	Air France-KLM 8.125% 31/5/2028	452,633	0.01
EUR 970,000	Altice France 2.125% 15/2/2025	976,098	0.01
EUR 2,187,000	Altice France 2.5% 15/1/2025	2,200,464	0.03
EUR 585,000	Altice France 4.25% 15/10/2029	441,407	0.01
EUR 2,896,000	Altice France 5.875% 1/2/2027	2,546,781	0.04
EUR 700,000	Arkema 1.5% 21/10/2025	684,590	0.01
EUR 1,700,000	Atos 0% 6/11/2024	1,555,158	0.02
EUR 1,000,000	Atos 1.75% 7/5/2025*	894,266	0.01
EUR 2,000,000	AXA 4.25% 10/3/2043	2,002,917	0.03
EUR 1,150,000	AXA 5.5% 11/7/2043	1,250,014	0.02
EUR 1,500,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.75% 1/2/2033	1,575,699	0.02
EUR 2,100,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4% 21/11/2029	2,275,810	0.03
EUR 4,200,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4.125% 14/6/2033*	4,529,179	0.06
GBP 4,500,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4.875% 25/9/2025	5,562,942	0.08
EUR 1,900,000	BNP Paribas 0.5% 1/9/2028	1,763,367	0.02
EUR 1,500,000	BNP Paribas 0.875% 11/7/2030	1,325,735	0.02
EUR 800,000	BNP Paribas 0.875% 31/8/2033	693,413	0.01
GBP 1,000,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027	1,060,032	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	フランス(続き)		
EUR 2,000,000	BNP Paribas 2.1% 7/4/2032	1,813,778	0.03
EUR 2,000,000	BNP Paribas 2.75% 25/7/2028*	2,039,499	0.03
GBP 2,000,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	2,376,638	0.03
EUR 3,800,000	BNP Paribas 3.625% 1/9/2029	3,955,640	0.05
EUR 2,900,000	BNP Paribas 3.875% 23/2/2029*	3,124,896	0.04
EUR 3,500,000	BNP Paribas 4.125% 24/5/2033*	3,804,808	0.05
USD 400,000	BNP Paribas 6.625% 25/3/2024	396,153	0.01
USD 400,000	BNP Paribas 7.375% 19/8/2025*	391,684	0.01
EUR 2,800,000	BPCE 4% 29/11/2032	2,992,552	0.04
EUR 3,900,000	BPCE 4.75% 14/6/2034	4,240,701	0.06
EUR 4,800,000	BPCE 5.125% 25/1/2035	5,071,242	0.07
EUR 700,000	Burger King France 8.475% 1/11/2026	763,715	0.01
EUR 2,300,000	Casino Guichard Perrachon 3.992% 31/1/2024	30,319	0.00
GBP 1,800,000	Clariane 4.125% 15/3/2024	1,765,063	0.02
EUR 3,500,000	Credit Agricole 2.5% 29/8/2029	3,509,506	0.05
EUR 4,000,000	Credit Agricole 3.875% 20/4/2031	4,300,687	0.06
GBP 2,300,000	Credit Agricole 4.875% 23/10/2029	2,744,056	0.04
GBP 4,600,000	Credit Agricole 5.75% 29/11/2027	5,710,585	0.08
GBP 600,000	Credit Agricole 7.375% 18/12/2023	760,293	0.01
EUR 1,511,000	Crown European 3.375% 15/5/2025	1,610,123	0.02
EUR 2,057,000	Crown European 5% 15/5/2028	2,246,562	0.03
EUR 1,600,000	Electricite de France 2.875% 15/12/2026	1,523,263	0.02
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/9/2027	185,743	0.00
EUR 1,800,000	Electricite de France 3.375% 15/6/2030	1,521,310	0.02
EUR 1,200,000	Electricite de France 4% 4/7/2024	1,266,456	0.02
EUR 400,000	Electricite de France 5% 22/1/2026	415,968	0.01
EUR 2,200,000	Electricite de France 5.375% 29/1/2025	2,330,191	0.03
GBP 200,000	Electricite de France 5.875% 22/1/2029	213,726	0.01
GBP 2,600,000	Electricite de France 6% 29/1/2026	3,060,234	0.04
GBP 1,800,000	Electricite de France 6.125% 2/6/2034	2,215,466	0.03
EUR 1,400,000	Electricite de France 7.5% 6/9/2028	1,562,213	0.02
EUR 800,000	Eutelsat 1.5% 13/10/2028*	663,148	0.01
EUR 300,000	Eutelsat 2% 2/10/2025	298,873	0.01
EUR 77,682	FCT Autonomia 2019 4.842% 25/9/2035	83,997	0.00
EUR 46,679	FCT Autonomia 2019 5.242% 25/9/2035	50,444	0.00
EUR 93,078	FCT Autonomia 2019 6.342% 25/9/2035	100,441	0.00
EUR 77,682	FCT Autonomia 2019 7.342% 25/9/2035	83,647	0.00
EUR 178,235	FCT Noria 2021 4.342% 25/10/2049	191,701	0.00
EUR 178,235	FCT Noria 2021 4.742% 25/10/2049	190,208	0.00
EUR 653,528	FCT Noria 2021 5.142% 25/10/2049	691,288	0.01
EUR 196,538	FCT Pixel 2021 5.576% 25/2/2038	209,917	0.01
EUR 1,864,000	Forvia 2.75% 15/2/2027	1,846,395	0.02
EUR 2,203,000	Forvia 3.75% 15/6/2028*	2,188,849	0.03
EUR 450,000	Forvia 7.25% 15/6/2026	508,252	0.01
EUR 993,375	Ginkgo Sales Finance 2022 4.342% 25/11/2049	1,079,103	0.02
EUR 2,368,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026*	2,483,778	0.03
EUR 675,000	Goldstory 8.97% 1/3/2026*	742,210	0.01
EUR 300,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4.734% 27/5/2061	320,133	0.00
EUR 4,138,000	Holding d' Infrastructures des Metiers de l' Environnement 0.625% 16/9/2028	3,724,290	0.05
EUR 400,000	iliad 1.5% 14/10/2024*	420,525	0.01
EUR 2,200,000	iliad 5.375% 14/6/2027	2,369,049	0.03
EUR 1,600,000	iliad 5.625% 15/2/2030*	1,690,779	0.02
EUR 920,000	iliad 5.125% 15/10/2026	961,403	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR 100,000	Iliad 5.625% 15/10/2028	102,415	0.00
EUR 420,000	La Financiere Atalian 4% 15/5/2024	338,299	0.01
EUR 1,346,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	1,003,280	0.01
GBP 1,640,000	La Financiere Atalian 6.625% 15/5/2025	1,434,473	0.02
EUR 400,000	L' Oreal 0.375% 29/3/2024	425,509	0.01
EUR 100,000	Loxam 3.25% 14/1/2025	107,259	0.00
EUR 2,857,000	Loxam 3.75% 15/7/2026	2,920,557	0.04
EUR 203,000	Loxam 4.5% 15/2/2027	209,698	0.00
EUR 400,000	Loxam 4.5% 15/4/2027	391,318	0.01
EUR 200,000	Loxam 5.75% 15/7/2027*	201,648	0.00
EUR 421,000	Loxam 6.375% 15/5/2028*	453,603	0.01
EUR 571,000	Novafives 5% 15/6/2025	585,734	0.01
EUR 1,800,000	Orano 2.75% 8/3/2028*	1,797,061	0.02
EUR 1,440,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026	1,443,054	0.02
EUR 5,200,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	5,310,264	0.07
EUR 1,351,000	RCI Banque 4.125% 1/12/2025	1,461,604	0.02
EUR 850,000	RCI Banque 4.625% 13/7/2026	927,884	0.01
EUR 500,000	Renault 2.375% 25/5/2026	509,965	0.01
EUR 300,000	Societe Generale 1.125% 21/4/2026	308,708	0.00
GBP 1,000,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024	1,208,878	0.02
EUR 6,500,000	Societe Generale 4.25% 6/12/2030	6,845,869	0.10
EUR 800,000	Societe Generale 5.625% 2/6/2033	860,304	0.01
USD 900,000	Societe Generale 7.375% 4/10/2023	900,384	0.01
USD 950,000	Societe Generale 7.875% 18/12/2023	947,519	0.01
USD 749,000	Societe Generale 8% 29/9/2025*	736,695	0.01
USD 960,000	Societe Generale 9.375% 22/11/2027	957,156	0.01
EUR 1,300,000	Solvay Finance SACA 5.425% 12/11/2023	1,414,145	0.02
EUR 7,572,000	TotalEnergies 1.75% 4/4/2024	8,005,718	0.11
EUR 2,918,000	TotalEnergies 2.625% 26/2/2025	3,018,697	0.04
GBP 1,000,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	1,145,882	0.02
EUR 600,000	Unibail-Rodamco-Westfield 7.25% 3/7/2028	585,252	0.01
EUR 1,592,000	Vallourec 8.5% 30/6/2026	1,727,043	0.03
EUR 2,700,000	Veolia Environnement 2.875% 19/1/2024	2,900,058	0.04
EUR 7,815	Worldline 0% 30/7/2025	926,000	0.01
		175,841,964	2.43
ドイツ			
USD 3,800,000	Allianz 3.2% 30/10/2027*	2,890,731	0.04
EUR 1,000,000	BASF 4.5% 8/3/2035	1,112,085	0.02
EUR 900,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	926,486	0.01
EUR 14,100,000	Bayer 2.375% 12/11/2029	14,283,152	0.20
EUR 750,000	Bayer 3.75% 1/7/2074	796,174	0.01
EUR 3,380,000	Bayer 4% 26/8/2026*	3,708,242	0.05
EUR 5,100,000	Bayer 4.5% 25/3/2082*	5,262,028	0.07
EUR 1,208,000	Bayer 4.625% 26/5/2033	1,328,222	0.02
EUR 17,920,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	18,299,988	0.25
EUR 1,159,000	Cheplapharm Arzneimittel 3.5% 11/2/2027	1,144,444	0.02
EUR 3,431,000	Cheplapharm Arzneimittel 4.375% 15/1/2028	3,401,070	0.05
EUR 600,000	Commerzbank 5.125% 18/1/2030*	646,309	0.01
EUR 1,000,000	Commerzbank 6.125% 9/10/2025	985,402	0.01
GBP 1,600,000	Commerzbank 8.625% 28/2/2033*	2,003,577	0.03
EUR 3,100,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024*	2,121,959	0.03
EUR 6,900,000	Deutsche Bahn Finance 0.95% 22/1/2025	6,910,121	0.10
EUR 800,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	779,164	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ドイツ(続き)			
EUR 2,200,000	Deutsche Bank 4.5% 30/11/2026	1,775,958	0.03
EUR 200,000	Deutsche Bank 6.75% 30/10/2028*	179,558	0.00
EUR 11,900,641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	15,754,622	0.22
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 1.625% 16/11/2023	538,480	0.01
EUR 800,000	Deutsche Lufthansa 2.875% 16/5/2027	800,321	0.01
EUR 800,000	Deutsche Lufthansa 3.5% 14/7/2029	789,280	0.01
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 3.75% 11/2/2028	509,767	0.01
EUR 900,000	DIC Asset 2.25% 22/9/2026	535,827	0.01
EUR 2,100,000	E.ON 3.5% 26/10/2037	2,119,001	0.03
EUR 1,300,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.125% 5/11/2079	1,339,955	0.02
EUR 5,500,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 2.125% 31/8/2081	4,281,910	0.06
EUR 400,000	FCT Autonoria DE 2023 4.792% 26/1/2043	433,280	0.01
EUR 300,000	FCT Autonoria DE 2023 5.742% 26/1/2043	324,646	0.00
EUR 100,000	FCT Autonoria DE 2023 6.692% 26/1/2043	108,076	0.00
EUR 100,000	FCT Autonoria DE 2023 9.142% 26/1/2043	108,176	0.00
EUR 2,700,000	Fresenius 4.25% 28/5/2026*	2,930,640	0.04
EUR 1,373,000	Gruenenthal 3.625% 15/11/2026*	1,415,543	0.02
EUR 1,006,000	Gruenenthal 4.125% 15/5/2028	1,021,476	0.01
EUR 181,000	Gruenenthal 6.75% 15/5/2030*	202,168	0.00
EUR 5,100,000	Heidelberg Materials 3.75% 31/5/2032	5,236,115	0.07
EUR 1,851,000	HT Troplast 9.375% 15/7/2028	2,015,483	0.03
EUR 969,715	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027	956,442	0.01
USD 200,000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	191,031	0.00
EUR 346,000	IHO Verwaltungs 8.75% 15/5/2028	392,111	0.01
EUR 1,144,000	PCF 4.75% 15/4/2026*	967,901	0.01
EUR 1,156,000	PCF 8.413% 15/4/2026*	1,096,137	0.01
EUR 155,815	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.388% 15/9/2030	168,277	0.00
EUR 311,630	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.588% 15/9/2030	332,749	0.01
EUR 77,908	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.988% 15/9/2030	82,526	0.00
EUR 2,415,000	Renk/Frankfurt am Main 5.75% 15/7/2025	2,600,570	0.04
EUR 3,200,000	Robert Bosch 4.375% 2/6/2043*	3,470,853	0.05
EUR 1,851,591	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6% 30/7/2026	1,975,969	0.03
EUR 3,377,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH 2% 15/7/2025	3,533,756	0.05
EUR 3,414,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025*	2,376,673	0.03
EUR 2,719,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	2,693,732	0.04
EUR 1,652,000	TK Elevator Midco 8.413% 15/7/2027*	1,792,159	0.02
EUR 900,000	Volkswagen Bank 4.25% 7/1/2026	973,199	0.01
EUR 4,211,000	Volkswagen Leasing 0.625% 19/7/2029	3,672,165	0.05
EUR 400,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	386,024	0.01
EUR 400,000	ZF Finance 2.25% 3/5/2028*	371,984	0.00
EUR 800,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	789,636	0.01
EUR 2,100,000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	2,179,366	0.03
EUR 2,100,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	2,294,311	0.03
		142,317,007	1.97
ガーナ			
USD 446,000	Ghana Government International Bond 6.375% 11/2/2027	195,102	0.00
USD 1,935,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/5/2029	838,513	0.01
USD 446,000	Ghana Government International Bond 8.625% 7/4/2034	197,081	0.01
USD 446,000	Ghana Government International Bond 8.95% 26/3/2051	191,780	0.00
		1,422,476	0.02
グアテマラ			
USD 2,028,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	1,640,824	0.02
USD 1,140,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	898,434	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
グアテマラ(続き)			
USD 1,118,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	1,065,208	0.02
USD 1,280,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	1,219,558	0.02
USD 3,003,000	Guatemala Government Bond 6.6% 13/6/2036*	3,016,514	0.04
		7,840,538	0.11
香港			
USD 400,000	AIA 4.95% 4/4/2033	392,326	0.01
ハンガリー			
USD 2,270,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	2,222,148	0.03
USD 330,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/3/2024	329,436	0.00
USD 1,375,000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 6.5% 29/6/2028	1,385,656	0.02
		3,937,240	0.05
インド			
USD 500,000	Export-Import Bank of India 3.875% 12/3/2024	494,985	0.01
USD 375,000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 2/2/2026	357,981	0.00
USD 400,000	Oil India 5.125% 4/2/2029	391,502	0.01
USD 400,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	372,232	0.01
USD 200,000	REC 5.625% 11/4/2028	197,587	0.00
		1,814,287	0.03
インドネシア			
USD 300,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026	279,398	0.01
USD 2,655,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027	2,561,809	0.04
USD 2,624,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	2,515,507	0.03
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.55% 11/1/2028*	196,037	0.00
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.85% 11/1/2033*	196,237	0.00
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 5.65% 11/1/2053	204,655	0.00
USD 1,965,000	Indonesia Government International Bond 6.75% 15/1/2044*	2,253,187	0.03
IDR 50,682,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15/8/2028	3,356,060	0.05
IDR 113,046,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	7,752,891	0.11
IDR 161,028,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	11,223,323	0.16
IDR 36,687,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2029	2,629,275	0.04
IDR 97,879,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	7,303,521	0.10
IDR 23,950,000,000	Indonesia Treasury Bond 9% 15/3/2029	1,767,551	0.02
USD 200,000	Pakuwon Jati 4.875% 29/4/2028	180,851	0.00
USD 510,000	Pertamina Geothermal Energy 5.15% 27/4/2028	504,262	0.01
USD 2,764,000	Pertamina Persero 3.65% 30/7/2029*	2,532,077	0.03
USD 600,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.8% 23/6/2050*	463,341	0.01
USD 1,432,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027*	1,401,527	0.02
		47,321,509	0.66
国際機関(International)			
EUR 300,000	European Union 2.5% 4/10/2052	270,680	0.00
EUR 662,000	European Union 2.625% 4/2/2048	635,254	0.01
EUR 1,122,400	European Union 3% 4/3/2053	1,123,633	0.02
		2,029,567	0.03
アイルランド			
USD 1,289,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 5.75% 6/6/2028	1,276,737	0.02
GBP 899,664	Agora UK 2021 6.37% 22/7/2031	1,097,692	0.02
EUR 1,098,000	AIB 5.25% 9/10/2024	1,120,389	0.01
EUR 2,300,000	AIB 6.25% 23/6/2025*	2,378,092	0.03
EUR 2,680,000	Alme Loan Funding V 9.073% 15/7/2031	2,837,414	0.04
EUR 838,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 5.263% 15/4/2034	883,577	0.01
EUR 1,000,000	Aqueduct European CLO 5-2020 5.705% 20/4/2034	1,017,947	0.01
EUR 1,023,000	Aqueduct European CLO 7-2022 5.247% 15/3/2036	1,118,324	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 2,490,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	2,412,384	0.03
GBP 2,150,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	2,152,000	0.03
USD 2,271,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 30/4/2025	2,219,904	0.03
EUR 1,200,000	Ares European CLO VII 5.163% 15/10/2030	1,276,480	0.02
EUR 2,150,000	Ares European CLO X 6.463% 15/10/2031	2,217,313	0.03
EUR 858,000	Ares European CLO XII 5.405% 20/4/2032	912,527	0.01
EUR 875,000	Ares European CLO XII 6.705% 20/4/2032	906,676	0.01
EUR 2,100,000	Armada Euro CLO III 6.963% 15/7/2031	2,205,857	0.03
USD 1,889,000	ASG Finance Designated Activity 7.875% 3/12/2024	1,843,475	0.03
GBP 1,541,946	Atom Mortgage 7.07% 22/7/2031	1,644,755	0.02
EUR 499,059	Aurium CLO IV 4.393% 16/1/2031	533,196	0.01
EUR 900,000	Aurium CLO VIII 4.418% 23/6/2034	951,424	0.01
EUR 550,000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	250,341	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 8.361% 12/1/2031	154,899	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 10.011% 12/1/2031	143,350	0.00
EUR 380,000	Avoca CLO XV 7.793% 15/4/2031	366,411	0.01
EUR 350,000	Avoca CLO XVIII 5.413% 15/4/2031	369,570	0.01
EUR 290,000	Avoca CLO XXII 4.963% 15/4/2035	302,146	0.00
EUR 1,000,000	Avoca CLO XXIII 6.713% 15/4/2034	1,024,431	0.01
EUR 1,459,000	Bank of Ireland 7.5% 19/5/2025	1,554,490	0.02
EUR 250,000	Bluemountain Euro 2021-2 CLO 5.413% 15/10/2035	264,359	0.00
EUR 900,000	BlueMountain Fuji CLO III 6.563% 15/1/2031	927,117	0.01
EUR 800,000	BlueMountain Fuji Eur CLO IV 10.036% 25/2/2034	811,446	0.01
EUR 300,000	Bridgepoint CLO I 7.913% 15/1/2034	322,514	0.00
EUR 2,300,000	Bridgepoint CLO IV 5.905% 20/1/2037	2,504,694	0.03
EUR 582,000	Capital Four CLO III 9.723% 15/10/2034	584,098	0.01
EUR 1,517,000	Capital Four CLO V 5.331% 25/4/2036	1,648,215	0.02
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO I 9.523% 15/7/2032	401,327	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO II 5.263% 15/4/2033	423,559	0.01
EUR 500,000	CIFC European Funding CLO III 6.163% 15/1/2034	520,869	0.01
EUR 1,500,000	CIFC European Funding CLO IV 4.61% 18/8/2035	1,583,059	0.02
EUR 1,580,000	Clontarf Park CLO 6.772% 5/8/2030	1,713,609	0.02
EUR 539,000	Contego CLO IX 9.708% 24/1/2034	540,948	0.01
EUR 2,400,000	Contego CLO VI 4.453% 15/4/2034	2,540,630	0.04
EUR 800,000	Contego CLO VIII 9.781% 25/1/2034	803,978	0.01
EUR 2,800,000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2031	3,016,973	0.04
EUR 1,750,000	CVC Cordatus Loan Fund 6.548% 20/5/2036	1,898,623	0.03
EUR 330,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 5.116% 22/2/2034	342,950	0.01
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund V 5.146% 21/7/2030	426,751	0.01
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund XIX 7.368% 23/12/2033	423,599	0.01
EUR 250,000	Euro-Galaxy III CLO 6.048% 24/4/2034	264,467	0.00
EUR 510,000	Euro-Galaxy III CLO 6.948% 24/4/2034	534,839	0.01
EUR 1,510,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 7.263% 15/10/2034	1,529,576	0.02
EUR 2,600,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 5.678% 15/8/2036	2,831,173	0.04
EUR 149,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2023-1 9.678% 15/8/2036	165,337	0.00
GBP 456,719	Frost CMBS 2021-1 6.568% 20/11/2033	565,930	0.01
EUR 550,000	Glencore Capital Finance 1.25% 1/3/2033*	434,743	0.01
EUR 700,000	Harvest CLO XVIII 4.863% 15/10/2030	738,958	0.01
EUR 390,000	Harvest CLO XXIII 6.705% 20/10/2032	397,544	0.01
EUR 714,793	Haus European Loan Conduit No 39 4.364% 28/7/2051	730,768	0.01
EUR 210,939	Haus European Loan Conduit No 39 4.814% 28/7/2051	204,849	0.00
EUR 840,757	Haus European Loan Conduit No 39 5.114% 28/7/2051	752,266	0.01
EUR 130,000	Henley CLO IV 5.071% 25/4/2034	136,311	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 250,000	Henley CLO IV 6.721% 25/4/2034	255,063	0.00
EUR 450,000	Invesco Euro CLO III 5.413% 15/7/2032	471,193	0.01
EUR 197,049	Invesco Euro CLO III 11.733% 15/7/2032	192,574	0.00
EUR 625,000	Invesco Euro CLO IV 5.363% 15/4/2033	657,454	0.01
EUR 1,600,000	Invesco Euro CLO IX 4.756% 20/4/2036	1,731,402	0.02
GBP 1,816,000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 8.636% 17/8/2033	2,302,628	0.03
GBP 1,569,000	Last Mile Logistics CMBS 2023-1 UK 9.636% 17/8/2033	1,989,689	0.03
EUR 565,547	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.537% 17/8/2033	588,433	0.01
EUR 344,632	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.837% 17/8/2033	347,941	0.01
EUR 1,331,397	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.187% 17/8/2033	1,352,190	0.02
EUR 1,030,949	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.687% 17/8/2033	1,013,895	0.01
EUR 660,864	Last Mile PE 2021 4.687% 17/8/2031	692,361	0.01
EUR 938,803	Last Mile PE 2021 4.987% 17/8/2031	957,184	0.01
EUR 1,060,777	Last Mile PE 2021 5.387% 17/8/2031	1,060,608	0.01
EUR 589,438	Lt Autorahoitus IV 4.313% 18/7/2033	640,677	0.01
EUR 1,200,000	Lt Autorahoitus IV 5.673% 18/7/2033	1,306,062	0.02
EUR 1,250,000	Madison Park Euro Funding XVI 6.863% 25/5/2034	1,276,742	0.02
EUR 1,050,000	Man GLG Euro CLO VI 7.163% 15/10/2032	1,084,216	0.02
EUR 1,606,000	Margay CLO I 5.8% 15/7/2036	1,756,153	0.02
EUR 142,000	Margay CLO I 10.25% 15/7/2036	156,293	0.00
EUR 150,000	Marino Park CLO 9.333% 16/1/2034	151,729	0.00
EUR 188,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 9.183% 17/4/2034	190,572	0.00
EUR 699,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 9.723% 15/4/2034	703,731	0.01
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 6.326% 25/11/2033	262,718	0.00
EUR 425,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5.546% 21/1/2035	449,611	0.01
EUR 450,000	OAK Hill European Credit Partners VI 4.905% 20/1/2032	475,807	0.01
EUR 800,000	OCP Euro CLO 2017-2 5.013% 15/1/2032	850,928	0.01
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 6.005% 20/4/2033	262,012	0.00
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 7.005% 20/4/2033	258,907	0.00
EUR 2,500,000	Palmer Square European CLO 2023-1 5.75% 15/7/2036	2,721,810	0.04
EUR 300,000	Palmer Square European CLO 2023-1 10.05% 15/7/2036	331,153	0.00
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 5.687% 17/11/2032	1,198,849	0.02
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 6.287% 17/11/2032	1,431,212	0.02
EUR 650,000	Penta CLO 11 6.231% 15/11/2034	701,598	0.01
EUR 470,000	Penta CLO 11 8.581% 15/11/2034	508,924	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 5.421% 25/7/2034	526,490	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 6.021% 25/7/2034	522,325	0.01
USD 1,193,387	Prodigy Finance CM2021-1 6.679% 25/7/2051	1,185,312	0.02
USD 488,586	Prodigy Finance CM2021-1 7.929% 25/7/2051	484,539	0.01
USD 286,769	Prodigy Finance CM2021-1 9.179% 25/7/2051	285,368	0.00
USD 433,454	Prodigy Finance CM2021-1 11.329% 25/7/2051	435,507	0.01
EUR 439,075	River Green Finance 2020 4.748% 22/1/2032	451,811	0.01
EUR 318,450	River Green Finance 2020 5.098% 22/1/2032	327,269	0.00
EUR 2,657,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 5.397% 20/12/2031	2,847,443	0.04
EUR 710,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 6.017% 20/12/2031	752,236	0.01
EUR 2,480,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 5.305% 20/1/2033	2,607,990	0.04
EUR 976,000	RRE 5 Loan Management 5.413% 15/1/2037	1,032,680	0.01
EUR 430,000	RRE 9 Loan Management 5.363% 15/10/2036	453,860	0.01
GBP 2,746,094	Scorpio European Loan Conduit No. 34 7.1% 17/5/2029	3,406,833	0.05
USD 1,400,000	Shire Acquisitions Investments Ireland 3.2% 23/9/2026	1,313,689	0.02
EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 5.963% 15/4/2033	262,397	0.00
EUR 1,350,000	St Paul's CLO XII 5.263% 15/4/2033	1,418,855	0.02
EUR 650,000	Sutton Park CLO 5.481% 15/11/2031	691,402	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 750,000	Sutton Park CLO 6.131% 15/11/2031	786,582	0.01
GBP 3,202,718	Taurus 2019-2 UK 7.138% 17/11/2029	3,942,673	0.05
GBP 1,885,348	Taurus 2019-2 UK 7.438% 17/11/2029	2,287,821	0.03
GBP 879,540	Taurus 2021-1 UK 6.519% 17/5/2031	1,053,234	0.01
GBP 536,063	Taurus 2021-1 UK 6.869% 17/5/2031	629,248	0.01
GBP 546,983	Taurus 2021-1 UK 7.819% 17/5/2031	665,216	0.01
GBP 967,481	Taurus 2021-4 UK 6.169% 17/8/2031	1,187,517	0.02
GBP 485,148	Taurus 2021-4 UK 6.719% 17/8/2031	581,222	0.01
GBP 5,203,376	Taurus 2021-4 UK 6.969% 17/8/2031	6,083,787	0.08
GBP 1,725,126	Taurus 2021-4 UK 7.319% 17/8/2031	2,009,496	0.03
EUR 2,300,000	Tikehau CLO VII 5.705% 20/10/2035	2,501,127	0.03
GBP 557,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028*	580,618	0.01
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 5.333% 15/7/2035	263,215	0.00
EUR 500,000	Voya Euro CLO II 5.813% 15/7/2035	514,572	0.01
EUR 439,000	Voya Euro CLO III 5.313% 15/4/2033	463,401	0.01
		139,045,934	1.92
マン島			
USD 1,675,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	1,393,265	0.02
イスラエル			
USD 843,000	Bank Leumi Le-Israel 7.129% 18/7/2033	834,465	0.01
USD 2,702,000	Energian Israel Finance 8.5% 30/9/2033	2,739,152	0.04
USD 2,107,311	Leviathan Bond 6.75% 30/6/2030*	1,978,702	0.03
		5,552,319	0.08
イタリア			
EUR 1,343,000	A2A 4.5% 19/9/2030*	1,474,144	0.02
EUR 675,000	ASTM 1.5% 25/1/2030	598,251	0.01
EUR 500,000	ASTM 2.375% 25/11/2033*	423,389	0.01
EUR 221,997	AutoFlorence 2 4.387% 24/12/2044	236,897	0.01
EUR 286,314	AutoFlorence 2 4.787% 24/12/2044	302,025	0.01
EUR 153,531	AutoFlorence 2 5.987% 24/12/2044	163,282	0.00
EUR 1,755,000	AutoFlorence 3 4.592% 25/12/2046	1,910,885	0.03
EUR 143,000	AutoFlorence 3 5.992% 25/12/2046	155,494	0.00
EUR 186,000	AutoFlorence 3 6.992% 25/12/2046	202,450	0.00
EUR 130,000	AutoFlorence 3 8.992% 25/12/2046	141,778	0.00
EUR 7,389,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	7,812,195	0.11
EUR 1,127,000	Azzurra Aeroporti 2.625% 30/5/2027	1,105,253	0.01
EUR 1,858,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 6.75% 2/3/2026	2,025,444	0.03
EUR 1,435,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	1,393,422	0.02
EUR 2,900,000	Banco BPM 3.25% 14/1/2031	2,926,097	0.04
EUR 1,550,000	Banco BPM 3.375% 19/1/2032	1,494,580	0.02
EUR 294,000	Banco BPM 5% 14/9/2030	313,929	0.00
EUR 3,475,000	Banco BPM 6% 14/6/2028	3,794,747	0.05
EUR 137,000	Brignole 2021 4.437% 24/7/2036	147,670	0.00
EUR 100,000	Brignole 2021 5.237% 24/7/2036	106,634	0.00
EUR 1,900,000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024	2,010,255	0.03
EUR 5,978,852	Cassia 2022-1 5.883% 22/5/2034	6,213,634	0.08
EUR 2,857,839	Cassia 2022-1 6.883% 22/5/2034	2,865,208	0.04
EUR 700,000	Castor 8.776% 15/2/2029	718,322	0.01
EUR 602,000	Cedacri Mergeco 8.424% 15/5/2028	638,647	0.01
EUR 1,432,000	Cedacri Mergeco 9.281% 15/5/2028	1,530,438	0.02
EUR 949,000	doValue 3.375% 31/7/2026	882,090	0.01
EUR 1,125,000	Enel 6.375% 16/4/2028*	1,247,721	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR 2,491,000	Engineering - Ingegneria Informatica - 11.125% 15/5/2028	2,701,869	0.04
EUR 7,100,000	Eni 2.625% 13/10/2025	7,160,100	0.10
EUR 2,900,000	Eni 4.25% 19/5/2033	3,128,092	0.04
EUR 950,000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027*	1,111,901	0.02
EUR 1,190,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	1,155,876	0.02
EUR 2,592,000	Infrastrutture Wireless Italiane 1.625% 21/10/2028	2,480,229	0.03
EUR 765,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	802,847	0.01
USD 1,400,000	Intesa Sanpaolo 5.017% 26/6/2024	1,368,933	0.02
EUR 2,100,000	Intesa Sanpaolo 5.125% 29/8/2031	2,312,116	0.03
GBP 3,575,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030*	3,804,714	0.05
EUR 400,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 4/3/2029	436,148	0.01
EUR 810,335	Koromo Italy 4.432% 26/2/2035	880,861	0.01
EUR 2,198,000	Lottomatica 7.6% 1/6/2028	2,405,063	0.03
EUR 300,000	Lottomatica 9.75% 30/9/2027*	353,263	0.01
EUR 4,400,000	Nexi 0% 24/2/2028	3,734,916	0.05
EUR 925,000	Poste Italiane 2.625% 24/3/2029	785,297	0.01
EUR 196,069	Progetto Quinto 4.23% 27/10/2036	212,475	0.00
EUR 518,311	Red & Black Auto Italy 6.482% 28/12/2031	548,876	0.01
EUR 3,703,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026*	3,739,196	0.05
EUR 3,744,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029*	3,201,574	0.04
EUR 746,000	Telecom Italia 2.375% 12/10/2027	706,150	0.01
EUR 599,000	Telecom Italia 2.75% 15/4/2025	625,593	0.01
EUR 400,000	Telecom Italia 2.875% 28/1/2026	413,134	0.01
EUR 200,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	209,770	0.00
EUR 685,000	Telecom Italia 4% 11/4/2024	739,312	0.01
EUR 3,469,000	Telecom Italia 6.875% 15/2/2028	3,805,960	0.05
EUR 489,000	Telecom Italia 7.875% 31/7/2028	552,237	0.01
EUR 700,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032*	680,667	0.01
EUR 1,025,000	UniCredit 4.45% 16/2/2029	1,092,513	0.02
EUR 300,000	UniCredit 4.875% 20/2/2029	324,670	0.00
EUR 400,000	UniCredit 5.375% 3/6/2025*	405,770	0.01
USD 1,900,000	UniCredit 7.296% 2/4/2034*	1,817,907	0.03
EUR 1,000,000	UniCredit 7.5% 3/6/2026*	1,087,658	0.01
		97,620,568	1.35
ジャマイカ			
USD 553,557	Digicel International Finance/Digicel international 8% 31/12/2026	32,867	0.00
USD 1,386,646	Digicel International Finance/Digicel international 8.75% 25/5/2024	1,270,355	0.02
USD 843,566	Digicel International Finance/Digicel international 13% 31/12/2025	603,150	0.01
USD 715,000	Jamaica Government International Bond 6.75% 28/4/2028	739,564	0.01
		2,645,936	0.04
日本			
JPY 40,000,000	Daifuku 0% 14/9/2028	290,308	0.00
EUR 4,760,000	East Japan Railway 2.614% 8/9/2025	5,039,492	0.07
EUR 5,100,000	East Japan Railway 4.11% 22/2/2043	5,398,766	0.07
USD 3,000,000	Mizuho Financial 3.261% 22/5/2030	2,635,321	0.04
EUR 820,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026	844,901	0.01
EUR 1,280,000	Nissan Motor 3.201% 17/9/2028	1,268,487	0.02
USD 4,900,000	Rakuten 3.546% 27/11/2024*	4,538,625	0.06
USD 905,000	Rakuten 10.25% 30/11/2024	913,991	0.01
EUR 2,288,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	2,401,120	0.03
EUR 1,785,000	SoftBank 3.125% 19/9/2025*	1,840,996	0.03
EUR 1,815,000	SoftBank 3.875% 6/7/2032	1,542,744	0.02
USD 1,000,000	SoftBank 4% 6/7/2026*	916,250	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本(続き)			
EUR 400,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025	426,160	0.01
USD 300,000	SoftBank 4.75% 19/9/2024*	289,875	0.00
EUR 1,181,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025	1,256,969	0.02
USD 300,000	SoftBank 6% 30/7/2025	294,375	0.01
USD 2,487,000	Sumitomo Mitsui Financial 2.472% 14/1/2029	2,130,382	0.03
USD 4,085,000	Takeda Pharmaceutical 2.05% 31/3/2030	3,359,276	0.05
JPY 80,000,000	Tokyu 0% 29/9/2028	572,406	0.01
JPY 80,000,000	Tokyu 0% 30/9/2030	575,690	0.01
		36,536,134	0.51
ジャージー			
USD 1,500,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,427,890	0.02
USD 1,500,000	Aptiv / Aptiv 3.25% 1/3/2032	1,272,290	0.02
GBP 678,000	CPUK Finance 3.588% 28/8/2025	806,587	0.01
GBP 392,000	CPUK Finance 4.5% 28/8/2027*	434,237	0.01
GBP 457,000	CPUK Finance 4.875% 28/8/2025	554,151	0.01
GBP 4,551,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	5,313,895	0.07
GBP 1,600,000	Glencore Finance Europe 3.125% 26/3/2026	1,893,351	0.03
GBP 3,105,000	Heathrow Funding 2.625% 16/3/2028	3,289,841	0.04
GBP 327,000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5.844% 5/11/2031	414,866	0.01
GBP 1,469,898	Intu Jersey 2 2.875% 1/11/2022	334,968	0.00
GBP 861,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	999,831	0.01
USD 270,000	Pikes Peak CLO 12 14.087% 20/4/2036	271,027	0.00
		17,012,934	0.23
ヨルダン			
USD 978,000	Jordan Government International Bond 4.95% 7/7/2025	954,944	0.01
USD 3,176,000	Jordan Government International Bond 5.85% 7/7/2030	2,938,260	0.04
		3,893,204	0.05
ケニア			
USD 3,263,000	Republic of Kenya Government International Bond 8% 22/5/2032*	2,712,369	0.04
ルクセンブルグ			
EUR 4,918,000	Adler Financing 12.5% 30/6/2025	5,510,080	0.08
EUR 2,946,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028*	2,624,759	0.04
GBP 418,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028*	421,436	0.00
EUR 1,822,000	Altice Financing 2.25% 15/1/2025	1,892,757	0.03
EUR 100,000	Altice Financing 3% 15/1/2028	84,516	0.00
EUR 672,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029	557,595	0.01
EUR 400,000	Aroundtown 3.375% 23/9/2024	181,858	0.00
GBP 1,381,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2024	683,444	0.01
USD 2,307,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	23,070	0.00
USD 529,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	5,290	0.00
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 4.742% 25/9/2038	569,344	0.01
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 5.292% 25/9/2038	731,610	0.01
EUR 356,000	BL Consumer Credit 2021 6.492% 25/9/2038	380,109	0.00
EUR 1,070,000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	1,065,808	0.01
GBP 3,015,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028	3,377,451	0.05
EUR 1,626,000	Cirsa Finance International 4.75% 22/5/2025	1,745,827	0.02
EUR 771,000	Cirsa Finance International 7.875% 31/7/2028	842,189	0.01
EUR 896,000	Cirsa Finance International 8.185% 31/7/2028	971,377	0.01
USD 5,423,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	5,147,588	0.07
USD 363,000	CSN Resources 5.875% 8/4/2032	293,304	0.00
EUR 1,650,000	Cullinan Holdco Scsp 4.625% 15/10/2026*	1,501,353	0.02
EUR 800,000	Cullinan Holdco Scsp 8.413% 15/10/2026*	812,726	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
EUR 1,378,000	Dana Financing Luxembourg 8.5% 15/7/2031	1,533,298	0.02
USD 909,000	EIG Pearl 3.545% 31/8/2036*	757,365	0.01
USD 3,570,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	2,707,595	0.04
EUR 2,300,000	European TopSoho 4% 21/9/2021	1,921,438	0.03
EUR 400,000	FACT Master 4.582% 20/7/2028	430,436	0.00
EUR 4,449,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025	3,740,188	0.05
GBP 1,814,000	Garfunkelux Holdco 3 7.75% 1/11/2025*	1,755,900	0.03
EUR 1,759,883	Germany Compartment Consumer 2020-1 5.371% 14/11/2034	1,908,197	0.03
EUR 639,957	Germany Compartment Consumer 2020-1 6.121% 14/11/2034	691,021	0.01
EUR 2,111,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029*	1,234,505	0.01
USD 293,000	Kenbourne Invest 4.7% 22/1/2028	178,730	0.00
USD 4,035,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	3,396,502	0.05
USD 628,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	528,902	0.01
USD 1,079,000	Kernel 6.5% 17/10/2024	772,197	0.01
USD 875,000	Kernel 6.75% 27/10/2027	533,737	0.01
EUR 244,000	Kleopatra 2 6.5% 1/9/2026	166,567	0.00
EUR 1,056,330	LHMC Finco 2 7.25% 2/10/2025*	1,145,040	0.02
EUR 395,000	Lion/Polaris Lux 4 7.526% 1/7/2026	425,241	0.01
USD 1,832,979	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	1,190,410	0.02
USD 2,579,892	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	1,675,485	0.02
EUR 1,080,000	Medtronic Global 2.625% 15/10/2025	1,143,250	0.01
USD 2,221,000	Medtronic Global 4.25% 30/3/2028	2,156,401	0.03
USD 853,000	MHP Lux 6.25% 19/9/2029	472,895	0.01
USD 810,000	MHP Lux 6.95% 3/4/2026	474,401	0.01
USD 1,519,200	Millicom International Cellular 5.125% 15/1/2028	1,368,229	0.02
USD 1,412,100	Millicom International Cellular 6.625% 15/10/2026*	1,382,107	0.02
EUR 538,000	Monitchem HoldCo 3 8.75% 1/5/2028	578,725	0.01
USD 4,135,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026*	3,807,549	0.05
USD 548,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024	543,063	0.01
EUR 4,230,000	Rossini 6.75% 30/10/2025	4,629,475	0.06
EUR 400,000	Rossini 7.589% 30/10/2025*	435,037	0.01
EUR 12,651,000	SES 2.875% 27/5/2026	11,970,819	0.17
EUR 1,700,000	SES 5.625% 29/1/2024	1,845,698	0.02
EUR 1,200,000	Stena International 7.25% 15/2/2028*	1,346,897	0.02
EUR 3,918,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026*	3,864,416	0.05
USD 143,000	Telecom Italia Capital 6% 30/9/2034	118,781	0.00
USD 603,000	Tupy Overseas 4.5% 16/2/2031	488,234	0.01
EUR 200,000	Vivion Investments 3% 8/8/2024	187,153	0.00
		92,929,375	1.28
マレーシア			
USD 885,000	Khazanah Capital 4.876% 1/6/2033	863,149	0.01
USD 895,000	Khazanah Global Sukuk 4.687% 1/6/2028	881,526	0.01
USD 500,000	TNB Global Ventures Capital 3.244% 19/10/2026	468,515	0.01
		2,213,190	0.03
マーシャル諸島			
USD 1,707,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	1,728,998	0.02
モーリシャス			
USD 333,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	299,114	0.01
USD 730,000	Diamond II 7.95% 28/7/2026	719,158	0.01
USD 1,025,000	HTA 7% 18/12/2025*	972,746	0.01
USD 744,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	732,840	0.01
USD 292,000	India Green Power 4% 22/2/2027	258,665	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
モーリシャス(続き)			
USD 300,000	Network i2i 3.975% 3/3/2026*	275,398	0.00
USD 481,000	Network i2i 5.65% 15/1/2025	468,213	0.01
		3,726,134	0.05
メキシコ			
USD 930,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2027	821,236	0.01
USD 1,571,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	937,628	0.01
EUR 998,000	Cemex 3.125% 19/3/2026*	1,050,557	0.01
USD 4,127,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	4,102,382	0.06
USD 1,492,000	Gruma 4.875% 1/12/2024*	1,473,716	0.02
USD 1,220,000	Grupo Bimbo 3.875% 27/6/2024*	1,202,310	0.02
USD 814,000	Grupo Posadas 5% 30/12/2027	698,139	0.01
USD 1,207,000	Metalsa Sapi 3.75% 4/5/2031*	941,020	0.01
MXN 148,600,000	Mexican Bonos 7.5% 3/6/2027	8,272,296	0.11
MXN 257,066,100	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	13,582,320	0.19
MXN 264,935,000	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	14,412,529	0.20
MXN 551,710,000	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	31,665,767	0.44
MXN 202,201,200	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	11,171,784	0.15
MXN 3,579,025,400	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	19,394,376	0.27
MXN 1,190,127,800	Mexico Cetes 0% 3/10/2024	6,324,526	0.09
MXN 5,180,900,000	Mexico Cetes 0% 28/11/2024	27,104,931	0.38
USD 2,858,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/5/2031	2,366,624	0.03
USD 2,134,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	2,024,579	0.03
USD 1,610,000	Mexico Government International Bond 6.338% 4/5/2053	1,605,170	0.02
USD 355,000	Mexico Government International Bond 6.35% 9/2/2035	368,701	0.00
USD 604,000	Nemak 3.625% 28/6/2031*	462,277	0.01
EUR 137,000	Petroleos Mexicanos 3.625% 24/11/2025	132,894	0.00
EUR 534,000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/2/2024	571,145	0.01
USD 920,000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/1/2025*	870,693	0.01
USD 2,163,000	Petroleos Mexicanos 4.875% 18/1/2024	2,143,133	0.03
USD 1,303,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 27/6/2044*	757,095	0.01
USD 2,231,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	1,616,471	0.02
USD 1,859,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027	1,632,946	0.02
USD 3,185,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	2,411,363	0.03
USD 9,908,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	9,044,666	0.13
MXN 62,256,000	Petroleos Mexicanos 7.19% 12/9/2024	3,483,741	0.05
USD 5,518,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	4,937,286	0.07
USD 1,375,000	Trust Fibra Uno 4.869% 15/1/2030	1,201,434	0.02
		178,785,735	2.47
モロッコ			
USD 670,000	Morocco Government International Bond 4% 15/12/2050	439,172	0.01
USD 1,079,000	Morocco Government International Bond 5.95% 8/3/2028*	1,080,521	0.01
USD 3,736,000	Morocco Government International Bond 6.5% 8/9/2033	3,760,938	0.05
USD 410,000	Morocco Government International Bond 6.5% 8/9/2033*	412,737	0.01
USD 1,508,000	OCP 4.5% 22/10/2025	1,465,180	0.02
USD 1,116,000	OCP 5.125% 23/6/2051	790,106	0.01
		7,948,654	0.11
オランダ			
EUR 2,100,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/11/2025	2,068,887	0.03
EUR 1,600,000	ABN AMRO Bank 0.5% 23/9/2029	1,396,701	0.02
EUR 6,600,000	ABN AMRO Bank 4.375% 20/10/2028	7,157,452	0.10
GBP 1,800,000	ABN AMRO Bank 5.25% 26/5/2026	2,246,209	0.03
EUR 4,000,000	ABN AMRO Bank 5.5% 21/9/2033	4,323,031	0.06
EUR 1,200,000	Ashland Services 2% 30/1/2028	1,124,394	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 4,200,000	ATF Netherlands 7.078% 20/1/2024	2,038,243	0.03
EUR 500,000	Axalta Coating Systems Dutch B 3.75% 15/1/2025	537,303	0.01
EUR 3,380,000	BP Capital Markets 4.323% 12/5/2035	3,636,017	0.05
USD 933,000	Braskem Netherlands Finance 7.25% 13/2/2033*	887,760	0.01
USD 971,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	972,025	0.01
GBP 1,000,000	Cooperatieve Rabobank 1.875% 12/7/2028	1,090,806	0.01
EUR 9,800,000	Cooperatieve Rabobank 4% 10/1/2030	10,508,648	0.15
EUR 1,200,000	Cooperatieve Rabobank 4.233% 25/4/2029*	1,295,750	0.02
GBP 2,432,000	Deutsche Telekom International Finance 8.875% 27/11/2028	3,535,108	0.05
EUR 590,558	Domi 2021-1 4.156% 15/6/2053	637,307	0.01
EUR 519,022	Domi 2023-1 4.901% 15/2/2055	567,185	0.01
EUR 167,000	Domi 2023-1 5.481% 15/2/2055	180,310	0.00
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 5.064% 28/1/2058	313,756	0.01
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 4.814% 28/7/2058	797,178	0.01
EUR 585,568	Dutch Property Finance 2021-2 4.414% 28/4/2059	633,769	0.01
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 4.514% 28/4/2059	869,614	0.01
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 4.764% 28/4/2059	527,878	0.01
GBP 800,000	E.ON International Finance 6.375% 7/6/2032	1,052,975	0.01
USD 1,215,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	1,236,913	0.02
USD 307,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	312,537	0.00
USD 1,885,000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	1,908,940	0.03
EUR 1,300,000	EnBW International Finance 3.625% 22/11/2026	1,406,649	0.02
EUR 723,000	Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30/6/2029	643,197	0.01
EUR 560,000	Global Switch Finance 1.375% 7/10/2030	501,580	0.01
EUR 168,000	Heimstaden Bostad Treasury 0.625% 24/7/2025	157,158	0.00
EUR 504,000	Heimstaden Bostad Treasury 1% 13/4/2028	393,854	0.00
EUR 168,000	Heimstaden Bostad Treasury 1.375% 3/3/2027	144,535	0.00
EUR 2,900,000	ING Groep 1% 16/11/2032	2,642,158	0.04
EUR 3,800,000	ING Groep 1.25% 16/2/2027	3,823,889	0.05
GBP 3,000,000	ING Groep 3% 18/2/2026	3,534,781	0.05
EUR 1,800,000	ING Groep 4.875% 14/11/2027	1,985,124	0.03
EUR 3,400,000	ING Groep 5% 20/2/2035	3,599,068	0.05
EUR 202,000	Jubilee Place 5.263% 17/1/2059	210,688	0.00
EUR 1,500,000	Koninklijke KPN 2% 8/11/2024	1,553,045	0.02
EUR 50,540	Magoi 2019 4.932% 27/7/2039	54,090	0.00
EUR 25,332	Magoi 2019 5.332% 27/7/2039	26,935	0.00
EUR 25,331	Magoi 2019 6.132% 27/7/2039	27,261	0.00
USD 1,066,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	941,465	0.01
USD 961,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	848,731	0.01
USD 984,000	MEGlobal 4.25% 3/11/2026	945,112	0.01
USD 1,565,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	974,588	0.02
USD 303,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	204,525	0.00
USD 782,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	527,850	0.01
USD 227,000	Mondelez International Netherlands 1.25% 24/9/2026	200,591	0.00
EUR 1,500,000	Naturgy Finance 2.374% 23/11/2026	1,445,961	0.02
EUR 1,000,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2024	1,065,959	0.02
EUR 409,000	Nobian Finance 3.625% 15/7/2026*	395,228	0.01
USD 2,250,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,973,947	0.03
USD 3,862,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.875% 18/6/2026	3,695,432	0.05
USD 1,300,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	1,217,496	0.01
USD 1,500,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.4% 1/6/2027	1,443,180	0.02
USD 1,485,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	1,411,507	0.02
EUR 781,200	OCI 3.625% 15/10/2025	824,175	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 858,000	OI European 2.875% 15/2/2025	910,692	0.01
EUR 1,632,000	OI European 6.25% 15/5/2028	1,814,923	0.03
EUR 900,000	Phoenix PIB Dutch Finance 2.375% 5/8/2025*	932,750	0.01
EUR 664,000	Q-Park I 1.5% 1/3/2025*	697,142	0.01
EUR 447,000	Q-Park I 2% 1/3/2027*	426,362	0.01
EUR 652,000	Q-Park I 5.47% 1/3/2026*	694,326	0.01
EUR 6,693,000	Repsol International Finance 2.5% 22/12/2026	6,390,154	0.09
EUR 658,000	Repsol International Finance 3.75% 11/3/2026	670,168	0.01
EUR 1,282,000	Repsol International Finance 4.247% 11/9/2028	1,266,066	0.02
EUR 949,637	Summer BidCo 9% 15/11/2025	979,247	0.01
EUR 2,083,507	Summer BidCo 9% 15/11/2025	2,123,099	0.03
EUR 2,500,000	Telefonica Europe 3% 2/10/2023	2,705,040	0.04
EUR 1,400,000	Telefonica Europe 3.875% 22/6/2026	1,420,497	0.02
EUR 9,100,000	Telefonica Europe 4.375% 14/12/2024	9,708,616	0.13
EUR 2,600,000	Telefonica Europe 5.875% 31/3/2024	2,838,496	0.04
EUR 3,200,000	Telefonica Europe 6.135% 3/2/2030	3,397,840	0.05
EUR 1,200,000	TenneT 2.374% 22/7/2025	1,233,908	0.02
EUR 1,000,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	933,411	0.01
EUR 1,242,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	1,235,167	0.02
EUR 887,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.375% 9/5/2030	834,147	0.01
EUR 702,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.5% 1/3/2025	752,991	0.01
EUR 3,207,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029	3,571,711	0.05
EUR 392,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.875% 15/9/2031	446,161	0.01
USD 400,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8.125% 15/9/2031	424,342	0.01
EUR 1,000,000	Thermo Fisher Scientific Finance I 0% 18/11/2025	999,511	0.01
EUR 1,000,000	Trivium Packaging Finance 3.75% 15/8/2026	986,926	0.01
USD 977,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	923,384	0.01
EUR 317,000	Trivium Packaging Finance 7.531% 15/8/2026	338,875	0.00
EUR 1,248,000	United 4% 15/11/2027*	1,169,155	0.02
EUR 3,100,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	3,093,524	0.04
EUR 3,319,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	3,050,080	0.04
GBP 500,000	Volkswagen Financial Services 1.875% 3/12/2024	600,528	0.01
GBP 2,700,000	Volkswagen Financial Services 2.125% 27/6/2024	3,323,775	0.05
GBP 400,000	Volkswagen Financial Services 4.25% 9/10/2025	486,991	0.01
GBP 5,000,000	Volkswagen Financial Services 5.5% 7/12/2026	6,207,872	0.09
EUR 9,800,000	Volkswagen International Finance 3.375% 27/6/2024	10,382,600	0.14
EUR 300,000	Volkswagen International Finance 3.748% 28/12/2027	282,796	0.00
EUR 1,400,000	Volkswagen International Finance 3.875% 17/6/2029	1,270,512	0.02
EUR 1,100,000	Volkswagen International Finance 4.375% 28/3/2031	979,248	0.01
EUR 700,000	Volkswagen International Finance 7.5% 6/9/2028	766,844	0.01
EUR 2,200,000	Wintershall Dea Finance 0.84% 25/9/2025	2,221,623	0.03
EUR 3,100,000	Wintershall Dea Finance 1.332% 25/9/2028	2,864,229	0.04
EUR 2,000,000	Wintershall Dea Finance 1.823% 25/9/2031	1,724,385	0.02
EUR 8,000,000	Wintershall Dea Finance 2 2.499% 20/4/2026	7,568,578	0.11
EUR 1,100,000	Wintershall Dea Finance 2 3% 20/7/2028	961,316	0.01
EUR 400,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	400,119	0.00
EUR 500,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027	480,653	0.01
EUR 200,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030*	179,828	0.00
		<u>188,347,063</u>	<u>2.61</u>
ナイジェリア			
USD 1,729,000	Nigeria Government International Bond 7.375% 28/9/2033	1,319,253	0.02
USD 2,693,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047*	1,849,687	0.02
USD 3,184,000	Nigeria Government International Bond 7.875% 16/2/2032	2,587,080	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ナイジェリア(続き)			
USD 1,398,000	Nigeria Government International Bond 8.375% 24/3/2029	1,232,001	0.02
USD 795,000	Nigeria Government International Bond 9.248% 21/1/2049	639,188	0.01
		7,627,209	0.11
ノルウェー			
EUR 784,000	Equinor 1.375% 22/5/2032*	710,667	0.01
EUR 1,300,000	Nassa Topco 2.875% 6/4/2024	1,386,071	0.02
EUR 710,000	Var Energi 5.5% 4/5/2029	778,442	0.01
		2,875,180	0.04
オマーン			
USD 2,475,000	Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047	2,329,631	0.03
USD 2,969,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048	2,871,127	0.04
USD 909,000	Oman Sovereign Sukuk 4.397% 1/6/2024	895,151	0.01
USD 744,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	712,536	0.01
		6,808,445	0.09
パナマ			
USD 744,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	558,357	0.01
EUR 1,084,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	1,173,546	0.02
USD 2,778,000	Panama Government International Bond 3.16% 23/1/2030	2,417,596	0.03
USD 905,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	852,044	0.01
USD 5,012,000	Panama Government International Bond 6.4% 14/2/2035	5,146,867	0.07
USD 3,257,000	Panama Government International Bond 6.853% 28/3/2054*	3,318,231	0.05
		13,466,641	0.19
パラグアイ			
USD 1,565,000	Frigorifico Concepcion 7.7% 21/7/2028	1,335,407	0.02
USD 2,095,000	Paraguay Government International Bond 5.6% 13/3/2048	1,800,401	0.03
		3,135,808	0.05
ペルー			
USD 1,975,000	Financiera de Desarrollo 4.75% 15/7/2025	1,937,011	0.02
USD 4,021,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032	3,036,257	0.04
USD 2,111,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	1,792,228	0.03
		6,765,496	0.09
フィリピン			
PHP 148,600,000	Philippine Government Bond 7% 13/7/2038	2,748,151	0.04
USD 400,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	259,596	0.00
USD 1,000,000	Rizal Commercial Banking 6.5% 27/8/2025	916,040	0.01
		3,923,787	0.05
ポーランド			
USD 3,287,000	Bank Gospodarstwa Krajowego 5.375% 22/5/2033	3,225,369	0.05
EUR 1,261,000	Republic of Poland Government International Bond 4.25% 14/2/2043	1,337,354	0.02
USD 947,000	Republic of Poland Government International Bond 4.875% 4/10/2033*	919,475	0.01
USD 1,447,000	Republic of Poland Government International Bond 5.5% 4/4/2053	1,410,232	0.02
		6,892,430	0.10
ポルトガル			
EUR 164,670	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 5.887% 25/1/2035	176,041	0.00
EUR 713,570	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 7.887% 25/1/2035	759,147	0.01
EUR 200,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017	46,653	0.00
EUR 20,500,000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019	4,781,896	0.06
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018	466,526	0.01
EUR 3,500,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	3,509,662	0.05
EUR 874,353	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos 0.7% 12/2/2024	938,893	0.02
EUR 687,541	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Ulisses Finance No. 2 6.462% 23/9/2038	700,143	0.01
EUR 143,558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 4.582% 28/10/2040	152,446	0.00
EUR 502,451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 5.182% 28/10/2040	523,064	0.01
		12,054,471	0.17

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 590,000	プエルトリコ Puerto Rico Sales Tax Financing Sales Tax Revenue 4.75% 1/7/2053	548,262	0.01
USD 500,000	カタール Qatar Government International Bond 4% 14/3/2029*	483,533	0.01
EUR 2,800,000	ルーマニア RCS & RDS 2.5% 5/2/2025	2,914,707	0.04
EUR 2,348,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031*	1,940,712	0.03
EUR 3,556,000	Romanian Government International Bond 2.125% 7/3/2028	3,395,174	0.05
EUR 2,469,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	2,242,606	0.03
EUR 2,348,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029*	2,248,330	0.03
USD 2,262,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	2,223,026	0.03
		14,964,555	0.21
RUB 352,509,000	ロシア連邦 Russian Federal Bond - OFZ 6.1% 18/7/2035	1,028,526	0.01
USD 129,000	サウジアラビア Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	122,043	0.00
USD 3,503,000	Saudi Government International Bond 3.45% 2/2/2061	2,332,560	0.03
USD 2,636,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	2,572,776	0.04
USD 2,089,000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1,859,993	0.03
		6,887,372	0.10
EUR 296,000	セネガル Senegal Government International Bond 4.75% 13/3/2028*	277,423	0.00
EUR 419,000	Senegal Government International Bond 5.375% 8/6/2037	304,684	0.00
USD 1,366,000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/5/2033*	1,120,543	0.02
USD 473,000	Senegal Government International Bond 6.75% 13/3/2048	330,043	0.01
		2,032,693	0.03
USD 343,000	シンガポール ABJA Investment 5.45% 24/1/2028	336,967	0.00
USD 1,178,000	Continuum Energy Aura 9.5% 24/2/2027	1,171,390	0.02
USD 1,029,394	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	961,197	0.01
USD 187,162	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027*	174,763	0.00
USD 600,000	DBS 3.3% 27/2/2025	569,439	0.01
USD 482,760	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039*	428,630	0.01
USD 5,105,000	Pfizer Investment Enterprises 4.65% 19/5/2025	5,047,977	0.07
USD 2,383,000	Pfizer Investment Enterprises 4.75% 19/5/2033	2,347,342	0.03
USD 2,280,000	Pfizer Investment Enterprises 5.3% 19/5/2053	2,284,727	0.03
SGD 1,000,000	Straits Trading 3.25% 13/2/2028	651,022	0.01
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	184,562	0.00
		14,158,016	0.19
ZAR 83,331,646	南アフリカ Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	3,979,481	0.05
ZAR 36,835,021	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044*	1,426,784	0.02
ZAR 206,119,562	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	8,404,662	0.12
ZAR 193,874,767	Republic of South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026	10,796,190	0.15
USD 2,154,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029*	1,900,841	0.03
USD 3,442,000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	2,289,756	0.03
USD 2,075,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 20/4/2032*	1,841,334	0.02
		30,639,048	0.42
USD 1,760,000	韓国 GS Caltex 5.375% 7/8/2028	1,747,451	0.02
USD 400,000	Kookmin Bank 4.35% 2/7/2024	390,302	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
韓国(続き)			
USD 200,000	Korea National Oil 4.75% 3/4/2026	196,756	0.00
USD 200,000	Korea National Oil 4.875% 3/4/2028	197,562	0.01
USD 360,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031	289,713	0.00
USD 538,000	POSCO 5.625% 17/1/2026*	538,498	0.01
USD 582,000	POSCO 5.75% 17/1/2028	586,254	0.01
USD 200,000	POSCO 5.875% 17/1/2033*	206,239	0.00
USD 400,000	SK Hynix 6.25% 17/1/2026*	401,652	0.01
USD 1,765,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028	1,786,127	0.03
USD 200,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028*	202,394	0.00
USD 250,000	SK Hynix 6.5% 17/1/2033	253,439	0.00
		6,796,387	0.10
スペイン			
USD 1,304,682	AI Candelaria Spain 7.5% 15/12/2028	1,212,415	0.02
EUR 244,215	Autonoria Spain 2021 FT 4.442% 31/1/2039	261,725	0.00
EUR 1,282,130	Autonoria Spain 2021 FT 4.692% 31/1/2039	1,361,801	0.02
EUR 549,485	Autonoria Spain 2021 FT 5.192% 31/1/2039	581,505	0.01
EUR 305,269	Autonoria Spain 2021 FT 6.292% 31/1/2039	319,931	0.01
EUR 122,108	Autonoria Spain 2021 FT 7.542% 31/1/2039	126,973	0.00
EUR 261,052	Autonoria Spain 2022 FT 6.442% 27/1/2040	285,795	0.00
EUR 87,017	Autonoria Spain 2022 FT 7.842% 28/1/2040	95,731	0.00
EUR 435,087	Autonoria Spain 2022 FT 10.642% 29/1/2040	479,075	0.01
EUR 1,600,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/3/2024	1,717,928	0.02
EUR 900,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030*	910,272	0.01
EUR 1,700,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031	1,648,632	0.02
EUR 1,100,000	Banco de Sabadell 2.625% 24/3/2026	1,150,392	0.02
EUR 1,000,000	Banco de Sabadell 5.25% 7/2/2029	1,078,517	0.01
GBP 2,300,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	2,697,928	0.04
EUR 8,000,000	Banco Santander 3.625% 27/9/2026	8,577,534	0.12
EUR 1,100,000	Banco Santander 3.75% 16/1/2026	1,183,212	0.02
EUR 2,400,000	Banco Santander 3.875% 16/1/2028	2,578,390	0.04
EUR 200,000	Banco Santander 4.213% 16/1/2025	217,417	0.00
EUR 2,400,000	Banco Santander 4.375% 14/1/2026*	2,190,010	0.03
EUR 1,200,000	Banco Santander 5.75% 23/8/2033	1,299,149	0.02
EUR 700,000	Bankinter 4.375% 3/5/2030	758,322	0.01
EUR 800,000	CaixaBank 6.375% 19/9/2023*	870,126	0.01
EUR 600,000	CaixaBank 6.75% 13/6/2024	641,746	0.01
EUR 1,100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	1,039,403	0.02
EUR 1,400,000	Cellnex Finance 1.5% 8/6/2028*	1,319,299	0.02
EUR 2,700,000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033*	2,306,888	0.03
USD 200,000	Cellnex Finance 3.875% 7/7/2041	142,264	0.00
EUR 4,700,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	3,922,184	0.05
EUR 1,700,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030*	1,514,498	0.02
EUR 700,000	Cellnex Telecom 1.875% 26/6/2029	650,494	0.01
EUR 200,000	Cellnex Telecom 2.125% 11/8/2030	210,989	0.00
EUR 741,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027*	767,297	0.01
EUR 233,185	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 21/3/2033	238,845	0.00
EUR 388,642	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4.522% 21/3/2033	417,140	0.01
EUR 116,593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5.522% 21/3/2033	124,540	0.00
EUR 729,000	Grupo Antolin-Irausa 3.5% 30/4/2028	586,095	0.01
GBP 600,000	Iberdrola Finanzas 7.375% 29/1/2024	764,819	0.01
EUR 1,100,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029*	1,044,206	0.01
EUR 515,000	Kaixo Bondco Telecom 5.125% 30/9/2029	493,943	0.01
EUR 3,672,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	3,707,116	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スペイン(続き)			
EUR 104,298,000	Spain Government Bond 2.55% 31/10/2032	105,632,070	1.46
EUR 9,733,000	Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046	8,896,551	0.12
EUR 88,392,000	Spain Government Bond 3.15% 30/4/2033	93,515,913	1.29
EUR 8,423,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	7,985,614	0.11
EUR 15,880,000	Spain Government Bond 3.55% 31/10/2033	17,303,101	0.24
EUR 4,914,000	Spain Government Bond 3.9% 30/7/2039	5,347,148	0.08
GBP 6,253,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	7,825,981	0.11
		298,000,924	4.12
スリランカ			
USD 306,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/4/2023	143,352	0.00
USD 821,000	Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	383,078	0.01
USD 677,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024*	315,428	0.00
		841,858	0.01
スウェーデン			
EUR 777,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	567,088	0.01
EUR 168,000	Heimstaden Bostad 1.125% 21/1/2026	152,379	0.00
EUR 3,976,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/2/2027	1,872,811	0.03
EUR 1,000,000	Heimstaden Bostad 3.375% 15/1/2026	508,242	0.01
EUR 129,236	Intrum 3.125% 15/7/2024	133,600	0.00
EUR 3,879,000	Intrum 4.875% 15/8/2025*	3,650,729	0.05
GBP 1,000,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	1,082,622	0.01
EUR 1,524,000	Verisure 3.25% 15/2/2027	1,490,971	0.02
EUR 1,498,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,534,836	0.02
EUR 2,220,000	Volvo Treasury 2.625% 20/2/2026	2,337,610	0.03
EUR 1,770,000	Volvo Treasury 3.625% 25/5/2027	1,910,310	0.03
GBP 2,740,000	Volvo Treasury 4.75% 15/6/2026	3,387,638	0.05
		18,628,836	0.26
スイス			
EUR 2,300,000	Credit Suisse 0.25% 5/1/2026	2,272,181	0.03
EUR 5,952,000	Credit Suisse 0.25% 1/9/2028	5,332,423	0.07
USD 1,620,000	Credit Suisse 2.95% 9/4/2025	1,537,984	0.02
USD 683,000	Credit Suisse 3.625% 9/9/2024	664,279	0.01
USD 4,625,000	Credit Suisse 3.7% 21/2/2025	4,455,759	0.06
USD 1,625,000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	1,578,913	0.02
EUR 7,932,000	Credit Suisse 5.5% 20/8/2026	8,893,769	0.12
GBP 1,000,000	Credit Suisse 7.75% 10/3/2026	1,310,021	0.02
USD 2,000,000	Credit Suisse 7.95% 9/1/2025	2,038,924	0.03
EUR 4,400,000	UBS 0.65% 14/1/2028	4,224,968	0.06
EUR 1,500,000	UBS 1% 21/3/2025	1,597,091	0.02
USD 1,981,000	UBS 1.305% 2/2/2027	1,766,435	0.02
USD 683,000	UBS 2.193% 5/6/2026*	635,975	0.01
USD 1,787,000	UBS 2.593% 11/9/2025	1,722,413	0.02
EUR 1,300,000	UBS 3.25% 2/4/2026	1,383,856	0.02
USD 200,000	UBS 5.125% 29/7/2026	180,139	0.00
USD 400,000	UBS 7% 31/1/2024	397,152	0.01
USD 1,960,000	UBS 7% 19/2/2025*	1,913,313	0.03
GBP 1,400,000	UBS 7% 30/9/2027	1,796,903	0.03
EUR 7,300,000	UBS 7.75% 1/3/2029	8,955,416	0.12
		52,657,914	0.72
タイ			
USD 890,000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025*	842,830	0.01
USD 524,000	Kasikornbank 3.343% 2/10/2031	470,204	0.01
USD 690,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/3/2026	627,900	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
タイ(続き)			
USD 600,000	Minor International 2.7% 19/4/2026	547,770	0.01
USD 700,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050	449,708	0.00
		2,938,412	0.04
トルコ			
USD 1,081,383	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4.2% 15/3/2027	1,004,106	0.01
ウクライナ			
EUR 2,027,000	Ukraine Government International Bond 4.375% 27/1/2032	521,756	0.01
USD 5,138,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	1,391,422	0.02
USD 8,228,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	2,228,225	0.03
USD 5,543,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2034	1,475,824	0.02
USD 1,582,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2034	421,207	0.01
USD 1,287,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	418,275	0.01
USD 825,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2026	240,488	0.00
USD 674,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2028	194,786	0.00
USD 2,673,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/8/2041	1,229,580	0.02
USD 1,131,000	Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2026	344,955	0.00
USD 1,255,000	VF Ukraine PAT via VFU Funding 6.2% 11/2/2025	928,700	0.01
		9,395,218	0.13
アラブ首長国連邦			
USD 401,000	Abu Dhabi National Energy 4.696% 24/4/2033	393,983	0.01
USD 1,140,000	Aldar Investment Properties Sukuk 4.875% 24/5/2033	1,122,957	0.02
USD 1,161,000	MDGH GMTN RSC 4.375% 22/11/2033	1,097,725	0.01
		2,614,665	0.04
英国			
EUR 400,000	Agps Bondco 5% 14/1/2029	127,186	0.00
EUR 2,100,000	Agps Bondco 5.5% 13/11/2026	766,107	0.01
EUR 6,400,000	Agps Bondco 6% 5/8/2025	2,700,733	0.04
EUR 1,036,000	Allwyn Entertainment Financing UK 7.25% 30/4/2030	1,148,267	0.02
EUR 2,400,000	Anglo American Capital 1.625% 18/9/2025*	2,485,132	0.04
EUR 710,000	Anglo American Capital 4.5% 15/9/2028*	772,965	0.01
EUR 3,300,000	Anglo American Capital 4.75% 21/9/2032*	3,538,322	0.05
EUR 4,170,000	Anglo American Capital 5% 15/3/2031*	4,556,660	0.06
GBP 125,000	Atlas Funding 2021-1 6.874% 25/7/2058	158,073	0.00
GBP 110,000	Atlas Funding 2021-1 7.424% 25/7/2058	138,987	0.00
GBP 877,248	Atlas Funding 2023-1 6.345% 20/1/2061	1,113,542	0.02
GBP 304,000	Atlas Funding 2023-1 7.095% 20/1/2061	384,202	0.01
GBP 200,000	Atlas Funding 2023-1 7.945% 20/1/2061	252,108	0.00
GBP 103,000	Atlas Funding 2023-1 8.995% 20/1/2061	130,018	0.00
USD 1,611,422	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	1,411,533	0.02
GBP 744,865	Azure Finance NO 2 8.195% 20/7/2030	946,221	0.01
EUR 400,000	Babcock International 1.375% 13/9/2027	387,114	0.01
GBP 2,000,000	Babcock International 1.875% 5/10/2026	2,224,338	0.03
GBP 1,000,000	Barclays 3% 8/5/2026	1,159,665	0.02
GBP 1,000,000	Barclays 3.25% 12/2/2027	1,138,349	0.02
GBP 1,000,000	Barclays 3.75% 22/11/2030	1,157,096	0.02
EUR 1,790,000	Barclays 4.918% 8/8/2030	1,945,674	0.03
EUR 7,000,000	Barclays 5.262% 29/1/2034	7,592,984	0.10
USD 500,000	Barclays 6.125% 15/12/2025	444,316	0.01
GBP 600,000	Barclays 6.375% 15/12/2025	675,974	0.01
GBP 400,000	Barclays 7.125% 15/6/2025	468,237	0.01
USD 861,000	Barclays 8% 15/6/2024	844,654	0.01
GBP 520,000	Barley Hill NO 2 6.895% 27/8/2058	633,698	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
EUR 700,000	BAT International Finance 2.75% 25/3/2025*	744,818	0.01
EUR 700,000	BCP V Modular Services Finance II 4.75% 30/11/2028*	642,049	0.01
GBP 400,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	416,060	0.01
GBP 2,985,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	3,253,238	0.04
GBP 3,498,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	3,894,327	0.05
GBP 1,826,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	2,287,034	0.03
EUR 9,176,000	BP Capital Markets 3.25% 22/3/2026	9,321,743	0.13
EUR 1,658,000	BP Capital Markets 3.625% 22/3/2029	1,585,675	0.02
GBP 607,000	Brants Bridge 2023-1 5.952% 14/6/2066	767,486	0.01
EUR 8,375,000	British Telecommunications 1.874% 18/8/2080*	8,312,254	0.12
USD 1,000,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	882,991	0.01
USD 1,300,000	British Telecommunications 4.875% 23/11/2081	1,067,325	0.01
GBP 3,200,000	British Telecommunications 5.75% 7/12/2028	4,015,979	0.06
GBP 2,575,000	British Telecommunications 8.375% 20/12/2083	3,269,307	0.05
GBP 225,000	Canada Square Funding 2021-2 6.214% 17/6/2058	280,579	0.00
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 6.614% 17/6/2058	126,200	0.00
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 6.601% 17/1/2059	385,623	0.01
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 7.001% 17/1/2059	210,072	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II 6.684% 22/10/2037	1,032,141	0.01
GBP 4,190,000	Canary Wharf Finance II 7.409% 22/10/2037	4,202,176	0.06
EUR 200,000	Carnival 1% 28/10/2029	145,651	0.00
EUR 1,071,000	Chanel Ceres 0.5% 31/7/2026	1,045,564	0.01
EUR 2,404,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	2,384,307	0.03
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance 3.043% 30/6/2050	1,959,093	0.03
GBP 220,000	CMF 2020-1 6.196% 16/1/2057	278,500	0.00
GBP 105,000	CMF 2020-1 6.446% 16/1/2057	132,706	0.00
GBP 898,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027*	912,860	0.01
GBP 1,030,947	Dignity Finance 3.546% 31/12/2034	1,151,924	0.02
GBP 350,000	Dignity Finance 4.696% 31/12/2049	280,413	0.00
GBP 18,962	Dowson 2021-2 5.875% 20/10/2028	24,040	0.00
GBP 400,000	Dowson 2021-2 6.395% 20/10/2028	507,174	0.01
GBP 1,300,000	Dowson 2021-2 6.795% 20/10/2028	1,644,674	0.02
GBP 1,143,000	Dowson 2022-1 7.445% 20/1/2029	1,440,593	0.02
GBP 725,000	Dowson 2022-1 7.895% 20/1/2029	902,837	0.01
GBP 451,000	Dowson 2022-2 8.895% 20/8/2029	576,418	0.01
GBP 245,000	Dowson 2022-2 10.445% 20/8/2029	310,520	0.01
EUR 2,820,000	DS Smith 4.5% 27/7/2030	3,040,760	0.04
EUR 3,498,000	EC Finance 3% 15/10/2026	3,570,979	0.05
GBP 364,219	Finsbury Square 5.647% 16/12/2067	459,050	0.01
GBP 544,000	Finsbury Square 5.997% 16/12/2067	678,896	0.01
GBP 1,045,000	Finsbury Square 6.247% 16/12/2067	1,281,852	0.02
GBP 862,088	Finsbury Square 2021-2 5.797% 16/12/2071	1,088,033	0.02
GBP 435,000	Finsbury Square 2021-2 6.247% 16/12/2071	545,068	0.01
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 6.397% 16/12/2071	454,684	0.01
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 6.697% 16/12/2071	240,013	0.00
GBP 116,000	Funding V 6.895% 15/10/2025	146,827	0.00
GBP 3,104,000	Funding VI 6.595% 15/7/2026	3,941,252	0.06
GBP 736,000	Funding VI 8.295% 15/7/2026	938,775	0.01
GBP 1,236,000	Funding VIII 6.375% 15/5/2028	1,567,546	0.02
GBP 229,000	Funding VIII 7.695% 15/5/2028	290,930	0.00
GBP 145,000	Funding VIII 8.695% 15/5/2028	184,260	0.00
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 6.297% 16/12/2067	271,313	0.00
GBP 1,880,000	Great Hall Mortgages No 1 5.439% 18/6/2039	2,284,261	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 2,454,784	Greene King Finance 3.593% 15/3/2035	2,587,108	0.04
GBP 981,897	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	1,050,114	0.02
GBP 300,000	Greene King Finance 6.903% 15/12/2034	302,772	0.00
GBP 300,000	Greene King Finance 7.08% 15/3/2036	300,326	0.00
GBP 741,000	Harben Finance 6.242% 28/9/2055	896,354	0.01
GBP 441,000	Harben Finance 6.592% 28/9/2055	515,261	0.01
GBP 400,000	Heathrow Finance 3.875% 1/3/2027*	437,648	0.01
GBP 405,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	415,727	0.01
GBP 1,099,000	Heathrow Finance 4.75% 1/3/2024	1,368,934	0.02
GBP 518,000	Heathrow Finance 5.75% 3/3/2025*	638,641	0.01
GBP 183,000	Hermitage 2023 7.646% 21/9/2033	232,200	0.00
GBP 199,992	Hops Hill No 1 7.045% 27/5/2054	252,899	0.00
GBP 99,997	Hops Hill No 1 7.545% 27/5/2054	124,930	0.00
GBP 1,391,000	Hops Hill No 3 0% 21/12/2055	1,757,569	0.02
GBP 1,127,000	Hops Hill No 3 6.532% 21/12/2055	1,410,398	0.02
GBP 1,041,000	Hops Hill No 3 7.332% 21/12/2055	1,293,858	0.02
GBP 1,000,000	Hops Hill No2 7.445% 27/11/2054	1,277,891	0.02
GBP 264,000	Hops Hill No2 8.045% 27/11/2054	333,723	0.01
GBP 8,060,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	8,983,431	0.12
GBP 2,200,000	HSBC 2.256% 13/11/2026	2,550,150	0.04
GBP 1,300,000	Imperial Brands Finance 5.5% 28/9/2026	1,608,271	0.02
GBP 700,000	Imperial Brands Finance 8.125% 15/3/2024	895,523	0.01
EUR 1,400,000	INEOS Finance 6.625% 15/5/2028*	1,511,276	0.02
EUR 2,414,000	INEOS Quattro Finance 2 2.5% 15/1/2026	2,388,515	0.03
EUR 5,470,000	Informa 2.125% 6/10/2025	5,687,561	0.08
GBP 3,834,000	Informa 3.125% 5/7/2026	4,481,302	0.06
USD 200,000	International Game Technology 6.25% 15/1/2027	198,279	0.00
GBP 1,582,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025	1,890,431	0.03
EUR 990,000	Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15/7/2028*	969,328	0.01
EUR 300,000	Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15/11/2026	329,562	0.01
GBP 776,000	Jerrold Finco 4.875% 15/1/2026	880,290	0.01
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7.208% 12/6/2057	465,855	0.01
GBP 260,363	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5.809% 20/7/2058	326,623	0.00
GBP 173,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.109% 20/7/2058	213,777	0.00
GBP 158,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.409% 20/7/2058	192,437	0.00
GBP 102,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.809% 20/7/2058	122,079	0.00
USD 626,000	Liquid Telecommunications Financing 5.5% 4/9/2026	391,720	0.01
GBP 981,000	Lloyds Banking 1.875% 15/1/2026	1,170,449	0.02
GBP 1,800,000	Lloyds Banking 2% 12/4/2028	1,945,629	0.03
GBP 2,000,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	2,429,545	0.03
EUR 900,000	Lloyds Banking 4.947% 27/6/2025	915,159	0.01
USD 800,000	Lloyds Banking 7.5% 27/6/2024*	780,829	0.01
GBP 299,000	London Cards NO 1 8.945% 15/5/2033	377,913	0.01
GBP 383,088	London Wall Mortgage Capital 5.968% 15/5/2051	482,414	0.01
GBP 219,284	London Wall Mortgage Capital 6.018% 15/5/2052	276,203	0.00
GBP 1,483,000	Mitchells & Butlers Finance 7.347% 15/6/2036	1,524,699	0.02
GBP 550,000	Mobico 4.25% 26/11/2025	608,558	0.01
GBP 614,702	Mortimer BTL 2021-1 5.733% 23/6/2053	771,374	0.01
GBP 198,000	Mortimer BTL 2021-1 6.133% 23/6/2053	246,495	0.00
GBP 111,000	Mortimer BTL 2021-1 6.483% 23/6/2053	135,843	0.00
EUR 3,200,000	National Grid 3.245% 30/3/2034	3,120,360	0.04
GBP 695,000	National Grid Electricity Distribution South West 5.875% 25/3/2027	882,368	0.01
GBP 900,000	National Grid Electricity Transmission 5.875% 2/2/2024	1,139,972	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 1,400,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/6/2027*	1,527,644	0.02
GBP 3,170,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	3,715,584	0.05
GBP 1,000,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	1,161,416	0.02
GBP 1,700,000	NatWest Markets 6.375% 8/11/2027	2,159,811	0.03
USD 8,097,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	8,063,802	0.11
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6.745% 15/3/2029	979,600	0.01
GBP 595,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.095% 15/11/2029	750,367	0.01
GBP 677,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.545% 15/11/2029	848,394	0.01
GBP 1,212,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 10.195% 15/7/2030	1,553,348	0.02
EUR 572,620	Newgate Funding 3.754% 1/12/2050	577,642	0.01
EUR 11,000,000	NGG Finance 1.625% 5/12/2079	11,380,749	0.16
GBP 1,000,000	NIE Finance 2.5% 27/10/2025	1,176,056	0.02
EUR 233,696	Paragon Mortgages No 12 4.261% 15/11/2038	237,916	0.00
GBP 2,200,862	Parkmore Point RMBS 2022-1 6.673% 25/7/2045	2,766,317	0.04
GBP 509,477	Pierpont BTL 2021-1 5.833% 22/12/2053	640,801	0.01
GBP 802,000	Pierpont BTL 2021-1 6.283% 22/12/2053	993,415	0.01
GBP 873,000	Pierpont Btl 2023-1 5.935% 21/9/2054	1,106,537	0.02
GBP 458,000	Pierpont Btl 2023-1 6.735% 21/9/2054	579,476	0.01
GBP 5,218,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025	6,146,648	0.09
GBP 421,000	Polaris 2022-1 6.697% 23/10/2059	517,259	0.01
GBP 307,000	Polaris 2022-1 7.197% 23/10/2059	375,055	0.01
GBP 538,000	Polaris 2022-1 8.597% 23/10/2059	652,604	0.01
GBP 1,244,888	Polaris 2023-1 6.447% 23/2/2061	1,583,007	0.02
GBP 488,000	Polaris 2023-1 7.947% 23/2/2061	623,556	0.01
GBP 361,000	Polaris 2023-1 8.847% 23/2/2061	460,013	0.01
GBP 223,000	Polaris 2023-1 9.547% 23/2/2061	281,923	0.00
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6.646% 16/10/2056	145,340	0.00
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7.146% 16/10/2056	124,375	0.00
GBP 1,735,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	1,989,937	0.03
GBP 1,197,000	Residential Mortgage 32 7.225% 20/6/2070	1,512,143	0.02
EUR 39,154	RMAC No 1 3.736% 12/6/2044	40,199	0.00
EUR 557,315	RMAC No 1 3.756% 12/6/2044	569,973	0.01
GBP 292,382	RMAC No 1 5.228% 12/6/2044	356,832	0.01
EUR 400,000	Rolls-Royce 1.625% 9/5/2028	374,139	0.00
EUR 442,000	Rolls-Royce 4.625% 16/2/2026*	475,877	0.01
USD 200,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	194,497	0.00
GBP 176,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	211,398	0.00
USD 1,725,000	Royalty Pharma 2.2% 2/9/2030	1,376,952	0.02
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 7.369% 17/11/2030	640,061	0.01
GBP 1,000,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026	1,181,129	0.02
GBP 799,000	Santander UK 6.75% 24/6/2024	981,672	0.01
GBP 369,000	Satus 2021-1 6.396% 17/8/2028	468,488	0.01
GBP 453,000	Satus 2021-1 6.796% 17/8/2028	571,977	0.01
GBP 122,000	Satus 2021-1 7.096% 17/8/2028	151,661	0.00
GBP 247,000	Satus 2021-1 8.396% 17/8/2028	309,984	0.01
USD 3,609,950	SCC Power 4% 17/5/2032	388,070	0.00
USD 6,664,525	SCC Power 8% 31/12/2028	2,482,536	0.04
GBP 324,000	Sherwood Financing 6% 15/11/2026	339,477	0.00
GBP 900,000	SP Distribution 5.875% 17/7/2026	1,140,136	0.02
GBP 2,300,000	SSE 8.375% 20/11/2028	3,234,757	0.04
EUR 1,702,000	Standard Chartered 4.874% 10/5/2031	1,842,422	0.03
GBP 535,000	Stanlington No 2 6.708% 12/6/2045	664,580	0.01
GBP 329,000	Stanlington No 2 7.158% 12/6/2045	402,362	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 450,000	Stanlington No 2 8% 12/6/2045	543,314	0.01
GBP 2,930,000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	3,423,169	0.05
GBP 540,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025	633,157	0.01
EUR 1,478,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025*	1,484,926	0.02
GBP 819,491	Tesco Property Finance 1 7.623% 13/7/2039	1,109,906	0.02
GBP 2,010,543	Tesco Property Finance 3 5.744% 13/4/2040	2,371,669	0.03
GBP 917,728	Tesco Property Finance 4 5.801% 13/10/2040	1,089,109	0.01
GBP 1,042,000	Thames Water Kemble Finance 4.625% 19/5/2026	894,904	0.01
EUR 337,000	Thames Water Utilities Finance 0.875% 31/1/2028	306,560	0.00
GBP 1,783,000	Thames Water Utilities Finance 4% 19/6/2025	2,114,538	0.03
EUR 5,038,000	Thames Water Utilities Finance 4.375% 18/1/2031	5,148,816	0.07
GBP 263,312	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5.837% 12/7/2063	331,832	0.01
GBP 157,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.087% 12/7/2063	194,845	0.00
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.387% 12/7/2063	130,948	0.00
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 7.014% 21/7/2064	460,776	0.01
GBP 252,000	Tower Bridge Funding 2021-1 7.314% 21/7/2064	316,496	0.00
GBP 986,066	Tower Bridge Funding 2022-1 5.745% 20/12/2063	1,238,519	0.02
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 6.275% 20/12/2063	322,383	0.00
GBP 312,000	Tower Bridge Funding 2023-1 7.359% 20/10/2064	396,001	0.01
GBP 211,000	Tower Bridge Funding 2023-1 8.309% 20/10/2064	268,500	0.00
GBP 237,000	Tower Bridge Funding 2023-1 9.459% 20/10/2064	299,859	0.00
GBP 158,000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	201,341	0.00
GBP 234,000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	297,542	0.00
GBP 201,000	Tower Bridge Funding 2023-2 0% 20/3/2065	255,487	0.00
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 6.845% 20/8/2028	2,021,993	0.03
GBP 797,000	Twin Bridges 5.721% 14/6/2055	1,009,535	0.01
GBP 1,259,000	Twin Bridges 6.371% 14/6/2055	1,582,092	0.02
GBP 529,000	Twin Bridges 7.271% 14/6/2055	663,204	0.01
GBP 340,000	Twin Bridges 8.271% 14/6/2055	430,799	0.01
GBP 500,000	Twin Bridges 2020-1 6.958% 12/12/2054	636,133	0.01
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 7.208% 12/12/2054	494,532	0.01
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 7.958% 12/12/2054	284,437	0.00
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 6.558% 12/3/2055	540,971	0.01
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 7.058% 12/3/2055	270,622	0.00
GBP 596,719	Twin Bridges 2021-2 5.618% 12/9/2055	748,418	0.01
GBP 274,000	Twin Bridges 2021-2 5.858% 12/9/2055	338,509	0.01
GBP 435,000	Twin Bridges 2021-2 6.108% 12/9/2055	528,488	0.01
GBP 187,000	Twin Bridges 2021-2 6.458% 12/9/2055	222,508	0.00
GBP 830,000	Twin Bridges 2022-1 6.258% 1/12/2055	997,648	0.01
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 6.658% 1/12/2055	429,772	0.01
GBP 2,791,000	Twin Bridges 2022-2 6.958% 12/6/2055	3,542,608	0.05
GBP 1,588,312	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	1,988,435	0.03
GBP 1,097,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	1,350,333	0.02
GBP 266,861	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	336,444	0.00
GBP 42,007,573	United Kingdom Gilt 0.5% 22/10/2061	15,746,025	0.22
USD 1,316,000	Vedanta Resources 6.125% 9/8/2024	788,968	0.01
USD 3,887,000	Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	2,549,678	0.04
GBP 800,000	Virgin Media Secured Finance 4.25% 15/1/2030	809,734	0.01
GBP 100,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	115,800	0.00
GBP 400,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029	431,954	0.01
EUR 4,484,000	Vmed O2 UK Financing I 3.25% 31/1/2031	4,057,030	0.06
GBP 338,000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	343,527	0.00
GBP 1,338,000	Vmed O2 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	1,318,255	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
EUR 975,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	966,743	0.01
EUR 950,000	Vodafone 3% 27/8/2080	846,925	0.01
EUR 600,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078	602,958	0.01
GBP 3,100,000	Vodafone 4.875% 3/10/2078	3,703,953	0.05
USD 1,626,000	Vodafone 6.25% 3/10/2078*	1,603,642	0.02
		335,938,762	4.67
米国			
USD 460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	405,795	0.01
USD 1,500,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	1,264,358	0.02
USD 300,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	271,784	0.00
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 0.271% 5/6/2037	43,932	0.00
USD 320,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	251,134	0.00
USD 1,708,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	1,324,256	0.02
USD 1,070,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6.902% 15/9/2034	965,989	0.01
USD 4,110,133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 7.485% 15/9/2034	3,649,218	0.05
USD 1,045,000	AbbVie 2.6% 21/11/2024	1,007,656	0.01
USD 1,500,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,402,877	0.02
USD 365,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	346,665	0.01
USD 8,885,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	8,007,503	0.11
USD 603,502	AccessLex Institute 5.953% 25/5/2036	586,721	0.01
USD 2,041,892	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 5.689% 25/5/2037	360,677	0.01
USD 103,678	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 6.029% 25/5/2037	18,439	0.00
USD 1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 0% 15/8/2030	1,134,341	0.01
USD 1,297,000	Affinity Interactive 6.875% 15/12/2027	1,151,423	0.02
USD 340,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-1 3.659% 25/1/2045	182,687	0.00
USD 391,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-3 3.537% 25/4/2045	209,160	0.00
USD 273,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-4 3.513% 25/6/2045	124,413	0.00
USD 35,786	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 0% 25/12/2057	17,771	0.00
USD 603,745	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2.25% 27/9/2060	593,731	0.01
USD 3,756,695	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2.25% 25/6/2060	3,666,685	0.05
USD 13,526,556	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2.115% 25/1/2061	12,884,241	0.18
USD 26,940,001	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-F 1.875% 25/6/2061	25,161,875	0.35
USD 1,678,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	1,455,092	0.02
USD 176,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	166,640	0.00
USD 130,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	119,433	0.00
USD 1,775,000	Alexander Funding Trust II 7.467% 31/7/2028	1,794,472	0.02
USD 1,327,000	Alexandria Real Estate Equities 2.95% 15/3/2034	1,050,783	0.01
USD 900,000	Alexandria Real Estate Equities 4.5% 30/7/2029	853,564	0.01
USD 403,000	Alexandria Real Estate Equities 4.75% 15/4/2035	373,812	0.01
USD 1,043,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,021,937	0.01
USD 9,893,000	Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	9,914,962	0.14
USD 3,441,664	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6.25% 25/10/2034	3,411,206	0.05
USD 2,026,758	Alternative Loan Trust 2005-22T1 5.42% 25/6/2035	1,659,677	0.02
USD 513,097	Alternative Loan Trust 2005-76 5.43% 25/2/2036	466,272	0.01
USD 2,447,154	Alternative Loan Trust 2005-J4 7.454% 25/7/2035	2,358,210	0.03
USD 3,454,993	Alternative Loan Trust 2006-11CB 6.5% 25/5/2036	1,779,183	0.03
USD 938,769	Alternative Loan Trust 2006-15CB 6.5% 25/6/2036	465,081	0.01
USD 1,519,476	Alternative Loan Trust 2006-23CB 5.829% 25/8/2036	315,434	0.00
USD 2,776,479	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.25% 25/11/2036	1,447,392	0.02
USD 529,489	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.933% 20/11/2046	396,051	0.01
USD 373,663	Alternative Loan Trust 2006-OA11 5.809% 25/9/2046	323,283	0.00
USD 2,722,225	Alternative Loan Trust 2006-OA14 6.16% 25/11/2046	2,115,131	0.03
USD 2,930,012	Alternative Loan Trust 2006-OA16 6.109% 25/10/2046	2,116,231	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 304,863	Alternative Loan Trust 2006-OA8 5.809% 25/7/2046	260,915	0.00
USD 2,443,563	Alternative Loan Trust 2006-OC10 5.889% 25/11/2036	2,113,098	0.03
USD 2,669,523	Alternative Loan Trust 2006-OC7 5.929% 25/7/2046	2,386,477	0.03
USD 3,179,102	Alternative Loan Trust 2007-25 6.5% 25/11/2037	1,542,584	0.02
USD 4,495,228	Alternative Loan Trust 2007-3T1 6% 25/4/2037	2,154,565	0.03
USD 2,644,358	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	1,364,151	0.02
USD 2,567	Alternative Loan Trust 2007-OA3 5.789% 25/4/2047	257	0.00
USD 172,836	Alternative Loan Trust 2007-OA8 5.789% 25/6/2047	129,943	0.00
USD 189,689	Alternative Loan Trust 2007-OH2 5.909% 25/8/2047	165,741	0.00
USD 4,345,000	Amazon.com 2.1% 12/5/2031	3,606,817	0.05
USD 4,690,000	Amazon.com 4.7% 1/12/2032	4,663,688	0.06
USD 671,974	Ambac Assurance 5.1% 31/12/9999	977,775	0.01
USD 1,251,000	American Express 2.5% 30/7/2024	1,215,222	0.02
USD 2,500,000	American Express 3% 30/10/2024	2,426,034	0.03
USD 750,000	American Express 4.05% 3/5/2029	711,420	0.01
USD 2,090,000	American Express 4.9% 13/2/2026	2,063,042	0.03
USD 2,440,000	American Express 4.99% 1/5/2026	2,404,574	0.03
USD 732,782	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 5.37% 25/10/2046	504,191	0.01
USD 1,553,783	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 5.639% 25/10/2046	842,445	0.01
USD 559,672	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 5.13% 25/2/2047	223,439	0.00
USD 3,907,883	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 5.619% 25/5/2047	2,289,879	0.03
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 6.231% 17/10/2036	1,858,548	0.03
USD 4,687,372	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	47	0.00
USD 1,285,000	American Municipal Power 7.834% 15/2/2041	1,580,059	0.02
EUR 2,750,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	2,612,425	0.04
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	1,001,270	0.01
EUR 1,600,000	American Tower 0.5% 15/1/2028	1,478,998	0.02
USD 2,000,000	American Tower 1.5% 31/1/2028	1,679,499	0.02
EUR 2,100,000	American Tower 1.95% 22/5/2026*	2,145,334	0.03
USD 750,000	American Tower 2.1% 15/6/2030	598,770	0.01
USD 4,000,000	American Tower 2.3% 15/9/2031	3,132,127	0.04
USD 2,540,000	American Tower 2.7% 15/4/2031	2,077,962	0.03
USD 1,000,000	American Tower 2.75% 15/1/2027	913,943	0.01
USD 1,300,000	American Tower 2.95% 15/1/2025	1,249,682	0.02
EUR 3,050,000	American Tower 4.125% 16/5/2027*	3,292,240	0.05
USD 1,684,000	American Tower 5.25% 15/7/2028	1,657,644	0.02
USD 3,000,000	American Tower 5.65% 15/3/2033	2,988,539	0.04
USD 1,346,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	1,048,686	0.01
USD 1,648,000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9.375% 1/6/2028	1,685,430	0.02
USD 2,000,000	Amgen 1.65% 15/8/2028	1,705,148	0.02
USD 750,000	Amgen 2% 15/1/2032	588,711	0.01
USD 3,250,000	Amgen 2.3% 25/2/2031	2,684,468	0.04
USD 1,320,000	Amgen 2.45% 21/2/2030	1,123,235	0.02
USD 1,000,000	Amgen 3% 22/2/2029	903,389	0.01
USD 6,315,000	Amgen 4.05% 18/8/2029	5,961,049	0.08
USD 5,200,000	Amgen 5.15% 2/3/2028	5,190,954	0.07
GBP 7,681,000	Amgen 5.5% 7/12/2026	9,687,889	0.13
USD 1,375,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	1,376,332	0.02
USD 700,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.5% 1/6/2030	643,987	0.01
USD 7,322,956	APS Resecuritization Trust 2016-1 2.978% 31/7/2057	2,481,984	0.03
USD 607,248	APS Resecuritization Trust 2016-3 8.279% 27/9/2046	609,401	0.01
EUR 1,260,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	1,135,463	0.02
EUR 641,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029*	522,926	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,103,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	2,638,241	0.04
USD 10,110,000	AREIT 2022-CRE7 7.556% 17/6/2039	10,113,975	0.14
USD 2,973,097	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 5.909% 25/5/2035	2,601,588	0.04
USD 155,000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	158,095	0.00
USD 2,200,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7.583% 15/4/2035	2,115,776	0.03
USD 3,265,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 8.583% 15/4/2035	3,175,736	0.04
USD 578,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	498,438	0.01
USD 1,520,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,297,343	0.02
USD 3,604,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6.625% 15/1/2028	3,454,811	0.05
USD 2,085,000	Astrazeneca Finance 4.875% 3/3/2028	2,078,111	0.03
USD 1,500,000	Astrazeneca Finance 4.9% 3/3/2030	1,491,681	0.02
EUR 9,800,000	AT&T 2.875% 2/3/2025*	9,897,760	0.14
GBP 9,000,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	10,333,867	0.14
EUR 1,700,000	AT&T 3.15% 4/9/2036	1,604,593	0.02
EUR 1,810,000	AT&T 4.3% 18/11/2034	1,924,751	0.03
GBP 4,000,000	AT&T 5.5% 15/3/2027	4,943,865	0.07
USD 3,538,972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 7.558% 15/12/2036	3,227,153	0.05
USD 300,000	AvalonBay Communities 3.35% 15/5/2027	280,539	0.00
USD 699,000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	692,953	0.01
EUR 1,100,000	Avantor Funding 2.625% 1/11/2025	1,136,901	0.02
USD 1,282,000	Azul Investments 5.875% 26/10/2024	1,179,440	0.02
USD 2,871,000	Azul Investments 5.875% 26/10/2024	2,641,320	0.04
USD 1,187,000	Azul Secured Finance 11.93% 28/8/2028	1,182,080	0.02
USD 1,607,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033	1,375,004	0.02
USD 5,860,000	Bamll Commercial Mortgage Trust 2016-SS1 0.702% 15/12/2035	60,305	0.00
USD 100,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6.358% 15/11/2033	94,280	0.00
USD 3,273,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6.758% 15/11/2033	3,010,851	0.04
USD 3,645,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6.858% 15/11/2032	3,060,250	0.04
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 7.358% 15/11/2032	1,466,889	0.02
USD 454,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6.508% 15/9/2034	451,929	0.01
USD 160,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6.708% 15/9/2034	158,898	0.00
USD 3,215,409	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 7.058% 15/9/2034	3,185,623	0.04
USD 939,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 4.482% 15/9/2048	843,396	0.01
USD 209,483	Banc of America Funding 2006-A Trust 4.388% 20/2/2036	188,155	0.00
USD 12,895,473	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 0% 26/11/2036	3,827,576	0.05
EUR 150,000	Banff Merger Sub 8.375% 1/9/2026	159,048	0.00
EUR 2,810,000	Bank of America 0.583% 24/8/2028	2,649,439	0.04
EUR 3,800,000	Bank of America 1.381% 9/5/2030	3,533,340	0.05
USD 341,000	Bank of America 1.658% 11/3/2027	308,090	0.00
USD 750,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	587,858	0.01
EUR 4,200,000	Bank of America 1.949% 27/10/2026	4,340,659	0.06
USD 2,415,000	Bank of America 2.299% 21/7/2032	1,906,215	0.03
USD 5,000,000	Bank of America 2.496% 13/2/2031	4,159,105	0.06
USD 2,355,000	Bank of America 2.572% 20/10/2032	1,887,409	0.03
USD 750,000	Bank of America 2.592% 29/4/2031	624,380	0.01
USD 2,415,000	Bank of America 2.651% 11/3/2032	1,978,230	0.03
USD 1,500,000	Bank of America 2.687% 22/4/2032	1,227,809	0.02
USD 4,009,000	Bank of America 3.384% 2/4/2026	3,851,951	0.05
USD 361,000	Bank of America 3.5% 19/4/2026	343,276	0.00
USD 1,881,000	Bank of America 3.705% 24/4/2028	1,759,879	0.02
USD 775,000	Bank of America 3.824% 20/1/2028	730,092	0.01
USD 1,020,000	Bank of America 3.97% 5/3/2029	952,343	0.01
USD 1,020,000	Bank of America 3.974% 7/2/2030	940,349	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,742,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	3,590,062	0.05
USD 4,720,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,631,970	0.06
USD 7,094,000	Bank of America 5.202% 25/4/2029	6,986,988	0.10
USD 9,780,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0.735% 15/2/2050	177,759	0.00
USD 4,000,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1.391% 15/2/2050	147,104	0.00
USD 1,700,000	Bank of New York Mellon 2.05% 26/1/2027	1,536,358	0.02
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.85% 26/4/2029	5,434,010	0.08
USD 1,475,000	Bank of New York Mellon 4.947% 26/4/2027	1,451,335	0.02
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.07% 10/2/2022	376,317	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.324% 10/12/2025	451,198	0.01
USD 1,725,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	1,967,754	0.03
USD 902,300	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5.749% 25/11/2035	819,622	0.01
USD 1,533,776	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5.879% 25/1/2036	1,407,949	0.02
USD 37,247	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 6.014% 25/1/2036	34,241	0.00
USD 98,438	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 6.104% 25/1/2036	90,234	0.00
USD 140,232	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.969% 25/4/2036	132,691	0.00
USD 403,166	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6.029% 25/4/2036	360,174	0.01
USD 97,014	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6.059% 25/4/2036	86,412	0.00
USD 530,291	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 6.209% 25/4/2036	473,694	0.01
USD 263,172	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 5.849% 25/7/2036	238,887	0.00
USD 438,887	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5.679% 25/10/2036	405,639	0.01
USD 2,426,140	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 5.774% 25/12/2036	2,241,592	0.03
USD 1,828,365	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5.834% 25/3/2037	1,645,356	0.02
USD 2,665,316	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 5.699% 25/7/2037	2,365,412	0.03
USD 4,132,263	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 6.104% 25/9/2037	3,785,008	0.05
USD 1,545,938	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 6.929% 25/12/2037	1,313,931	0.02
USD 1,630,545	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 7.929% 25/4/2038	1,591,385	0.02
USD 4,757,019	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6.435% 28/5/2039	3,836,488	0.05
USD 1,213,914	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 6.735% 28/5/2039	1,033,635	0.01
USD 3,937,681	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 6.435% 28/2/2040	3,450,341	0.05
USD 314,363	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 6.435% 28/12/2040	293,454	0.00
USD 840,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4.409% 5/8/2038	552,373	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.23% 15/3/2037	806,995	0.01
USD 1,000,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.479% 15/3/2037	846,184	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0.295% 10/8/2035	88,039	0.00
USD 19,046,126	BBCMS Trust 2015-SRCH 1.059% 10/8/2035	511,371	0.01
USD 1,035,022	BCAP 2011-RR5-I Trust 4.137% 28/5/2036	984,123	0.01
USD 1,816,171	BCAP Trust 2007-AA4 4.244% 25/6/2047	829,023	0.01
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 7.575% 15/6/2030	209,701	0.00
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 7.83% 15/6/2030	201,259	0.00
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A 8.29% 15/6/2030	153,706	0.00
USD 5,980,000	BDS 2022-FL12 7.45% 19/8/2038	5,971,334	0.08
USD 408,253	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 5.749% 25/11/2036	333,156	0.00
USD 1,716,867	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 5.749% 25/1/2047	1,408,425	0.02
USD 49,145	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 3.682% 25/7/2034	44,392	0.00
USD 23,721	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2004-HE7 7.154% 25/8/2034	23,409	0.00
USD 1,709,237	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6.25% 25/12/2035	1,083,040	0.02
USD 1,840,023	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-HE8 7.379% 25/8/2035	1,813,573	0.03
USD 2,176,281	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6.25% 25/2/2036	1,585,944	0.02
USD 1,351,133	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 5.02% 25/12/2035	1,992,230	0.03
USD 1,479,890	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 5.769% 25/9/2036	1,455,012	0.02
USD 720,000	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE8 5.949% 25/10/2036	624,503	0.01
USD 429,625	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5.569% 25/3/2037	386,756	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 676,909	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5.569% 25/3/2037	612,130	0.01
USD 932,242	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 5.749% 25/3/2037	829,092	0.01
USD 339,745	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5.679% 25/4/2037	485,892	0.01
USD 5,208,551	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 5.779% 25/4/2037	5,243,821	0.07
USD 203,910	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 5.709% 25/8/2036	197,514	0.00
USD 239,511	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 5.769% 25/3/2037	219,259	0.00
USD 435,931	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 5.569% 25/3/2037	372,112	0.01
USD 290,095	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 5.639% 25/6/2037	271,426	0.00
USD 3,142,000	Beazer Homes USA 7.25% 15/10/2029	3,033,652	0.04
EUR 1,000,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	1,007,133	0.01
USD 2,875,000	Becton Dickinson 1.957% 11/2/2031	2,311,218	0.03
USD 1,400,000	Becton Dickinson 3.734% 15/12/2024	1,366,065	0.02
USD 1,300,000	Becton Dickinson 4.693% 13/2/2028	1,275,687	0.02
EUR 500,000	Belden 3.375% 15/7/2027*	506,941	0.01
EUR 200,000	Belden 3.875% 15/3/2028*	200,828	0.00
USD 2,000,000	Belton Independent School District 4% 15/2/2047	1,874,064	0.03
USD 5,012,995	BHMS 2018-ATLS 6.857% 15/7/2035	4,927,138	0.07
USD 4,161,000	BHMS 2018-ATLS 7.507% 15/7/2035	3,998,996	0.06
USD 1,321,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	1,315,247	0.02
USD 464,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	465,124	0.01
EUR 1,100,000	Booking 4% 15/11/2026*	1,205,468	0.02
EUR 5,244,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	5,653,040	0.08
USD 1,045,000	BP Capital Markets America 3.588% 14/4/2027	996,296	0.01
USD 1,460,000	BP Capital Markets America 3.937% 21/9/2028	1,392,973	0.02
USD 5,612,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	4,526,692	0.06
USD 2,250,000	Broadcom 3.419% 15/4/2033	1,866,949	0.03
USD 1,410,000	Broadcom 4% 15/4/2029	1,299,587	0.02
USD 4,210,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	3,850,030	0.05
USD 1,500,000	Broadcom 4.3% 15/11/2032	1,356,871	0.02
USD 82,000	Buckeye Partners 3.95% 1/12/2026	75,542	0.00
USD 941,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	905,430	0.01
USD 1,500,000	Buckeye Partners 4.35% 15/10/2024	1,457,520	0.02
USD 1,034,492	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.454% 10/3/2033	971,307	0.01
USD 2,604,935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,351,091	0.03
USD 13,358,641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.717% 10/3/2033	11,762,707	0.16
USD 573,000	BXP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	422,014	0.01
USD 2,156,000	BXP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	1,493,440	0.02
USD 470,000	BXP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	392,918	0.01
USD 945,000	BXP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	723,856	0.01
USD 1,864,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	1,850,724	0.03
USD 3,368,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027	3,425,990	0.05
USD 1,272,000	California Resources 7.125% 1/2/2026	1,276,066	0.02
USD 1,655,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,016,277	0.03
USD 1,299,000	Calpine 5.125% 15/3/2028	1,187,917	0.02
USD 2,755,000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9.75% 15/7/2028	2,744,966	0.04
USD 1,285,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7.575% 15/12/2037	1,269,059	0.02
USD 7,075,000	Capital One Financial 6.377% 8/6/2034	7,005,417	0.10
USD 1,490,000	Cargill 4.5% 24/6/2026	1,471,461	0.02
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 6.059% 25/1/2036	390,757	0.01
USD 906,848	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 5.579% 25/8/2036	852,108	0.01
USD 302,654	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 5.589% 25/10/2036	290,212	0.00
USD 2,536,562	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 5.689% 25/2/2037	2,355,872	0.03
USD 1,198,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	1,032,077	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
EUR 1,768,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	1,606,584	0.02
USD 942,000	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3.911% 13/11/2050	762,082	0.01
USD 1,270,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,186,735	0.02
USD 199,000	CenterPoint Energy Houston Electric 5.3% 1/4/2053	198,187	0.00
USD 332,000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	336,484	0.01
USD 9,621,000	Century Communities 6.75% 1/6/2027	9,595,444	0.13
USD 5,181,244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1.859% 10/1/2048	176,948	0.00
USD 5,189,832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.851% 10/5/2058	86,139	0.00
USD 1,710,609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 4.998% 10/5/2058	1,544,221	0.02
USD 1,462,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4.199% 15/6/2050	1,245,821	0.02
USD 1,628,000	Charles Schwab 5.875% 24/8/2026	1,637,325	0.02
USD 1,825,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	1,514,923	0.02
USD 2,365,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.3% 1/2/2032	1,785,332	0.03
USD 1,784,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	1,660,683	0.02
USD 1,500,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5.05% 30/3/2029	1,425,913	0.02
USD 9,505,824	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	4,176,842	0.06
EUR 600,000	Chemours 4% 15/5/2026	614,083	0.01
USD 874,000	Chesapeake Energy 5.5% 1/2/2026	853,778	0.01
USD 2,092,772	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 5.39% 25/4/2046	655,473	0.01
USD 323,264	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 5.829% 25/4/2046	300,707	0.00
USD 5,435,709	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6.5% 25/9/2037	2,090,342	0.03
USD 68,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	62,851	0.00
USD 82,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	79,068	0.00
USD 982,447	Citicorp Mortgage Trust Series 2007-9 6.25% 25/12/2037	817,831	0.01
USD 1,057,180	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6.5% 25/6/2038	822,790	0.01
EUR 2,400,000	Citigroup 1.5% 24/7/2026*	2,477,149	0.03
GBP 1,524,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	1,708,568	0.02
USD 3,165,000	Citigroup 2.561% 1/5/2032	2,550,350	0.04
USD 5,750,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	4,752,348	0.07
USD 3,165,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	2,653,532	0.04
USD 6,950,000	Citigroup 3.07% 24/2/2028	6,376,489	0.09
USD 1,933,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,856,399	0.03
USD 124,000	Citigroup 3.4% 1/5/2026	117,319	0.00
USD 375,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	344,705	0.00
USD 3,000,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	2,785,171	0.04
USD 1,622,121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5.257% 11/3/2047	1,564,827	0.02
USD 3,715,001	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 5.629% 25/5/2037	2,405,309	0.03
USD 2,332,342	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 5.599% 25/7/2045	1,573,497	0.02
USD 2,024,884	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 5.749% 25/12/2036	1,115,218	0.02
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 6.134% 25/3/2037	2,583,119	0.04
USD 597,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4.25% 25/2/2054	539,975	0.01
USD 245,995	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	213,676	0.00
USD 2,865,000	City of Charlotte Airport Revenue 3% 1/7/2046	2,158,498	0.03
USD 1,055,000	City of Riverside Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,285,820	0.02
USD 3,015,000	City of Salt Lake City Airport Revenue 5% 1/7/2046	3,086,601	0.04
USD 3,428,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	3,523,996	0.05
EUR 2,834,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	2,977,604	0.04
USD 206,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	184,950	0.00
USD 4,424,000	Cleveland-Cliffs 6.75% 15/4/2030	4,226,058	0.06
USD 8,005,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	7,160,173	0.10
USD 2,490,000	Colorado Health Facilities Authority 4% 15/11/2046	2,321,728	0.03
USD 321,000	Comcast 1.95% 15/1/2031	259,686	0.00
USD 1,500,000	Comcast 2.35% 15/1/2027	1,374,112	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,750,000	Comcast 3.3% 1/2/2027	1,654,422	0.02
USD 3,250,000	Comcast 3.4% 1/4/2030	2,963,773	0.04
USD 156,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	147,210	0.00
USD 2,736,000	Comcast 4.65% 15/2/2033	2,675,264	0.04
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 4.54% 10/8/2030	80,687	0.00
USD 323,283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4.813% 10/2/2047	285,136	0.00
USD 666,000	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust 3.961% 10/3/2047	659,863	0.01
USD 1,265,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4.514% 10/9/2047	1,189,449	0.02
USD 2,691,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 4.491% 10/8/2048	2,482,361	0.03
USD 3,919,612	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0.942% 10/8/2048	48,000	0.00
USD 1,024,500	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4.667% 10/8/2048	923,900	0.01
USD 846,000	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust 3.829% 10/2/2048	771,020	0.01
USD 1,316,780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3.774% 10/10/2048	1,254,099	0.02
USD 111,320,422	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0.145% 10/10/2036	234,029	0.00
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3.285% 10/10/2036	853,398	0.01
USD 2,910,275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1.75% 10/5/2051	185,137	0.00
USD 5,105,000	Commercial Metals 4.125% 15/1/2030	4,523,437	0.06
USD 1,857,000	Commercial Metals 4.375% 15/3/2032	1,591,587	0.02
USD 425,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	380,352	0.01
USD 295,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	203,928	0.00
USD 1,880,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	1,993,553	0.03
USD 235,000	Commonwealth of Massachusetts 5.456% 1/12/2039	243,533	0.00
USD 835,000	Concentrix 6.6% 2/8/2028	817,605	0.01
USD 1,625,000	Concentrix 6.65% 2/8/2026	1,626,117	0.02
USD 412,019	Conseco Finance 6.63% 1/6/2030	395,257	0.01
USD 183,775	Conseco Finance 6.83% 1/4/2030	176,572	0.00
USD 1,945,053	Conseco Finance 6.98% 1/9/2030	1,822,216	0.03
USD 353,314	Conseco Finance 7.21% 15/1/2029	339,501	0.00
USD 786,194	Conseco Finance 7.5% 1/3/2030	299,063	0.00
USD 619,190	Conseco Finance 7.53% 15/3/2028	601,513	0.01
USD 733,047	Conseco Finance 7.86% 1/3/2030	290,284	0.00
USD 1,774,161	Conseco Finance Securitizations 7.96% 1/5/2031	515,778	0.01
USD 1,191,186	Conseco Finance Securitizations 8.06% 1/9/2029	242,295	0.00
USD 3,228,998	Conseco Finance Securitizations 8.2% 1/5/2031	966,522	0.01
USD 1,472,272	Conseco Finance Securitizations 8.31% 1/5/2032	287,034	0.00
USD 415,000	Conservation Fund A Nonprofit 3.474% 15/12/2029	356,253	0.01
USD 2,748,000	Consumers Energy 4.9% 15/2/2029	2,724,505	0.04
USD 850,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	937,319	0.01
EUR 2,073,000	Coty 3.875% 15/4/2026	2,187,759	0.03
EUR 300,000	Coty 4.75% 15/4/2026	320,764	0.00
USD 325,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	324,090	0.00
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 5.864% 25/11/2036	4,364,124	0.06
USD 1,495,356	Countrywide Asset-Backed Certificates 5.93% 25/5/2037	1,142,046	0.02
USD 850,000	County of Broward Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	714,742	0.01
USD 2,090,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	1,783,469	0.02
USD 1,588,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	1,367,228	0.02
USD 2,204	Credit Suisse First Boston Mortgage 4.877% 15/4/2037	2,135	0.00
USD 7,508,217	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6.5% 27/10/2037	3,053,446	0.04
USD 286,193	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3.053% 25/12/2036	229,475	0.00
USD 1,418,696	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 5.769% 25/7/2037	908,789	0.01
USD 3,370,922	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.056% 25/9/2036	183,177	0.00
USD 499,253	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.75% 25/10/2036	481,400	0.01
USD 11,673,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	11,366,304	0.16

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 6,250,000	Crown Castle 2.5% 15/7/2031	5,045,564	0.07
USD 3,408,000	Crown Castle 2.9% 15/3/2027	3,126,416	0.04
USD 2,040,000	Crown Castle 3.1% 15/11/2029	1,774,896	0.02
USD 1,300,000	Crown Castle 4.3% 15/2/2029	1,220,938	0.02
USD 2,561,000	Crown Castle 5% 11/1/2028	2,513,238	0.03
USD 728,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	715,915	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0.259% 15/11/2050	195,699	0.00
USD 2,494,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.864% 15/8/2051	1,986,660	0.03
USD 2,937,000	CSC 5.25% 1/6/2024	2,789,865	0.04
USD 2,992,000	CSC 5.5% 15/4/2027	2,582,142	0.04
USD 116,659,107	CSMC 2014-USA OA 0.186% 15/9/2037	160,453	0.00
USD 770,000	CSMC 2017-TIME 3.646% 13/11/2039	657,495	0.01
USD 451,695	CSMC Series 2014-4R 4.498% 27/2/2036	430,682	0.01
USD 1,239,491	CSMC Series 2015-4R 3.931% 27/10/2036	915,652	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 6.308% 15/12/2030	754,944	0.01
USD 2,815,000	CVS Health 1.3% 21/8/2027	2,421,632	0.03
USD 5,037,000	CVS Health 1.75% 21/8/2030	4,000,383	0.06
USD 4,590,000	CVS Health 1.875% 28/2/2031	3,599,506	0.05
USD 500,000	CVS Health 2.875% 1/6/2026	468,184	0.01
USD 815,000	CVS Health 3.625% 1/4/2027	771,332	0.01
USD 3,746,220	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 4.52% 25/4/2036	3,212,363	0.04
USD 2,938,323	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 6.547% 25/5/2036	2,319,961	0.03
USD 803,344	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5.689% 25/12/2036	724,068	0.01
USD 8,157	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 5.749% 25/9/2046	8,108	0.00
USD 6,207,634	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 5.879% 25/3/2037	4,921,641	0.07
USD 1,259,186	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-22 5.659% 25/5/2047	1,005,076	0.01
USD 197,031	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 5.695% 15/3/2034	190,583	0.00
USD 124,351	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 5.631% 25/1/2029	180,145	0.00
USD 62,418	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6.155% 25/6/2035	74,771	0.00
USD 172,856	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5.615% 15/5/2035	172,359	0.00
USD 35,756	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 5.615% 15/5/2035	35,346	0.00
USD 118,472	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 5.605% 15/5/2035	116,999	0.00
USD 624,806	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 5.605% 15/5/2036	603,046	0.01
USD 318,997	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 5.575% 15/11/2036	312,330	0.00
USD 467,541	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I 5.565% 15/1/2037	428,441	0.01
USD 895,000	DAE Funding 1.55% 1/8/2024	856,399	0.01
USD 452,000	DAE Funding 2.625% 20/3/2025*	425,370	0.01
USD 650,000	Dallas Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	488,625	0.01
USD 417,000	Dana 4.25% 1/9/2030	342,813	0.00
USD 3,655,051	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.906% 15/5/2035	3,585,342	0.05
USD 3,207,307	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7.606% 15/5/2035	3,126,082	0.04
USD 4,389,268	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	133,303	0.00
USD 6,941,235	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	5,425,804	0.08
USD 2,469,265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	1,917,739	0.03
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	870,361	0.01
USD 1,432,000	Dell International / EMC 6.02% 15/6/2026	1,446,672	0.02
USD 4,471,802	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4 5.769% 25/8/2047	3,945,396	0.06
USD 157,555	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.364% 25/7/2036	127,415	0.00
USD 246,830	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.51% 25/7/2036	199,585	0.00
USD 2,472,000	DISH DBS 5.875% 15/11/2024	2,305,267	0.03
USD 1,660,000	DISH Network 0% 15/12/2025	1,077,158	0.02
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	922,845	0.01
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	917,079	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,150,000	Dollar General 3.5% 3/4/2030	1,913,387	0.03
USD 1,045,000	Dollar General 3.875% 15/4/2027	997,634	0.01
USD 1,026,000	Dresdner Funding Trust I 8.151% 30/6/2031	1,099,103	0.02
EUR 3,207,000	Duke Energy 3.1% 15/6/2028	3,310,277	0.05
USD 2,214,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	2,260,284	0.03
USD 757,000	Eaton 4.35% 18/5/2028	742,938	0.01
USD 5,100,000	Ecolab 2.125% 1/2/2032	4,153,438	0.06
USD 2,000,000	Ecolab 5.25% 15/1/2028	2,026,318	0.03
USD 750,000	Edison International 6.95% 15/11/2029	789,767	0.01
USD 3,426,000	Elevance Health 1.5% 15/3/2026	3,111,119	0.04
USD 4,555,000	Elevance Health 2.55% 15/3/2031	3,813,696	0.05
USD 1,750,000	Elevance Health 2.875% 15/9/2029	1,544,462	0.02
USD 715,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	674,037	0.01
USD 750,000	Elevance Health 4.1% 15/5/2032	692,554	0.01
USD 2,000,000	Elevance Health 4.9% 8/2/2026	1,972,591	0.03
USD 1,260,000	Elmwood CLO 15 6.686% 22/4/2035	1,251,570	0.02
USD 2,750,000	Elmwood CLO 15 9.016% 22/4/2035	2,691,625	0.04
EUR 396,000	Emerald Debt Merger Sub 6.375% 15/12/2030	429,735	0.01
USD 1,049,000	Emerald Debt Merger Sub 6.625% 15/12/2030	1,032,281	0.01
EUR 1,725,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025*	1,789,922	0.02
GBP 600,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026*	685,832	0.01
USD 1,500,000	Enterprise Products Operating 2.8% 31/1/2030	1,300,418	0.02
USD 750,000	Enterprise Products Operating 3.125% 31/7/2029	671,136	0.01
USD 900,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2027	908,734	0.01
USD 595,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	610,887	0.01
USD 1,500,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	1,382,390	0.02
USD 625,000	Equinix 2.9% 18/11/2026	577,355	0.01
USD 2,020,000	Equinix 3.2% 18/11/2029	1,767,813	0.02
USD 6,123,000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	6,090,276	0.08
USD 1,681,000	Eversource Energy 2.9% 1/10/2024	1,630,996	0.02
USD 2,085,000	Eversource Energy 4.75% 15/5/2026	2,050,650	0.03
USD 1,118,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	1,025,746	0.01
USD 8,977,089	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/10/2049	1,424,374	0.02
USD 21,083,529	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/3/2050	3,615,705	0.05
USD 8,734,890	Fannie Mae Interest Strip 3.5% 25/8/2049	1,559,437	0.02
USD 25,184	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	23,044	0.00
USD 159,064	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2050	144,877	0.00
USD 619,198	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	583,719	0.01
USD 699,200	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	654,568	0.01
USD 515,182	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	484,402	0.01
USD 510,957	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	480,429	0.01
USD 1,505,284	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	1,410,837	0.02
USD 13,462,395	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	12,596,714	0.17
USD 4,155,007	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2050	3,872,500	0.05
USD 232,513	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	217,700	0.00
USD 1,510,794	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	1,411,528	0.02
USD 5,568,073	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	5,201,700	0.07
USD 1,614,654	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	1,507,517	0.02
USD 346,508	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	323,701	0.00
USD 34,901,812	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	32,621,600	0.45
USD 39,667,001	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	37,042,488	0.51
USD 4,980,449	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2051	4,640,595	0.06
USD 19,160,248	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	17,884,894	0.25

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 518,775	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2052	487,053	0.01
USD 10,463,491	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	9,728,927	0.14
USD 8,350,874	Fannie Mae REMICS 3.5% 25/2/2051	1,499,191	0.02
USD 3,016,779	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	622,583	0.01
USD 10,489,417	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	2,111,435	0.03
USD 9,610,053	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	1,914,297	0.03
USD 4,124,187	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	774,886	0.01
EUR 1,000,000	Fidelity National Information Services 0.625% 3/12/2025	1,009,704	0.01
USD 1,256,000	Fidelity National Information Services 1.15% 1/3/2026	1,130,182	0.02
EUR 2,550,000	Fidelity National Information Services 1.5% 21/5/2027	2,539,651	0.04
USD 2,920,000	Fifth Third Bancorp 6.339% 27/7/2029	2,953,478	0.04
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 6.479% 25/10/2034	729,801	0.01
USD 1,388,150	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5.669% 25/10/2036	927,431	0.01
USD 814,047	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 5.749% 25/10/2036	527,346	0.01
USD 5,229,216	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 5.709% 25/3/2037	2,825,604	0.04
GBP 800,000	Fiserv 2.25% 1/7/2025	948,779	0.01
USD 7,341,000	Five Point Operating / Five Point Capital 7.875% 15/11/2025*	6,886,959	0.10
USD 3,140,322	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4.921% 25/10/2048	2,686,825	0.04
USD 2,174,000	Florida Power & Light 4.4% 15/5/2028	2,124,821	0.03
USD 1,144,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032	894,740	0.01
USD 2,667,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	2,545,507	0.03
GBP 1,560,000	Ford Motor Credit 4.535% 6/3/2025	1,891,274	0.03
EUR 875,000	Ford Motor Credit 4.867% 3/8/2027	936,976	0.01
USD 1,579,000	Ford Motor Credit 5.584% 18/3/2024	1,571,409	0.02
EUR 618,000	Ford Motor Credit 6.125% 15/5/2028	688,512	0.01
GBP 5,605,000	Ford Motor Credit 6.86% 5/6/2026*	6,935,400	0.10
USD 739,000	Forestar 3.85% 15/5/2026	685,780	0.01
USD 5,361,000	Forestar 5% 1/3/2028	4,964,290	0.07
USD 18,533,943	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.941% 25/5/2029	638,077	0.01
USD 30,127,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.024% 25/6/2029	1,328,824	0.02
USD 6,910,758	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.119% 25/10/2030	380,116	0.01
USD 3,380,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.467% 25/12/2029	195,843	0.00
USD 13,537,109	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	12,732,212	0.18
USD 7,713,717	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	7,184,301	0.10
USD 1,287,059	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	214,491	0.00
USD 3,327,193	Freddie Mac REMICS 3% 25/3/2051	549,663	0.01
USD 2,826,206	Freddie Mac REMICS 3% 25/6/2051	452,079	0.01
USD 1,307,393	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	211,674	0.00
USD 3,449,904	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	510,738	0.01
USD 1,666,576	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	260,534	0.00
USD 3,725,181	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	625,865	0.01
USD 11,792,592	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	1,572,015	0.02
USD 11,794,726	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	1,994,460	0.03
USD 4,851,967	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/3/2051	841,494	0.01
USD 7,975,642	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/6/2051	1,457,781	0.02
USD 3,810,424	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/10/2051	693,810	0.01
USD 8,016,646	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	1,562,474	0.02
USD 4,655,448	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8.688% 25/1/2042	4,626,374	0.06
USD 50,382,931	Freddie Mac Strips 3% 15/10/2052	8,346,873	0.12
USD 401,109	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 13.352% 25/5/2025	404,111	0.01
USD 214,257	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 16.902% 25/1/2025	217,781	0.00
USD 1,337,000	Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	1,332,060	0.02
USD 767,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	755,683	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 782,435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3.715% 25/10/2027	713,930	0.01
USD 4,972,000	FREMF 2018-KW05 Trust 3.786% 25/4/2028	4,184,232	0.06
USD 83,237,874	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0.1% 25/1/2029	307,968	0.00
USD 2,755,116	Fremont Home Loan Trust 2006-3 5.709% 25/2/2037	2,127,596	0.03
USD 3,100,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	2,824,913	0.04
USD 3,365,000	Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	3,230,883	0.05
USD 3,925,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	3,810,380	0.05
USD 4,910,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	4,579,704	0.06
USD 1,125,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	1,026,186	0.01
USD 15,753,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.894% 17/8/2037	15,831,795	0.22
USD 776,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028*	691,138	0.01
USD 1,956,311	GAM Resecuritization Trust 2018-B 6.5% 27/8/2051	1,833,758	0.03
USD 205,000	Garden Spinco 8.625% 20/7/2030	218,627	0.00
USD 2,410,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	2,411,275	0.03
USD 1,755,000	Gen Digital 7.125% 30/9/2030	1,770,539	0.02
USD 750,000	General Mills 2.875% 15/4/2030	655,936	0.01
USD 800,000	General Mills 4.2% 17/4/2028	766,757	0.01
USD 3,500,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	3,112,458	0.04
GBP 1,300,000	General Motors Financial 5.15% 15/8/2026	1,602,730	0.02
USD 1,499,000	General Motors Financial 5.4% 6/4/2026	1,481,315	0.02
USD 700,000	Georgia-Pacific 0.95% 15/5/2026	621,430	0.01
USD 1,000,000	Georgia-Pacific 2.3% 30/4/2030	840,416	0.01
USD 1,950,000	Gilead Sciences 1.65% 1/10/2030	1,566,037	0.02
USD 2,750,000	Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026	2,642,678	0.04
EUR 3,407,000	Global Payments 4.875% 17/3/2031	3,694,265	0.05
USD 1,086,000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	932,435	0.01
USD 904,000	Golden Entertainment 7.625% 15/4/2026	898,151	0.01
EUR 3,000,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029	2,684,377	0.04
USD 3,340,000	Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,996,297	0.04
EUR 4,000,000	Goldman Sachs 1.25% 7/2/2029	3,691,700	0.05
USD 1,709,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,532,108	0.02
USD 6,500,000	Goldman Sachs 1.542% 10/9/2027	5,736,611	0.08
USD 1,510,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	1,342,917	0.02
USD 1,500,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	1,169,132	0.02
USD 750,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032*	592,947	0.01
USD 1,125,000	Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	911,203	0.01
USD 4,250,000	Goldman Sachs 2.65% 21/10/2032	3,412,517	0.05
USD 1,300,000	Goldman Sachs 3.5% 23/1/2025	1,259,523	0.02
USD 4,633,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	4,332,304	0.06
GBP 1,000,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028	1,318,921	0.02
USD 4,672,078	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	3,570,947	0.05
USD 3,373,596	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	2,605,370	0.04
USD 8,588,000	GoTo 5.5% 1/9/2027	5,031,572	0.07
USD 2,394,789	Government National Mortgage Association 0.519% 16/9/2053	33,899	0.00
USD 462,128	Government National Mortgage Association 0.618% 16/10/2056	12,082	0.00
USD 565,174	Government National Mortgage Association 0.679% 16/8/2057	16,168	0.00
USD 2,828,723	Government National Mortgage Association 0.77% 16/12/2057	103,752	0.00
USD 370,979	Government National Mortgage Association 0.923% 16/2/2050	8,629	0.00
USD 3,277,507	Government National Mortgage Association 2.5% 20/9/2050	428,876	0.01
USD 5,622,041	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	662,947	0.01
USD 2,831,373	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	372,007	0.01
USD 954,600	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	125,148	0.00
USD 3,480,626	Government National Mortgage Association 2.5% 20/12/2050	458,546	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,538,901	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2050	231,860	0.00
USD 1,497,560	Government National Mortgage Association 3% 20/4/2051	212,286	0.00
USD 25,089,161	Government National Mortgage Association 3% 20/5/2051	3,683,502	0.05
USD 2,685,284	Government National Mortgage Association 3% 20/6/2051	404,582	0.01
USD 13,521,407	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2051	2,040,133	0.03
USD 2,074,515	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	247,123	0.00
USD 1,202,223	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	143,639	0.00
USD 1,786,699	Government National Mortgage Association 3.5% 20/1/2051	300,050	0.00
USD 2,718,737	Government National Mortgage Association 3.5% 20/10/2051	427,836	0.01
USD 1,215,155	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	166,672	0.00
USD 1,850,148	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	357,760	0.01
USD 1,154,819	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	183,141	0.00
USD 2,649,694	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	417,405	0.01
USD 333,000	GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028	323,137	0.00
USD 731,000	Grand Canyon University 3.25% 1/10/2023	721,862	0.01
USD 2,102,000	Grand Canyon University 5.125% 1/10/2028	1,899,788	0.03
EUR 316,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029	302,668	0.00
USD 259,044	Greenpoint Manufactured Housing 8.29% 15/12/2029	257,537	0.00
USD 772,575	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 6.43% 25/3/2036	681,471	0.01
USD 25,000,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0.395% 3/5/2032	94,765	0.00
USD 2,452,265	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.366% 3/5/2032	2,375,679	0.03
USD 110,000	GS Mortgage Trust 2014-GC20 4.529% 10/4/2047	103,773	0.00
USD 730,000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3.932% 10/10/2035	610,094	0.01
USD 1,455,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4.554% 10/7/2048	1,303,940	0.02
USD 440,000	GS Mortgage Trust 2017-375H 3.591% 10/9/2037	390,257	0.01
USD 2,170,000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2.856% 10/5/2034	1,586,812	0.02
USD 9,680,133	GSAA Home Equity Trust 2006-5 5.789% 25/3/2036	3,194,787	0.04
USD 417,260	GSAA Home Equity Trust 2007-2 5.917% 25/3/2037	83,142	0.00
USD 880,273	GSAMP Trust 2007-HI 5.829% 25/1/2047	451,562	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 8.804% 25/2/2047	1,863,818	0.03
USD 756,860	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 5.779% 25/1/2035	640,272	0.01
USD 2,826,791	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 5.779% 25/3/2035	2,465,446	0.03
USD 725,054	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1 5.779% 25/1/2036	587,771	0.01
USD 1,658,781	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6.5% 25/8/2036	595,040	0.01
USD 411,870	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5.5% 25/1/2037	529,165	0.01
USD 3,940,246	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2.929% 25/6/2047	2,526,296	0.04
USD 2,377,000	GXO Logistics 2.65% 15/7/2031	1,862,928	0.03
USD 6,820,249	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 5.838% 19/12/2036	5,384,709	0.07
USD 362,316	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 5.678% 19/7/2047	333,907	0.01
USD 2,800,000	Hays Consolidated Independent School District 4% 15/2/2047	2,611,637	0.04
USD 1,328,000	HCA 3.125% 15/3/2027	1,218,894	0.02
USD 1,400,000	HCA 3.5% 1/9/2030	1,223,542	0.02
USD 1,000,000	HCA 3.625% 15/3/2032	860,046	0.01
USD 4,700,000	HCA 4.5% 15/2/2027	4,540,891	0.06
USD 3,576,000	HCA 5.375% 1/2/2025	3,552,535	0.05
USD 2,045,000	HCA 5.875% 1/2/2029	2,055,698	0.03
USD 1,000,000	Healthpeak 1.35% 1/2/2027	876,549	0.01
USD 684,000	Healthpeak 5.25% 15/12/2032	660,531	0.01
USD 6,200,000	Home Depot 1.375% 15/3/2031	4,858,632	0.07
USD 3,000,000	Home Depot 2.95% 15/6/2029	2,722,275	0.04
USD 1,190,000	Home Equity Asset Trust 2006-3 6.029% 25/7/2036	1,073,454	0.01
USD 1,446,216	Home Equity Asset Trust 2007-1 5.729% 25/5/2037	1,105,906	0.02
USD 6,519,759	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 5.599% 25/4/2037	4,518,014	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 6,774,716	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 5.669% 25/4/2037	4,398,584	0.06
USD 262,607	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3.726% 25/7/2034	252,626	0.00
USD 204,000	Horizon Therapeutics USA 5.5% 1/8/2027	208,574	0.00
USD 2,073,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982% 5/3/2037	1,879,710	0.03
USD 2,120,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	1,914,520	0.03
USD 65,000	iHeartCommunications 4.75% 15/1/2028	50,184	0.00
USD 98,000	iHeartCommunications 5.25% 15/8/2027	77,858	0.00
USD 104,490	iHeartCommunications 6.375% 1/5/2026	91,192	0.00
USD 464,752	Impac Secured Assets Trust 2006-3 5.769% 25/11/2036	412,365	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS 3.478% 15/6/2034	1,175,445	0.02
USD 5,620,171	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	5,382,499	0.07
USD 2,669,820	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	2,578,946	0.04
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	1,902,192	0.03
USD 370,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	344,486	0.01
USD 800,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4.158% 10/7/2035	740,685	0.01
USD 2,317,513	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 0% 25/7/2047	1,650	0.00
USD 434,749	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 5.669% 25/7/2036	423,924	0.01
USD 3,487,702	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 5.789% 25/1/2037	3,077,213	0.04
USD 4,006,027	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 3.689% 25/9/2037	2,736,443	0.04
USD 457,722	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 5.669% 25/8/2037	402,615	0.01
USD 2,785,000	Intercontinental Exchange 1.85% 15/9/2032	2,121,676	0.03
USD 1,500,000	Intercontinental Exchange 3.1% 15/9/2027	1,387,706	0.02
USD 200,000	IQVIA 5% 15/5/2027	192,299	0.00
USD 261,783	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 6.53% 25/9/2037	243,935	0.00
USD 73,742	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 5.709% 25/12/2036	70,736	0.00
USD 10,068,590	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 5.659% 25/5/2037	2,421,714	0.03
USD 3,813,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-NINE 2.949% 6/9/2038	3,217,425	0.04
USD 1,455,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4.128% 5/7/2031	1,334,508	0.02
USD 4,428,722	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 6.567% 15/6/2035	4,137,876	0.06
USD 1,270,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	1,237,536	0.02
USD 255,000	Johnson & Son 3.35% 30/9/2024	248,229	0.00
USD 186,384	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 4.47% 25/5/2037	169,950	0.00
USD 2,321,741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.881% 15/1/2049	1,952,264	0.03
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP3 0.75% 15/8/2049	203,194	0.00
USD 217,929	JP Morgan Madison Avenue Trust Series 2014-1 9.652% 25/11/2024	215,157	0.00
USD 619,245	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 5.834% 25/5/2036	594,650	0.01
USD 4,655,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4.589% 25/11/2036	4,557,849	0.06
USD 1,092,441	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0.945% 15/9/2047	4,361	0.00
USD 837,772	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 0.737% 15/9/2047	3,235	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C27 0.5% 15/2/2048	48,203	0.00
USD 1,139,081	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C29 0.692% 15/5/2048	8,271	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4.29% 15/12/2048	1,118,631	0.02
USD 1,198,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4.359% 17/3/2049	981,754	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.75% 15/12/2049	80,659	0.00
USD 312,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2018-C8 4.421% 15/6/2051	278,222	0.00
GBP 2,600,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	3,041,956	0.04
EUR 2,900,000	JPMorgan Chase 1.638% 18/5/2028	2,886,531	0.04
USD 1,500,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	1,174,389	0.02
USD 1,709,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,606,894	0.02
USD 1,664,000	JPMorgan Chase 2.182% 1/6/2028	1,477,386	0.02
USD 1,125,000	JPMorgan Chase 2.739% 15/10/2030	963,904	0.01
USD 4,610,000	JPMorgan Chase 3.702% 6/5/2030	4,206,712	0.06
USD 5,465,000	JPMorgan Chase 4.08% 26/4/2026	5,328,839	0.07

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 12,611,000	JPMorgan Chase 4.323% 26/4/2028	12,113,768	0.17
USD 4,143,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	4,061,392	0.06
USD 4,455,000	JPMorgan Chase 6.577% 2/2/2037	3,836,269	0.05
USD 4,150,000	Keurig Dr Pepper 3.95% 15/4/2029	3,903,761	0.05
USD 4,135,000	Keurig Dr Pepper 4.597% 25/5/2028	4,036,639	0.06
USD 4,801,011	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 6.869% 28/7/2042	4,487,627	0.06
USD 4,900,135	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 6.844% 27/12/2038	4,677,418	0.06
USD 1,875,000	Kraft Heinz Foods 3.75% 1/4/2030	1,718,588	0.02
GBP 609,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	730,275	0.01
USD 1,325,000	Kraft Heinz Foods 4.25% 1/3/2031	1,241,728	0.02
EUR 1,840,000	Kronos International 3.75% 15/9/2025*	1,819,447	0.03
USD 1,796,402	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1.322% 15/2/2036	72,670	0.00
USD 166,919	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 0% 15/6/2033	155,004	0.00
USD 252,048	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 2007-1 5.519% 25/6/2037	160,305	0.00
USD 718,341	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 5.879% 25/9/2036	623,982	0.01
USD 29,069	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 5.679% 25/3/2037	28,790	0.00
USD 6,294,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 7.429% 25/10/2037	5,344,083	0.07
USD 896,955	Lehman XS Trust Series 2007-16N 7.329% 25/9/2047	1,125,260	0.02
USD 448,426	Lehman XS Trust Series 2007-20N 7.729% 25/12/2037	451,446	0.01
USD 659,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	603,355	0.01
EUR 2,992,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	3,098,586	0.04
USD 5,928,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	3,587,946	0.05
USD 8,440,064	Loanpal Solar Loan 2.47% 20/12/2047	6,393,403	0.09
USD 2,691,557	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 5.729% 25/6/2036	1,265,397	0.02
USD 732,375	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 5.729% 25/7/2036	292,372	0.00
USD 5,927,006	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 5.749% 25/8/2036	2,369,257	0.03
USD 1,850,000	Louisiana Public Facilities Authority 3% 15/5/2047	1,249,290	0.02
USD 2,310,000	Lowe' s 1.7% 15/10/2030	1,834,977	0.02
USD 3,250,000	Lowe' s 2.625% 1/4/2031	2,728,944	0.04
USD 2,050,000	Lowe' s 3.1% 3/5/2027	1,907,137	0.03
USD 2,251,000	Lowe' s 3.35% 1/4/2027	2,117,930	0.03
USD 750,000	Lowe' s 3.75% 1/4/2032	671,906	0.01
USD 1,125,000	Lowe' s 4.5% 15/4/2030	1,084,507	0.01
USD 807,000	Lowe' s 4.8% 1/4/2026	797,230	0.01
USD 190,177	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3.279% 20/4/2048	183,326	0.00
USD 1,912,685	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0.955% 10/3/2050	31,501	0.00
USD 1,885,000	Lyford Consolidated Independent School District 4% 15/8/2047	1,748,011	0.02
USD 3,192,000	M/I Homes 4.95% 1/2/2028	2,963,619	0.04
USD 4,008,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.108% 15/8/2034	3,401,790	0.05
USD 3,529,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.167% 15/8/2034	2,709,833	0.04
USD 159,205	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 8.679% 25/3/2032	159,234	0.00
USD 290,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	278,237	0.00
USD 3,520,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	3,025,895	0.04
USD 2,545,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,166,344	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Trust 2007-HE1 5.709% 25/5/2037	1,082,232	0.01
USD 308,436	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 5.472% 25/8/2037	184,212	0.00
USD 237,373	Mastr Specialized Loan Trust 5.949% 25/6/2046	225,386	0.00
USD 143,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	139,559	0.00
USD 7,007,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	6,892,303	0.10
USD 11,511,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	10,031,475	0.14
USD 920,092	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 5.849% 25/4/2037	834,358	0.01
USD 4,411,712	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 5.909% 25/5/2037	3,191,198	0.04
USD 4,204,934	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 8.929% 25/10/2037	3,793,708	0.05

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 814,332	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 5.609% 25/6/2037	185,992	0.00
USD 147,000	Metropolitan Life Global Funding I 1.875% 11/1/2027	131,285	0.00
USD 33,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	31,115	0.00
USD 357,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	340,604	0.00
USD 32,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	31,614	0.00
USD 1,876,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,633,852	0.02
EUR 1,102,000	Moody's 0.95% 25/2/2030	1,007,317	0.01
EUR 1,600,000	Morgan Stanley 0.495% 26/10/2029	1,436,951	0.02
EUR 5,000,000	Morgan Stanley 1.102% 29/4/2033	4,174,004	0.06
USD 360,000	Morgan Stanley 1.512% 20/7/2027	319,442	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley 1.794% 13/2/2032	1,154,804	0.02
USD 5,498,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	4,959,052	0.07
USD 4,250,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	3,577,629	0.05
EUR 10,500,000	Morgan Stanley 2.95% 7/5/2032	10,334,076	0.15
USD 1,200,000	Morgan Stanley 3.622% 1/4/2031	1,066,632	0.01
USD 8,706,000	Morgan Stanley 4.21% 20/4/2028	8,322,848	0.12
USD 375,000	Morgan Stanley 4.431% 23/1/2030	355,517	0.01
EUR 2,700,000	Morgan Stanley 4.656% 2/3/2029	2,961,458	0.04
USD 4,034,000	Morgan Stanley 5.05% 28/1/2027	3,988,393	0.06
USD 700,000	Morgan Stanley 5.449% 20/7/2029	695,131	0.01
USD 2,230,457	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 6.299% 25/9/2035	1,833,947	0.03
USD 286,246	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 9.229% 25/2/2047	261,577	0.00
USD 3,765,000	Morgan Stanley Bank 4.754% 21/4/2026	3,711,866	0.05
USD 1,862,000	Morgan Stanley Bank 5.479% 16/7/2025	1,862,608	0.03
USD 3,654,543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.328% 15/12/2047	54,205	0.00
USD 10,520,884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.328% 15/12/2047	140,706	0.00
USD 3,349,202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0.41% 15/3/2048	14,055	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.468% 15/5/2048	1,372,635	0.02
USD 209,922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4.668% 15/10/2048	186,687	0.00
USD 5,104,909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1.452% 15/10/2048	125,385	0.00
USD 362,592	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2.73% 15/12/2050	220,727	0.00
USD 2,519,058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2.307% 15/6/2050	171,956	0.00
USD 1,617,856	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4.281% 15/6/2050	1,283,002	0.02
USD 2,754,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	1,866,398	0.03
USD 225,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	194,223	0.00
USD 690,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6.58% 15/7/2035	685,698	0.01
USD 1,213,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 6.88% 15/7/2035	1,202,309	0.02
USD 23,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 8.23% 15/7/2035	22,610	0.00
USD 702,064	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 5.749% 25/4/2036	505,076	0.01
USD 1,423,782	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 5.732% 26/12/2046	1,308,259	0.02
USD 630,775	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-1 6.683% 25/6/2044	615,605	0.01
USD 1,840,005	Mortgage Loan Resecuritization Trust 5.773% 16/4/2036	1,760,853	0.02
USD 1,438,113	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4.01% 22/6/2043	1,309,421	0.02
USD 3,630,899	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4.2% 22/2/2044	3,275,913	0.05
USD 606,009	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5.97% 22/2/2044	507,040	0.01
USD 4,536,640	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4.37% 21/12/2043	4,155,538	0.06
USD 861,017	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	800,425	0.01
USD 4,307,077	MSCG Trust 2018-SELF 7.508% 15/10/2037	4,216,432	0.06
USD 402,103	MSCG Trust 2018-SELF 8.408% 15/10/2037	394,659	0.01
USD 422,740	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4.78% 28/11/2035	284,028	0.00
USD 1,425,233	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6.5% 25/3/2034	1,214,898	0.02
USD 327,234	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7.5% 25/3/2034	288,378	0.00
EUR 2,080,000	Nasdaq 4.5% 15/2/2032	2,296,133	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,390,000	Nasdaq 5.35% 28/6/2028	1,388,523	0.02
USD 878,000	Nasdaq 5.65% 28/6/2025	878,740	0.01
EUR 783,000	National Grid North America 1.054% 20/1/2031	682,201	0.01
USD 1,620,000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 5.839% 25/4/2037	1,460,470	0.02
USD 1,680,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	1,419,293	0.02
USD 1,832,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	1,666,891	0.02
USD 794,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031	681,705	0.01
USD 648,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	617,810	0.01
USD 188,563	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-FL1 6.375% 15/6/2035	182,022	0.00
USD 2,882,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.5% 15/8/2044	2,659,262	0.04
USD 2,174,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 3.5% 15/12/2044	1,932,938	0.03
USD 1,200,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,007,335	0.01
USD 2,110,000	Navient Private Education Refi Loan Trust 2020-H 2.95% 15/4/2069	1,575,303	0.02
USD 700,000	Netflix 4.875% 15/4/2028	689,035	0.01
USD 700,000	Netflix 5.875% 15/2/2025	703,769	0.01
USD 2,000,000	Netflix 5.875% 15/11/2028	2,059,148	0.03
USD 3,396,243	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 6.149% 25/10/2035	3,267,023	0.05
USD 2,663,773	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 6.104% 25/12/2035	2,122,639	0.03
USD 639,000	New Home 8.25% 15/10/2027	612,005	0.01
USD 1,155,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	781,820	0.01
USD 1,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	1,164,601	0.02
USD 1,515,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.44% 15/6/2043	1,569,039	0.02
USD 435,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.75% 15/6/2041	461,923	0.01
GBP 1,170,000	New York Life Global Funding 4.35% 16/9/2025	1,435,890	0.02
USD 1,245,000	New York State Urban Development 3.32% 15/3/2029	1,155,448	0.02
USD 1,480,000	New York State Urban Development 4% 15/3/2038	1,477,085	0.02
USD 1,224,000	Nexstar Media 4.75% 1/11/2028	1,075,263	0.02
USD 737,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	693,566	0.01
USD 1,500,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	1,287,894	0.02
USD 1,075,000	NextEra Energy Capital 4.625% 15/7/2027	1,047,960	0.01
USD 2,960,000	NextEra Energy Capital 5.749% 1/9/2025	2,968,464	0.04
USD 711,000	NextEra Energy Capital 6.051% 1/3/2025	713,677	0.01
USD 179,872	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	172,701	0.00
USD 608,845	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2005-API 6.046% 25/2/2035	581,153	0.01
USD 443,543	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AFI 7.134% 25/5/2036	87,830	0.00
USD 67,531	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-S5 5.829% 25/10/2036	77,177	0.00
USD 1,354,049	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2007-2 5.849% 25/6/2037	1,180,501	0.02
USD 1,669,000	Norfolk Southern 5.05% 1/8/2030	1,650,929	0.02
USD 1,189,000	Northern Oil and Gas 8.75% 15/6/2031	1,215,438	0.02
USD 4,395,000	Northern States Power 2.9% 1/3/2050	2,899,199	0.04
USD 4,835,000	NVIDIA 2.85% 1/4/2030	4,340,419	0.06
USD 456,876	Oakwood Mortgage Investors 5.26% 15/1/2019	197,607	0.00
USD 379,929	Oakwood Mortgage Investors 6.93% 15/9/2031	203,837	0.00
USD 896,453	Oakwood Mortgage Investors 7.475% 15/8/2027	726,452	0.01
USD 28,148,566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 0.511% 10/5/2039	357,000	0.01
USD 2,232,801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4.077% 10/5/2039	1,537,013	0.02
USD 1,142,000	Olympus Water US 7.125% 1/10/2027	1,068,567	0.01
EUR 2,656,000	Olympus Water US 9.625% 15/11/2028	2,886,572	0.04
USD 5,950,000	Olympus Water US 9.75% 15/11/2028	5,999,040	0.08
USD 1,800,000	Oncor Electric Delivery 2.75% 15/5/2030	1,556,243	0.02
USD 1,585,000	Oncor Electric Delivery 4.3% 15/5/2028	1,535,602	0.02
USD 2,200,000	Oncor Electric Delivery 4.6% 1/6/2052	1,962,735	0.03
USD 2,340,000	Oncor Electric Delivery 5.75% 15/3/2029	2,409,720	0.03

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 41,869,799	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0% 10/2/2032	1,407	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0.218% 10/2/2032	22,908	0.00
USD 1,989,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	1,825,493	0.03
USD 3,870,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 4.05% 14/10/2036	3,332,437	0.05
USD 1,270,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2.76% 14/9/2035	1,104,148	0.02
USD 3,210,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3.45% 14/9/2035	2,757,191	0.04
USD 450,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	376,850	0.01
USD 3,831,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 5.94% 16/6/2036	3,750,804	0.05
USD 2,000,000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 6.164% 25/11/2035	1,639,517	0.02
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 5.639% 25/3/2037	1,579,863	0.02
USD 4,573,183	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	3,664,084	0.05
USD 4,919,337	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,053,088	0.06
USD 1,869,375	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5.82% 25/3/2037	1,623,592	0.02
USD 2,000,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	1,821,562	0.03
USD 1,000,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	879,805	0.01
USD 1,500,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	1,267,753	0.02
USD 1,400,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	1,212,854	0.02
USD 2,974,000	Oracle 4.9% 6/2/2033	2,841,708	0.04
USD 2,115,000	Oracle 6.25% 9/11/2032	2,212,426	0.03
USD 730,530	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	719,019	0.01
USD 1,910,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	1,927,478	0.03
EUR 1,200,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2.875% 30/4/2028*	1,158,526	0.02
USD 422,494	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 7.82% 15/3/2032	404,503	0.01
USD 555,314	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 6.625% 15/10/2037	540,641	0.01
USD 65,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	52,894	0.00
USD 85,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	77,014	0.00
USD 1,323,094	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6.5% 25/1/2037	1,136,055	0.02
USD 72,000	Pacific Gas and Electric 3.25% 16/2/2024	71,120	0.00
USD 150,000	Pacific Gas and Electric 3.5% 1/8/2050	94,590	0.00
USD 1,750,000	Pacific Gas and Electric 4.95% 1/7/2050	1,358,960	0.02
USD 695,000	Pacific Gas and Electric 6.1% 15/1/2029	686,612	0.01
USD 641,000	Pacific Gas and Electric 6.4% 15/6/2033	634,439	0.01
USD 500,000	Palomino Funding Trust I 7.233% 17/5/2028	506,433	0.01
USD 3,206,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,651,843	0.04
USD 2,627,000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4.875% 15/5/2029	2,281,288	0.03
USD 3,060,000	Parker-Hannifin 3.25% 14/6/2029	2,765,215	0.04
USD 2,675,000	Parker-Hannifin 3.65% 15/6/2024	2,629,481	0.04
USD 78,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	77,951	0.00
USD 1,500,000	PECO Energy 3% 15/9/2049	1,001,729	0.01
USD 1,350,000	PECO Energy 4.6% 15/5/2052	1,186,836	0.02
USD 858,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	826,510	0.01
USD 2,045,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5.55% 1/5/2028	2,004,517	0.03
USD 453,000	Periana 5.95% 19/4/2026	432,053	0.01
USD 10,347,000	Permian Resources Operating 5.375% 15/1/2026	10,025,197	0.14
USD 677,000	Permian Resources Operating 5.875% 1/7/2029	655,170	0.01
USD 1,448,000	Permian Resources Operating 6.875% 1/4/2027	1,439,958	0.02
USD 379,000	Permian Resources Operating 7.75% 15/2/2026	383,275	0.00
USD 1,200,000	Pfizer 2.55% 28/5/2040	861,179	0.01
USD 1,860,000	Pfizer 2.625% 1/4/2030	1,636,220	0.02
USD 2,622,000	Pilgrim's Pride 6.25% 1/7/2033	2,606,191	0.04
USD 7,020,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027*	5,323,968	0.07
USD 1,650,000	PNC Financial Services 5.068% 24/1/2034	1,567,618	0.02
USD 3,060,000	PNC Financial Services 5.939% 18/8/2034	3,093,594	0.04

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,300,000	PPG Industries 1.2% 15/3/2026	1,172,917	0.02
USD 153,592	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 5.5% 25/5/2035	125,878	0.00
USD 612,000	Prologis 2.25% 15/1/2032	491,528	0.01
USD 1,561,000	Prologis 4.625% 15/1/2033	1,498,328	0.02
USD 1,853,000	Prologis 4.875% 15/6/2028	1,831,230	0.03
USD 2,912,637	PRPM 2020-4 2.951% 25/10/2025	2,865,011	0.04
USD 550,000	Public Service Electric and Gas 4.65% 15/3/2033	533,358	0.01
USD 671,000	Rain Carbon 12.25% 1/9/2029	693,807	0.01
USD 569,907	RALI Series 2007-QH9 Trust 5.654% 25/11/2037	456,994	0.01
USD 783,166	RAMP Series 2004-RS7 Trust 4.681% 25/7/2034	608,018	0.01
USD 4,428,000	Rand Parent 8.5% 15/2/2030	4,227,253	0.06
USD 2,733,088	RASC Series 2006-EMX9 Trust 5.909% 25/11/2036	2,168,244	0.03
USD 17,796,697	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7.867% 25/10/2039	17,809,092	0.25
USD 3,692,661	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7.782% 25/6/2037	3,699,755	0.05
EUR 1,300,000	Realty Income 5.125% 6/7/2034	1,414,470	0.02
USD 2,635,000	Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	2,622,049	0.04
USD 61,953	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 5.829% 25/9/2035	53,125	0.00
USD 1,500,000	Republic Services 2.5% 15/8/2024	1,453,877	0.02
USD 750,000	Republic Services 2.9% 1/7/2026	704,898	0.01
USD 750,000	Republic Services 3.375% 15/11/2027	697,183	0.01
USD 987,000	Republic Services 4.875% 1/4/2029	972,655	0.01
USD 935,151	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 5.5% 25/5/2035	613,911	0.01
USD 2,341,488	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 5.341% 25/8/2036	1,663,315	0.02
USD 227,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	210,763	0.00
USD 2,175,000	RingCentral 8.5% 15/8/2030	2,145,779	0.03
USD 3,244,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	2,886,349	0.04
USD 3,312,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.625% 1/3/2029	2,825,763	0.04
USD 710,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.875% 1/3/2031	575,936	0.01
USD 1,000,000	Roper Technologies 2.95% 15/9/2029	883,247	0.01
USD 1,000,000	Roper Technologies 3.8% 15/12/2026	954,102	0.01
USD 1,070,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	819,359	0.01
USD 2,727,000	Sabre GBLB 7.375% 1/9/2025	2,683,125	0.04
USD 466,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	459,531	0.01
USD 1,889,000	Sabre GBLB 11.25% 15/12/2027	1,802,033	0.03
USD 2,345,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2,525,628	0.04
USD 1,879,000	San Diego Gas & Electric 4.95% 15/8/2028	1,861,148	0.03
USD 1,800,000	Sanger Independent School District 4% 15/8/2047	1,668,804	0.02
USD 372,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	333,370	0.00
USD 3,762,000	Sasol Financing USA 5.875% 27/3/2024*	3,721,954	0.05
USD 1,499,000	Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028	1,360,725	0.02
USD 2,750,000	Sasol Financing USA 8.75% 3/5/2029*	2,698,438	0.04
EUR 1,446,000	SCIL IV / SCIL USA 9.5% 15/7/2028*	1,596,764	0.02
USD 3,636,833	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	383,608	0.01
USD 4,545,646	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0.954% 25/7/2056	557,020	0.01
USD 485,780	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 3.326% 25/5/2057	186,639	0.00
USD 170,000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-OP1 6.434% 25/10/2035	124,158	0.00
USD 560,520	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5.649% 25/2/2037	237,768	0.00
USD 5,974,716	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2007-BR1 5.969% 25/2/2037	2,534,248	0.04
USD 6,005,000	Select Medical 6.25% 15/8/2026	5,952,742	0.08
USD 1,401,000	Sempra 3.7% 1/4/2029	1,278,381	0.02
USD 892,000	Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	858,876	0.01
USD 857,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	812,661	0.01
USD 395,000	Service Properties Trust 5.5% 15/12/2027	349,904	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,337,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,320,481	0.03
USD 5,966,400	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	5,655,221	0.08
USD 1,251,952	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 5.749% 25/7/2036	264,526	0.00
USD 1,000,000	Sherwin-Williams 3.45% 1/8/2025	962,561	0.01
USD 360,000	Sherwin-Williams 3.95% 15/1/2026	348,346	0.00
USD 1,374,000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	1,038,277	0.01
USD 395,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	364,747	0.01
USD 217,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	195,743	0.00
USD 5,917,263	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.175% 15/10/2041	6,262,085	0.09
USD 1,485,000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4.5% 15/9/2045	1,265,301	0.02
USD 6,689,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 3.5% 17/12/2040	6,414,277	0.09
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3.5% 15/9/2043	1,831,307	0.03
USD 1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	1,531,202	0.02
USD 3,410,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2.5% 15/9/2054	2,699,169	0.04
USD 1,290,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3.2% 15/9/2054	1,042,704	0.01
USD 3,600,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2.5% 15/9/2054	2,871,657	0.04
USD 7,136,406	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	5,937,297	0.08
USD 1,983,036	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	1,794,996	0.02
USD 1,362,329	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	1,224,447	0.02
USD 813,000	Sofi Professional Loan Program 2018-A 3.61% 25/2/2042	727,884	0.01
USD 437,000	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.83% 25/8/2047	393,893	0.01
USD 248,000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 4.14% 25/2/2048	221,409	0.00
USD 28,859	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 6.224% 25/1/2035	26,974	0.00
EUR 9,787,000	Southern 1.875% 15/9/2081	8,422,642	0.12
USD 2,235,000	Southern California Edison 2.75% 1/2/2032	1,848,933	0.02
USD 620,000	Southern California Edison 2.85% 1/8/2029	545,321	0.01
USD 1,650,000	Southern California Edison 3.65% 1/6/2051	1,180,382	0.02
USD 1,900,000	Southern California Edison 4.7% 1/6/2027	1,867,529	0.03
USD 1,000,000	Southern California Edison 5.3% 1/3/2028	1,002,786	0.01
USD 955,000	Southern California Edison 5.95% 1/11/2032	990,529	0.01
EUR 1,300,000	Southern Power 1.85% 20/6/2026*	1,333,598	0.02
USD 3,643,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025	3,600,042	0.05
USD 630,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	656,195	0.01
USD 6,489,000	Sprint 7.875% 15/9/2023	6,484,685	0.09
USD 1,299,375	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	1,286,179	0.02
USD 356,250	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 5.152% 20/3/2028	353,084	0.01
USD 1,155,000	State of California 7.3% 1/10/2039	1,367,401	0.02
USD 630,000	State of California 7.35% 1/11/2039	749,359	0.01
USD 580,000	State of California 7.5% 1/4/2034	693,998	0.01
USD 1,300,000	State of California 7.55% 1/4/2039	1,597,187	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2040	1,722,468	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2041	1,716,100	0.02
USD 1,885,000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	1,920,096	0.03
USD 3,080,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	2,660,069	0.04
USD 955,000	State of Ohio 5% 1/3/2039	1,041,684	0.01
USD 1,070,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	1,089,815	0.02
USD 4,564,000	State Street 6.552% 15/6/2047	3,729,226	0.05
USD 3,000,000	Steel Dynamics 3.25% 15/10/2050	1,939,152	0.03
USD 3,815,000	Steel Dynamics 3.45% 15/4/2030	3,386,744	0.05
USD 297,000	Stem 0.5% 1/12/2028	181,332	0.00
USD 776,098	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3.875% 25/4/2036	468,182	0.01
USD 542,510	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 5.889% 25/2/2036	463,544	0.01
USD 276,900	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 5.849% 25/5/2046	186,473	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,806,846	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	2,153,197	0.03
USD 2,407,258	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	1,338,402	0.02
USD 200,000	Summer BC Bidco B 5.5% 31/10/2026	173,778	0.00
USD 760,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	668,688	0.01
USD 2,334,000	Sunoco / Sunoco Finance 4.5% 30/4/2030	2,081,791	0.03
USD 1,210,000	Sunoco / Sunoco Finance 5.875% 15/3/2028	1,172,723	0.02
USD 1,717,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	1,688,755	0.02
USD 424,000	TEGNA 4.625% 15/3/2028	380,761	0.01
USD 8,970,000	Tenet Healthcare 4.25% 1/6/2029	8,021,170	0.11
USD 4,095,000	Tenet Healthcare 4.375% 15/1/2030	3,631,976	0.05
USD 1,852,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	1,795,984	0.03
USD 2,125,000	Tenneco 8% 17/11/2028	1,748,578	0.02
USD 235,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	221,975	0.00
USD 190,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	180,311	0.00
USD 1,700,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,598,235	0.02
USD 936,000	Thornburg Mortgage Trust 2006-3 3.58% 25/6/2046	630,282	0.01
USD 29,577	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 7.376% 25/6/2047	28,813	0.00
USD 2,612,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	2,460,853	0.03
USD 2,000,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	1,821,693	0.03
USD 1,000,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	872,523	0.01
USD 1,750,000	T-Mobile USA 2.4% 15/3/2029	1,502,761	0.02
USD 1,500,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	1,221,702	0.02
USD 1,500,000	T-Mobile USA 2.875% 15/2/2031	1,260,708	0.02
USD 5,415,000	T-Mobile USA 3.375% 15/4/2029	4,855,310	0.07
USD 1,125,000	T-Mobile USA 3.5% 15/4/2031	982,694	0.01
USD 1,700,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	1,610,310	0.02
USD 4,290,000	T-Mobile USA 3.875% 15/4/2030	3,912,765	0.05
USD 2,715,000	Tobacco Settlement Financing 6.706% 1/6/2046	2,323,839	0.03
USD 1,610,620	Topaz Solar Farms 5.75% 30/9/2039	1,524,444	0.02
USD 555,000	Toyota Motor Credit 3.05% 22/3/2027	520,612	0.01
USD 2,085,000	Toyota Motor Credit 4.45% 18/5/2026	2,055,100	0.03
USD 3,195,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	3,046,372	0.04
USD 167,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	158,025	0.00
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.564% 17/5/2037	819,657	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.96% 17/5/2037	561,360	0.01
USD 1,550,000	Truist Financial 5.867% 8/6/2034*	1,537,056	0.02
USD 2,675,000	Tyson Foods 3.95% 15/8/2024	2,627,315	0.04
USD 691,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4.788% 15/8/2051	585,746	0.01
EUR 1,381,000	UGI International 2.5% 1/12/2029*	1,172,172	0.02
USD 132,000	United Rentals North America 5.5% 15/5/2027	129,515	0.00
USD 1,378,000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	1,363,083	0.02
USD 13,020,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	14,197,699	0.20
USD 3,424,200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2026	3,573,018	0.05
USD 8,076,300	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	8,063,068	0.11
USD 105,415,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024*	124,776,243	1.73
USD 107,080,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2024*	138,119,562	1.91
USD 35,904,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/7/2032	33,848,080	0.47
USD 1,524,200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.5% 15/2/2053	1,407,869	0.02
USD 33,173,100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.625% 15/10/2027*	33,486,284	0.46
USD 46,479,100	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/2/2031*	37,734,312	0.52
USD 15,484,500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/5/2040	9,594,341	0.13
USD 163,874,400	United States Treasury Note/Bond 1.25% 30/11/2026*	147,864,640	2.05
USD 46,464,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/12/2026*	41,867,056	0.58

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 14,306,600	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031*	11,589,464	0.16
USD 8,589,500	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/11/2050	4,973,857	0.07
USD 20,159,800	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041	13,555,891	0.19
USD 19,225,400	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2041*	13,349,637	0.19
USD 7,385,700	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2051	4,560,381	0.06
USD 10,043,200	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049*	6,837,222	0.09
USD 31,898,500	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029	28,870,634	0.40
USD 13,926,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042*	10,357,462	0.14
USD 14,761,300	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/11/2049	10,328,874	0.14
USD 107,318,600	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/5/2027*	100,627,956	1.39
USD 19,130,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/7/2027	17,988,930	0.25
USD 10,379,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/8/2032	9,312,627	0.13
USD 382,655,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2032*	347,603,841	4.81
USD 264,901,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2052*	205,785,161	2.85
USD 567,700	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	450,656	0.01
USD 10,804,300	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2052*	8,617,695	0.12
USD 59,908,800	United States Treasury Note/Bond 3.125% 31/8/2027	57,105,256	0.79
USD 58,982,700	United States Treasury Note/Bond 3.25% 30/6/2027*	56,563,488	0.78
USD 34,771,300	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042*	29,687,356	0.41
USD 57,763,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025*	56,785,993	0.79
USD 15,457,300	United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052	14,924,748	0.21
USD 1,632,000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/8/2053	1,610,963	0.02
USD 43,600,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 30/9/2024*	43,098,114	0.60
USD 39,300	United States Treasury Note/Bond 4.625% 28/2/2025	39,007	0.00
USD 4,836,000	United Wholesale Mortgage 5.5% 15/11/2025	4,648,850	0.06
USD 2,010,000	UnitedHealth 2.3% 15/5/2031	1,680,534	0.02
USD 1,600,000	UnitedHealth 3.375% 15/4/2027	1,516,688	0.02
USD 1,942,000	UnitedHealth 3.875% 15/12/2028	1,859,244	0.03
USD 1,500,000	UnitedHealth 4.2% 15/5/2032	1,417,627	0.02
USD 6,150,000	UnitedHealth 4.25% 15/1/2029	5,959,570	0.08
USD 6,900,000	UnitedHealth 5.35% 15/2/2033	7,086,521	0.10
USD 2,916,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	2,906,386	0.04
USD 1,095,000	University of California 5.77% 15/5/2043	1,150,350	0.02
USD 1,279,909	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/11/2025	1,214,756	0.02
USD 1,550,000	US Bancorp 5.836% 12/6/2034	1,548,464	0.02
USD 656,540	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 4.24% 25/11/2047	527,189	0.01
USD 109,684	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 5% 25/11/2047	84,831	0.00
USD 111,795	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 4.26% 25/4/2048	97,910	0.00
USD 6,220,000	Venture Global LNG 8.125% 1/6/2028	6,268,970	0.09
GBP 1,000,000	Verizon Communications 1.125% 3/11/2028	1,003,396	0.01
EUR 372,000	Verizon Communications 1.125% 19/9/2035	283,832	0.00
USD 2,815,000	Verizon Communications 1.68% 30/10/2030	2,199,388	0.03
USD 2,600,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	2,269,900	0.03
USD 1,500,000	Verizon Communications 2.355% 15/3/2032	1,186,559	0.02
USD 4,195,000	Verizon Communications 2.55% 21/3/2031	3,451,968	0.05
USD 202,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	187,783	0.00
USD 2,250,000	Verizon Communications 3.15% 22/3/2030	1,973,141	0.03
USD 1,000,000	Verizon Communications 3.875% 8/2/2029	932,924	0.01
USD 375,000	Verizon Communications 4.016% 3/12/2029	348,069	0.01
GBP 264,000	Verizon Communications 4.073% 18/6/2024	330,242	0.00
USD 687,000	Verizon Communications 4.125% 16/3/2027	661,589	0.01
USD 2,500,000	Verizon Communications 4.5% 10/8/2033	2,310,435	0.03
USD 290,000	Viasat 5.625% 15/9/2025	273,893	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,736,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	1,551,468	0.02
USD 1,250,000	VICI Properties 4.95% 15/2/2030	1,176,919	0.02
USD 3,625,000	VICI Properties / VICI Note 3.5% 15/2/2025	3,477,830	0.05
USD 2,429,000	VICI Properties / VICI Note 3.75% 15/2/2027	2,230,077	0.03
USD 850,000	VICI Properties / VICI Note 3.875% 15/2/2029	748,208	0.01
USD 1,000,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	875,988	0.01
USD 1,858,000	VICI Properties / VICI Note 4.25% 1/12/2026	1,751,081	0.02
USD 138,000	VICI Properties / VICI Note 4.5% 1/9/2026	130,745	0.00
USD 1,633,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,474,840	0.02
USD 2,180,000	VICI Properties / VICI Note 5.625% 1/5/2024	2,164,913	0.03
USD 207,000	VICI Properties / VICI Note 5.75% 1/2/2027	202,880	0.00
USD 5,790,000	Vistra Operations 3.55% 15/7/2024	5,635,695	0.08
USD 1,763,000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	1,652,789	0.02
USD 1,750,000	Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,705,769	0.02
USD 750,000	VMware 2.2% 15/8/2031	584,931	0.01
USD 1,800,000	VMware 4.65% 15/5/2027	1,749,594	0.02
USD 6,080,000	VMware 4.7% 15/5/2030	5,734,780	0.08
USD 13,644,268	Voyager OPTONE Delaware Trust 7.495% 25/2/2038	3,269,575	0.05
USD 1,200,000	Walt Disney 1.75% 30/8/2024	1,156,157	0.02
USD 3,000,000	Walt Disney 2% 1/9/2029	2,545,643	0.04
USD 750,000	Walt Disney 3.8% 22/3/2030	702,501	0.01
USD 4,188,154	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 5.43% 25/2/2046	3,665,569	0.05
USD 520,891	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 5.42% 25/6/2046	454,043	0.01
USD 1,583,047	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 5.18% 25/6/2047	1,279,208	0.02
USD 1,201,000	Warnermedia 6.412% 15/3/2026	1,202,923	0.02
USD 5,500,000	Washington Health Care Facilities Authority 4% 1/10/2045	5,044,184	0.07
USD 745,012	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.5% 25/11/2035	511,912	0.01
USD 304,629	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.5% 25/11/2035	231,829	0.00
USD 595,319	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6.5% 25/2/2036	478,247	0.01
USD 2,327,483	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	2,071,585	0.03
USD 196,460	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6.85% 25/5/2036	157,489	0.00
USD 859,433	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	688,950	0.01
USD 3,998,951	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4.298% 25/10/2036	1,270,424	0.02
USD 1,972,862	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2007-OA3 Trust 5.68% 25/4/2047	1,668,042	0.02
USD 3,608,302	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 5.789% 25/9/2036	1,006,787	0.01
USD 4,291,274	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 4.162% 25/10/2036	3,179,053	0.04
USD 2,500,000	Waste Management 1.15% 15/3/2028	2,109,454	0.03
USD 1,290,000	Waste Management 2% 1/6/2029	1,093,008	0.01
USD 3,090,000	Waste Management 4.875% 15/2/2034	3,014,988	0.04
USD 921,000	Weekley Homes / Weekley Finance 4.875% 15/9/2028	815,123	0.01
EUR 6,100,000	Wells Fargo 1.741% 4/5/2030	5,750,427	0.08
USD 1,500,000	Wells Fargo 2.572% 11/2/2031	1,252,519	0.02
GBP 2,400,000	Wells Fargo 3.473% 26/4/2028	2,734,796	0.04
USD 2,602,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	2,523,374	0.04
USD 2,897,000	Wells Fargo 5.574% 25/7/2029	2,883,105	0.04
USD 572,513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4.224% 15/12/2048	528,319	0.01
USD 2,633,561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1.389% 15/8/2049	79,453	0.00
USD 448,469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.111% 15/1/2059	418,351	0.01
USD 1,543,418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.144% 15/1/2059	1,364,733	0.02
USD 830,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4.188% 15/11/2050	679,367	0.01
USD 960,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4.002% 15/12/2050	795,766	0.01
USD 896,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.874% 15/6/2036	757,875	0.01
USD 859,552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4.727% 15/6/2051	706,632	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 941,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4.633% 15/8/2051	813,347	0.01
USD 1,675,000	Welltower 2.05% 15/1/2029	1,404,227	0.02
USD 3,615,000	Welltower 2.75% 15/1/2032	2,926,654	0.04
USD 1,500,000	Welltower 4.25% 15/4/2028	1,418,921	0.02
USD 496,178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4.204% 15/11/2047	460,728	0.01
USD 1,711,001	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3.978% 20/11/2044	1,521,498	0.02
USD 3,949,291	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3.752% 20/8/2045	2,465,029	0.03
USD 1,515,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2035	1,558,834	0.02
EUR 603,000	WMG Acquisition 2.25% 15/8/2031	526,201	0.01
USD 2,250,000	Workday 3.7% 1/4/2029	2,077,353	0.03
USD 2,685,000	WRKCo 3.9% 1/6/2028	2,489,977	0.03
USD 391,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	369,999	0.00
USD 611,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	603,252	0.01
USD 2,416,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	2,165,326	0.03
USD 7,845,000	Xerox 5% 15/8/2025	7,487,150	0.10
USD 808,000	XHR 4.875% 1/6/2029	699,868	0.01
USD 699,000	XHR 6.375% 15/8/2025	691,061	0.01
		3,741,465,951	51.79
ウルグアイ			
USD 2,330,751	Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034*	2,503,821	0.03
債券合計		6,272,948,921	86.83
コマーシャル・ペーパー			
フランス			
USD 6,454,000	Societe Generale 0% 6/3/2024	6,263,139	0.09
ドイツ			
USD 8,815,000	Bayer 0% 1/9/2023	8,812,329	0.12
スイス			
USD 4,430,000	UBS (London Branch) 0% 18/6/2024	4,225,386	0.06
USD 6,141,000	UBS (London Branch) 0% 25/6/2024	5,850,735	0.08
		10,076,121	0.14
米国			
USD 8,549,000	3M 0% 7/9/2023	8,538,977	0.12
USD 16,329,000	AT&T 0% 19/12/2023	16,045,190	0.22
USD 2,880,000	AT&T 0% 20/12/2023	2,829,474	0.04
USD 8,815,000	AT&T 0% 23/1/2024	8,611,584	0.12
USD 22,620,000	AT&T 0% 21/2/2024	21,990,159	0.30
USD 15,100,000	Crown Castle 0% 28/9/2023	15,028,951	0.21
USD 3,680,000	Enel Finance America 0% 6/9/2023	3,676,097	0.05
USD 5,585,000	General Motors 0% 22/1/2024	5,453,268	0.08
USD 3,355,000	General Motors 0% 23/1/2024	3,275,307	0.04
USD 6,924,000	General Motors 0% 25/1/2024	6,757,193	0.09
USD 6,350,000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	6,308,691	0.09
USD 3,300,000	Global Payments 0% 25/9/2023	3,285,607	0.05
USD 10,000,000	Harley-Davidson Bank 0% 22/9/2023	9,963,788	0.14
USD 3,054,000	HSBC USA 0% 20/11/2023	3,015,239	0.04
USD 3,000,000	HSBC USA 0% 24/6/2024	2,849,977	0.04
USD 8,645,000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8,201,901	0.11
USD 4,340,000	HSBC USA 0% 12/8/2024	4,085,427	0.06
USD 30,000,000	Ovintiv 0% 20/9/2023	29,898,395	0.41
USD 28,500,000	Walgreens Boots Alliance 0% 2/10/2023	28,343,354	0.39
		188,158,579	2.60

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー合計		213,310,168	2.95
預託証券			
	米国		
USD 13,820,000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	13,814,869	0.19
USD 1,700,000	Mizuho Corporate Bank (New York Branch) 5.48% 4/1/2024	1,697,894	0.02
預託証券合計		15,512,763	0.21
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		6,616,843,954	91.58

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通/優先株式およびワラント			
83,783	ルクセンブルグ ADLER	45,450	0.00
米国			
97,804	Fanatics	7,105,461	0.10
110,969	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)	500,470	0.01
17,614	Hawkeye 360 ATM (Wts 7/7/2033)	40,513	0.00
44,035	Hawkeye 360 MGR (Wts 7/7/2033)	198,598	0.00
344,760	Hawkeye 360 Series D1	3,109,735	0.04
134,037	Latch (Wts 4/6/2026)	-	0.00
112,358	Lessen Series C	1,005,604	0.01
247,879	Versa Networks (Wts 7/10/2032)	684,146	0.01
2,011,152	Versa Networks Series E	6,234,571	0.09
		18,879,098	0.26
普通/優先株式およびワラント合計		18,924,548	0.26
債券			
バミューダ			
USD 8,777	DGL2 9.125% 1/4/2024	-	0.00
HKD 348,254	REXLot 6% 28/4/2017	-	0.00
HKD 4,062,966	REXLot 4.5% 17/4/2019	64,755	0.00
		64,755	0.00
ケイマン諸島			
USD 4,065,000	ALM VII 0% 15/10/2116	1	0.00
香港			
CNH 917,253	China City Construction International 5.35% 3/7/2017	-	0.00
インド			
USD 116,050	Videocon Industries 2.8% 31/12/2020	-	0.00
国際機関(International)			
EUR 4,326,000	Natra Foods 0% 13/10/2029	4,547,037	0.06
米国			
USD 9,177,700	American Airlines Pass Through Trust 3.5% 15/12/2027	8,558,205	0.12
USD 814,000	American Airlines Pass Through Trust 4% 15/12/2025	798,778	0.01
USD 250,000	Chesapeake Energy 0% 15/6/2021	-	0.00
USD 5,581,000	Chesapeake Energy 0% 15/2/2022	1	0.00
USD 546,000	Chesapeake Energy 0% 15/8/2022	-	0.00
USD 8,273,137	Lessen 0% 5/1/2028	7,756,066	0.11
USD 5,956,139	Pioneer Midco 10.5% 18/11/2030	5,866,797	0.08
USD 11,239,675	Sitio Rotalties 0% 21/9/2026	11,211,576	0.16
USD 787,431	Sun Country 7% 15/12/2023	783,494	0.01
USD 969,926	Sun Country 4.7% 15/12/2025	938,404	0.01
USD 1,802,969	Sun Country 4.84% 15/3/2031	1,744,372	0.03
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 6/11/2018	-	0.00
USD 7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 1/5/2018	-	0.00
USD 630,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018	-	0.00
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 4/2/2018	-	0.00
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018	-	0.00
		37,657,693	0.53
債券合計		42,269,486	0.59

その他の譲渡可能な有価証券(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
その他の譲渡可能な有価証券合計		61,194,034	0.85
投資有価証券合計		6,678,037,988	92.44
その他の純資産		546,396,925	7.56
純資産合計(米ドル)		7,224,434,913	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
AUD	1,420,000	NZD	1,561,129	Deutsche Bank	20/9/2023	(8,166)
AUD	18,880,655	USD	12,462,450	JP Morgan	20/9/2023	(225,270)
AUD	7,952,428	USD	5,296,741	Morgan Stanley	20/9/2023	(142,509)
AUD	12,631,433	USD	8,439,110	BNP Paribas	20/9/2023	(252,258)
AUD	3,364,000	USD	2,281,421	Bank of America	20/9/2023	(101,101)
AUD	3,521,000	USD	2,390,804	State Street	20/9/2023	(108,727)
AUD	3,292,298	USD	2,200,000	HSBC Bank	20/9/2023	(66,153)
AUD	530,289	USD	350,000	Deutsche Bank	20/9/2023	(6,302)
AUD	2,166,848	USD	1,450,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(45,593)
AUD	8,203,281	EUR	5,006,317	Citibank	21/9/2023	(119,038)
AUD	8,266,828	EUR	5,002,362	JP Morgan	20/9/2023	(73,489)
AUD	2,830,376	USD	1,850,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(15,539)
AUD	8,281,503	EUR	4,997,000	Citigroup	20/9/2023	(58,156)
AUD	5,533,631	EUR	3,332,336	HSBC Bank	20/9/2023	(31,674)
AUD	1,603,962	USD	1,050,000	UBS	20/9/2023	(10,419)
AUD	841,150	USD	550,000	Citigroup	20/9/2023	(4,823)
AUD	4,888,000	USD	3,164,169	Citigroup	18/9/2023	3,673
AUD	4,316,000	CAD	3,760,401	HSBC Bank	18/9/2023	16,939
AUD	1,118,000	USD	721,754	Morgan Stanley	18/9/2023	2,806
AUD	5,581,000	USD	3,605,670	JP Morgan	18/9/2023	11,296
BRL	57,773,141	USD	11,668,590	Citigroup	14/9/2023	38,553
BRL	45,366,481	USD	9,218,671	Toronto-Dominion	20/9/2023	(34,601)
BRL	22,310,532	USD	4,533,500	Deutsche Bank	20/9/2023	(16,917)
BRL	36,284,242	USD	7,562,000	Barclays	5/9/2023	(198,580)
BRL	3,597,597	USD	730,000	BNP Paribas	5/9/2023	86
BRL	8,169,753	USD	1,657,655	Citigroup	20/9/2023	(3,756)
BRL	3,602,830	USD	721,000	JP Morgan	5/9/2023	10,148
BRL	7,008,000	USD	1,432,192	Barclays	14/9/2023	(12,091)
BRL	10,596,298	USD	2,155,954	JP Morgan	20/9/2023	(10,821)
BRL	22,949,434	USD	4,674,000	HSBC Bank	3/10/2023	(37,930)
BRL	14,076,804	USD	2,884,000	Citigroup	3/10/2023	(40,312)
CAD	1,869,846	USD	1,400,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(17,514)
CAD	5,652,775	USD	4,200,000	HSBC Bank	20/9/2023	(20,575)
CAD	5,438,852	USD	4,050,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(28,741)
CAD	2,798,008	USD	2,119,893	Bank of America	20/9/2023	(51,163)
CAD	3,325,880	USD	2,520,000	Citigroup	20/9/2023	(60,984)
CAD	7,395,610	USD	5,600,000	BNP Paribas	20/9/2023	(131,995)
CAD	1,646,542	USD	1,250,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(32,616)
CAD	7,503,666	USD	5,650,000	JP Morgan	20/9/2023	(102,102)
CAD	1,332,081	USD	1,000,000	Morgan Stanley	20/9/2023	(15,116)
CAD	6,670,188	EUR	4,544,000	UBS	18/9/2023	(1,828)
CAD	1,959,562	USD	1,439,000	JP Morgan	18/9/2023	9,773
CAD	1,955,000	JPY	210,451,781	JP Morgan	15/9/2023	2,873
CHF	1,114,743	USD	1,250,000	Deutsche Bank	20/9/2023	14,346
CHF	3,036,312	USD	3,450,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(6,203)
CHF	1,631,695	USD	1,850,000	HSBC Bank	20/9/2023	675
CHF	7,399,000	USD	8,316,567	State Street	20/9/2023	75,410
CHF	1,108,132	USD	1,250,000	JP Morgan	20/9/2023	6,848
CHF	919,072	USD	1,050,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(7,587)
CHF	559,122	USD	650,000	BNP Paribas	20/9/2023	(15,842)
CHF	1,434,303	USD	1,650,000	Morgan Stanley	20/9/2023	(23,207)
CHF	2,265,847	USD	2,600,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(30,068)
CLP	5,681,312,200	USD	6,528,000	Citigroup	15/9/2023	112,586
CLP	626,046,200	USD	722,000	BNP Paribas	15/9/2023	9,752

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
CLP	1,874,601,000	USD	2,162,170	BNP Paribas	14/9/2023	29,230
CLP	1,246,379,000	USD	1,440,235	Toronto-Dominion	14/9/2023	16,776
CLP	3,736,363,500	USD	4,317,000	Toronto-Dominion	15/9/2023	50,238
CLP	3,097,964,120	USD	3,598,000	JP Morgan	15/9/2023	23,045
CLP	1,246,379,000	USD	1,443,905	JP Morgan	14/9/2023	13,106
CLP	610,532,572	USD	722,000	Goldman Sachs	15/9/2023	(8,381)
CLP	618,688,800	USD	720,000	Barclays	15/9/2023	3,153
CNH	26,865,000	USD	3,802,655	Citigroup	14/9/2023	(108,140)
CNH	4,716,784	USD	661,204	Toronto-Dominion	20/9/2023	(12,343)
CNH	57,432,000	USD	8,049,738	Barclays	20/9/2023	(149,152)
CNH	53,455,000	USD	7,420,376	JP Morgan	14/9/2023	(69,163)
CNH	17,857,840	USD	2,496,919	BNP Paribas	21/9/2023	(40,193)
CNH	14,803,874	USD	2,084,759	Credit Agricole	20/9/2023	(48,276)
CNH	2,955,311	USD	416,241	JP Morgan	20/9/2023	(9,696)
CNH	5,456,157	USD	745,931	BNP Paribas	20/9/2023	4,641
CNH	4,243,414	USD	580,169	Bank of America	20/9/2023	3,573
COP	328,666,313	USD	76,608	Citigroup	20/9/2023	3,006
COP	21,011,368,736	USD	4,951,289	BNY Mellon	20/12/2023	23,432
COP	27,844,593,640	USD	6,542,433	BNY Mellon	14/9/2023	215,947
COP	20,562,934,000	USD	5,047,334	Standard Chartered Bank	14/9/2023	(56,344)
COP	13,082,574,000	GBP	2,586,000	Citigroup	18/9/2023	(107,216)
COP	28,729,637,000	USD	6,645,764	Morgan Stanley	15/8/2024	(115,942)
COP	14,885,798,000	USD	3,391,615	BNP Paribas	17/5/2024	36,419
COP	21,029,868,000	USD	5,076,000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	21,511
COP	5,892,750,000	USD	1,432,017	Bank of America	14/9/2023	(1,741)
COP	11,851,604,000	USD	2,878,000	Bank of America	18/9/2023	(5,244)
COP	11,883,994,000	USD	2,858,791	Toronto-Dominion	29/9/2023	11,204
COP	11,897,280,000	USD	2,880,000	Citigroup	18/9/2023	3,828
COP	5,950,210,000	USD	1,441,427	Citigroup	14/9/2023	2,795
CZK	70,522,709	USD	3,192,634	Barclays	14/9/2023	(13,316)
CZK	41,399,000	USD	1,892,963	Morgan Stanley	20/9/2023	(27,049)
CZK	151,942,231	USD	7,099,451	UBS	14/9/2023	(249,561)
CZK	148,584,925	USD	6,819,028	HSBC Bank	14/9/2023	(120,494)
CZK	28,700,188	USD	1,317,613	Morgan Stanley	6/9/2023	(23,335)
CZK	197,608,648	USD	8,936,000	Barclays	18/9/2023	(28,780)
EUR	15,342,303	USD	16,774,243	Deutsche Bank	20/9/2023	(115,787)
EUR	14,370,000	GBP	12,337,292	UBS	20/9/2023	(37,762)
EUR	20,111,000	GBP	17,310,916	Bank of America	20/9/2023	(109,538)
EUR	64,490,297	USD	70,884,907	JP Morgan	20/9/2023	(862,246)
EUR	6,702,000	GBP	5,771,825	JP Morgan	20/9/2023	(40,250)
EUR	54,934,676	USD	60,380,099	HSBC Bank	20/9/2023	(732,800)
EUR	19,129,313	USD	20,947,131	BNP Paribas	20/9/2023	(176,792)
EUR	1,865,856	USD	2,050,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(24,079)
EUR	1,787,000	SEK	20,977,950	UBS	20/9/2023	15,826
EUR	22,467,300	USD	24,755,065	Citigroup	20/9/2023	(360,386)
EUR	3,355,000	SEK	39,289,626	Morgan Stanley	20/9/2023	38,462
EUR	136,963	USD	150,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1,287)
EUR	59,329,894	USD	66,865,705	Morgan Stanley	20/9/2023	(2,446,140)
EUR	2,800,000	USD	3,063,928	Société Générale	20/9/2023	(23,727)
EUR	5,580,000	GBP	4,782,395	HSBC Bank	20/9/2023	(4,159)
EUR	294,192	NOK	3,400,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(15)
EUR	2,487,778	SEK	29,290,891	Goldman Sachs	20/9/2023	14,108
EUR	286,387	NOK	3,200,000	Deutsche Bank	20/9/2023	10,301
EUR	2,501,000	USD	2,793,355	JP Morgan	21/9/2023	(77,673)

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
EUR	2,277,604	USD	2,500,000	Barclays	20/9/2023	(27,010)
EUR	5,006,317	AUD	8,156,492	Citibank	21/9/2023	149,364
EUR	6,664,000	USD	7,403,737	Citibank	14/9/2023	(170,161)
EUR	3,351,000	GBP	2,876,313	Goldman Sachs	20/9/2023	(7,955)
EUR	2,503,679	SEK	29,217,829	JP Morgan	20/9/2023	38,076
EUR	5,002,362	AUD	8,230,751	Morgan Stanley	20/9/2023	96,872
EUR	3,661,859	USD	3,984,566	Goldman Sachs	20/9/2023	(8,571)
EUR	2,501,000	USD	2,751,338	HSBC Bank	21/9/2023	(35,656)
EUR	91,286	USD	100,000	RBS	20/9/2023	(883)
EUR	268,828	HUF	106,000,000	Société Générale	20/9/2023	(9,516)
EUR	2,165,000	SEK	25,265,312	BNP Paribas	20/9/2023	32,939
EUR	1,049,420	USD	1,155,110	Bank of America	20/9/2023	(15,665)
EUR	1,665,867	AUD	2,789,357	Deutsche Bank	20/9/2023	901
EUR	2,498,801	AUD	4,191,848	Citigroup	20/9/2023	(3,713)
EUR	319,868	HUF	124,000,000	Deutsche Bank	20/9/2023	(5,280)
EUR	1,112,000	PLN	4,963,896	HSBC Bank	18/9/2023	3,112
EUR	5,251,000	USD	5,725,092	Citigroup	18/9/2023	(24,182)
EUR	4,164,668	AUD	7,040,704	Bank of America	20/9/2023	(41,376)
EUR	3,343,000	USD	3,610,425	JP Morgan	18/9/2023	19,005
EUR	6,673,618	USD	7,237,753	State Street	20/9/2023	8,368
GBP	16,890,777	USD	21,777,229	JP Morgan	20/9/2023	(364,078)
GBP	19,520,025	EUR	22,700,000	HSBC Bank	20/9/2023	99,022
GBP	1,680,665	USD	2,144,480	Deutsche Bank	20/9/2023	(13,830)
GBP	1,826,225	USD	2,347,031	Morgan Stanley	20/9/2023	(31,849)
GBP	4,399,730	USD	5,655,399	HSBC Bank	20/9/2023	(77,676)
GBP	785,861	USD	1,000,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(3,731)
GBP	7,782,412	EUR	8,991,000	Deutsche Bank	20/9/2023	103,791
GBP	196,576	USD	250,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(792)
GBP	5,570,233	USD	7,135,699	BNP Paribas	20/9/2023	(74,079)
GBP	1,463,720	USD	1,877,361	Barclays	20/9/2023	(21,740)
GBP	2,350,000	USD	3,010,741	JP Morgan	13/9/2023	(31,642)
GBP	2,885,340	EUR	3,351,000	JP Morgan	20/9/2023	19,399
GBP	118,472	USD	150,000	Commonwealth Bank of Australia	20/9/2023	191
GBP	7,218,321	EUR	8,370,000	Bank of America	20/9/2023	62,943
GBP	392,540	USD	500,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(2,360)
GBP	4,798,000	USD	6,071,342	JP Morgan	18/9/2023	11,230
HUF	3,403,377,863	USD	9,652,508	JP Morgan	14/9/2023	36,870
HUF	327,000,000	EUR	840,044	Deutsche Bank	20/9/2023	17,702
HUF	107,000,000	EUR	274,256	JP Morgan	20/9/2023	6,466
HUF	116,000,000	EUR	291,648	BNP Paribas	20/9/2023	13,174
HUF	1,109,825,402	USD	3,120,000	Deutsche Bank	18/9/2023	37,044
HUF	762,646,000	USD	2,159,920	Citigroup	14/9/2023	11,325
IDR	37,800,000,000	USD	2,532,154	Bank of America	20/9/2023	(50,727)
IDR	58,343,191,818	USD	3,927,253	UBS	20/9/2023	(97,242)
IDR	111,061,120,000	USD	7,409,014	JP Morgan	14/9/2023	(117,624)
IDR	54,600,000,000	USD	3,628,871	Barclays	20/9/2023	(44,587)
IDR	82,501,230,000	USD	5,394,000	Barclays	18/9/2023	22,054
IDR	65,504,582,120	USD	4,270,738	Barclays	26/9/2023	29,010
IDR	141,834,616,513	USD	9,251,492	Citigroup	20/9/2023	59,416
IDR	72,872,244,720	USD	4,763,203	HSBC Bank	14/9/2023	21,009
INR	764,250,000	USD	9,215,765	Barclays	20/9/2023	15,498
INR	1,408,575,000	USD	17,004,359	Citigroup	14/9/2023	9,846
INR	990,419,728	USD	12,001,000	Citigroup	20/9/2023	(37,866)
INR	297,501,000	USD	3,602,143	BNP Paribas	14/9/2023	(8,622)

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
INR	357,928,914	USD	4,326,000	Citigroup	18/9/2023	(2,610)
JPY	370,000,000	USD	2,596,284	Bank of America	20/9/2023	(58,232)
JPY	210,591,050	USD	1,500,000	Deutsche Bank	20/9/2023	(55,430)
JPY	747,082,299	USD	5,263,915	BNP Paribas	20/9/2023	(139,229)
JPY	290,451,899	USD	2,075,676	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(83,291)
JPY	3,357,478,583	USD	24,109,950	Nomura	20/9/2023	(1,078,986)
JPY	311,077,360	USD	2,200,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	(66,134)
JPY	3,688,482,709	USD	26,153,680	JP Morgan	20/9/2023	(852,157)
JPY	870,607,213	USD	6,320,608	Morgan Stanley	20/9/2023	(348,590)
JPY	42,750,000	USD	312,363	Standard Chartered Bank	20/9/2023	(19,115)
JPY	228,765,222	USD	1,665,000	Citigroup	20/9/2023	(95,762)
JPY	186,463,888	USD	1,335,266	Citibank	20/9/2023	(56,198)
JPY	312,000,000	USD	2,181,500	HSBC Bank	20/9/2023	(41,304)
JPY	369,815,483	USD	2,600,000	Goldman Sachs	20/9/2023	(63,213)
JPY	180,787,214	USD	1,250,000	Credit Agricole	20/9/2023	(9,872)
JPY	463,517,841	USD	3,204,000	HSBC Bank	15/9/2023	(26,995)
JPY	431,470,352	EUR	2,733,000	HSBC Bank	15/9/2023	(9,387)
JPY	209,931,555	CAD	1,955,000	JP Morgan	15/9/2023	(6,439)
JPY	209,284,551	USD	1,444,000	JP Morgan	15/9/2023	(9,539)
JPY	157,000,000	USD	1,079,592	Barclays	20/9/2023	(2,634)
KRW	431,369,450	USD	335,000	Morgan Stanley	20/9/2023	(8,588)
KRW	4,816,725,000	USD	3,692,774	Citigroup	14/9/2023	(48,222)
KRW	3,932,931,600	USD	2,964,000	Citigroup	18/9/2023	11,948
MXN	1,070,000,737	USD	61,206,379	Barclays	20/9/2023	2,552,272
MXN	303,602,000	USD	17,427,928	Citigroup	20/9/2023	662,951
MXN	186,421,840	USD	11,001,779	JP Morgan	20/9/2023	106,629
MXN	14,565,602	USD	833,036	BNP Paribas	20/9/2023	34,892
MXN	7,696,314	USD	448,000	JP Morgan	18/9/2023	10,764
MXN	44,126,352	GBP	2,030,000	UBS	18/9/2023	56,799
MXN	50,139,484	USD	2,920,000	JP Morgan	15/9/2023	70,283
MXN	44,128,967	GBP	2,030,000	JP Morgan	18/9/2023	56,955
MXN	196,934	USD	11,443	State Street	14/9/2023	304
MXN	148,675,256	USD	8,759,000	Goldman Sachs	18/9/2023	103,265
MXN	22,434,706	USD	1,330,000	Toronto-Dominion	18/9/2023	7,292
MYR	13,314,334	USD	2,948,915	Barclays	14/9/2023	(77,383)
MYR	27,193,320	USD	5,940,000	Barclays	18/9/2023	(73,468)
NOK	39,805,915	USD	3,620,146	Deutsche Bank	14/9/2023	119,077
NOK	81,443,836	USD	7,778,273	Morgan Stanley	20/9/2023	(126,283)
NOK	62,828,003	USD	5,965,445	HSBC Bank	20/9/2023	(62,490)
NOK	27,055,957	USD	2,530,008	Toronto-Dominion	20/9/2023	12,013
NOK	71,094,549	USD	6,748,145	Goldman Sachs	20/9/2023	(68,512)
NOK	1,460,000	USD	139,248	Citigroup	20/9/2023	(2,075)
NOK	147,186,200	USD	14,162,005	JP Morgan	20/9/2023	(333,243)
NOK	2,930,000	USD	274,530	Bank of America	20/9/2023	756
NOK	17,557,803	USD	1,710,550	BNP Paribas	20/9/2023	(60,921)
NOK	27,381,062	USD	2,652,603	Deutsche Bank	20/9/2023	(80,038)
NOK	6,600,000	EUR	561,403	Goldman Sachs	20/9/2023	10,534
NOK	1,180,000	USD	109,999	UBS	20/9/2023	867
NOK	1,310,000	USD	129,857	Barclays	20/9/2023	(6,777)
NOK	16,781,231	USD	1,668,612	Barclays	21/9/2023	(91,895)
NOK	16,905,388	USD	1,669,119	HSBC Bank	21/9/2023	(80,736)
NOK	960,000	USD	95,348	BNY Mellon	20/9/2023	(5,152)
NOK	5,154,259	USD	500,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(15,736)
NOK	1,600,000	USD	157,636	Société Générale	20/9/2023	(7,309)

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
NOK	30,564,233	USD	2,920,000	Deutsche Bank	15/9/2023	(48,816)
NOK	30,671,319	USD	2,884,000	Deutsche Bank	18/9/2023	(2,483)
NOK	15,315,673	USD	1,443,000	Goldman Sachs	18/9/2023	(4,119)
NOK	30,652,580	USD	2,878,000	JP Morgan	18/9/2023	1,756
NZD	3,187,248	USD	1,950,000	Deutsche Bank	20/9/2023	(54,314)
NZD	4,951,684	USD	3,069,967	Toronto-Dominion	20/9/2023	(124,844)
NZD	3,364,000	USD	2,077,277	Bank of America	20/9/2023	(76,464)
NZD	8,055,255	USD	4,976,799	JP Morgan	20/9/2023	(185,758)
NZD	1,568,113	AUD	1,420,000	Deutsche Bank	20/9/2023	12,321
NZD	4,924,159	USD	2,982,563	BNP Paribas	20/9/2023	(53,811)
NZD	2,861,543	USD	1,700,000	Goldman Sachs	20/9/2023	1,966
NZD	1,473,854	USD	906,993	HSBC Bank	20/9/2023	(30,385)
NZD	6,132,838	USD	3,760,354	Morgan Stanley	20/9/2023	(112,714)
NZD	1,810,551	USD	1,100,000	UBS	20/9/2023	(23,135)
NZD	3,519,541	USD	2,100,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(6,676)
PLN	22,045,000	USD	5,289,742	Bank of America	14/9/2023	59,219
PLN	14,798,000	USD	3,618,680	Morgan Stanley	20/9/2023	(29,312)
PLN	9,050,011	USD	2,202,000	Citigroup	18/9/2023	(6,608)
SEK	54,628,651	USD	5,147,065	Deutsche Bank	20/9/2023	(135,546)
SEK	8,539,914	USD	800,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(16,566)
SEK	27,126,173	USD	2,567,109	Citigroup	20/9/2023	(78,608)
SEK	13,458,897	USD	1,267,669	Bank of America	20/9/2023	(32,978)
SEK	73,832,201	USD	6,865,325	Goldman Sachs	20/9/2023	(92,111)
SEK	29,530,196	USD	2,750,000	JP Morgan	20/9/2023	(40,961)
SEK	71,973,706	USD	6,772,057	Morgan Stanley	20/9/2023	(169,338)
SEK	39,037,524	USD	3,630,573	HSBC Bank	20/9/2023	(49,350)
SEK	36,269,864	USD	3,420,874	BNP Paribas	20/9/2023	(93,549)
SEK	7,860,000	USD	740,173	Barclays	20/9/2023	(19,113)
SEK	21,112,955	EUR	1,787,000	Morgan Stanley	20/9/2023	(3,441)
SEK	1,630,000	USD	150,631	Société Générale	20/9/2023	(1,098)
SEK	19,158,427	USD	1,788,801	Toronto-Dominion	20/9/2023	(31,247)
SEK	45,048,803	EUR	3,842,500	JP Morgan	20/9/2023	(39,448)
SEK	1,620,000	USD	150,083	BNY Mellon	20/9/2023	(1,468)
SEK	29,657,807	EUR	2,487,778	BNP Paribas	20/9/2023	19,552
SEK	3,050,000	USD	298,187	State Street	20/9/2023	(18,386)
SEK	19,292,089	EUR	1,677,500	UBS	20/9/2023	(51,589)
SEK	28,918,619	EUR	2,503,679	HSBC Bank	20/9/2023	(65,525)
SEK	3,747,114	USD	350,000	UBS	20/9/2023	(6,248)
SEK	1,820,000	USD	166,749	RBS	20/9/2023	214
SEK	31,235,328	USD	2,880,000	UBS	18/9/2023	(14,818)
SGD	5,094,467	USD	3,794,220	JP Morgan	14/9/2023	(23,614)
THB	268,292,620	USD	7,767,592	HSBC Bank	14/9/2023	(98,314)
THB	258,460,000	USD	7,495,118	Citigroup	14/9/2023	(106,911)
THB	252,700,000	USD	7,290,301	Citigroup	20/9/2023	(62,447)
THB	312,728,884	USD	8,873,000	Goldman Sachs	18/9/2023	70,058
TWD	58,700,000	USD	1,888,917	Citigroup	20/9/2023	(45,393)
USD	2,095,450	EUR	1,954,000	RBS	20/9/2023	(26,176)
USD	7,608,394	CZK	167,850,445	Barclays	6/9/2023	38,928
USD	46,236,563	EUR	42,442,259	HSBC Bank	20/9/2023	153,357
USD	14,123,652	EUR	12,778,000	Standard Chartered Bank	20/9/2023	249,480
USD	15,990,071	IDR	238,567,858,000	Citigroup	20/9/2023	328,990
USD	1,929,081	TWD	58,700,000	Barclays	20/9/2023	85,556
USD	9,124,995	IDR	135,832,845,842	UBS	14/9/2023	207,291
USD	7,022,324	CZK	155,719,486	Deutsche Bank	14/9/2023	2,148

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	30,886,118	MXN	546,187,018	JP Morgan	14/9/2023	(1,693,743)
USD	10,838,753	ZAR	209,193,816	Goldman Sachs	14/9/2023	(284,698)
USD	3,279,650	EUR	3,015,339	Royal Bank of Canada	20/9/2023	5,636
USD	4,860,062	GBP	3,826,157	Toronto-Dominion	20/9/2023	9,481
USD	14,544,727	COP	61,421,675,915	Citigroup	14/9/2023	(363,410)
USD	14,077,648	EUR	12,978,100	State Street	20/9/2023	(13,790)
USD	2,740,517	EUR	2,531,952	State Street	14/9/2023	(7,842)
USD	553,070	EUR	509,698	BNY Mellon	14/9/2023	(192)
USD	5,028,919	NOK	52,134,120	Deutsche Bank	20/9/2023	130,699
USD	16,075,632	GBP	12,508,185	JP Morgan	20/9/2023	218,476
USD	1,800,000	GBP	1,421,429	Deutsche Bank	20/9/2023	(2,005)
USD	2,150,000	CAD	2,848,618	Deutsche Bank	20/9/2023	43,851
USD	6,338,648	KRW	8,000,000,000	State Street	20/9/2023	285,138
USD	1,050,000	AUD	1,542,418	Deutsche Bank	20/9/2023	50,308
USD	10,687,098	MXN	186,421,840	JP Morgan	20/9/2023	(421,310)
USD	1,000,000	JPY	141,261,612	Goldman Sachs	20/9/2023	31,002
USD	3,250,000	NZD	5,354,161	Goldman Sachs	20/9/2023	65,494
USD	1,900,000	EUR	1,735,633	Morgan Stanley	20/9/2023	15,474
USD	600,000	CHF	534,276	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(5,979)
USD	2,344,094	SEK	25,145,763	Deutsche Bank	20/9/2023	37,274
USD	5,459,592	SEK	57,950,000	Bank of America	20/9/2023	143,379
USD	1,818,173	EUR	1,666,367	Citigroup	14/9/2023	9,380
USD	3,975,687	GBP	3,129,000	Bank of America	20/9/2023	8,921
USD	4,498,435	SEK	48,545,314	Goldman Sachs	20/9/2023	44,987
USD	8,278,821	NOK	85,737,583	Morgan Stanley	20/9/2023	223,414
USD	16,992,607	CNH	120,869,011	Toronto-Dominion	20/9/2023	365,360
USD	250,000	GBP	195,939	Royal Bank of Canada	20/9/2023	1,599
USD	499,054,608	EUR	454,765,776	Toronto-Dominion	20/9/2023	5,276,326
USD	6,083,988	AUD	9,141,057	Royal Bank of Canada	20/9/2023	159,366
USD	32,892,110	MXN	568,434,096	Goldman Sachs	20/9/2023	(979,447)
USD	600,000	CAD	802,949	Royal Bank of Canada	20/9/2023	6,333
USD	1,646,018	SEK	17,623,544	BNP Paribas	20/9/2023	29,269
USD	2,700,000	NOK	28,596,553	Royal Bank of Canada	20/9/2023	13,234
USD	14,075,534	JPY	1,963,140,000	BNY Mellon	20/9/2023	609,176
USD	525,085	CAD	692,000	BNY Mellon	20/9/2023	13,449
USD	6,237,079	SEK	66,191,748	Morgan Stanley	20/9/2023	164,784
USD	4,696,682	AUD	6,830,000	BNY Mellon	20/9/2023	269,933
USD	2,320,244	AUD	3,364,000	Nomura	20/9/2023	139,924
USD	500,000	GBP	389,123	Nomura	20/9/2023	6,693
USD	2,073,928	GBP	1,628,054	Morgan Stanley	20/9/2023	9,976
USD	8,278,058	CAD	11,047,038	Morgan Stanley	20/9/2023	110,341
USD	4,190,855	NZD	6,725,000	Nomura	20/9/2023	191,014
USD	1,250,000	AUD	1,812,955	Citigroup	20/9/2023	74,964
USD	872,513,088	EUR	795,060,244	BNP Paribas	20/9/2023	9,247,858
USD	1,242,818	AUD	1,810,000	Bank of America	20/9/2023	69,697
USD	433,156,204	GBP	337,805,450	BNP Paribas	20/9/2023	4,905,957
USD	3,269,364	JPY	465,476,290	Bank of America	20/9/2023	76,381
USD	1,862,702	EUR	1,695,739	Bank of America	22/9/2023	21,315
USD	52,462,632	EUR	47,413,741	JP Morgan	20/9/2023	981,460
USD	4,383,937	HKD	34,238,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	15,094
USD	785,081	EUR	714,691	Deutsche Bank	22/9/2023	9,005
USD	2,462,106	SGD	3,297,000	Toronto-Dominion	20/9/2023	21,208
USD	13,207,215	AUD	20,013,254	JP Morgan	20/9/2023	235,963
USD	617,632	GBP	484,000	RBS	20/9/2023	4,045

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	3,150,000	CHF	2,785,473	Goldman Sachs	20/9/2023	(9,295)
USD	6,700,000	CAD	8,876,469	JP Morgan	20/9/2023	137,111
USD	146,694	NOK	1,570,000	RBS	20/9/2023	(814)
USD	600,000	CHF	533,260	HSBC Bank	20/9/2023	(4,825)
USD	11,141,353	NOK	117,603,280	JP Morgan	20/9/2023	92,030
USD	1,843,361	NOK	19,559,268	HSBC Bank	20/9/2023	5,686
USD	439,554	EUR	400,332	Citigroup	22/9/2023	4,837
USD	3,414,037	SEK	36,464,710	Citigroup	20/9/2023	68,839
USD	1,303,731	NZD	2,107,034	HSBC Bank	20/9/2023	50,526
USD	3,827,697	JPY	548,862,380	HSBC Bank	20/9/2023	62,720
USD	25,887,652	BRL	124,825,733	Goldman Sachs	20/9/2023	617,710
USD	14,841,611	MXN	258,592,809	Citigroup	20/9/2023	(567,284)
USD	6,977,371	SEK	73,759,738	JP Morgan	20/9/2023	210,806
USD	12,308,053	IDR	184,313,096,232	Citigroup	26/9/2023	209,665
USD	4,610,000	CAD	6,078,943	HSBC Bank	20/9/2023	115,483
USD	13,932,031	ZAR	265,289,422	Citigroup	14/9/2023	(174,189)
USD	13,416,136	JPY	1,905,489,415	JP Morgan	20/9/2023	345,236
USD	13,101,803	EUR	11,943,825	Deutsche Bank	20/9/2023	133,366
USD	2,850,000	NZD	4,747,946	Royal Bank of Canada	20/9/2023	26,054
USD	1,626,211	JPY	229,273,098	Royal Bank of Canada	20/9/2023	53,488
USD	2,304,155	AUD	3,466,350	BNP Paribas	20/9/2023	57,498
USD	550,000	CHF	485,705	BNP Paribas	20/9/2023	(888)
USD	1,100,000	CAD	1,452,473	BNP Paribas	20/9/2023	26,103
USD	600,000	NZD	979,761	Citigroup	20/9/2023	17,265
USD	2,381,615	NOK	24,414,668	Barclays	20/9/2023	87,755
USD	4,943,438	EUR	4,520,000	Société Générale	20/9/2023	35,686
USD	18,623,273	COP	81,025,204,449	Bank of America	20/12/2023	(560,520)
USD	4,100,000	NZD	6,666,638	JP Morgan	20/9/2023	134,870
USD	2,130,418	GBP	1,674,000	State Street	20/9/2023	8,218
USD	1,052,748	HKD	8,230,000	UBS	20/9/2023	2,583
USD	2,996,887	GBP	2,350,000	JP Morgan	13/9/2023	17,787
USD	3,773,805	SGD	5,094,467	Citigroup	14/9/2023	3,199
USD	3,791,455	NOK	39,204,760	Goldman Sachs	20/9/2023	108,004
USD	15,672,988	INR	1,289,260,000	Barclays	14/9/2023	99,990
USD	900,000	CHF	791,213	Deutsche Bank	20/9/2023	2,604
USD	900,000	NZD	1,469,594	Toronto-Dominion	20/9/2023	25,927
USD	1,300,000	CAD	1,730,605	Toronto-Dominion	20/9/2023	20,464
USD	5,008,446	EUR	4,583,561	UBS	20/9/2023	31,680
USD	750,000	JPY	107,123,565	Toronto-Dominion	20/9/2023	15,175
USD	4,169,965	GBP	3,279,769	Standard Chartered Bank	20/9/2023	12,063
USD	300,000	JPY	42,769,020	RBS	20/9/2023	6,622
USD	820,135	NOK	8,627,715	Bank of America	20/9/2023	9,524
USD	2,688,726	IDR	40,376,598,000	HSBC Bank	20/9/2023	38,155
USD	7,290,102	SGD	9,820,000	Morgan Stanley	20/9/2023	19,974
USD	1,934,191	INR	159,300,000	Goldman Sachs	20/9/2023	10,030
USD	1,264,772	GBP	990,000	Barclays	20/9/2023	9,707
USD	1,400,000	NOK	14,321,504	Toronto-Dominion	20/9/2023	54,435
USD	550,000	CHF	486,480	Toronto-Dominion	20/9/2023	(1,768)
USD	850,000	AUD	1,271,743	Toronto-Dominion	20/9/2023	25,741
USD	4,721,000	TWD	146,870,310	BNP Paribas	11/10/2023	104,850
USD	2,573,285	GBP	2,007,502	HSBC Bank	20/9/2023	28,289
USD	5,793,892	JPY	824,837,990	Barclays	20/9/2023	135,832
USD	17,649,251	EUR	16,240,979	Barclays	20/9/2023	15,024
USD	965,013	SEK	10,246,454	Barclays	20/9/2023	25,025

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	15,901,996	JPY	2,304,520,337	Citigroup	20/9/2023	93,906
USD	5,584,591	JPY	782,374,456	BNP Paribas	20/9/2023	217,815
USD	25,903,396	EUR	23,435,467	Citigroup	20/9/2023	464,548
USD	1,461,130	SEK	15,587,087	UBS	20/9/2023	31,202
USD	2,850,000	CHF	2,484,674	JP Morgan	20/9/2023	31,872
USD	200,000	NZD	322,832	Deutsche Bank	20/9/2023	7,988
USD	2,496,919	CNH	17,820,012	Citigroup	21/9/2023	45,397
USD	2,702,310	PHP	148,600,000	Deutsche Bank	20/9/2023	78,870
USD	335,000	KRW	427,099,540	Morgan Stanley	20/9/2023	11,819
USD	670,000	JPY	92,504,735	Deutsche Bank	20/9/2023	35,454
USD	2,629,909	NZD	4,315,679	Morgan Stanley	20/9/2023	63,064
USD	348,155	SEK	3,610,000	State Street	20/9/2023	16,980
USD	152,794	NOK	1,530,000	BNY Mellon	20/9/2023	9,044
USD	94,865	SEK	970,000	BNY Mellon	20/9/2023	5,880
USD	1,746,459	SEK	17,786,329	Toronto-Dominion	20/9/2023	114,778
USD	1,237,133	EUR	1,099,000	Royal Bank of Canada	22/9/2023	43,739
USD	1,350,000	CHF	1,169,599	Morgan Stanley	20/9/2023	23,436
USD	151,941	NOK	1,520,000	State Street	20/9/2023	9,131
USD	4,453,686	AUD	6,609,504	HSBC Bank	20/9/2023	169,847
USD	600,000	NZD	962,882	BNP Paribas	20/9/2023	27,304
USD	3,951,657	NOK	39,805,915	Barclays	14/9/2023	212,435
USD	2,501,000	CNH	17,835,431	BNP Paribas	20/9/2023	47,483
USD	14,987,677	MXN	257,001,191	HSBC Bank	20/9/2023	(326,377)
USD	12,358,593	CZK	271,444,614	Barclays	14/9/2023	121,275
USD	3,803,340	EUR	3,449,373	BNY Mellon	20/9/2023	58,060
USD	4,348,792	HUF	1,522,647,000	Bank of America	14/9/2023	13,834
USD	3,229,424	GBP	2,501,000	Citibank	20/9/2023	58,800
USD	582,178	EUR	523,924	Morgan Stanley	14/9/2023	13,474
USD	136,598	EUR	122,880	Standard Chartered Bank	22/9/2023	3,165
USD	14,821,774	BRL	72,483,956	BNY Mellon	14/9/2023	133,632
USD	1,668,612	NOK	16,665,336	Morgan Stanley	21/9/2023	102,784
USD	700,000	GBP	548,042	Goldman Sachs	20/9/2023	5,225
USD	3,702,165	EUR	3,400,914	Goldman Sachs	20/9/2023	9,500
USD	2,600,000	CAD	3,480,345	Goldman Sachs	20/9/2023	26,779
USD	1,132,597	NOK	11,840,528	BNP Paribas	20/9/2023	20,130
USD	14,733,707	IDR	224,049,787,270	Morgan Stanley	20/9/2023	25,683
USD	5,521,808	EUR	5,002,000	Citigroup	21/9/2023	90,444
USD	4,388,547	IDR	66,903,406,000	Citigroup	14/9/2023	(3,798)
USD	5,761,431	MXN	99,887,000	Citigroup	14/9/2023	(196,792)
USD	400,000	CHF	348,650	UBS	20/9/2023	4,560
USD	589,053	NOK	6,032,357	UBS	20/9/2023	22,288
USD	1,450,000	AUD	2,206,488	Goldman Sachs	20/9/2023	19,902
USD	5,124,373	PLN	20,945,000	JP Morgan	14/9/2023	42,315
USD	3,615,715	BRL	17,670,000	Goldman Sachs	14/9/2023	35,068
USD	1,669,119	NOK	17,049,633	JP Morgan	21/9/2023	67,184
USD	500,000	JPY	70,673,650	UBS	20/9/2023	15,207
USD	500,000	GBP	393,760	UBS	20/9/2023	813
USD	150,000	CAD	200,388	UBS	20/9/2023	1,842
USD	3,421,220	EUR	3,112,735	UBS	7/11/2023	33,353
USD	9,967,204	ZAR	188,016,429	State Street	7/11/2023	18,602
USD	7,136,725	MXN	121,840,565	Barclays	14/9/2023	(131,021)
USD	833,036	MXN	14,409,893	BNP Paribas	20/9/2023	(25,613)
USD	1,050,000	JPY	152,460,392	Morgan Stanley	20/9/2023	4,182
USD	420,711	CZK	9,332,135	UBS	6/9/2023	(135)

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	1,256,683	COP	5,315,768,395	Citigroup	20/12/2023	(1,896)
USD	730,000	COP	2,996,956,600	Barclays	18/9/2023	3,556
USD	300,000	CAD	402,786	Citigroup	20/9/2023	2,197
USD	1,462,122	AUD	2,234,006	Morgan Stanley	20/9/2023	14,189
USD	5,244,000	COP	21,070,104,000	Citigroup	18/9/2023	136,735
USD	6,547,598	CNH	47,468,000	Citigroup	14/9/2023	19,726
USD	2,800,000	CHF	2,446,580	Barclays	20/9/2023	25,079
USD	6,292,403	AUD	9,681,132	Barclays	20/9/2023	17,741
USD	730,000	BRL	3,575,007	Goldman Sachs	5/9/2023	4,498
USD	5,965,512	BRL	29,083,581	Citigroup	20/9/2023	77,781
USD	7,139,572	COP	28,729,637,000	Morgan Stanley	15/9/2023	168,712
USD	2,920,000	CLP	2,492,512,000	BNP Paribas	15/9/2023	6,635
USD	1,032,000	CLP	880,605,600	Morgan Stanley	15/9/2023	2,706
USD	2,008,000	ZAR	38,471,774	Morgan Stanley	18/9/2023	(36,937)
USD	4,380,000	CNH	31,812,896	Goldman Sachs	18/9/2023	4,138
USD	627,914	AUD	970,000	Citigroup	18/9/2023	(729)
USD	3,188,000	CAD	4,292,732	Deutsche Bank	18/9/2023	14,232
USD	2,271,000	JPY	328,542,140	HSBC Bank	15/9/2023	19,134
USD	2,920,000	NOK	30,620,673	Deutsche Bank	15/9/2023	43,514
USD	3,616,333	EUR	3,305,000	Goldman Sachs	14/9/2023	28,853
USD	3,619,386	CNH	26,315,000	JP Morgan	14/9/2023	507
USD	2,202,000	PLN	9,006,323	HSBC Bank	18/9/2023	17,206
USD	10,199,000	MXN	174,303,624	JP Morgan	18/9/2023	(190,926)
USD	2,920,000	MXN	50,238,573	JP Morgan	15/9/2023	(76,193)
USD	4,374,000	JPY	636,770,784	JP Morgan	15/9/2023	9,498
USD	730,000	ZAR	14,046,300	Goldman Sachs	18/9/2023	(16,620)
USD	2,902,000	MXN	50,108,834	Citigroup	18/9/2023	(84,898)
USD	2,902,000	COP	11,999,770,000	Standard Chartered Bank	18/9/2023	(6,672)
USD	3,166,563	GBP	2,486,000	Citigroup	20/9/2023	14,956
USD	3,562,048	COP	14,885,798,000	BNP Paribas	17/10/2023	(14,804)
USD	2,174,462	AUD	3,353,000	JP Morgan	18/9/2023	1,431
USD	112,575	NOK	1,180,000	Citigroup	20/9/2023	1,709
USD	2,898,000	THB	102,647,160	BNP Paribas	18/9/2023	(37,384)
USD	2,174,141	THB	77,032,000	BNP Paribas	14/9/2023	(27,857)
USD	2,411,297	IDR	36,970,000,000	Barclays	20/9/2023	(15,644)
USD	4,332,900	GBP	3,410,000	JP Morgan	18/9/2023	9,938
USD	4,211,404	AUD	6,564,000	Deutsche Bank	18/9/2023	(42,630)
USD	950,000	SEK	10,396,038	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(3,712)
USD	950,000	SEK	10,379,282	HSBC Bank	20/9/2023	(2,174)
USD	2,163,000	ZAR	40,524,232	Barclays	18/9/2023	8,966
USD	721,000	BRL	3,565,828	JP Morgan	5/9/2023	(2,639)
USD	3,608,000	NOK	38,550,956	Goldman Sachs	18/9/2023	(13,795)
USD	662,435	CNH	4,818,376	JP Morgan	20/9/2023	(401)
USD	2,880,000	ZAR	53,413,473	Citigroup	18/9/2023	40,849
USD	1,439,000	CAD	1,948,862	JP Morgan	18/9/2023	(1,863)
USD	2,883,000	CLP	2,482,263,000	Toronto-Dominion	15/9/2023	(18,386)
USD	83,072,171	MXN	1,404,359,970	Barclays	28/9/2023	(493,701)
USD	5,755,000	MXN	97,115,067	Goldman Sachs	18/9/2023	(33,855)
USD	2,877,283	BRL	14,082,000	Citigroup	14/9/2023	23,708
USD	2,888,000	BRL	14,113,656	Citigroup	5/9/2023	23,816
USD	2,158,000	ZAR	40,224,967	UBS	18/9/2023	19,874
USD	720,000	ZAR	13,395,975	HSBC Bank	18/9/2023	7,948
USD	1,445,000	ZAR	26,959,986	JP Morgan	18/9/2023	11,963
USD	4,674,000	BRL	22,847,680	HSBC Bank	5/9/2023	37,358

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	170,183	SEK	1,870,000	RBS	20/9/2023	(1,367)
USD	1,441,776	EUR	1,330,000	Goldman Sachs	18/9/2023	(2,180)
USD	1,477,395	NZD	2,482,898	Bank of America	20/9/2023	637
USD	1,316,103	EUR	1,208,000	Morgan Stanley	18/9/2023	4,601
USD	4,326,000	CNH	31,552,546	Citigroup	18/9/2023	(14,052)
USD	879,656	EUR	805,000	Barclays	18/9/2023	5,683
USD	721,000	NOK	7,603,984	Morgan Stanley	18/9/2023	6,619
USD	7,126,327	COP	29,227,203,255	BNY Mellon	14/9/2023	32,363
ZAR	152,104,927	USD	8,178,036	Barclays	20/9/2023	(94,444)
ZAR	31,016,000	USD	1,678,097	Morgan Stanley	20/9/2023	(29,757)
ZAR	65,844,000	USD	3,655,238	HSBC Bank	14/9/2023	(154,119)
ZAR	122,301,000	USD	6,479,480	Citigroup	14/9/2023	23,625
ZAR	60,950,504	EUR	2,916,000	Morgan Stanley	18/9/2023	73,930
ZAR	27,811,158	USD	1,452,000	Morgan Stanley	18/9/2023	26,280
ZAR	188,016,429	USD	9,781,587	Morgan Stanley	7/11/2023	167,016
ZAR	13,723,665	USD	721,000	Barclays	18/9/2023	8,471
ZAR	26,927,712	USD	1,440,000	BNP Paribas	18/9/2023	(8,679)
ZAR	53,849,106	USD	2,878,000	Bank of America	18/9/2023	(15,694)
ZAR	81,239,105	USD	4,323,000	UBS	18/9/2023	(4,800)
ZAR	40,429,757	USD	2,160,000	JP Morgan	18/9/2023	(10,988)
未実現純評価益						15,185,830
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	87,105,221	USD	56,731,082	BNY Mellon	15/9/2023	(285,569)
USD	633,805	AUD	988,462	BNY Mellon	15/9/2023	(6,730)
未実現純評価損						(292,299)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,059,986,695	USD	788,234,805	BNY Mellon	15/9/2023	(4,584,516)
USD	19,637,523	CAD	26,589,915	BNY Mellon	15/9/2023	(20,430)
未実現純評価損						(4,604,946)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	185,311,568	USD	212,198,182	BNY Mellon	15/9/2023	(2,128,544)
USD	9,752,888	CHF	8,534,739	BNY Mellon	15/9/2023	77,912
未実現純評価損						(2,050,632)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	26,627	USD	3,690	BNY Mellon	15/9/2023	(28)
USD	44	CNY	319	BNY Mellon	15/9/2023	-
未実現純評価損						(28)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	971,677,240	USD	1,066,198,069	BNY Mellon	15/9/2023	(11,413,806)
USD	13,028,942	EUR	11,938,417	BNY Mellon	15/9/2023	69,475
未実現純評価損						(11,344,331)

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	247,304,027	USD	314,648,586	BNY Mellon	15/9/2023	(1,137,896)
USD	15,360,138	GBP	12,080,053	BNY Mellon	15/9/2023	46,093
未実現純評価損						(1,091,803)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	2,947,401	USD	377,658	BNY Mellon	15/9/2023	(1,654)
USD	2,270	HKD	17,766	BNY Mellon	15/9/2023	4
未実現純評価損						(1,650)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	50,985,523,133	USD	357,896,541	BNY Mellon	15/9/2023	(8,420,952)
USD	10,396,919	JPY	1,503,266,884	BNY Mellon	15/9/2023	93,188
未実現純評価損						(8,327,764)
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	91,433,875	USD	22,500,152	BNY Mellon	15/9/2023	(316,216)
USD	557,248	PLN	2,285,505	BNY Mellon	15/9/2023	2,729
未実現純評価損						(313,487)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローナ建投資証券クラス						
SEK	4,570,399	USD	427,799	BNY Mellon	15/9/2023	(8,620)
USD	74,041	SEK	811,115	BNY Mellon	15/9/2023	(350)
未実現純評価損						(8,970)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
USD	685,907	SGD	928,588	BNY Mellon	5/9/2023	(1,096)
SGD	114,748,575	USD	85,243,134	BNY Mellon	15/9/2023	(309,404)
USD	653,850	SGD	887,456	BNY Mellon	15/9/2023	(3,018)
未実現純評価損						(313,518)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-7,434,242,227米ドル)						(13,163,598)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

未決済上場先物取引 2023年8月31日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益/(損) (米ドル)
40	USD	30 Day Federal Funds	2023年 8月	15,779,596	(10,001)
(88)	EUR	Euro BOBL	2023年 9月	11,077,985	(52,826)
931	EUR	Euro Bund	2023年 9月	134,341,172	496,762
(128)	EUR	Euro BUXL	2023年 9月	18,533,989	375,760
(471)	EUR	Euro Schatz	2023年 9月	53,704,512	25,605
(723)	EUR	Euro-BTP	2023年 9月	90,921,589	(358,035)
44	EUR	Euro-OAT	2023年 9月	6,096,568	(49,117)
(111)	JPY	Nikkei 225 Index	2023年 9月	12,400,211	(52,249)
86	JPY	TOPIX Index	2023年 9月	13,745,410	564,880
(247)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年 9月	248,343,587	1,006,482
343	AUD	Australian 10 Year Bond	2023年 9月	25,850,823	(51,811)
(272)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2023年 9月	12,798,708	(14,097)
10	GBP	FTSE 100 Index	2023年 9月	950,484	(12,296)
175	USD	MSCI Emerging Markets Index	2023年 9月	8,621,375	(207,200)
(76)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2023年 9月	23,661,080	(760,376)
(343)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2023年 9月	32,862,830	(508,442)
(41)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2023年 9月	9,298,287	(240,721)
291	GBP	3 Month SONIA	2023年 9月	87,527,461	(456,516)
19	KRW	Korean 10 Year Bond	2023年 9月	1,575,200	(15,956)
327	KRW	Korean 3 Year Bond	2023年 9月	25,620,669	(42,134)
213	USD	SGX FTSE China A50 Index	2023年 9月	2,694,663	873
(56)	EUR	3 Month EURIBOR	2023年 9月	14,610,523	(2,278)
(779)	EUR	EURO STOXX Banks Index	2023年 9月	4,760,433	(346,521)
(1,726)	USD	US Long Bond (CBT)	2023年12月	209,816,875	(3,026,110)
(5,440)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年12月	603,245,000	(5,518,497)
(7,208)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年12月	836,015,375	(10,954,597)
(1,317)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年12月	170,510,344	(2,503,618)
(280)	GBP	Long Gilt	2023年12月	33,836,621	(278,198)
(2,215)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2023年12月	451,133,201	(668,723)
1,206	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年12月	128,806,453	102,194
1,164	USD	3 Month SOFR	2024年 3月	275,213,250	(1,053,271)
84	GBP	3 Month SONIA	2024年 3月	25,097,949	58,175
60	EUR	3 Month EURIBOR	2024年 6月	15,687,494	(66,168)
1,231	USD	3 Month SOFR	2024年 6月	291,639,287	(437,666)
1,090	USD	3 Month SOFR	2024年 9月	259,052,125	(158,144)
23	GBP	3 Month SONIA	2024年 9月	6,878,618	25,215
35	CAD	Banker's Acceptance	2024年 9月	6,135,993	3,714
23	USD	3 Month SOFR	2024年12月	5,487,225	7,339
(1,151)	USD	3 Month SOFR	2025年 3月	275,606,950	1,869,945
合計				4,449,939,915	(23,308,624)

スワップ 2023年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 3,044,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(41,587)	(21,385)
CDS	USD 3,045,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(41,600)	(21,392)
CDS	USD 3,040,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(41,532)	(21,357)
CDS	USD 3,044,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(41,205)	(21,385)
CDS	USD 4,260,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(57,665)	(29,928)
CDS	USD 1,844,000	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(24,962)	(12,955)
CDS	USD 11,294,412	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(61,171)	(215,713)
CDS	EUR 4,450,000	ファンドはENIに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(53,902)	(83,232)
CDS	EUR 1,558,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(21,457)	(21,013)
CDS	EUR 1,500,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(99,947)	(16,807)
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(20,814)	(29,992)
CDS	USD 215,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(6,019)	5,576
CDS	USD 515,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(13,649)	13,356
CDS	USD 250,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(1,799)	10,023
CDS	USD 500,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(16,837)	(17,762)
CDS	USD (510,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(56,463)	39,881
CDS	USD (725,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(73,943)	56,693
CDS	USD (256,667)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(26,972)	20,071
CDS	EUR (26,683)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2027	2,298	3,156
CDS	EUR (900,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2027	86,307	106,445
CDS	USD 346,223	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2027	(10,918)	(5,360)
CDS	EUR (159,806)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	(394)	(39,631)
CDS	EUR (100,709)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	(249)	(24,975)
CDS	EUR (283,073)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	(699)	(70,200)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 240,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2027	27,438	81,166
CDS	EUR (342,000)	ファンドはLadbrokesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2028	7,187	(13,823)
CDS	USD 13,188,750	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(640,771)	579,880
CDS	USD 1,409,599	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(7,628)	(26,922)
CDS	USD 2,114,398	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(11,528)	(40,383)
CDS	USD 1,409,599	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(7,685)	(26,922)
CDS	USD 12,596,500	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(502,514)	338,439
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(28,948)	63,873
CDS	USD 2,366,784	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(40,671)	(15,581)
CDS	USD 1,881,511	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(25,125)	(12,387)
CDS	USD 12,259,512	ファンドはMexicanに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2028	(222,099)	(5,590)
CDS	USD (525,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(48,504)	41,054
CDS	USD 500,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(7,065)	604
CDS	USD 1,250,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(2,532)	(9,031)
CDS	USD (818,182)	ファンドはCCOに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2025	(85,669)	63,090
CDS	USD 750,000	ファンドはBorgwarnerに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(21,013)	(12,004)
CDS	EUR 247,191	ファンドはIneosに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(5,963)	(28,806)
CDS	EUR 1,310,000	ファンドはIntesa Sanpaoloに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(38,785)	52,497
CDS	EUR (2,000,000)	ファンドはIntesa Sanpaoloに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2028	11,067	3,987
CDS	EUR 5,800,000	ファンドはHSBCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2028	(10,028)	(64,847)
CDS	EUR 450,000	ファンドはPicardに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2028	(11,295)	(2,734)
CDS	EUR 888,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2028	(48,340)	(9,950)
CDS	EUR 2,000,000	ファンドはUnicreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2028	(13,733)	26,300
CDS	EUR 1,700,000	ファンドはStandard Charteredに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2028	(3,458)	(12,608)
CDS	EUR (720,000)	ファンドはTkagrに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2023	23,724	1,497
CDS	EUR (167,547)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	159	(41,550)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (263,745)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	28,317	(12,037)
CDS	USD 32,345,960	ファンドはCDX.NA.IG.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(282,132)	(495,155)
CDS	USD 370,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	40,011	125,131
CDS	USD 2,100,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	(11,814)	(62,617)
CDS	USD 290,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	3,201	103,702
CDS	EUR (5,836,555)	ファンドはITRAXX.XO.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2027	116,290	311,420
CDS	USD 9,193,059	ファンドはCDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(193,552)	(304,917)
CDS	EUR 26,382,000	ファンドはITRAXX.FINSR.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(587,550)	(249,012)
CDS	EUR 11,356,603	ファンドはITRAXX.FINSUB.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(509,717)	247,377
CDS	EUR 36,749,300	ファンドはITRAXX.XO.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	(513,360)	(1,646,761)
CDS	USD 1,567,604	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2028	(16,591)	(9,812)
CDS	USD (3,675,000)	ファンドはAT&Tに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2023	(2,364)	5,774
CDS	USD 215,000	ファンドはAlly Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(3,228)	(11,541)
CDS	USD 325,000	ファンドはAlly Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(4,882)	(17,446)
CDS	EUR 1,891,000	ファンドはEdfに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(10,078)	(16,736)
CDS	USD 330,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(16,373)	35,757
CDS	EUR (82,139)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2027	390	(20,370)
CDS	EUR (84,622)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2027	402	(20,986)
CDS	USD 150,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	15,416	50,729
CDS	USD 230,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	22,008	77,784
CDS	USD 250,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	4,619	84,548
CDS	USD 260,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	(7,582)	18,551
CDS	USD 10,130,000	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2028	(45,857)	(193,474)
CDS	USD 2,350,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2028	(27,217)	(4,299)
CDS	USD (3,052,000)	ファンドはCMBX.NA.15.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Citibank	15/11/2064	(153,188)	(744,128)
CDS	USD 750,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	28,120	30,068
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Citibank	17/9/2058	260,288	305,697

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (110,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	5,384	11,175
CDS	EUR (244,777)	ファンドはIntrum Justitiaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(62,034)	(42,176)
CDS	EUR (155,223)	ファンドはIntrum Justitiaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(39,434)	(26,745)
CDS	EUR (2,200,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	157,219	260,200
CDS	EUR (147,145)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	12,391	17,403
CDS	EUR (425,714)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	67,615	50,350
CDS	EUR (638,572)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	100,864	75,526
CDS	USD (772,906)	ファンドはCDX.NA.HY.40.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/6/2028	4,319	22,869
CDS	USD 3,310,811	ファンドはAT&Tに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(39,973)	(3,868)
CDS	USD 4,138,513	ファンドはAT&Tに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(39,685)	(4,835)
CDS	USD 2,350,676	ファンドはAT&Tに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(12,877)	(2,746)
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(21,976)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(26,485)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(25,999)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(25,951)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(23,482)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(21,101)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(16,213)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(16,163)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(13,268)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(16,087)	63,873
CDS	USD 1,339,585	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(15,688)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(14,711)	63,873
CDS	USD 996,651	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(8,069)	47,521
CDS	USD 783,801	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(8,578)	(4,906)
CDS	USD 783,802	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(8,618)	(4,906)
CDS	EUR 335,000	ファンドはVerisure Midholdingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(236)	(39)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,009,377	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2028	(20,321)	95,809
CDS	USD 250,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	12	10,023
CDS	USD 165,000	ファンドはMacysに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(13,756)	721
CDS	USD 500,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(40,195)	54,177
CDS	USD 250,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(12,361)	(2,613)
CDS	USD 290,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(11,627)	(3,031)
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(13,393)	(5,571)
CDS	USD 665,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(12,850)	(5,571)
CDS	USD 1,040,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(31,089)	(8,712)
CDS	EUR (90,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2026	877	9,144
CDS	USD 3,525,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	(15,509)	(84,040)
CDS	EUR (425,714)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2027	65,959	50,350
CDS	EUR (748,195)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	71,913	(34,147)
CDS	EUR (375,000)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	32,548	(17,115)
CDS	USD 1,825,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(38,011)	(13,361)
CDS	EUR 1,310,000	ファンドはUnicreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(42,442)	47,604
CDS	EUR 1,372,000	ファンドはBNP Paribasに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(43,291)	8,863
CDS	USD 8,925,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(86,893)	392,413
CDS	USD 10,110,000	ファンドはComcastに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(59,293)	(215,530)
CDS	EUR 1,891,000	ファンドはHSBCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(8,655)	17,334
CDS	EUR 1,260,000	ファンドはHSBCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(3,986)	11,550
CDS	EUR 129,000	ファンドはIntrum Justitiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	298	27,595
CDS	USD 1,959,908	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(25,615)	(12,903)
CDS	USD 783,963	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(10,850)	(5,161)
CDS	EUR 331,500	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	1,484	12,558
CDS	USD 1,959,505	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(24,975)	(12,265)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,100,000	ファンドはIntesa Sanpaoloに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2028	(8,185)	49,619
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(70,076)	(89,171)
CDS	USD (948,150)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(66,182)	(84,267)
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.A.9に係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(72,190)	(89,171)
CDS	USD (900,000)	ファンドはCMBX.NA.BBB-14に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	16/12/2072	(68,442)	(220,542)
CDS	USD 825,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(24,659)	(29,423)
CDS	USD 800,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(23,912)	(28,532)
CDS	USD 875,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(26,187)	(31,207)
CDS	USD 894,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(29,748)	(31,758)
CDS	USD 250,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	28,550	84,548
CDS	EUR 4,525,000	ファンドはINGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(53,987)	41,137
CDS	USD 2,679,168	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(56,581)	127,745
CDS	USD 783,963	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(10,781)	(5,161)
CDS	USD 783,963	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(10,781)	(5,161)
CDS	USD 1,567,604	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	(18,438)	(9,812)
CDS	EUR 129,000	ファンドはIntrum Justitiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank	20/6/2028	(89)	27,595
CDS	EUR 336,000	ファンドはEuro Garagesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	HSBC Bank	20/6/2028	1,551	499
CDS	EUR (227,000)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2024	(2,320)	(32,688)
CDS	EUR (1,110,000)	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	(990)	(86,893)
CDS	EUR (1,130,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	(105,291)	63,642
CDS	EUR (1,186,667)	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(103,841)	(133,623)
CDS	USD (850,000)	ファンドはCCOに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(91,487)	65,544
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCOに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(52,304)	37,854
CDS	EUR (147,863)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	12,024	17,488
CDS	EUR (138,990)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	11,303	16,439
CDS	EUR (39,319)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	3,202	4,650
CDS	EUR (171,897)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2027	49	(42,629)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (723,255)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2027	85,525	(33,009)
CDS	USD 390,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	13,613	131,895
CDS	USD 1,420,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(29,588)	(10,396)
CDS	EUR 1,129,000	ファンドはUnicreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(29,277)	41,027
CDS	USD 440,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(12,959)	31,395
CDS	EUR (6,100,000)	ファンドはGlencore Internationalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2028	(2,088)	949,575
CDS	EUR (840,000)	ファンドはLoxamに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2028	85,963	(27,248)
CDS	EUR 2,000,000	ファンドはAegonに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(4,062)	(21,923)
CDS	EUR 582,000	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	27,366	121,844
CDS	EUR 1,780,000	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	83,697	372,649
CDS	EUR 1,110,000	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(9,206)	232,382
CDS	EUR 1,600,000	ファンドはBarclaysに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	1,246	53,208
CDS	EUR 975,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(87,758)	71,288
CDS	EUR 3,800,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(207,262)	97,567
CDS	EUR 2,227,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(58,328)	57,179
CDS	EUR 742,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(19,434)	19,051
CDS	EUR 831,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(24,596)	21,336
CDS	EUR 1,785,000	ファンドはEuro Garagesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(12,857)	2,649
CDS	EUR 419,500	ファンドはEuro Garagesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(1,313)	623
CDS	EUR 419,500	ファンドはEuro Garagesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(2,984)	623
CDS	EUR 298,000	ファンドはIntrum Justitiaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(4,132)	63,746
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(28,624)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(28,670)	63,873
CDS	USD 1,339,584	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(28,511)	63,873
CDS	USD 669,792	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(13,025)	31,936
CDS	USD 669,792	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(8,983)	31,936
CDS	USD 401,875	ファンドはLincoln Nationalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(4,857)	19,162

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 2,400,000	ファンドはLloyds Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	5,120	50,286
CDS	USD 783,963	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(13,471)	(5,161)
CDS	EUR 571,000	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(5,508)	21,631
CDS	USD 1,230,000	ファンドはParamount Globalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	4,820	57,291
CDS	USD 1,180,000	ファンドはParamount Globalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	4,623	54,962
CDS	EUR 93,023	ファンドはPicardに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(93)	(565)
CDS	USD 1,959,505	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(28,968)	(12,265)
CDS	EUR 1,300,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(85,088)	(14,566)
CDS	EUR 750,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(48,634)	(8,404)
CDS	EUR 750,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(47,041)	(8,404)
CDS	EUR 779,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(53,582)	(8,729)
CDS	EUR 6,400,000	ファンドはUBSに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(291,798)	(71,712)
CDS	EUR 2,250,000	ファンドはUnicreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(114,087)	104,157
CDS	USD 820,000	ファンドはDonnelley & Sonsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(9,403)	(6,834)
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Homeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(14,667)	(23,020)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(553)	(1,016)
CDS	USD 250,000	ファンドはTHCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(8,372)	(8,916)
CDS	USD 1,110,000	ファンドはAvis Budget Car Rentalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(75,196)	(50,670)
CDS	USD 290,000	ファンドはAvis Budgetに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(20,258)	(13,849)
CDS	USD 1,380,000	ファンドはAvis Budget Car Rentalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(143,166)	(81,005)
CDS	EUR (300,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(21,904)	17,469
CDS	EUR (1,070,000)	ファンドはLadbrokesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	108,823	(23,364)
CDS	EUR 2,325,000	ファンドはCommerzbankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(43,246)	143,372
CDS	USD 7,047,995	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(44,140)	(134,610)
CDS	USD 3,523,997	ファンドはCVS Healthに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(18,989)	(67,305)
CDS	USD 1,175,945	ファンドはMetlifeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(17,635)	(7,742)
CDS	EUR 7,525,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2028	(80,755)	(101,491)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	(6,079)	(9,242)
CDS	USD 250,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2023	1,318	2,401
CDS	USD 3,445,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	(14,360)	(24,890)
CDS	USD (282,209)	ファンドはMexicanに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2026	5,677	3,790
CDS	USD 346,223	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(10,918)	(5,360)
CDS	USD 462,554	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(14,125)	(7,161)
CDS	EUR 680,851	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(11,568)	(12,530)
CDS	EUR 1,117,021	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(18,979)	(20,556)
CDS	EUR (124,635)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2027	(189)	(30,909)
CDS	EUR (232,425)	ファンドはAdler Real Estate 500に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2027	(352)	(57,640)
CDS	USD 4,472,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2028	(56,637)	196,624
CDS	EUR 221,000	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2028	5,192	8,372
CDS	EUR 2,250,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2028	(17,928)	(30,346)
CDS	USD (2,006,667)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(144,825)	(178,343)
CDS	USD (1,000,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBBに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(100,449)	(212,290)
CDS	USD (3,740,500)	ファンドはCMBX.NA.9.BBBに係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(375,959)	(794,070)
CDS	USD (598,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(124,284)	(126,949)
CDS	USD 811,501	ファンドはFederative Republic Of Brazilに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(43,895)	(6,711)
CDS	USD 1,250,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(50,967)	(13,065)
CDS	USD 33,774	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(293)	99
CDS	USD 3,605,883	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(27,175)	10,624
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBBに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	103,751	137,139
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBBに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	81,428	107,631
CDS	USD 785,000	ファンドはFord Motorに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2028	(34,519)	(71,640)
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(19,185)	(26,278)
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(12,414)	(17,519)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCOに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2025	(51,144)	37,854
CDS	USD 1,888,179	ファンドはPrudential Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2028	(19,844)	(11,819)
CDS	USD 5,880,000	ファンドはCDX.NA.HY.35に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2025	(11,001)	(245,341)
CDS	USD 199,964,574	ファンドはCDX.NA.IG.40に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	(746,999)	(3,157,915)
CDS	EUR 16,150,000	ファンドはITRAXX.EUR.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	(73,325)	(229,856)
IFS	EUR 7,045,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを受け取り、2.56%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2028	6,488	6,488
IFS	EUR 4,665,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを受け取り、2.46%の固定金利を支払う	Bank of America	15/7/2028	19,947	19,947
IFS	EUR 5,835,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを提供し、2.555%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/6/2033	(4,776)	(4,776)
IFS	EUR 5,895,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを提供し、2.505%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/7/2033	(24,973)	(24,973)
IFS	EUR 1,694,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを提供し、2.5737%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/5/2038	(8,294)	(8,294)
IFS	EUR 3,145,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを提供し、2.60125%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/5/2043	(35,989)	(33,778)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはデフォルト・プロテクション UKRPI + 0bpsを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/3/2048	(367,504)	(367,504)
IFS	EUR 6,680,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを提供し、2.693%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/8/2032	(152,787)	(152,787)
IFS	EUR 3,115,000	ファンドはデフォルト・プロテクション CPTFEMU + 0bpsを受け取り、2.435%の固定金利を支払う	Bank of America	15/5/2033	33,067	34,084
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはデフォルト・プロテクション UKRPI + 0bpsを提供し、3.5325%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	(543,602)	(543,602)
IRS	BRL 123,899,000	ファンドは9.98%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	HSBC Bank	2/1/2026	(62,334)	(62,334)
IRS	BRL 11,339,500	ファンドは11.5625%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Barclays	2/1/2026	60,578	60,578
IRS	BRL 13,156,807	ファンドは11.82%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Barclays	2/1/2026	87,639	87,639
IRS	BRL 115,197,000	ファンドは10.3164%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Barclays	4/1/2027	54,805	54,805
IRS	BRL 13,277,676	ファンドは11.27%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2026	53,747	53,747
IRS	BRL 49,606,478	ファンドは10.0325%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(88,296)	(88,296)
IRS	BRL 376,541	ファンドは10.12%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(470)	(470)
IRS	BRL 67,465,547	ファンドは10.1225%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(83,079)	(83,079)
IRS	BRL 1,570,000	ファンドは9.94%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(3,332)	(3,332)
IRS	USD 854,267,523	ファンドは4.4005%の固定金利を受け取り、USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/2/2024	(4,539,343)	(4,539,343)
IRS	USD 427,133,762	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、3.7505%の固定金利を支払う	Bank of America	13/2/2024	3,480,066	3,480,066
IRS	MXN 279,585,258	ファンドは4.68%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	27/2/2024	(547,537)	(547,537)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	MXN 278,683,371	ファンドは4.855%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2024	(539,929)	(539,929)
IRS	USD 232,932,853	ファンドは1.1285%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2024	(5,173,827)	(5,173,827)
IRS	USD 349,576,239	ファンドは1.12925%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	(7,803,225)	(7,803,225)
IRS	USD 326,657,900	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.61%の固定金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	3,201,911	3,250,056
IRS	USD 469,854,799	ファンドは1.079%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2024	(11,152,238)	(11,152,238)
IRS	USD 94,081,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.61%の固定金利を支払う	Bank of America	19/3/2024	979,654	986,546
IRS	GBP 458,228,116	ファンドは3.22%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	3/4/2024	(8,330,928)	(8,330,928)
IRS	GBP 229,114,058	ファンドはGBP 1日SONIAの変動金利を受け取り、 2.47%の固定金利を支払う	Bank of America	3/4/2024	5,383,858	5,383,858
IRS	EUR 630,858,796	ファンドは1.75%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	4/5/2024	(9,917,835)	(9,917,835)
IRS	EUR 315,429,398	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を 受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	4/5/2024	6,639,695	6,639,695
IRS	USD 70,839,300	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	1,071,907	1,082,379
IRSKRW	33,396,220,000	ファンドは3.865%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	3/7/2024	12,130	12,130
IRS	USD 410,521,000	ファンドは4.4605%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	12/7/2024	(3,422,443)	(3,422,443)
IRS	USD 186,987,507	ファンドは5.3715%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	12/7/2024	(143,222)	(143,222)
IRS	USD 186,987,506	ファンドは5.3745%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	12/7/2024	(138,560)	(138,560)
IRS	USD 64,256,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.55%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2024	1,019,332	1,030,011
IRS	USD 94,577,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.57%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2024	1,503,620	1,502,373
IRS	USD 94,133,300	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	1,520,458	1,525,430
IRS	USD 124,214,200	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	23/7/2024	2,009,727	2,015,758
IRS	USD 91,336,800	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	1,555,063	1,546,793
IRS	USD 59,462,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	1,015,251	1,009,261
IRS	USD 171,433,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.53%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	3,010,181	3,038,358
IRS	GBP 120,074,658	ファンドは4.255%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	6/9/2024	(2,159,795)	(2,159,795)
IRSCOP	39,165,864,000	ファンドはCOP-IBR-BANREP 1日の変動金利を 受け取り、11.895%の固定金利を支払う	Bank of America	19/10/2024	(29,586)	(29,586)
IRS	USD 388,107,062	ファンドは4.592%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/12/2024	(1,865,318)	(1,865,652)
IRS	NZD 39,775,000	ファンドは4.697%の固定金利を受け取り、 NZD 3ヶ月BBRの変動金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	(197,463)	(197,463)
IRS	AUD 34,470,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、 4.0425%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2024	40,965	40,965

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 55,667,679	ファンドは11.865%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	134,251	134,251
IRS	BRL 5,584,150	ファンドは13.125%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	35,812	35,812
IRS	BRL 116,287,721	ファンドは13.15%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	756,706	756,706
IRS	BRL 116,035,072	ファンドは13.32%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	829,375	829,375
IRS	JPY 808,310,000	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.23%の固定金利を支払う	Bank of America	11/1/2025	(13,255)	(13,255)
IRS	JPY 5,415,350,000	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.235%の固定金利を支払う	Bank of America	19/1/2025	(91,647)	(91,647)
IRS	JPY 1,310,133,939	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.2%の固定金利を支払う	Bank of America	3/2/2025	(17,856)	(17,856)
IRS	JPY 1,310,133,940	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.205%の固定金利を支払う	Bank of America	3/2/2025	(18,497)	(18,497)
IRS	MXN 205,611,898	ファンドは9.8%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2025	(122,417)	(122,417)
IRS	MXN 772,497,615	ファンドは9.9%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(397,209)	(397,209)
IRS	MXN 372,215,081	ファンドは9.92%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(185,431)	(185,431)
IRS	MXN 869,313,000	ファンドは9.95%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2025	(409,515)	(409,515)
IRS	AUD 29,970,000	ファンドはAUD 3ヶ月 BBSWの変動金利を受け取り、 3.8025%の固定金利を支払う	Bank of America	9/2/2025	109,066	109,066
IRS	NZD 33,330,000	ファンドは4.94%の固定金利を受け取り、 NZD 3ヶ月 BBRの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2025	(168,721)	(168,721)
IRS	USD 233,257,979	ファンドは2.601%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	(8,235,320)	(8,235,320)
IRS	USD 233,257,979	ファンドは2.701%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	(7,910,463)	(7,910,463)
IRS	USD 434,496,685	ファンドは4.031%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/3/2025	(6,755,639)	(6,755,639)
IRS	ZAR 457,077,000	ファンドは7.2%の固定金利を受け取り、 ZAR 3ヶ月 JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	20/3/2025	(147,303)	(147,303)
IRS	CZK 973,667,000	ファンドはCZK-PRIBOR-PRBO 3ヶ月の変動金利を 受け取り、4.615%の固定金利を支払う	Bank of America	19/6/2025	(168,836)	(168,836)
IRS	USD 49,554,240	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 4.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2025	51,050	51,050
IRS	GBP 93,270,000	ファンドは5.28523%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	7/8/2025	40,225	(6,501)
IRS	GBP 93,280,000	ファンドは5.34%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	7/8/2025	49,167	51,866
IRS	EUR 208,790,000	ファンドはEUR 1日 ESTRの変動金利を受け取り、 3.12083%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2025	(11,877)	(61,476)
IRS	USD 203,905,866	ファンドは4.104%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	(2,745,307)	(2,745,307)
IRS	USD 12,104,000	ファンドは4.053%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/8/2025	(173,788)	(173,788)
IRS	GBP 9,960,000	ファンドは5.795%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2025	63,524	63,524
IRS	USD 5,819,000	ファンドは4.1115%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2025	(76,912)	(76,912)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 6,052,000	ファンドは4.1527%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2025	(75,329)	(75,329)
IRS	USD 5,819,000	ファンドは4.1005%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2025	(78,075)	(78,075)
IRS	USD 6,052,000	ファンドは4.1327%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2025	(77,557)	(77,557)
IRS	USD 11,639,000	ファンドは4.181%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	(138,279)	(138,279)
IRS	JPY 4,428,000,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.1045%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2025	25,105	25,105
IRS	USD 415,102,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.891%の固定金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	6,984,035	6,984,035
IRS	USD 54,507,000	ファンドは3.8085%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/12/2025	(1,009,209)	(1,009,209)
IRS	GBP 8,890,000	ファンドは3.6%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	17/3/2026	(117,373)	(117,837)
IRS	GBP 3,710,000	ファンドは3.75343%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	17/3/2026	(51,668)	(42,850)
IRS	GBP 43,050,000	ファンドは3.478%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	31/3/2026	(619,983)	(619,983)
IRS	GBP 4,440,000	ファンドは3.7%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	31/3/2026	(53,007)	(53,007)
IRS	GBP 161,560,000	ファンドは3.46%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2026	(2,347,392)	(2,342,060)
IRS	USD 181,181,900	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.15%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2026	6,059,245	6,229,769
IRS	JPY 5,871,360,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.266%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	68,266	68,266
IRS	JPY 1,324,640,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.2925%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	13,015	13,015
IRS	JPY 1,324,450,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.3205%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	10,493	10,493
IRS	JPY 1,324,650,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.324%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	10,179	10,179
IRS	JPY 3,973,150,000	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.33%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	28,911	28,911
IRS	JPY 2,026,612,500	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.331%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	14,609	14,609
IRS	JPY 1,947,137,500	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、 0.364%の固定金利を支払う	Bank of America	7/7/2026	9,668	9,668
IRSKRW	20,872,984,725	ファンドは3.1875%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(206,410)	(206,410)
IRSKRW	15,427,858,275	ファンドは3.19%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(151,740)	(151,740)
IRSKRW	8,277,065,211	ファンドは3.33%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(56,633)	(56,633)
IRSKRW	11,569,578,649	ファンドは3.376%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(67,783)	(67,783)
IRSKRW	8,278,306,895	ファンドは3.38%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(47,792)	(47,792)
IRSKRW	8,278,306,894	ファンドは3.3825%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(47,350)	(47,350)
IRSKRW	11,569,578,650	ファンドは3.384%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(65,804)	(65,804)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRSKRW	11,567,843,300	ファンドは3.389%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(64,557)	(64,557)
IRS	BRL 27,019,000	ファンドは10.04%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2027	(51,925)	(51,925)
IRS	BRL 3,150,000	ファンドは10.11%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2027	(3,717)	(3,717)
IRS	BRL 70,316,840	ファンドは10.12%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2027	(87,716)	(87,716)
IRS	BRL 57,809,236	ファンドは9.965%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Bank of America	4/1/2027	(105,308)	(105,308)
IRS	BRL 12,186,000	ファンドはBRL 1日BROISの変動金利を受け取り、 10.1%の固定金利を支払う	Bank of America	4/1/2027	8,939	8,939
IRS	USD 116,466,427	ファンドは1.549%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2027	(10,287,733)	(10,287,733)
IRS	USD 41,805,000	ファンドは3.468%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/3/2027	(123,312)	(123,312)
IRS	GBP 20,240,000	ファンドは3.44723%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	16/3/2027	(231,250)	(202,634)
IRS	USD 116,003,796	ファンドは2.9095%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/10/2027	(5,467,517)	(5,467,517)
IRS	MXN 190,277,000	ファンドは8.42%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	20/1/2028	(249,101)	(249,101)
IRS	GBP 20,860,000	ファンドは3.2%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/1/2028	(201,784)	(195,443)
IRS	GBP 143,664,300	ファンドは3.18%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2028	(1,357,870)	(1,357,870)
IRS	MXN 101,706,000	ファンドは8.35%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/4/2028	(143,896)	(143,896)
IRS	GBP 10,210,000	ファンドはGBP 1日SONIAの変動金利を受け取り、 4.638%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2028	108,255	108,255
IRS	EUR 9,711,000	ファンドは3.1518%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2028	(3,458)	(3,458)
IRS	GBP 2,150,000	ファンドは4.86823%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	4/8/2028	5,079	7,105
IRS	GBP 2,160,000	ファンドは4.8733%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	4/8/2028	7,731	7,731
IRS	GBP 2,100,000	ファンドは4.77918%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2028	7,487	(2,796)
IRS	GBP 2,120,000	ファンドは4.9008%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2028	11,168	11,168
IRS	MXN 414,714,000	ファンドは9.1343%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2028	209,025	209,025
IRS	CZK 227,669,000	ファンドは4.321%の固定金利を受け取り、 CZK-PRIBOR-PRBO 6ヶ月の変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2028	40,770	40,770
IRS	PLN 32,083,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、 5.7005%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2028	(407,088)	(407,087)
IRS	USD 64,027,800	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.92%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	3,228,652	3,391,285
IRS	USD 126,206,600	ファンドは2.85%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/10/2031	(7,928,148)	(8,845,040)
IRS	USD 67,115,000	ファンドは2.86%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/11/2031	(4,263,776)	(4,696,034)
IRS	USD 142,421,500	ファンドは2.85%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/1/2032	(9,187,335)	(10,221,088)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 10,222,322	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.3525%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	1,111,675	1,111,675
IRS	USD 63,216,532	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.58%の固定金利を支払う	Bank of America	24/5/2032	5,879,344	5,891,838
IRS	EUR 8,974,000	ファンドは2.4425%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2032	(170,931)	(170,931)
IRS	USD 53,540,807	ファンドは3.04%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/10/2032	(3,279,642)	(3,279,642)
IRS	USD 54,305,155	ファンドは2.868%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/11/2032	(4,042,329)	(4,042,329)
IRS	USD 54,182,125	ファンドは2.908%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	4/11/2032	(3,869,785)	(3,869,785)
IRS	USD 87,128,964	ファンドは2.8905%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/11/2032	(6,353,855)	(6,353,855)
IRS	USD 53,201,779	ファンドは3.191%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/11/2032	(2,663,401)	(2,663,401)
IRS	AUD 6,960,000	ファンドは4.15%の固定金利を受け取り、 AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	9/2/2033	(78,067)	(78,067)
IRS	NZD 7,710,000	ファンドはNZD 3ヶ月BBRの変動金利を受け取り、 4.2525%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2033	159,192	159,192
IRS	CAD 607,150	ファンドは3.3%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	27/3/2033	(31,620)	(31,576)
IRS	CAD 617,168	ファンドは3.35%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	30/3/2033	(28,866)	(30,155)
IRS	EUR 8,090,000	ファンドは2.962%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	31/3/2033	(64,138)	(63,077)
IRS	CHF 5,050,000	ファンドはCHF 1H SARONの変動金利を受け取り、 1.912%の固定金利を支払う	Bank of America	31/3/2033	(101,807)	(96,790)
IRS	CAD 1,825,430	ファンドは3.28%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	25/4/2033	(89,622)	(95,711)
IRS	CAD 618,755	ファンドは3.442%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	9/5/2033	(25,936)	(25,936)
IRS	CAD 628,587	ファンドは3.3625%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	12/5/2033	(29,294)	(29,331)
IRS	CAD 1,883,532	ファンドは3.43%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	15/5/2033	(70,711)	(79,937)
IRS	CAD 641,426	ファンドは3.77%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	30/5/2033	(13,292)	(13,595)
IRS	CAD 648,653	ファンドは3.6829%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	31/5/2033	(17,188)	(17,188)
IRS	CAD 599,152	ファンドは3.677%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	1/6/2033	(16,069)	(16,069)
IRS	CAD 119,537	ファンドは3.921%の固定金利を受け取り、 CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	13/6/2033	(1,416)	(1,416)
IRS	GBP 1,610,000	ファンドは3.4329%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/6/2033	(23,899)	(23,899)
IRS	GBP 2,120,000	ファンドは3.6589%の固定金利を受け取り、 GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/6/2033	(9,716)	(9,716)
IRS	MXN 38,177,000	ファンドは8.5%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2033	(40,544)	(40,544)
IRS	USD 51,841,870	ファンドは3.7565%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/8/2033	(309,060)	(309,060)
IRS	USD 25,362,638	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.23%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2033	1,241,366	1,241,366

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 4,140,000	ファンドは2.85708%の固定金利を受け取り、EUR 1日 ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	28/8/2033	11,521	10,606
IRS	USD 8,083,900	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Bank of America	26/11/2041	905,172	889,716
IRS	EUR 560,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、2.668%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2048	19,569	19,569
IRS	EUR 3,220,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、2.8133%の固定金利を支払う	Bank of America	15/8/2048	16,453	16,453
IRS	USD 18,194,800	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	25/1/2051	2,696,963	2,421,522
IRS	USD 33,463,500	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	28/1/2051	4,962,153	4,453,452
IRS	USD 18,855,500	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	1/2/2051	2,791,919	2,541,496
IRS	USD 10,566,500	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2051	1,565,186	1,424,192
IRS	USD 10,880,700	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2051	1,611,717	1,466,536
IRS	USD 4,450,600	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2051	839,017	599,750
IRS	USD 16,715,200	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2051	3,167,330	2,248,716
IRS	USD 2,732,300	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2051	517,738	367,582
IRS	USD 36,909,800	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.79%の固定金利を支払う	Bank of America	21/1/2052	7,084,248	5,014,935
IRS	JPY 19,611,570	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.88%の固定金利を支払う	Bank of America	23/5/2052	17,173	17,173
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.85%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	14,971	14,971
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	16,537	16,537
IRS	JPY 49,810,000	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.99%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2052	34,780	34,780
IRS	JPY 37,745,000	ファンドは1.10625%の固定金利を受け取り、JPY 1日 TONARの変動金利を支払う	Bank of America	12/9/2052	(19,163)	(19,163)
IRS	JPY 37,745,000	ファンドは1.13%の固定金利を受け取り、JPY 1日 TONARの変動金利を支払う	Bank of America	12/9/2052	(17,667)	(17,667)
IRS	EUR 240,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、2.761%の固定金利を支払う	Bank of America	4/10/2052	(1,045)	(1,045)
IRS	EUR 990,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、2.2705%の固定金利を支払う	Bank of America	4/3/2053	97,818	97,818
IRS	CAD 263,099	ファンドはCAD 3ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、3.37%の固定金利を支払う	Bank of America	27/3/2053	18,187	18,141
IRS	CAD 267,440	ファンドはCAD 3ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、3.4%の固定金利を支払う	Bank of America	30/3/2053	16,640	17,325
IRS	CHF 2,060,000	ファンドは1.8565%の固定金利を受け取り、CHF 1日 SARONの変動金利を支払う	Bank of America	31/3/2053	77,987	72,571
IRS	EUR 2,300,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、2.508%の固定金利を支払う	Bank of America	31/3/2053	108,573	107,791
IRS	CAD 791,019	ファンドはCAD 3ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、3.32%の固定金利を支払う	Bank of America	25/4/2053	54,150	58,986
IRS	CAD 268,127	ファンドはCAD 3ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、3.4841%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2053	13,851	13,851

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CAD 272,388	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.375%の固定金利を支払う	Bank of America	12/5/2053	18,266	18,039
IRS	CAD 816,197	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.44%の固定金利を支払う	Bank of America	15/5/2053	43,170	46,785
IRS	CAD 277,951	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.66%の固定金利を支払う	Bank of America	30/5/2053	6,700	7,520
IRS	CAD 281,083	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.5816%の固定金利を支払う	Bank of America	31/5/2053	10,566	10,566
IRS	CAD 260,501	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.5595%の固定金利を支払う	Bank of America	1/6/2053	10,553	10,553
IRS	CAD 51,800	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.7685%の固定金利を支払う	Bank of America	13/6/2053	631	631
IRS	USD 880,417	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8417%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2053	(1,690)	(1,690)
IRS	USD 65,616,484	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2%の固定金利を支払う	BNP Paribas	17/2/2025	2,865,847	2,865,847
IRS	GBP 630,000	ファンドは5.628%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2025	2,469	2,581
IRS	GBP 20,560,000	ファンドは5.65%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	22/8/2025	90,666	90,666
IRS	GBP 30,480,000	ファンドは5.4%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2025	50,036	48,822
IRS	USD 51,465,000	ファンドは3.75736%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	15/12/2025	(1,010,079)	(1,010,079)
IRS	GBP 32,400,000	ファンドはGBP 1H SONIAの変動金利を受け取り、4.75%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2026	(56,498)	(52,717)
IRS	ZAR 222,097,804	ファンドはZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を受け取り、8.22%の固定金利を支払う	Bank of America	20/9/2026	(99,494)	(99,494)
IRS	GBP 25,665,000	ファンドは4.86%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	41,963	41,963
IRS	EUR 41,523,251	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.02%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	26/8/2031	9,584,771	9,584,771
IRS	USD 11,858,932	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.585%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	26/5/2032	1,101,552	1,101,552
IRS	USD 50,468,327	ファンドは3.4665%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/10/2032	(1,444,793)	(1,444,793)
IRS	USD 23,973,778	ファンドは3.415%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	5/10/2032	(779,973)	(779,973)
IRS	EUR 31,939,000	ファンドは2.34%の固定金利を受け取り、EUR 1H ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	19/1/2033	(567,354)	(567,354)
IRS	USD 56,994,117	ファンドは3.136%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	12/5/2033	(884,612)	(884,612)
IRS	EUR 6,920,000	ファンドは2.78%の固定金利を受け取り、EUR 1H ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	1/8/2033	(6,636)	(3,402)
IRS	MXN 18,885,000	ファンドは8.58%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	1/8/2033	(14,080)	(14,080)
IRS	EUR 3,580,000	ファンドは3%の固定金利を受け取り、EUR 1H ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	17/8/2033	34,578	32,149
IRS	EUR 16,640,000	ファンドは3.0313%の固定金利を受け取り、EUR 1H ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2033	171,025	171,025
IRS	USD 19,440,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.8642%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2033	(223,238)	(223,238)
IRS	EUR 11,130,000	ファンドは2.87515%の固定金利を受け取り、EUR 1H ESTRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2033	39,082	37,805

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 13,020,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.71334%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2033	(85,853)	(75,872)
IRS	ZAR 113,535,584	ファンドは9.895%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2033	232,552	232,552
IRS	ZAR 56,767,792	ファンドは9.896%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2033	116,475	116,475
IRS	ZAR 56,767,792	ファンドは9.9175%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	20/9/2033	120,760	120,760
IRS	USD 4,780,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.828%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2035	(95,447)	(94,562)
IRS	BRL 258,795,934	ファンドはBRL 1H BROISの変動金利を受け取り、12.615%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2024	(8,803)	(8,803)
IRS	BRL 283,000,557	ファンドはBRL 1H BROISの変動金利を受け取り、12.615%の固定金利を支払う	Citibank	2/1/2024	(9,627)	(9,627)
IRSCOP	75,525,656,000	ファンドはCOP-IBR-BANREP 1日の変動金利を受け取り、12.37%の固定金利を支払う	Citibank	18/4/2024	14,552	14,552
IRS	BRL 31,919,188	ファンドは13.22%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	216,120	216,120
IRS	BRL 54,321,000	ファンドは11.745%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2026	339,253	339,253
IRS	BRL 4,732,026	ファンドは11.76%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2026	29,990	29,990
IRS	BRL 60,073,885	ファンドは11.8%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2026	393,682	393,682
IRS	BRL 52,770,635	ファンドは10.1%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2027	(72,583)	(72,583)
IRS	BRL 56,273,050	ファンドは9.95%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2027	(107,763)	(107,763)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,370,714)	(1,370,714)
IRSCOP	23,767,988,000	ファンドはCOP-IBR-BANREP 1日の変動金利を受け取り、10.2%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	28/2/2025	2,092	2,092
IRS	BRL 128,965,000	ファンドは10.1075%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	2/1/2026	1,025	1,025
IRS	BRL 81,608,634	ファンドは10.005%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2027	(168,517)	(168,517)
IRS	BRL 140,975,999	ファンドは10.05%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2027	(235,186)	(235,186)
IRS	BRL 5,601,000	ファンドはBRL 1H BROISの変動金利を受け取り、10.105%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2027	4,436	4,436
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(1,329,459)	(1,329,459)
IRS	BRL 60,676,416	ファンドは13.18%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	401,666	401,666
IRS	BRL 4,940,556	ファンドは11.775%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2026	31,711	31,711
IRS	BRL 56,143,465	ファンドは10.025%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2027	(81,293)	(81,293)
IRS	BRL 3,140,000	ファンドは10.425%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2027	15	15
IRS	USD 432,055,000	ファンドは4.505%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Morgan Stanley	9/3/2024	(2,406,810)	(2,406,810)
IRS	BRL 232,775,572	ファンドは12.7825%の固定金利を受け取り、BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	1,196,044	1,196,044

スワップ 2023年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	BRL 8,688,363	ファンドは11.83%の固定金利を受け取り、 BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2026	58,343	58,343
IRS	BRL 56,203,890	ファンドは9.99%の固定金利を受け取り、 BRL 1H BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	4/1/2027	(93,636)	(93,636)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を 受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	773,885	773,886
IRS	MXN 144,525,723	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を 受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	416,261	416,261
TRS	USD (5,757)	ファンドはUSD 1H SOFR - 100bpsを受け取り、 Western Alliance + 0bpsを支払う	Citibank	6/9/2023	13,817	(289,865)
TRS	USD 2,517	ファンドはS5INDU Performance Shell + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 38bpsを支払う	Citibank	20/9/2023	64,988	64,988
TRS	USD 7,877,609	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2023	(60,754)	(68,854)
TRS	USD 10,364,590	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2023	121,098	96,947
TRS	USD 94,891	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 75bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2023	(487,423)	(487,423)
TRS	USD 26,764,109	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2023	313,331	250,341
TRS	USD 12,462,500	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2023	(16,813)	(28,917)
TRS	USD 20,975,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2023	245,068	196,192
TRS	USD 5,000,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2023	7,673	18,984
TRS	USD 34,999,049	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2023	431,220	345,798
TRS	USD 16,433,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2023	(155,323)	(117,031)
合計 (米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 13,880,828,434 米ドル)					<u>(65,928,357)</u>	<u>(67,771,680)</u>

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレ・レート・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

買建オプション 2023年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
10,485,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(3,036)	88,121
580,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.017	12/9/2023	(24,449)	-
8,357,856	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7.1	22/9/2023	(75,443)	1,876
5,888,000	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4.65	27/9/2023	(14,426)	1,412
5,338,000	プット	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5.4	6/10/2023	3,300	112,237
8,288,400	コール	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7.35	16/10/2023	(8,039)	9,367
4,972,965	コール	OTC AUD/USD	Bank of America	AUD 0.67	9/11/2023	(6,721)	8,629
10,690,000	プット	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82.6	15/11/2023	(9,705)	7,399
8,550,000	プット	OTC USD/INR	Bank of America	USD 82.6	15/11/2023	(11,182)	5,918
4,870,000	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 150	1/5/2024	8,942	37,285
12,514,591	コール	OTC USD/NOK	Barclays	USD 10.7	22/9/2023	73,310	134,131
7,350,000	プット	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7.1	28/9/2023	(57,198)	3,366
5,844,000	プット	OTC USD/MXN	Barclays	USD 17.2	6/10/2023	75,418	160,875
5,316,000	プット	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.08	16/10/2023	5,694	40,203
5,670,000	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.125	20/12/2023	(30,043)	25,800
656,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	7/9/2023	(104,304)	-
1,670,000	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7.1	25/9/2023	(16,449)	2,589
736,000	プット	OTC CNH/USD	Citibank	USD 7.22	26/1/2024	34,149	124,677
5,298,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.105	11/9/2023	(52,673)	2,112
13,271,590	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4.8	19/9/2023	(62,363)	28,773
29,140,000	コール	OTC USD/HKD	Goldman Sachs	USD 7.81	8/11/2023	25,818	69,674
670,000	プット	OTC PLN/EUR	HSBC Bank	EUR 4.66	1/11/2023	74,106	159,104
45,710,000	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7.82	10/11/2023	12,163	65,873
545,000	プット	OTC EUR/USD	HSBC Bank	EUR 1.05	16/11/2023	(237)	72,024
201,961,668	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 8.5	21/8/2024	(241,706)	55,784
71,964,757	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.099	25/9/2023	538,245	1,143,276
25,007,076	コール	OTC AUD/USD	JP Morgan	AUD 0.7	2/10/2023	(14,733)	1,040
8,260,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.133	12/10/2023	(59,018)	2,937
19,630,000	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.9	18/10/2023	(91,174)	891
12,546,157	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	146,473	280,968
16,589,487	プット	OTC USD/CAD	JP Morgan	USD 1.3	8/11/2023	(23,044)	9,471
62,527,455	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.6	12/9/2023	(188,887)	134,380
1,170,000	プット	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1.06	27/9/2023	95,277	248,510
1,424,000	プット	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1.06	20/10/2023	246,427	483,470
40,131,800	コール	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7.81	13/11/2023	19,083	93,166
4,171,530	プット	OTC USD/NOK	UBS	USD 9.8	22/9/2023	(24,976)	345
604	プット	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4,000	20/10/2023	(9,762)	13,516
1,187	プット	EURO STOXX 50 Index	Bank of America	EUR 4,100	20/10/2023	(13,891)	39,934
2,277,000	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239,439	10/11/2023	19,828	168,151
912	プット	EURO STOXX 50 Index	BNP Paribas	EUR 4.125	17/11/2023	14,366	36,518
755	コール	S&P 500 Index	Citibank	USD 4,100	15/9/2023	(68,379)	100
509,721,096	プット	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0.07	27/9/2023	(890,121)	1,891
3,055	プット	NXP Semiconductors	Goldman Sachs	EUR 715	20/10/2023	(21,058)	-
3,793,482	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239.3	10/11/2023	27,034	281,894
1,519,518	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239.43	10/11/2023	25,774	112,259
2,043	コール	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15,700	15/9/2023	(92,111)	282,780
58	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	1/9/2023	(26,485)	26,245
116	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	16,779	46,806
116	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 449	1/9/2023	(16,946)	6,438
108	プット	Spirax-Sarco Engineering	Exchange Traded	USD 4,400	1/9/2023	(429,372)	4,050
200	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(5,447)	2,500
156	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12.5	15/9/2023	(8,886)	3,120
200	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(7,546)	2,500
874	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 20	15/9/2023	(153,289)	2,622

買建オプション 2023年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
623	コール	Barclays	Exchange Traded	GBP 1.6	15/9/2023	(26,560)	1,974
625	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(83,581)	1,563
27	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	150,017	189,810
41	コール	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(32,864)	3,095
827	コール	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(42,344)	827
248	コール	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(37,806)	620
246	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 60	15/9/2023	(62,364)	3,321
103	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 62.5	15/9/2023	(26,061)	670
575	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(102,194)	2,587
95	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(98,628)	2,422
103	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(120,585)	4,171
102	プット	NVIDIA	Exchange Traded	USD 375	15/9/2023	(48,703)	1,377
400	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(4,692)	1,600
450	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 14	15/9/2023	(5,789)	1,125
75	プット	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(2,323)	750
135	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	1,198	3,982
124	プット	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57.5	15/9/2023	(5,324)	372
81	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(11,298)	365
682	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(475,425)	29,667
500	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(3,865)	3,750
200	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(3,546)	1,500
357	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(70,946)	9,103
149	コール	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(31,991)	28,492
77	コール	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	16,610	186,725
186	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(53,332)	5,673
70	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(4,286)	1,225
33	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 22.5	15/9/2023	(692)	330
103	コール	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(22,798)	894
200	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(10,946)	2,700
816	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 445	22/9/2023	(37,316)	224,808
45	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108.5	22/9/2023	(10,968)	4,570
31	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 461	29/9/2023	(16,913)	6,913
481	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94.875	13/10/2023	284,569	393,819
721	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95	13/10/2023	601,640	802,112
1,202	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.625	13/10/2023	1,905,505	3,170,275
1,232	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 110	20/10/2023	(226,355)	117,656
132	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(3,367)	3,630
143	コール	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	111,136	166,595
71	コール	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	35,621	56,977
100	コール	Equitrans Midstream	Exchange Traded	USD 12	20/10/2023	(3,623)	500
286	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(32,669)	8,723
408	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	94,748	169,320
520	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(209,041)	160,940
816	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	32,702	308,040
200	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(3,046)	3,000
204	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	5,364	87,210
15	コール	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	34,274	95,550
1,225	コール	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(24,172)	70,437
77	コール	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(38,399)	11,357
194	コール	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	7,010	95,545
308	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 94	15/12/2023	(15,094)	8,662
400	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	508	7,400
150	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(2,135)	2,250

買建オプション 2023年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
124	プット	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 500	15/12/2023	(18,084)	22,198
124	プット	STOXX Europe 600 Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 600	15/12/2023	(30,753)	117,044
350	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	12,172	19,600
200	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	2,854	7,500
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 696,914,194米ドル)						(165,863)	11,280,328

売建オプション 2023年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
(10,485,000)	コール	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 145	1/9/2023	(46,663)	(88,121)
(10,029,427)	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 6.95	22/9/2023	29,140	(16)
(5,338,000)	コール	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5.7	6/10/2023	40,939	(14,624)
(5,338,000)	プット	OTC EUR/BRL	Bank of America	EUR 5.2	6/10/2023	6,633	(26,373)
(10,104,000)	プット	OTC USD/CNH	Bank of America	USD 7.27	6/10/2023	4,953	(69,230)
(4,171,530)	プット	OTC USD/NOK	Barclays	USD 9.8	22/9/2023	44,249	(345)
(7,350,000)	コール	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7.25	28/9/2023	(24,131)	(48,239)
(7,350,000)	プット	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6.95	28/9/2023	16,178	(65)
(4,382,000)	コール	OTC USD/MXN	Barclays	USD 18.3	6/10/2023	28,237	(2,437)
(5,844,000)	プット	OTC USD/MXN	Barclays	USD 16.7	6/10/2023	(20,664)	(47,839)
(5,316,000)	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.115	16/10/2023	12,237	(10,557)
(7,946,000)	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.12	11/9/2023	37,237	(154)
(46,570,000)	プット	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.06	27/9/2023	57,278	(56,302)
(3,317,897)	コール	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 5.05	19/9/2023	25,850	(13,430)
(24,884,231)	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 4.68	19/9/2023	47,507	(6,641)
(45,710,000)	コール	OTC USD/HKD	HSBC Bank	USD 7.85	10/11/2023	3,915	(7,513)
(4,965,466)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146.5	11/9/2023	7,559	(22,145)
(4,965,466)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146.5	11/9/2023	(10,355)	(40,058)
(71,964,757)	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.079	25/9/2023	(121,218)	(354,654)
(19,630,000)	プット	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.775	18/10/2023	36,372	(42)
(20,954,425)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 146.5	31/10/2023	(108,036)	(206,627)
(4,145,897)	コール	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 143	31/10/2023	(29,248)	(92,846)
(5,670,000)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.125	20/12/2023	68,315	(25,800)
(62,527,455)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.2	12/9/2023	87,438	(2,602)
(20,342,900)	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.11	20/10/2023	14,404	(41,299)
(12,514,591)	コール	OTC USD/NOK	UBS	USD 10.7	22/9/2023	(57,542)	(134,131)
(2,277,000)	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262.243	10/11/2023	18,745	(52,176)
(509,721,096)	コール	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0.57	27/9/2023	261,811	-
(509,721,096)	コール	CMS Energy	Goldman Sachs	USD 0.68	27/9/2023	383,504	(126,217)
(3,793,482)	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262.09	10/11/2023	31,143	(87,680)
(1,519,518)	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262.232	10/11/2023	(4)	(34,838)
(117)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4.300	1/9/2023	195,493	(1,755)
(625)	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	20,482	(625)
(41)	プット	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(20,182)	(33,005)
(827)	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(54,358)	(73,190)
(248)	プット	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(20,921)	(42,408)
(246)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	15,165	(2,583)
(103)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	1,236	(10,352)
(575)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 41	15/9/2023	17,406	(8,913)
(154)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	74,269	(847)
(95)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	27,365	(20,710)
(682)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	194,846	(8,525)
(357)	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42.5	15/9/2023	38,295	(4,820)
(149)	プット	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	29,865	(3,193)
(103)	プット	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	9,075	(4,582)
(200)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	3,354	(800)
(313)	プット	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 106.5	22/9/2023	119,335	(119,820)
(481)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 95.125	13/10/2023	(463,987)	(679,412)
(721)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.25	13/10/2023	(869,908)	(1,234,712)
(1,202)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.375	13/10/2023	(1,617,895)	(2,426,537)
(1,232)	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	58,852	(24,640)
(214)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	31,378	(9,309)
(286)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 40	20/10/2023	(826)	(14,729)
(408)	プット	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52.5	20/10/2023	27,908	(8,364)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建オプション 2023年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
(43)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,250	20/10/2023	47,291	(76,110)
(65)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 109	27/10/2023	38,493	(32,500)
(204)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	13,950	(30,498)
(15)	プット	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	17,742	(13,950)
(1,225)	プット	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	5,840	(21,438)
(77)	プット	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(13,789)	(34,265)
(194)	プット	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(5,909)	(25,317)
(408)	プット	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 105.5	24/11/2023	83,807	(194,437)
(161)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	(277,075)	(668,633)
(248)	プット	STOXX Europe 600					
		Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 550	15/12/2023	52,842	(97,537)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 611,200,649米ドル)						(1,374,778)	(7,541,517)

買建スワップション 2023年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 201,353,051	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4%の固定金利を8/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を8/9/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	6/9/2023	(1,479,752)	315,140
USD 102,651,282	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.65%の固定金利を14/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/9/2024より毎年支払う。	Citibank	12/9/2023	(671,945)	14,792
USD 30,539,807	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.6%の固定金利を15/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/9/2024より毎年支払う。	Citibank	13/9/2023	(234,276)	3,323
USD 5,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	20/9/2023	(11,285)	8,440
USD 5,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	20/9/2023	(15,660)	4,040
USD 5,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	20/9/2023	(24,206)	3,045
USD 5,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	20/9/2023	(14,453)	5,697
EUR 115,560,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.EUR.39.V1の変動金利を20/6/2028より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	20/9/2023	(134,580)	77,654
USD 30,467,706	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.81%の固定金利を25/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を25/9/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	21/9/2023	(568,798)	35
USD 13,001,291	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.8%の固定金利を26/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/9/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	22/9/2023	(322,406)	19
USD 58,253,923	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を23/4/2024より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を23/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	19/10/2023	(245,022)	10,324
USD 50,109,750	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を26/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/10/2024より毎年支払う。	Citibank	24/10/2023	(902,682)	27,499

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

買建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 50,109,750	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を26/10/2024より毎年受け取り、4.55%の固定金利を26/4/2024より半年毎に支払う。	Citibank	24/10/2023	(1,222,936)	55,363
USD 50,109,751	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9%の固定金利を1/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/11/2024より毎年支払う。	JP Morgan	30/10/2023	(900,122)	18,307
USD 50,109,751	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を1/11/2024より毎年受け取り、4.4%の固定金利を1/5/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/10/2023	(923,479)	112,766
USD 20,371,341	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を3/11/2024より毎年受け取り、3.65%の固定金利を3/5/2024より半年毎に支払う。	Citibank	1/11/2023	109,729	377,913
USD 20,221,990	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を9/11/2024より毎年受け取り、4.82%の固定金利を9/5/2024より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	(295,904)	15,127
USD 20,221,990	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.82%の固定金利を9/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/11/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	(221,420)	7,472
USD 15,212,544	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.85%の固定金利を16/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年支払う。	Citibank	14/11/2023	(600,728)	26,583
JPY 1,290,600,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはJPY TONARの変動金利を22/12/2024より毎年受け取り、0.8%の固定金利を22/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	61,354	134,784
JPY 800,172,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはJPY TONARの変動金利を22/12/2024より毎年受け取り、0.8%の固定金利を22/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	38,332	83,566
JPY 490,428,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはJPY TONARの変動金利を22/12/2024より毎年受け取り、0.8%の固定金利を22/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	23,536	51,218
USD 224,135,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.5%の固定金利を24/7/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を24/1/2025より毎年支払う。	Citibank	22/1/2024	(280,794)	276,181
USD 224,135,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.55%の固定金利を26/7/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/1/2025より毎年支払う。	Citibank	24/1/2024	(229,201)	309,844

買建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 811,582,172	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.45%の固定金利を14/8/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/2/2025より毎年支払う。	Citibank	12/2/2024	(719,558)	1,246,258
EUR 116,920,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を29/10/2024より半年毎に受け取り、3.37%の固定金利を29/7/2025より毎年支払う。	Citibank	25/7/2024	(56,832)	491,420
EUR 104,380,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を9/11/2024より毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を9/8/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	7/8/2024	(28,606)	315,587
EUR 104,300,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を29/8/2025より毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を29/11/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/8/2024	(30,694)	341,276
USD 6,601,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.235%の固定金利を17/12/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/6/2027より毎年支払う。	Barclays	15/6/2026	(75,301)	241,712
USD 6,601,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を17/6/2027より毎年受け取り、3.235%の固定金利を17/12/2026より半年毎に支払う。	Barclays	15/6/2026	103,081	420,094
USD 8,059,300	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を22/7/2027より毎年受け取り、3.211%の固定金利を22/1/2027より半年毎に支払う。	Barclays	20/7/2026	128,278	524,594
USD 8,059,300	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.211%の固定金利を22/1/2027より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/7/2027より毎年支払う。	Barclays	20/7/2026	(103,989)	292,327
USD 15,473,900	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を22/7/2027より毎年受け取り、3.225%の固定金利を22/1/2027より半年毎に支払う。	Barclays	20/7/2026	237,987	998,336
USD 15,473,900	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.225%の固定金利を22/1/2027より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/7/2027より毎年支払う。	Barclays	20/7/2026	(192,025)	568,324
USD 15,359,200	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.582%の固定金利を5/2/2027より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を5/8/2027より毎年支払う。	Barclays	3/8/2026	(27,670)	765,633
USD 15,359,200	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を5/8/2027より毎年受け取り、3.582%の固定金利を5/2/2027より半年毎に支払う。	Barclays	3/8/2026	(3,720)	789,582
USD 54,131,518	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を13/8/2027より毎年受け取り、3.63%の固定金利を13/2/2027より半年毎に支払う。	Barclays	11/8/2026	(127,916)	2,703,162

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

買建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 54,131,518	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.63%の固定金利を13/2/2027より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を13/8/2027より毎年支払う。	Barclays	11/8/2026	(22,821)	2,808,257
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 886,158,173米ドル)				(9,986,484)	14,445,694

売建スワップション 2023年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (11,639,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.39%の固定金利を7/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を7/9/2024より毎年支払う。	JP Morgan	5/9/2023	(60,189)	(91,963)
USD (11,639,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.605%の固定金利を7/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を7/9/2024より毎年支払う。	Barclays	5/9/2023	(12,566)	(46,028)
USD (302,029,576)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を8/9/2024より毎年受け取り、3.6%の固定金利を8/3/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	6/9/2023	1,049,022	(1,250)
USD (102,651,282)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/9/2024より毎年受け取り、3.3%の固定金利を14/3/2024より半年毎に支払う。	Citibank	12/9/2023	272,850	(202)
USD (30,539,807)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を15/9/2024より毎年受け取り、3.1%の固定金利を15/3/2024より半年毎に支払う。	Citibank	13/9/2023	58,019	(7)
USD (5,000,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	20/9/2023	2,827	(1,048)
USD (5,000,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.40.V1の変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	20/9/2023	1,379	(1,371)
EUR (8,510,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.39.V1の変動金利を20/6/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	20/9/2023	(43,114)	(189,969)
USD (51,107,377)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.93%の固定金利を4/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	2/10/2023	20,011	(353,073)
USD (70,648,773)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.5%の固定金利を17/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	13/10/2023	(1,337,933)	(2,069,148)
USD (306,144,689)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.25%の固定金利を17/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2024より毎年支払う。	Citibank	13/10/2023	(2,198,915)	(2,849,472)
USD (156,170,183)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.05%の固定金利を18/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	16/10/2023	(1,538,095)	(1,979,276)
USD (140,135,656)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.25%の固定金利を19/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を19/10/2024より毎年支払う。	Citibank	17/10/2023	(863,708)	(1,305,135)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (29,126,961)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.3%の固定金利を23/4/2024より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を23/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	19/10/2023	(48,795)	(151,710)
USD (58,253,923)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を23/10/2024より毎年受け取り、2.45%の固定金利を23/4/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	19/10/2023	157,326	(2,873)
USD (200,439,002)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を26/10/2024より毎年受け取り、3.09%の固定金利を26/4/2024より半年毎に支払う。	Citibank	24/10/2023	902,763	(6,939)
USD (103,025,626)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.4%の固定金利を30/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/10/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	27/10/2023	197,352	(255,961)
USD (101,856,705)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を3/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/11/2024より毎年支払う。	Citibank	1/11/2023	74,697	(129,017)
USD (20,371,341)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4%の固定金利を3/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/11/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	1/11/2023	158,713	(112,226)
USD (408,714,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.8%の固定金利を10/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/11/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	8/11/2023	(198,206)	(1,068,767)
USD (307,263,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.85%の固定金利を14/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/11/2024より毎年支払う。	JP Morgan	10/11/2023	(222,658)	(683,553)
USD (60,850,161)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.75%の固定金利を16/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年支払う。	Citibank	14/11/2023	20,630	(186,684)
USD (152,125,451)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年受け取り、2.75%の固定金利を16/5/2024より半年毎に支払う。	Citibank	14/11/2023	522,618	(8,755)
USD (96,200,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.9%の固定金利を5/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を5/12/2024より毎年支払う。	Citibank	1/12/2023	(728,388)	(1,334,448)
USD (16,827,243)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.9%の固定金利を15/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/12/2024より毎年支払う。	JP Morgan	13/12/2023	(92,243)	(210,034)
USD (16,827,243)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を15/6/2024より毎年受け取り、2.9%の固定金利を15/12/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	13/12/2023	124,082	(14,743)

売建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (26,051,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年受け取り、2.4%の固定金利を18/6/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/12/2023	466,631	(7,497)
USD (26,051,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.6%の固定金利を18/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/12/2023	(199,941)	(707,935)
JPY (1,290,600,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を24/12/2024より毎年受け取り、JPY TONARの変動金利を24/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	(21,748)	(62,543)
JPY (800,172,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を22/12/2024より毎年受け取り、JPY TONARの変動金利を22/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	(13,646)	(38,777)
JPY (490,428,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1%の固定金利を22/12/2024より毎年受け取り、JPY TONARの変動金利を22/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/12/2023	(8,388)	(23,766)
USD (51,658,246)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.5%の固定金利を9/7/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/1/2025より毎年支払う。	Citibank	5/1/2024	115,477	(206,870)
USD (96,200,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を19/1/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を19/7/2024より半年毎に支払う。	Citibank	17/1/2024	504,138	(44,202)
USD (224,135,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を24/1/2025より毎年受け取り、3.8%の固定金利を24/7/2024より半年毎に支払う。	Citibank	22/1/2024	143,462	(91,880)
USD (224,135,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を26/1/2025より毎年受け取り、3.85%の固定金利を26/7/2024より半年毎に支払う。	Citibank	24/1/2024	106,352	(104,335)
USD (811,582,172)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/2/2025より毎年受け取り、3.75%の固定金利を14/8/2024より半年毎に支払う。	Citibank	12/2/2024	252,209	(480,002)
USD (149,988,494)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.79%の固定金利を1/10/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/4/2025より毎年支払う。	JP Morgan	27/3/2024	(983,860)	(2,530,241)
USD (132,310,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.495%の固定金利を29/1/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を29/7/2025より毎年支払う。	JP Morgan	25/7/2024	4,496	(542,606)
EUR (104,380,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を9/11/2024より半年毎に受け取り、2%の固定金利を9/8/2025より毎年支払う。	JP Morgan	7/8/2024	13,024	(102,854)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2023年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (3,340,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/8/2025より毎年受け取り、3.7%の固定金利を16/2/2025より半年毎に支払う。	Nomura	14/8/2024	3,533	(117,625)
USD (3,340,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.7%の固定金利を16/2/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/8/2025より毎年支払う。	Nomura	14/8/2024	15,163	(105,995)
EUR (104,300,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を29/11/2024より半年毎に受け取り、2%の固定金利を29/8/2025より毎年支払う。	JP Morgan	27/8/2024	(11,564)	(115,265)
USD (31,835,228)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を3/9/2026より毎年受け取り、3.585%の固定金利を3/3/2026より半年毎に支払う。	Bank of America	29/8/2025	8,238	(1,427,133)
USD (31,835,228)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.585%の固定金利を3/3/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/9/2026より毎年支払う。	Bank of America	29/8/2025	1,682	(1,433,688)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,421,963,896米ドル)				(3,387,263)	(21,196,866)

差金決済取引 2023年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価損 (米ドル)
(1,756,000)	バミューダ Luye Pharma	HSBC Bank	51,496
			<u>51,496</u>
(182,600)	ケイマン諸島 iQIYI	Bank of America	112,299
			<u>112,299</u>
40,271	イタリア Lottomatica	HSBC Bank	(1,005)
			<u>(1,005)</u>
(38,000)	日本 Tokyu	HSBC Bank	1,820
			<u>1,820</u>
2,450	韓国 SK Hynix	HSBC Bank	(153)
			<u>(153)</u>
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-2,669,175米ドル)			<u>164,457</u>

事後通告証券契約 2023年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD 268,810,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	231,659,963	3.20
USD 562,060,453	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	502,148,260	6.95
USD (159,858,900)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(147,551,659)	(2.04)
USD (81,270,396)	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	(77,073,786)	(1.07)
USD 266,003,792	Fannie Mae or Freddie Mac 5.5% TBA	262,784,492	3.64
USD 23,975,000	Fannie Mae or Freddie Mac 6.5% TBA	24,346,173	0.34
USD (87,311,880)	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	(84,680,449)	(1.17)
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-1,330,244,781米ドル)		<u>711,632,994</u>	<u>9.85</u>

<参考情報>

ブラックロック・グローバル・ファンズ
USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドの運用状況について
(計算期間: 2022年9月1日～2023年8月31日)

ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド(以下BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド)はブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年8月末日)です。従って、入手可能な直前の計算期間(決算)である2023年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	
形 態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および 投資 態 度	純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが5年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは3年以下を原則とします。 通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。
設 定 日	2002年10月31日
存 続 期 間	無期限
主 な 投 資 制 限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・ 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管 理 報 酬	ありません。(注)
そ の 他 費 用	保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決 算 日	年1回(原則として8月末日)に決算を行います。
収 益 分 配 方 針	分配を行いません。
申 込 手 数 料	ありません。
管 理 会 社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投 資 顧 問 会 社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク
保 管 会 社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌ・ブイ

(注) 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

■損益及び純資産変動計算書

※ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーはBGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドのクラスX投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2022年9月1日から2023年8月31日までの期間

	BGF USダラー・ショート・ デュレーション・ボンド・ファンド	
	米ドル	
期首純資産		1,582,256,819
収益		
現金および現金同等物に係る利息		1,628,778
債券利息、源泉徴収税控除後		63,406,089
スワップ利息		410,228
差金決済契約に係る受取利息		-
短期金融商品預け入れによる利息		2,031,114
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後		-
配当金、源泉徴収税控除後		-
有価証券貸付による収益		163,704
投資運用報酬リベート		-
その他の払戻し		4,360
収益合計		67,644,273
費用		
スワップ利息		801,424
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後		-
年間サービス費用		1,111,487
ローン・コミットメント・フィー		4,937
保管および預託報酬		200,783
販売報酬		682,339
税金		724,713
投資運用報酬		8,489,762
費用合計		12,015,445
純利益		55,628,828
以下に係る実現純評価益／(損)：		
投資有価証券	(58,266,286)
事後通告証券契約	(271,737)
差金決済取引		-
上場先物取引	(4,587,947)
オプション／スワップション契約		-
スワップ取引		644,316
先渡為替予約		8,848,084
その他の取引に係る外国通貨	(493,621)
当期実現純評価損	(54,127,191)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：		
投資有価証券		54,562,737
事後通告証券契約	(121,542)
差金決済取引		-
上場先物取引	(1,819,850)
オプション／スワップション契約		-
スワップ取引	(496,761)
先渡為替予約	(12,855,081)
その他の取引に係る外国通貨		32,040
当期末実現評価益／(損)の純変動		39,301,543
運用成績による純資産の増加		40,803,180
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		749,669,561
投資証券買戻しによる正味支払額	(749,450,072)
資本の変動による純資産の(減少)／増加		219,489
配当金宣言額	(5,156,910)
期末純資産		1,618,122,578

BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド

投資有価証券明細表 2023年8月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
オーストラリア			
USD 379,000	National Australia Bank 4.944% 12/1/2028	375,966	0.02
USD 5,165,000	Westpac Banking 4.184% 22/5/2028*	5,002,199	0.31
		5,378,165	0.33
ベルギー			
EUR 600,000	KBC 0.5% 3/12/2029	610,419	0.04
バミューダ諸島			
USD 221,000	Carnival Bermuda 10.375% 1/5/2028	240,781	0.01
USD 15,000	NCL 8.375% 1/2/2028	15,465	0.00
USD 73,000	Valaris 8.375% 30/4/2030	74,489	0.01
USD 8,000	Viking Ocean Cruises Ship VII 5.625% 15/2/2029	7,472	0.00
USD 19,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	19,048	0.00
		357,255	0.02
カナダ			
USD 4,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	3,643	0.00
USD 125,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	114,868	0.01
USD 87,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	80,471	0.01
USD 3,040,000	Bank of Montreal 5.2% 12/12/2024	3,022,586	0.19
USD 15,000	Baytex Energy 8.5% 30/4/2030	15,220	0.00
USD 94,000	Bombardier 6% 15/2/2028	87,870	0.00
USD 146,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	143,672	0.01
USD 48,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029	47,168	0.00
USD 83,000	Bombardier 7.875% 15/4/2027	82,883	0.01
USD 70,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	58,398	0.00
USD 371,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	367,636	0.02
USD 5,030,000	CPPIB Capital 0.5% 16/9/2024	4,783,933	0.30
USD 2,460,000	Enbridge 2.5% 14/2/2025	2,350,379	0.15
USD 26,000	Enerflex 9% 15/10/2027	25,870	0.00
USD 53,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	49,078	0.00
USD 53,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	52,921	0.01
USD 49,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	43,381	0.00
USD 15,000	GFL Environmental 3.75% 1/8/2025	14,307	0.00
USD 104,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	93,331	0.01
USD 2,000	GFL Environmental 4.25% 1/6/2025	1,937	0.00
USD 61,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	59,090	0.00
USD 25,000	Jones Deslauriers Insurance Management 8.5% 15/3/2030	25,544	0.00
USD 5,000	Masonite International 5.375% 1/2/2028	4,722	0.00
USD 10,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	8,830	0.00
USD 43,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	41,064	0.00
USD 25,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	24,589	0.00
USD 3,975,000	OMERS Finance Trust 1.1% 26/3/2026	3,604,984	0.22
USD 2,115,000	OMERS Finance Trust 4% 20/4/2028	2,039,043	0.13
USD 18,000	Ontario Gaming GTA 8% 1/8/2030	18,220	0.00
USD 3,985,000	Ontario Teachers' Finance Trust 4.25% 25/4/2028	3,895,393	0.24
USD 2,000	Precision Drilling 6.875% 15/1/2029	1,903	0.00
USD 398,000	Rogers Communications 2.9% 15/11/2026	366,675	0.02
USD 3,587,000	Rogers Communications 3.2% 15/3/2027	3,314,286	0.21
USD 1,969,000	Royal Bank of Canada 6% 1/11/2027	2,013,365	0.12
EUR 730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	773,548	0.05
USD 3,043,000	Toronto-Dominion Bank/The 5.156% 10/1/2028	3,011,370	0.19

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	カナダ(続き)		
USD 58,000	Videotron 5.125% 15/4/2027	55,587	0.00
		30,697,765	1.90
	ケイマン諸島		
USD 650,000	Allegro CLO II-S 7.745% 21/10/2028	648,702	0.04
USD 2,000,000	Allegro CLO IV 7.12% 15/1/2030	1,981,644	0.12
USD 550,000	Allegro CLO XI 7.432% 19/1/2033	544,439	0.03
USD 3,250,000	Apidos CLO XXIX 7.163% 25/7/2030	3,220,929	0.20
USD 1,421,442	ASSURANT CLO 6.628% 20/4/2031	1,414,962	0.09
USD 3,214,336	Bean Creek CLO 6.608% 20/4/2031	3,194,038	0.20
USD 520,000	Benefit Street Partners CLO V-B 6.678% 20/4/2031	518,099	0.03
USD 500,000	Canyon CLO 2018-1 6.64% 15/7/2031	498,029	0.03
USD 1,612,683	Carbone CLO 6.728% 20/1/2031	1,610,667	0.10
USD 2,333,392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 6.71% 15/7/2031	2,327,224	0.14
USD 1,250,000	CARLYLE US CLO 2018- 4 7.658% 20/1/2031	1,245,131	0.08
USD 931,069	CIFC Funding 2017-V 6.75% 16/11/2030	930,141	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 6.76% 15/1/2032	249,596	0.02
USD 7,000,000	CIFC Funding 2019-I 6.688% 20/4/2032	6,929,587	0.43
USD 713,743	Clear Creek CLO 6.788% 20/10/2030	710,975	0.04
USD 4,543,151	Deer Creek CLO 2017-1 6.768% 20/10/2030	4,524,404	0.28
USD 222,000	Fantasia 10.875% 9/1/2023	11,100	0.00
USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	10,000	0.00
USD 2,150,000	Galaxy XXII CLO 6.77% 16/4/2034	2,121,177	0.13
USD 5,000	GGAM Finance 7.75% 15/5/2026	5,026	0.00
USD 5,000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	5,072	0.00
USD 2,500,000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6.888% 20/4/2030	2,457,794	0.15
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 6.658% 20/10/2032	497,125	0.03
USD 929,114	Goldentree Loan Opportunities XI 6.642% 18/1/2031	927,150	0.06
USD 31,000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5.75% 20/1/2026	28,702	0.00
USD 400,000	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 6.65% 16/7/2031	399,100	0.02
USD 250,000	Marble Point CLO XXII 7.463% 25/7/2034	244,199	0.02
USD 232,129	Milos CLO 6.658% 20/10/2030	231,454	0.01
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 6.922% 18/10/2029	494,605	0.03
USD 4,743,902	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 6.492% 18/10/2030	4,721,691	0.29
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.712% 19/10/2031	498,828	0.03
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 7.282% 19/10/2031	299,026	0.02
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 6.65% 16/10/2033	846,565	0.05
USD 750,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7.076% 20/1/2035	739,935	0.05
USD 500,225	OCP CLO 2017-14 6.791% 20/11/2030	497,904	0.03
USD 8,600,000	Peace Park CLO 6.718% 20/10/2034	8,566,307	0.53
USD 3,920,000	Pikes Peak CLO 1 6.787% 24/7/2031	3,895,243	0.24
USD 4,016,065	Regatta VIII Funding 6.82% 17/10/2030	4,012,377	0.25
USD 1,000,000	Regatta VIII Funding 7.27% 17/10/2030	1,000,096	0.06
USD 250,000	Regatta X Funding 7.02% 17/1/2031	247,375	0.02
USD 1,750,000	Regatta XVI Funding 7.62% 15/1/2033	1,745,631	0.11
USD 258,887	Rockford Tower CLO 2017-3 6.778% 20/10/2030	258,563	0.02
USD 525,000	RR 19 6.71% 15/10/2035	522,451	0.03
USD 2,249,457	RR 3 6.66% 15/1/2030	2,245,578	0.14
USD 77,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	80,908	0.01
USD 17,000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	17,052	0.00
USD 1,000,000	Symphony CLO XXIII 7.17% 15/1/2034	988,585	0.06
USD 1,000,000	TICP CLO V 2016-1 7.32% 17/7/2031	997,534	0.06
USD 93,100	Transocean 8.75% 15/2/2030	95,674	0.01
USD 21,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	21,604	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ケイマン諸島(続き)		
USD 900,000	Trinitas CLO XVIII 6.758% 20/1/2035	891,352	0.05
		71,171,350	4.40
	フィンランド		
EUR 905,000	CRH Finland Services 0.875% 5/11/2023	976,372	0.06
	フランス		
USD 326,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	275,806	0.02
EUR 200,000	Arkema 0.125% 14/10/2026	195,598	0.01
EUR 400,000	Banque Stellantis France SACA 0% 22/1/2025	410,357	0.02
EUR 400,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	410,795	0.03
EUR 77,682	FCT Autonoria 2019 4.492% 25/9/2035	84,257	0.01
EUR 77,565	FCT Autonoria 2019 6.342% 25/9/2035	83,701	0.00
EUR 475,293	FCT Noria 2021 4.342% 25/10/2049	511,204	0.03
EUR 297,058	FCT Noria 2021 4.742% 25/10/2049	317,014	0.02
EUR 415,882	FCT Noria 2021 5.142% 25/10/2049	439,910	0.03
EUR 196,538	FCT Pixel 2021 5.576% 25/2/2038	209,917	0.01
EUR 1,000,000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 5.134% 27/8/2061	1,081,960	0.07
EUR 400,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4.734% 27/5/2061	426,844	0.02
USD 362,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	345,229	0.02
EUR 800,000	Pernod Ricard 0% 24/10/2023	863,217	0.06
EUR 600,000	Schneider Electric 0.25% 9/9/2024	629,372	0.04
EUR 950,000	WPP Finance 4.125% 30/5/2028	1,031,450	0.06
		7,316,631	0.45
	ドイツ		
EUR 600,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	617,658	0.04
EUR 1,240,000	Bayer 4% 26/8/2026	1,360,420	0.08
EUR 200,000	Commerzbank 0.75% 24/3/2026	204,024	0.01
EUR 290,000	Covestro 0.875% 3/2/2026	294,745	0.02
EUR 100,000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	103,775	0.01
USD 1,310,000	Deutsche Bank 1.447% 1/4/2025	1,268,919	0.08
EUR 210,000	E.ON 0.875% 8/1/2025*	219,207	0.01
EUR 233,723	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.388% 15/9/2030	252,416	0.02
EUR 311,630	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.588% 15/9/2030	332,749	0.02
EUR 1,100,000	Volkswagen Bank 1.875% 31/1/2024	1,181,493	0.07
EUR 600,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	618,862	0.04
EUR 600,000	Volkswagen Bank 4.25% 7/1/2026*	648,799	0.04
EUR 520,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	488,161	0.03
EUR 330,000	Volkswagen Leasing 0.375% 20/7/2026	322,112	0.02
		7,913,340	0.49
	アイルランド		
USD 2,200,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.45% 29/10/2026	1,979,766	0.12
USD 1,700,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,650,202	0.10
GBP 799,701	Agora UK 2021 6.37% 22/7/2031	975,726	0.06
GBP 784,347	Atom Mortgage 7.07% 22/7/2031	836,643	0.05
USD 2,000	Castlelake Aviation Finance 5% 15/4/2027	1,841	0.00
EUR 500,000	CRH SMW Finance 4% 11/7/2027	545,147	0.04
EUR 525,000	ESB Finance 3.494% 12/1/2024	568,796	0.03
GBP 731,147	Frost CMBS 2021-1 6.568% 20/11/2033	905,979	0.06
EUR 1,050,696	Haus European Loan Conduit No 39 4.364% 28/7/2051	1,074,178	0.07
EUR 796,770	Haus European Loan Conduit No 39 4.814% 28/7/2051	773,767	0.05
EUR 636,816	Haus European Loan Conduit No 39 5.114% 28/7/2051	569,790	0.04
EUR 987,744	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.537% 17/8/2033	1,027,715	0.06
EUR 906,253	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.187% 17/8/2033	920,407	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 320,085	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.687% 17/8/2033	314,790	0.02
EUR 1,000,794	Last Mile PE 2021 4.687% 17/8/2031	1,048,493	0.06
EUR 1,316,724	Last Mile PE 2021 4.837% 17/8/2031	1,356,696	0.08
EUR 678,857	Last Mile PE 2021 4.987% 17/8/2031	692,149	0.04
EUR 918,807	Last Mile PE 2021 5.387% 17/8/2031	918,660	0.06
USD 264,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	248,977	0.02
EUR 500,000	Linde 3.625% 12/6/2025	541,182	0.03
EUR 2,001,394	Pearl Finance 2020 5.187% 17/11/2032	2,136,334	0.13
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 5.687% 17/11/2032	1,198,849	0.07
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 6.287% 17/11/2032	1,431,212	0.09
USD 789,175	Prodigy Finance CM2021-1 6.679% 25/7/2051	783,835	0.05
EUR 453,550	River Green Finance 2020 4.748% 22/1/2032	466,705	0.03
EUR 236,425	River Green Finance 2020 5.098% 22/1/2032	242,973	0.01
EUR 345,330	SCF Rahoituspalvelut IX 4.622% 25/10/2030	372,665	0.02
USD 950,000	SMBC Aviation Capital Finance 1.9% 15/10/2026	842,963	0.05
USD 605,000	SMBC Aviation Capital Finance 2.3% 15/6/2028	516,610	0.03
GBP 321,638	Taurus 2021-1 UK 6.869% 17/5/2031	377,549	0.02
GBP 262,075	Taurus 2021-1 UK 7.819% 17/5/2031	318,724	0.02
GBP 478,579	Taurus 2021-4 UK 6.169% 17/8/2031	587,424	0.04
GBP 285,648	Taurus 2021-4 UK 7.319% 17/8/2031	332,734	0.02
EUR 1,476,664	Vita Scientia 2022-1 5.084% 27/2/2033	1,540,380	0.10
		28,099,861	1.73
イタリア			
EUR 340,000	ACEA 0% 28/9/2025	340,129	0.02
EUR 420,480	AutoFlorence 2 4.387% 24/12/2044	448,701	0.03
EUR 286,314	AutoFlorence 2 4.787% 24/12/2044	302,025	0.02
EUR 153,531	AutoFlorence 2 5.987% 24/12/2044	163,283	0.01
EUR 167,000	AutoFlorence 3 5.992% 25/12/2046	181,591	0.01
EUR 143,000	Brignole 2021 4.437% 24/7/2036	154,138	0.01
EUR 100,000	Brignole 2021 5.237% 24/7/2036	106,634	0.01
EUR 270,000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024	285,668	0.02
EUR 180,000	CA Auto Bank 0.125% 16/11/2023	193,737	0.01
EUR 620,000	CA Auto Bank 0.5% 18/9/2023	672,074	0.04
EUR 979,765	Cassia 2022-1 5.883% 22/5/2034	1,018,239	0.06
EUR 468,531	Cassia 2022-1 6.883% 22/5/2034	469,739	0.03
EUR 1,040,000	Eni 3.625% 19/5/2027	1,118,921	0.07
EUR 256,287	Progetto Quinto 4.23% 27/10/2036	277,732	0.02
EUR 518,311	Red & Black Auto Italy 6.482% 28/12/2031	548,876	0.03
EUR 320,000	Snam 0% 15/8/2025	321,797	0.02
USD 310,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	306,313	0.02
		6,909,597	0.43
日本			
EUR 621,000	Asahi 0.01% 19/4/2024	656,782	0.04
EUR 190,000	Asahi 0.155% 23/10/2024	197,278	0.01
USD 310,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.08% 19/4/2028	294,503	0.02
USD 5,510,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.788% 18/7/2025	5,447,904	0.34
USD 1,525,000	Mitsubishi UFJ Financial 5.719% 20/2/2026	1,520,594	0.09
EUR 847,000	Mizuho Financial 0.523% 10/6/2024	894,449	0.05
USD 505,000	Mizuho Financial 1.234% 22/5/2027	446,931	0.03
USD 200,000	Mizuho Financial 4.018% 5/3/2028	188,218	0.01
EUR 185,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026	190,618	0.01
USD 2,671,000	Nissan Motor 3.043% 15/9/2023	2,669,472	0.17
USD 1,400,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027*	1,280,839	0.08

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	日本(続き)		
USD 300,000	Nomura 1.851% 16/7/2025	277,412	0.02
USD 200,000	Nomura 2.648% 16/1/2025	190,881	0.01
USD 200,000	Nomura 5.709% 9/1/2026	198,762	0.01
USD 2,409,000	Sumitomo Mitsui Financial 5.464% 13/1/2026	2,401,128	0.15
		16,855,771	1.04
	ジャージー		
USD 1,342,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,277,485	0.08
EUR 1,230,000	Heathrow Funding 1.5% 12/10/2025	1,264,509	0.08
		2,541,994	0.16
	リベリア		
USD 83,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	79,825	0.01
USD 5,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	4,699	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 7.25% 15/1/2030	30,478	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 8.25% 15/1/2029	31,370	0.00
USD 46,000	Royal Caribbean Cruises 9.25% 15/1/2029	49,028	0.00
USD 10,000	Royal Caribbean Cruises 11.5% 1/6/2025	10,579	0.00
USD 31,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	33,812	0.00
		239,791	0.01
	ルクセンブルグ		
USD 200,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	169,180	0.01
USD 200,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	162,957	0.01
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 4.742% 25/9/2038	569,344	0.03
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 5.292% 25/9/2038	731,610	0.05
EUR 355,000	BL Consumer Credit 2021 6.492% 25/9/2038	379,041	0.02
USD 68,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	63,723	0.00
USD 242,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	229,710	0.02
EUR 700,000	FACT Master 4.582% 20/7/2028	753,264	0.05
EUR 599,960	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.771% 14/11/2034	650,630	0.04
EUR 319,979	Germany Compartment Consumer 2020-1 5.371% 14/11/2034	346,945	0.02
EUR 239,984	Germany Compartment Consumer 2020-1 6.121% 14/11/2034	259,133	0.02
USD 200,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	153,835	0.01
EUR 220,000	Holcim Finance Luxembourg 0.125% 19/7/2027	209,799	0.01
EUR 270,000	SIG Combibloc PurchaseCo 2.125% 18/6/2025	282,381	0.02
USD 200,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028	183,800	0.01
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	524,424	0.03
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024*	516,895	0.03
EUR 200,000	Traton Finance Luxembourg 4.125% 22/11/2025	215,631	0.02
		6,402,302	0.40
	マルタ		
USD 14,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6.375% 1/2/2030	11,487	0.00
	オランダ		
EUR 600,000	Bayer Capital 1.5% 26/6/2026	611,486	0.04
EUR 490,000	Conti-Gummi Finance 1.125% 25/9/2024	514,903	0.03
EUR 1,115,000	Digital Dutch Finco 0.625% 15/7/2025	1,117,310	0.07
EUR 483,920	Domi 2021-1 4.156% 15/6/2053	522,228	0.03
EUR 1,603,159	Domi 2022-1 4.513% 15/4/2054	1,732,283	0.11
EUR 608,859	Dutch Property Finance 2020-2 4.504% 28/1/2058	660,516	0.04
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 5.064% 28/1/2058	313,756	0.02
EUR 1,026,517	Dutch Property Finance 2021-1 4.364% 28/7/2058	1,113,463	0.07
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 4.814% 28/7/2058	797,178	0.05
EUR 887,136	Dutch Property Finance 2021-2 4.414% 28/4/2059	960,160	0.06
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 4.514% 28/4/2059	869,614	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 4.764% 28/4/2059	527,877	0.03
EUR 230,000	Haleon Netherlands Capital 1.25% 29/3/2026	233,633	0.01
EUR 500,000	ING Groep 0.1% 3/9/2025	520,683	0.03
EUR 800,000	ING Groep 1% 20/9/2023	866,841	0.05
USD 900,000	ING Groep 1.726% 1/4/2027	809,701	0.05
EUR 201,000	Jubilee Place 5.263% 17/1/2059	209,645	0.01
EUR 350,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025	364,131	0.02
EUR 75,810	Magoi 2019 4.932% 27/7/2039	81,135	0.01
EUR 450,000	Mercedes-Benz International Finance 0.25% 6/11/2023*	485,133	0.03
USD 742,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.7% 1/5/2025	706,021	0.04
USD 675,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	632,161	0.04
EUR 200,000	Redexis Gas Finance 1.875% 28/5/2025	208,308	0.01
USD 80,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	70,442	0.00
USD 47,000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	45,859	0.00
EUR 935,000	Siemens Financieringsmaatschappij 0.375% 6/9/2023	1,013,800	0.06
USD 94,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	85,133	0.01
EUR 310,000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	310,689	0.02
USD 311,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	293,933	0.02
EUR 381,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025*	380,204	0.02
USD 194,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	180,688	0.01
		17,238,914	1.05
パナマ			
USD 30,000	Carnival 4% 1/8/2028	26,935	0.00
USD 147,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	138,075	0.01
USD 37,000	Carnival 6% 1/5/2029	33,271	0.00
USD 17,000	Carnival 7% 15/8/2029	17,279	0.00
USD 13,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	12,971	0.00
		228,531	0.01
ポルトガル			
EUR 164,670	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 5.887% 25/1/2035	176,041	0.01
EUR 713,570	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 7.887% 25/1/2035	759,147	0.05
EUR 611,147	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Ulisses Finance No. 2 6.462% 23/9/2038	622,349	0.04
EUR 1,076,682	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 4.332% 28/10/2040	1,163,807	0.07
EUR 143,558	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 4.582% 28/10/2040	152,446	0.01
EUR 502,451	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 5.182% 28/10/2040	523,064	0.03
		3,396,854	0.21
サウジアラビア			
USD 865,000	Saudi Arabian Oil 2.875% 16/4/2024	849,075	0.05
シンガポール			
USD 1,634,000	Pfizer Investment Enterprises 4.45% 19/5/2028	1,602,172	0.10
スペイン			
EUR 488,430	Autonomia Spain 2021 FT 4.442% 31/1/2039	523,450	0.03
EUR 122,108	Autonomia Spain 2021 FT 5.192% 31/1/2039	129,223	0.01
EUR 305,269	Autonomia Spain 2021 FT 6.292% 31/1/2039	319,931	0.02
EUR 122,108	Autonomia Spain 2021 FT 7.542% 31/1/2039	126,973	0.01
EUR 400,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025	414,442	0.03
USD 800,000	Banco Santander 2.746% 28/5/2025	756,915	0.05
USD 200,000	Banco Santander 5.147% 18/8/2025	196,687	0.01
EUR 194,321	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 21/3/2033	199,038	0.01
EUR 233,185	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4.522% 21/3/2033	250,284	0.01
EUR 116,593	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5.522% 21/3/2033	124,540	0.01
		3,041,483	0.19

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スイス			
USD 2,000,000	Credit Suisse 0.495% 2/2/2024	1,951,597	0.12
USD 1,900,000	Credit Suisse 3.7% 21/2/2025	1,830,474	0.11
USD 2,300,000	Credit Suisse 7.5% 15/2/2028	2,454,338	0.15
EUR 715,000	UBS 0.25% 29/1/2026	730,743	0.05
USD 3,220,000	UBS 1.494% 10/8/2027	2,831,821	0.17
USD 2,300,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,228,857	0.14
		12,027,830	0.74
英国			
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 6.674% 25/7/2058	126,743	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 6.874% 25/7/2058	126,459	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 7.424% 25/7/2058	126,351	0.01
GBP 744,865	Azure Finance NO 2 8.195% 20/7/2030	946,221	0.06
USD 235,000	Barclays 3.932% 7/5/2025	231,582	0.01
USD 899,000	Barclays 4.375% 12/1/2026	866,527	0.05
USD 2,135,000	Barclays 5.501% 9/8/2028	2,080,687	0.13
USD 4,008,000	Barclays 5.829% 9/5/2027	3,970,986	0.25
USD 943,000	Barclays 7.385% 2/11/2028	981,654	0.06
GBP 202,000	Barley Hill NO 2 6.595% 27/8/2058	250,063	0.02
GBP 115,000	Barley Hill NO 2 6.895% 27/8/2058	140,145	0.01
EUR 545,000	BAT International Finance 0.875% 13/10/2023	589,149	0.04
USD 4,963,000	BAT International Finance 5.931% 2/2/2029	4,948,129	0.31
GBP 310,627	Brants Bridge 2022-1 6.208% 12/12/2064	394,900	0.02
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 6.614% 17/6/2058	126,200	0.01
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 6.601% 17/1/2059	385,622	0.02
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 7.001% 17/1/2059	210,072	0.01
GBP 139,822	CMF 2020-1 5.796% 16/1/2057	177,188	0.01
GBP 220,000	CMF 2020-1 6.196% 16/1/2057	278,500	0.02
GBP 105,000	CMF 2020-1 6.446% 16/1/2057	132,706	0.01
GBP 18,251	Dowson 2021-2 5.875% 20/10/2028	23,138	0.00
GBP 700,000	Dowson 2021-2 6.395% 20/10/2028	887,555	0.05
GBP 800,000	Dowson 2021-2 6.795% 20/10/2028	1,012,107	0.06
GBP 331,000	Dowson 2022-1 6.945% 20/1/2029	420,410	0.03
GBP 172,000	Dowson 2022-1 7.445% 20/1/2029	216,782	0.01
GBP 100,000	Dowson 2022-1 7.895% 20/1/2029	124,529	0.01
USD 200,000	eG Global Finance 6.75% 7/2/2025	196,679	0.01
GBP 1,045,000	Finsbury Square 6.247% 16/12/2067	1,281,852	0.08
GBP 806,061	Finsbury Square 2021-2 5.797% 16/12/2071	1,017,322	0.06
GBP 730,000	Finsbury Square 2021-2 6.247% 16/12/2071	914,711	0.06
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 6.397% 16/12/2071	454,684	0.03
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 6.697% 16/12/2071	240,013	0.01
GBP 424,000	Funding V 6.395% 15/10/2025	537,304	0.03
GBP 115,000	Funding V 6.895% 15/10/2025	145,561	0.01
GBP 210,000	Funding VI 8.295% 15/7/2026	267,857	0.02
GBP 370,455	Gemgarto 2021-1 5.587% 16/12/2067	468,015	0.03
GBP 668,000	Gemgarto 2021-1 6.097% 16/12/2067	841,049	0.05
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 6.297% 16/12/2067	271,313	0.02
GBP 720,000	Harben Finance 5.992% 28/9/2055	890,620	0.05
GBP 730,000	Harben Finance 6.242% 28/9/2055	883,048	0.05
GBP 441,000	Harben Finance 6.592% 28/9/2055	515,261	0.03
GBP 542,843	Hops Hill No 1 6.145% 27/5/2054	688,175	0.04
GBP 124,993	Hops Hill No 1 6.795% 27/5/2054	158,043	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 7.045% 27/5/2054	252,899	0.02
GBP 99,998	Hops Hill No 1 7.545% 27/5/2054	124,930	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
USD 788,000	HSBC 2.251% 22/11/2027	702,343	0.05
USD 200,000	HSBC 2.999% 10/3/2026	190,864	0.01
USD 1,091,000	HSBC 4.041% 13/3/2028	1,023,834	0.06
USD 556,000	HSBC 4.583% 19/6/2029	523,933	0.03
USD 200,000	HSBC 4.755% 9/6/2028	191,747	0.01
USD 264,000	HSBC 5.21% 11/8/2028	257,489	0.02
USD 523,000	HSBC 7.39% 3/11/2028	549,187	0.03
EUR 239,000	Informa 2.125% 6/10/2025	248,506	0.02
GBP 150,750	Lanark Master Issuer 5.789% 22/12/2069	191,241	0.01
GBP 657,035	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 6.058% 12/6/2057	834,147	0.05
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7.208% 12/6/2057	465,855	0.03
GBP 159,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.409% 20/7/2058	193,655	0.01
GBP 103,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.809% 20/7/2058	123,276	0.01
GBP 361,562	London Wall Mortgage Capital 6.018% 15/5/2052	455,412	0.03
USD 12,000	Macquarie Airfinance 8.375% 1/5/2028	12,249	0.00
GBP 305,000	Mortimer BTL 2021-1 6.133% 23/6/2053	379,702	0.02
GBP 108,000	Mortimer BTL 2021-1 6.483% 23/6/2053	132,171	0.01
EUR 600,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	617,931	0.04
USD 290,000	NatWest Markets 1.6% 29/9/2026	256,027	0.02
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6.745% 15/3/2029	979,600	0.06
GBP 735,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.095% 15/11/2029	926,924	0.06
GBP 404,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.545% 15/11/2029	506,280	0.03
GBP 1,156,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 6.495% 15/4/2030	1,463,645	0.09
USD 910,000	NTT Finance 4.372% 27/7/2027	886,692	0.06
GBP 693,000	Polaris 2022-1 6.547% 23/10/2059	864,689	0.05
GBP 421,000	Polaris 2022-1 6.697% 23/10/2059	517,259	0.03
GBP 307,000	Polaris 2022-1 7.197% 23/10/2059	375,055	0.02
GBP 538,000	Polaris 2022-1 8.597% 23/10/2059	652,604	0.04
GBP 696,131	Precise Mortgage Funding 2019-1B 6.158% 12/12/2055	884,025	0.05
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6.646% 16/10/2056	145,340	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6.896% 16/10/2056	126,291	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7.146% 16/10/2056	124,375	0.01
GBP 344,457	Residential Mortgage 32 6.275% 20/6/2070	437,171	0.03
GBP 525,000	Residential Mortgage 32 7.225% 20/6/2070	663,221	0.04
GBP 292,382	RMAC No 1 5.228% 12/6/2044	356,832	0.02
USD 322,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	313,140	0.02
GBP 905,000	Sage AR Funding No 1 6.469% 17/11/2030	1,123,774	0.07
GBP 385,000	Sage AR Funding No 1 7.169% 17/11/2030	470,964	0.03
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 7.369% 17/11/2030	640,060	0.04
GBP 43,644	Satus 2021-1 5.896% 17/8/2028	55,337	0.00
GBP 743,000	Satus 2021-1 6.796% 17/8/2028	938,144	0.06
GBP 122,000	Satus 2021-1 7.096% 17/8/2028	151,661	0.01
GBP 247,000	Satus 2021-1 8.396% 17/8/2028	309,984	0.02
GBP 120,000	Stanlington No 2 6.708% 12/6/2045	149,065	0.01
GBP 110,000	Stanlington No 2 7.158% 12/6/2045	134,528	0.01
GBP 303,000	Stanlington No 2 8% 12/6/2045	365,832	0.02
GBP 342,090	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5.837% 12/7/2063	431,109	0.03
GBP 156,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.087% 12/7/2063	193,604	0.01
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.387% 12/7/2063	130,948	0.01
GBP 1,016,418	Tower Bridge Funding 2021-1 6.064% 21/7/2064	1,288,352	0.08
GBP 381,999	Tower Bridge Funding 2021-1 6.664% 21/7/2064	483,681	0.03
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 7.014% 21/7/2064	460,776	0.03
GBP 253,000	Tower Bridge Funding 2021-1 7.314% 21/7/2064	317,752	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 139,999	Tower Bridge Funding 2021-2 6.718% 20/11/2063	173,622	0.01
GBP 169,999	Tower Bridge Funding 2021-2 7.018% 20/11/2063	205,619	0.01
GBP 293,000	Tower Bridge Funding 2022-1 6.025% 20/12/2063	364,550	0.02
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 6.275% 20/12/2063	322,383	0.02
GBP 1,040,000	Turbo Finance 9 6.845% 20/8/2028	1,322,562	0.08
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 7.208% 12/12/2054	494,532	0.03
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 7.958% 12/12/2054	284,437	0.02
GBP 1,176,709	Twin Bridges 2021-1 5.808% 12/3/2055	1,487,787	0.09
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 6.558% 12/3/2055	540,971	0.03
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 7.058% 12/3/2055	270,622	0.02
GBP 338,000	Twin Bridges 2021-2 6.108% 12/9/2055	410,642	0.03
GBP 188,000	Twin Bridges 2021-2 6.458% 12/9/2055	223,697	0.01
GBP 782,118	Twin Bridges 2022-1 5.728% 1/12/2055	982,089	0.06
GBP 891,000	Twin Bridges 2022-1 5.958% 1/12/2055	1,099,306	0.07
GBP 723,000	Twin Bridges 2022-1 6.258% 1/12/2055	869,036	0.05
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 6.658% 1/12/2055	429,772	0.03
GBP 292,896	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	369,268	0.02
EUR 314,000	WPP Finance 2013 3% 20/11/2023	339,462	0.02
		65,332,381	4.04
米国			
USD 5,673,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3.901% 10/8/2035	5,324,789	0.33
USD 2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016-225L 3.597% 10/2/2036	1,922,388	0.12
USD 5,662,000	7-Eleven 0.8% 10/2/2024	5,537,492	0.34
USD 1,165,000	7-Eleven 0.95% 10/2/2026	1,045,531	0.07
EUR 320,000	AbbVie 1.25% 1/6/2024	339,845	0.02
EUR 1,205,000	AbbVie 1.5% 15/11/2023	1,299,901	0.08
USD 704,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	658,417	0.05
USD 1,521,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	1,444,595	0.09
USD 5,000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	4,618	0.00
USD 200,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	162,189	0.01
USD 117,000	AdaptHealth 6.125% 1/8/2028	105,707	0.01
USD 117,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	111,698	0.01
USD 35,000	Advanced Drainage Systems 6.375% 15/6/2030	34,629	0.00
USD 105,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	105,619	0.01
USD 1,185,000	Air Lease 1.875% 15/8/2026	1,059,983	0.07
USD 6,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.25% 15/3/2026	5,585	0.00
USD 57,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	49,428	0.00
USD 32,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	30,298	0.00
USD 68,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	66,038	0.00
USD 15,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028	14,940	0.00
USD 1,905,000	Alexander Funding Trust 1.841% 15/11/2023	1,885,488	0.12
USD 22,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	21,556	0.00
USD 262,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4.25% 15/10/2027	238,627	0.02
USD 62,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6.75% 15/4/2028	61,163	0.00
USD 204,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	194,430	0.01
USD 25,000	Alteryx 8.75% 15/3/2028*	24,188	0.00
USD 47,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	44,046	0.00
USD 42,494	American Airlines / AAdvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	41,789	0.00
USD 4,714,000	American Express 2.55% 4/3/2027	4,283,053	0.27
USD 2,404,000	American Express 3.625% 5/12/2024	2,340,314	0.15
USD 1,600,000	American Honda Finance 5.25% 7/7/2026	1,601,750	0.10
EUR 1,400,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	1,329,962	0.08
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	1,001,270	0.06

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 304,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	278,738	0.02
USD 3,900,000	American Tower 1.45% 15/9/2026	3,454,081	0.21
USD 1,053,000	American Tower 1.6% 15/4/2026	950,797	0.06
USD 649,000	American Tower 4.4% 15/2/2026	631,565	0.04
USD 3,590,000	American Tower 5.25% 15/7/2028	3,533,813	0.22
USD 32,000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9.375% 1/6/2028	32,727	0.00
USD 162,000	Amgen 2.2% 21/2/2027	147,107	0.01
USD 5,414,000	Amgen 5.15% 2/3/2028	5,404,582	0.33
USD 42,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	37,712	0.00
USD 17,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	13,606	0.00
USD 3,306,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4% 13/4/2028	3,180,180	0.20
USD 173,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7.875% 15/5/2026	175,851	0.01
USD 79,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	80,611	0.01
USD 2,041,000	Aon / Aon Global 2.85% 28/5/2027	1,878,693	0.12
USD 44,000	APX 6.75% 15/2/2027	42,623	0.00
USD 45,000	Aramark Services 5% 1/4/2025	44,485	0.00
USD 63,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	58,849	0.01
USD 55,000	Aramark Services 6.375% 1/5/2025	55,202	0.00
USD 123,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	117,729	0.01
USD 66,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	64,987	0.00
USD 58,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	51,930	0.00
USD 200,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	196,077	0.01
USD 21,000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	21,419	0.00
USD 3,000	Asbury Automotive 4.75% 1/3/2030	2,630	0.00
USD 64,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	58,337	0.00
EUR 845,000	AT&T 1.05% 5/9/2023	916,678	0.06
USD 1,099,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	1,002,330	0.06
EUR 1,770,000	AT&T 3.55% 18/11/2025	1,902,081	0.12
USD 55,000	ATI 5.875% 1/12/2027	53,583	0.00
USD 58,000	ATI 7.25% 15/8/2030	58,584	0.00
USD 2,000	Avantor Funding 3.875% 1/11/2029	1,754	0.00
USD 154,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	143,047	0.01
USD 9,000	Avient 7.125% 1/8/2030	9,020	0.00
USD 299,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	253,853	0.02
USD 19,000	Ball 6% 15/6/2029	18,716	0.00
USD 10,585	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 3.887% 25/11/2033	9,555	0.00
USD 1,555,000	Bank of America 1.197% 24/10/2026	1,408,498	0.09
USD 2,694,000	Bank of America 1.319% 19/6/2026	2,478,734	0.15
USD 3,067,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	2,900,270	0.18
USD 1,575,000	Bank of America 2.015% 13/2/2026	1,485,084	0.09
USD 365,000	Bank of America 2.456% 22/10/2025	350,852	0.02
USD 600,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	575,638	0.04
USD 2,800,000	Bank of America 5.08% 20/1/2027	2,761,337	0.17
USD 155,000	Bank of America 5.202% 25/4/2029	152,662	0.01
USD 1,953,000	Bank of America 5.526% 18/8/2026	1,965,007	0.12
USD 2,588,000	Bank of America 6.204% 10/11/2028	2,645,208	0.16
USD 4,784,000	BAT Capital 3.222% 15/8/2024	4,666,789	0.29
USD 9,000	Beacon Roofing Supply 4.125% 15/5/2029	7,759	0.00
USD 25,000	Beacon Roofing Supply 6.5% 1/8/2030	24,654	0.00
EUR 398,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	400,839	0.03
USD 143,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	142,377	0.01
USD 74,000	Black Knight InfoServ 3.625% 1/9/2028	68,635	0.00
USD 205,000	Block 2.75% 1/6/2026	186,268	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 4,000	Blue Owl Credit Income 3.125% 23/9/2026	3,524	0.00
USD 45,000	Blue Owl Credit Income 7.75% 16/9/2027	44,720	0.00
USD 3,800,000	BMW US Capital 5.05% 11/8/2028	3,778,260	0.24
USD 620,000	Boeing 2.196% 4/2/2026	572,131	0.04
USD 990,000	Boeing 3.1% 1/5/2026	932,110	0.06
EUR 840,000	Booking 0.1% 8/3/2025	860,956	0.05
USD 81,000	Booz Allen Hamilton 3.875% 1/9/2028	73,455	0.01
USD 101,000	Boston Properties 6.75% 1/12/2027	103,143	0.01
USD 212,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	212,456	0.01
USD 45,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	40,611	0.00
USD 146,000	Brand Industrial Services 10.375% 1/8/2030	149,944	0.01
USD 187,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	162,152	0.01
USD 103,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.5% 15/1/2028	94,919	0.01
USD 696,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	660,823	0.04
USD 42,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GCSI Selco LL 4.5% 1/4/2027	35,120	0.00
USD 15,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	14,433	0.00
USD 70,000	Buckeye Partners 4.5% 1/3/2028	63,063	0.00
USD 82,000	BWX Technologies 4.125% 30/6/2028	74,357	0.01
USD 1,130,000	BX Trust 2018-BILT 7.378% 15/5/2030	1,111,421	0.07
USD 239,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	237,298	0.02
USD 165,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	165,369	0.01
USD 53,000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5.75% 1/7/2025	53,063	0.00
USD 32,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	31,611	0.00
USD 69,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	67,931	0.00
USD 75,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	76,079	0.01
USD 85,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	73,952	0.00
USD 73,000	Calpine 5.25% 1/6/2026	71,774	0.00
USD 34,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	33,708	0.00
USD 7,100,000	Capital One Financial 1.343% 6/12/2024	6,997,338	0.43
USD 3,100,000	Capital One Financial 4.166% 9/5/2025	3,041,784	0.19
USD 3,482,000	Capital One Financial 5.468% 1/2/2029	3,376,382	0.21
USD 3,000,000	Capital One Financial 5.888% 6/12/2024	2,966,148	0.18
USD 3,290,000	Capital One Financial 6.312% 8/6/2029	3,287,295	0.20
USD 36,000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	35,488	0.00
USD 12,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	11,740	0.00
USD 69,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	58,022	0.00
USD 22,000	Catalent Pharma Solutions 3.5% 1/4/2030	18,517	0.00
USD 2,000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	1,869	0.00
USD 298,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	281,122	0.02
USD 150,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	137,115	0.01
USD 90,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	85,406	0.01
USD 1,853,742	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2.622% 10/8/2049	1,753,916	0.11
USD 30,000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/7/2025	29,238	0.00
USD 8,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	7,475	0.00
USD 39,000	Cedar Fair / Canada's WonderLand / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	38,744	0.00
USD 340,000	CenterPoint Energy Resources 5.25% 1/3/2028	339,268	0.02
USD 60,000	Central Garden & Pet 5.125% 1/2/2028	56,477	0.00
USD 66,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	65,226	0.00
USD 49,000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	49,662	0.00
USD 3,180,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3.217% 10/11/2049	2,927,676	0.18
USD 33,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	30,287	0.00
USD 628,000	Charles Schwab 3.2% 2/3/2027	580,872	0.04
USD 5,805,000	Charles Schwab 5.875% 24/8/2026	5,838,250	0.36

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 54,000	Chart Industries 7.5% 1/1/2030	55,479	0.00
USD 358,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.75% 15/2/2028	327,545	0.02
USD 2,766,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	2,574,803	0.16
USD 15,000	Chemours 4.625% 15/11/2029	12,482	0.00
USD 4,000	Chemours 5.75% 15/11/2028	3,585	0.00
USD 146,000	Cheniere Energy Partners 4.5% 1/10/2029	134,772	0.01
USD 97,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	96,378	0.01
USD 115,378	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 4.004% 20/12/2035	103,833	0.01
USD 110,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	98,803	0.01
USD 79,000	CHS/Community Health Systems 5.25% 15/5/2030	62,327	0.00
USD 12,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	10,612	0.00
USD 37,000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	31,029	0.00
EUR 340,000	Chubb INA 0.3% 15/12/2024	351,391	0.02
USD 60,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	55,457	0.00
USD 158,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	152,350	0.01
USD 67,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	66,407	0.00
USD 2,824,000	Citigroup 1.462% 9/6/2027	2,514,290	0.16
USD 566,000	Citigroup 2.014% 25/1/2026	535,423	0.03
USD 2,480,000	Citigroup 3.52% 27/10/2028	2,287,501	0.14
USD 1,792,000	Citigroup 4.14% 24/5/2025	1,768,196	0.11
USD 446,000	Citigroup 5.61% 29/9/2026	443,789	0.03
USD 2,620,496	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3.251% 10/5/2035	2,446,841	0.15
USD 120,807	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 3.552% 11/3/2047	120,499	0.01
USD 3,380,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3.855% 10/5/2047	3,332,396	0.21
USD 4,800,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3.137% 10/2/2048	4,611,765	0.29
USD 5,519,653	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2.935% 10/4/2048	5,352,171	0.33
USD 2,054,249	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.779% 10/7/2049	1,965,057	0.12
USD 79,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	81,212	0.01
USD 17,000	Clarios Global 6.75% 15/5/2025	17,031	0.00
USD 88,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.75% 15/5/2028	87,863	0.01
USD 198,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	174,612	0.01
USD 76,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	72,814	0.00
USD 215,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	193,030	0.01
USD 116,000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	116,568	0.01
USD 62,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	57,511	0.00
USD 415,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	371,202	0.02
USD 91,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	86,719	0.01
USD 118,000	Comcast 3.15% 15/2/2028	109,350	0.01
USD 120,000	Comcast 3.3% 1/4/2027	113,253	0.01
USD 286,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	269,885	0.02
USD 794,215	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 3.741% 10/6/2046	738,172	0.05
USD 3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3.732% 10/8/2049	2,836,297	0.18
USD 4,250,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3.828% 15/7/2047	4,165,637	0.26
USD 4,744,426	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	4,603,863	0.28
USD 5,000,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 4.006% 10/4/2047	4,950,200	0.31
USD 163,915	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 3.367% 10/6/2047	163,347	0.01
USD 379,468	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3.548% 10/9/2047	376,424	0.02
USD 560,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3.178% 10/2/2035	525,933	0.03
USD 7,857,617	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 0.999% 10/5/2048	82,817	0.01
USD 884,786	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3.445% 10/8/2048	869,393	0.05
USD 4,093,089	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3.445% 10/7/2048	3,959,740	0.24
USD 75,000	CommScope 6% 1/3/2026	68,013	0.00
USD 6,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	5,490	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 109,000	Comstock Resources 6.75% 1/3/2029	102,027	0.01
USD 27,000	Consensus Cloud Solutions 6.5% 15/10/2028	24,302	0.00
USD 85,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	69,564	0.01
USD 4,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	3,669	0.00
USD 26,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	25,927	0.00
USD 165,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	162,367	0.01
USD 41,000	Crescent Energy Finance 9.25% 15/2/2028	41,966	0.00
USD 23,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	22,396	0.00
USD 29,000	Crocs 4.25% 15/3/2029	24,479	0.00
USD 89,000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	76,353	0.01
USD 82,000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4.75% 1/2/2026	79,153	0.01
USD 1,420,000	Crown Castle 1.05% 15/7/2026	1,254,418	0.08
USD 887,000	Crown Castle 4.45% 15/2/2026	863,960	0.05
USD 4,135,000	Crown Castle 4.8% 1/9/2028	4,011,354	0.25
USD 12,000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	11,114	0.00
USD 199,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	195,697	0.01
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3.505% 15/4/2050	1,578,802	0.10
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	163,890	0.01
USD 149,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	141,022	0.01
USD 2,367,000	CVS Health 4.3% 25/3/2028	2,274,548	0.14
EUR 375,000	Danaher 1.7% 30/3/2024	401,344	0.03
USD 64,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	62,317	0.00
USD 2,238,719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.409% 15/5/2035	2,231,443	0.14
USD 1,115,931	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2.632% 10/8/2049	1,020,502	0.06
USD 1,576,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 6.491% 19/12/2030	1,566,425	0.10
USD 1,810,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1,783,270	0.11
EUR 1,000,000	Digital Euro Finco 2.5% 16/1/2026	1,028,714	0.06
USD 67,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	59,521	0.00
USD 120,000	DISH DBS 5.25% 1/12/2026	101,628	0.01
USD 105,000	DISH Network 11.75% 15/11/2027	106,740	0.01
USD 694,000	DR Horton 1.3% 15/10/2026	611,691	0.04
USD 126,000	DR Horton 1.4% 15/10/2027	108,199	0.01
USD 12,000	Dream Finders Homes 8.25% 15/8/2028	12,178	0.00
USD 94,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	83,243	0.01
USD 61,000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	54,521	0.00
USD 13,000	Dycom Industries 4.5% 15/4/2029	11,629	0.00
USD 39,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	39,815	0.00
USD 3,605,000	Edison International 4.7% 15/8/2025	3,525,138	0.22
USD 203,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	178,521	0.01
USD 5,400,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	5,090,629	0.31
USD 558,000	Elevance Health 5.35% 15/10/2025	557,083	0.04
USD 75,000	Enact 6.5% 15/8/2025	74,383	0.01
USD 29,000	Encompass Health 4.75% 1/2/2030	26,479	0.00
USD 850,000	Energy Transfer 2.9% 15/5/2025	807,622	0.05
USD 438,000	Energy Transfer 4.5% 15/4/2024	434,058	0.03
USD 4,400,000	Energy Transfer 5.875% 15/1/2024	4,397,049	0.27
USD 62,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	59,264	0.00
USD 35,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	33,897	0.00
USD 118,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	113,390	0.01
USD 75,000	EnPro Industries 5.75% 15/10/2026	73,203	0.00
USD 167,000	Entegris Escrow 4.75% 15/4/2029	155,209	0.01
USD 2,700,000	Enterprise Products Operating 4.15% 16/10/2028	2,576,348	0.16
USD 136,000	Enterprise Products Operating 5.05% 10/1/2026	135,296	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 47,000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	46,594	0.00
USD 116,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	115,223	0.01
USD 543,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	500,425	0.03
USD 533,000	Equinix 1.45% 15/5/2026	478,550	0.03
USD 1,063,000	Equinix 1.55% 15/3/2028	897,288	0.06
USD 800,000	Equinix 1.8% 15/7/2027	698,704	0.04
USD 2,340,000	Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	2,152,738	0.13
USD 276,000	Eversource Energy 4.6% 1/7/2027	268,467	0.02
USD 1,520,000	Eversource Energy 4.75% 15/5/2026	1,494,958	0.09
USD 1,165,000	Eversource Energy 5.45% 1/3/2028	1,167,995	0.07
USD 740,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	678,937	0.04
USD 1,710,000	Exelon 5.15% 15/3/2028	1,696,608	0.11
USD 31,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	28,369	0.00
USD 6,336,198	Fannie Mae Pool 1.5% 1/6/2031	5,667,874	0.35
USD 3,911,060	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2035	3,531,215	0.22
USD 14,850	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	14,321	0.00
USD 23,351	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	22,345	0.00
USD 286,475	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	270,359	0.02
USD 113,075	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	106,493	0.01
USD 29,301	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	27,653	0.00
USD 17,385	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	16,411	0.00
USD 9,645	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	9,105	0.00
USD 36,456	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	34,413	0.00
USD 296,547	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	279,843	0.02
USD 43,171	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	40,746	0.00
USD 10,850	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	10,240	0.00
USD 7,829	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	7,370	0.00
USD 211,743	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	199,392	0.01
USD 262,878	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	248,149	0.02
USD 35,057	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	33,019	0.00
USD 12,978	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	12,222	0.00
USD 22,527	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	21,257	0.00
USD 219,082	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	206,760	0.01
USD 247,018	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	232,804	0.01
USD 19,433	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	18,337	0.00
USD 33,673	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	31,773	0.00
USD 31,898	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	30,040	0.00
USD 46,729	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	44,092	0.00
USD 218,471	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	205,578	0.01
USD 11,463	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	10,820	0.00
USD 25,847	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	24,399	0.00
USD 402,609	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	379,872	0.02
USD 272,076	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	255,692	0.02
USD 73,751	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	69,605	0.00
USD 32,251	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	30,437	0.00
USD 229,549	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	216,623	0.01
USD 95,850	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	90,049	0.01
USD 141,534	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	133,553	0.01
USD 306,951	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	289,691	0.02
USD 430,120	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	404,980	0.03
USD 17,587	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	16,594	0.00
USD 7,384	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	6,967	0.00
USD 1,770,588	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	1,670,886	0.10

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 10,153	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	9,582	0.00
USD 191,404	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	180,588	0.01
USD 212,058	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	199,658	0.01
USD 304,555	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	287,382	0.02
USD 35,045	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	33,069	0.00
USD 16,570	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	15,633	0.00
USD 9,929	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	9,368	0.00
USD 54,893	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	51,317	0.00
USD 117,419	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	110,826	0.01
USD 31,293	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	29,529	0.00
USD 183,963	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	173,615	0.01
USD 19,126	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	17,869	0.00
USD 7,410,627	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2033	7,007,604	0.43
USD 3,465,034	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2034	3,270,749	0.20
USD 760,813	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	702,291	0.04
USD 328,600	Fannie Mae Pool 3.126% 1/9/2044	320,113	0.02
USD 82,978	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	79,356	0.01
USD 495,520	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	473,895	0.03
USD 732,294	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	708,056	0.04
USD 577,780	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	560,119	0.03
USD 243,286	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	237,084	0.01
USD 310,530	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	301,429	0.02
USD 21,462	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	20,735	0.00
USD 164,477	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	158,929	0.01
USD 152,116	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	146,692	0.01
USD 220,246	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	208,800	0.01
USD 273,357	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	259,175	0.02
USD 187,826	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	178,084	0.01
USD 2,758,693	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	2,621,120	0.16
USD 9,006,620	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	8,557,456	0.53
USD 572,062	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2037	557,345	0.03
USD 2,432,218	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,377,872	0.15
USD 909,953	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	889,575	0.06
USD 2,197,320	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,141,647	0.13
USD 453,459	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	444,916	0.03
USD 576,419	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2037	565,325	0.04
USD 592,957	Fannie Mae Pool 4.5% 1/3/2047	574,129	0.04
USD 1,820,514	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2047	1,762,653	0.11
USD 244,810	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2047	237,082	0.01
USD 2,024,478	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2047	1,967,502	0.12
USD 327,043	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	316,670	0.02
USD 1,004,213	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2048	972,188	0.06
USD 3,071,813	Fannie Mae Pool 4.5% 1/2/2049	2,981,148	0.18
USD 857,528	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2049	831,809	0.05
USD 285,678	Fannie Mae Pool 4.704% 1/9/2042	289,701	0.02
USD 258	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	254	0.00
USD 455,124	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2037	452,739	0.03
USD 2,274,545	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2,273,497	0.14
USD 1,889,075	Fannie Mae REMICS 1.5% 25/11/2050	1,597,474	0.10
USD 7,292,534	Fannie Mae REMICS 6% 25/9/2052	7,076,619	0.44
USD 14,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 0.71% 1/4/2025	13,014,653	0.80
USD 2,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 1.3% 3/2/2031	1,559,254	0.10
USD 8,500,000	Federal Farm Credit Banks Funding 1.68% 17/9/2035	5,914,600	0.37

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.17% 29/10/2029	1,716,608	0.11
USD 5,500,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.25% 15/8/2029	4,787,500	0.30
USD 1,150,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.78% 1/12/2036	892,682	0.05
USD 4,000,000	Federal Home Loan Banks 0.6% 30/12/2026	3,507,175	0.22
USD 2,560,000	Federal Home Loan Banks 1.4% 9/1/2031	2,009,724	0.12
USD 3,000,000	Federal Home Loan Banks 1.61% 27/1/2033	2,258,564	0.14
USD 4,000,000	Federal Home Loan Banks 2.06% 27/9/2029	3,451,055	0.21
USD 3,500,000	Federal Home Loan Banks 2.18% 6/11/2029	3,018,543	0.19
USD 1,150,000	Federal Home Loan Banks 2.5% 5/11/2036	864,736	0.05
USD 4,000,000	Federal Home Loan Mortgage 0.65% 28/5/2026	3,575,905	0.22
USD 189,000	Federal Home Loan Mortgage 1.55% 20/11/2031	147,196	0.01
USD 4,500,000	Federal Home Loan Mortgage 4.2% 28/8/2025	4,416,359	0.27
USD 4,500,000	Federal Home Loan Mortgage 5.68% 3/4/2025	4,477,558	0.28
USD 16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	14,675,879	0.91
USD 4,000,000	Federal National Mortgage Association 0.74% 25/8/2027	3,421,013	0.21
USD 4,000,000	Federal National Mortgage Association 0.81% 25/9/2028	3,296,889	0.20
USD 61,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	52,670	0.00
USD 2,158,000	Fidelity National Information Services 1.15% 1/3/2026	1,941,825	0.12
USD 2,700,000	Fidelity National Information Services 4.5% 15/7/2025	2,645,334	0.16
USD 894,000	Fidelity National Information Services 4.7% 15/7/2027	875,519	0.05
USD 535,000	Fifth Third Bancorp 6.339% 27/7/2029	541,134	0.03
USD 1,235,000	Fifth Third Bank 5.852% 27/10/2025	1,217,096	0.08
USD 250,000	Fiserv 3.2% 1/7/2026	235,594	0.02
USD 2,200,000	Fiserv 5.45% 2/3/2028	2,212,157	0.14
USD 783,000	Florida Power & Light 4.4% 15/5/2028	765,287	0.05
USD 2,180,000	Florida Power & Light 5.05% 1/4/2028	2,188,410	0.14
USD 615,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	551,467	0.04
USD 1,826,000	Ford Motor Credit 3.37% 17/11/2023	1,812,748	0.11
USD 200,000	Ford Motor Credit 7.2% 10/6/2030	202,501	0.01
USD 261,000	Ford Motor Credit 7.35% 6/3/2030	265,955	0.02
USD 19,000	Fortrea 7.5% 1/7/2030	18,772	0.00
USD 30,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5.5% 1/5/2028	27,934	0.00
USD 102,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6.5% 1/10/2025	100,919	0.01
USD 16,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9.75% 1/8/2027	16,649	0.00
USD 661,209	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/9/2032	624,789	0.04
USD 423,748	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	391,262	0.02
USD 816,797	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	790,724	0.05
USD 968,544	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	942,503	0.06
USD 855,793	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	835,026	0.05
USD 46,344	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	44,000	0.00
USD 616,360	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	585,125	0.04
USD 198,165	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/7/2047	192,175	0.01
USD 5,995,604	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/3/2049	5,814,291	0.36
USD 95,101,691	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.788% 25/9/2024	493,416	0.03
USD 1,461,020	Freddie Mac Non Gold Pool 3.219% 1/5/2045	1,416,416	0.09
USD 484,434	Freddie Mac Pool 4.5% 1/10/2037	475,302	0.03
USD 492,333	Freddie Mac Pool 4.5% 1/1/2050	479,925	0.03
USD 3,881,878	Freddie Mac REMICS 1.5% 15/4/2044	3,672,894	0.23
USD 727,200	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	646,561	0.04
USD 2,067,133	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	1,814,122	0.11
USD 1,308,411	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1,175,814	0.07
USD 507,327	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	487,611	0.03
USD 1,398,140	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1,291,566	0.08

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 932,388	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	812,646	0.05
USD 1,139,455	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1,074,860	0.07
USD 17,563	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/9/2041	17,332	0.00
USD 59,468	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/11/2041	57,997	0.00
USD 69,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	59,146	0.00
USD 102,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	92,949	0.01
USD 16,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	15,533	0.00
USD 12,000	FTAI Infra Escrow 10.5% 1/6/2027	12,017	0.00
USD 46,000	Gartner 4.5% 1/7/2028	42,959	0.00
USD 25,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	24,835	0.00
USD 22,000	GCI 4.75% 15/10/2028	19,110	0.00
USD 51,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	51,027	0.00
EUR 360,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	360,472	0.02
USD 297,000	General Mills 5.241% 18/11/2025	295,564	0.02
USD 266,000	General Motors 6.125% 1/10/2025	267,096	0.02
USD 176,000	General Motors Financial 1.25% 8/1/2026	158,305	0.01
USD 434,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	385,945	0.03
USD 772,000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	750,596	0.05
USD 1,993,000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	1,997,573	0.13
USD 6,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7.75% 1/2/2028	5,855	0.00
USD 11,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.875% 15/4/2030	10,953	0.00
USD 36,000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3.75% 15/12/2027	28,139	0.00
USD 2,764,000	Global Payments 1.2% 1/3/2026	2,472,798	0.16
USD 1,058,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	942,794	0.06
USD 281,000	Global Payments 4.95% 15/8/2027	273,467	0.02
USD 15,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	12,922	0.00
USD 96,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	91,769	0.01
USD 1,030,000	Goldman Sachs 0.657% 10/9/2024	1,029,033	0.06
USD 1,621,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,453,217	0.09
USD 826,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	734,602	0.05
USD 2,787,000	Goldman Sachs 2.64% 24/2/2028	2,520,981	0.16
USD 1,077,000	Goldman Sachs 4.482% 23/8/2028	1,036,229	0.07
USD 1,501,000	Goldman Sachs 5.798% 10/8/2026	1,495,756	0.09
USD 649,381	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1.93% 20/7/2048	488,597	0.03
USD 552,572	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	426,742	0.03
USD 30,000	Goodyear Tire & Rubber 9.5% 31/5/2025	30,673	0.00
USD 3,313,784	Government National Mortgage Association 0.641% 16/2/2053	52,267	0.00
USD 1,168,246	Government National Mortgage Association 1.5% 20/6/2050	912,126	0.06
USD 1,490,481	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1,403,399	0.09
USD 701,677	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	635,568	0.04
USD 28,000	GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028	27,171	0.00
USD 33,000	Graham 5.75% 1/6/2026	32,287	0.00
USD 56,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	49,969	0.00
USD 16,000	Greystar Real Estate Partners 7.75% 1/9/2030	16,150	0.00
USD 1,302,650	GS Mortgage Trust 2011-GC5 5.209% 10/8/2044	1,225,625	0.08
USD 3,495,242	GS Mortgage Trust 2014-GC18 4.074% 10/1/2047	3,465,527	0.21
USD 2,960,000	GS Mortgage Trust 2014-GC24 3.931% 10/9/2047	2,864,076	0.18
USD 2,330,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 3.764% 10/7/2048	2,223,300	0.14
USD 1,641,984	GS Mortgage Trust 2016-GS3 2.777% 10/10/2049	1,567,382	0.10
USD 8,000	Gulfpport Energy 8% 17/5/2026	8,132	0.00
USD 20,000	GYP III 4.625% 1/5/2029	17,612	0.00
USD 14,000	Hanesbrands 4.875% 15/5/2026	13,112	0.00
USD 35,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	31,436	0.00

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,324,000	HCA 5.25% 15/4/2025	1,311,671	0.08
USD 3,128,000	HCA 5.375% 1/2/2025	3,107,475	0.19
USD 593,000	HCA 5.375% 1/9/2026	588,228	0.04
USD 2,467,000	HCA 5.875% 15/2/2026	2,470,706	0.15
USD 70,000	HealthEquity 4.5% 1/10/2029	62,126	0.00
USD 820,000	Healthpeak 1.35% 1/2/2027	718,771	0.05
USD 61,000	Herc 5.5% 15/7/2027	58,754	0.00
USD 31,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	28,787	0.00
USD 15,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	14,454	0.00
USD 20,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	17,653	0.00
USD 25,000	Hilton Domestic Operating 5.375% 1/5/2025	24,847	0.00
USD 10,000	Hilton Domestic Operating 5.75% 1/5/2028	9,820	0.00
USD 82,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	79,195	0.01
EUR 710,000	Honeywell International 3.5% 17/5/2027*	762,053	0.05
USD 43,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	38,832	0.00
USD 30,000	Howard Midstream Energy Partners 8.875% 15/7/2028	30,862	0.00
USD 121,000	HP 4.75% 15/1/2028	117,874	0.01
USD 6,200,000	HSBC USA 5.625% 17/3/2025	6,185,112	0.38
USD 158,000	HUB International 7.25% 15/6/2030	160,141	0.01
USD 8,000	Hughes Satellite Systems 5.25% 1/8/2026	7,304	0.00
USD 2,471,000	Hyundai Capital America 1.65% 17/9/2026	2,194,271	0.14
USD 15,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	11,872	0.00
USD 21,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.75% 15/9/2024	20,320	0.00
USD 66,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	57,854	0.00
USD 39,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	36,216	0.00
EUR 1,045,000	Illinois Tool Works 0.25% 5/12/2024	1,082,505	0.07
USD 82,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	73,037	0.00
USD 2,079,000	Intercontinental Exchange 3.75% 21/9/2028*	1,960,838	0.12
USD 493,000	International Business Machines 3.45% 19/2/2026	472,677	0.03
USD 497,000	International Business Machines 4.5% 6/2/2026	488,905	0.03
USD 1,715,000	Invitation Homes Operating Partnership 5.45% 15/8/2030	1,678,124	0.10
USD 308,000	IQVIA 5% 15/5/2027	296,140	0.02
USD 130,000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	129,916	0.01
USD 18,000	JELD-WEN 4.625% 15/12/2025	17,435	0.00
USD 1,085,000	John Deere Capital 4.95% 14/7/2028	1,086,798	0.07
USD 1,015,678	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-C16 4.166% 15/12/2046	1,013,384	0.06
USD 1,008,740	JP Morgan Mortgage Trust 2014-2 3% 25/6/2029	962,444	0.06
USD 496,518	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 6.808% 25/6/2046	456,891	0.03
USD 80,021	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2013-C17 3.705% 15/1/2047	79,809	0.01
USD 919,932	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3.657% 15/9/2047	904,886	0.06
USD 232,923	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3.288% 15/1/2048	228,907	0.01
USD 879,964	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3.504% 15/12/2048	833,892	0.05
USD 606,000	JPMorgan Chase 1.045% 19/11/2026	546,576	0.03
EUR 420,000	JPMorgan Chase 1.5% 27/1/2025	440,657	0.03
USD 328,000	JPMorgan Chase 1.561% 10/12/2025	309,894	0.02
USD 1,850,000	JPMorgan Chase 1.578% 22/4/2027	1,661,977	0.10
USD 1,200,000	JPMorgan Chase 2.069% 1/6/2029	1,029,082	0.06
USD 1,234,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,160,273	0.07
USD 1,581,000	JPMorgan Chase 3.782% 1/2/2028	1,491,899	0.09
USD 1,100,000	JPMorgan Chase 3.96% 29/1/2027	1,057,880	0.07
USD 2,430,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	2,382,134	0.15
USD 4,190,000	JPMorgan Chase 5.299% 24/7/2029	4,165,365	0.26
USD 109,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	96,148	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000	KBR 4.75% 30/9/2028	1,804	0.00
USD 46,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	42,828	0.00
USD 162,000	Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026	152,598	0.01
USD 28,000	LABL 5.875% 1/11/2028	25,372	0.00
USD 4,000	LABL 6.75% 15/7/2026	3,913	0.00
USD 49,000	LABL 9.5% 1/11/2028	50,501	0.00
USD 48,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	43,461	0.00
USD 4,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5.25% 1/10/2025	3,854	0.00
USD 363,000	Lam Research 3.8% 15/3/2025	354,315	0.02
USD 81,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	76,617	0.01
USD 21,000	Legacy LifePoint Health 4.375% 15/2/2027	18,165	0.00
USD 20,000	Legends Hospitality Co / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	18,618	0.00
USD 98,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	89,725	0.01
USD 76,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	57,250	0.00
USD 70,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	71,145	0.00
USD 57,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	55,641	0.00
USD 33,000	LifePoint Health 9.875% 15/8/2030	32,574	0.00
USD 31,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	30,058	0.00
USD 28,000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	28,797	0.00
USD 21,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	12,710	0.00
USD 21,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	18,750	0.00
USD 43,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	39,940	0.00
USD 4,000	Live Nation Entertainment 5.625% 15/3/2026	3,883	0.00
USD 134,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	134,187	0.01
USD 169,000	Lowe's 3.35% 1/4/2027	159,009	0.01
USD 288,000	Lowe's 4.4% 8/9/2025	282,768	0.02
USD 34,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	21,282	0.00
USD 980,000	LYB International Finance III 1.25% 1/10/2025	893,620	0.06
USD 7,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	6,791	0.00
USD 56,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	54,652	0.00
USD 22,000	Matador Resources 6.875% 15/4/2028	22,027	0.00
USD 103,000	Match II 4.625% 1/6/2028	94,991	0.01
USD 301,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	296,073	0.02
USD 123,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	107,191	0.01
USD 3,785,000	Mercedes-Benz Finance North America 5.2% 3/8/2026	3,776,165	0.23
USD 92,000	Meritage Homes 5.125% 6/6/2027	88,478	0.01
USD 48,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	43,002	0.00
USD 74,760	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6.5% 20/6/2027	74,556	0.01
EUR 400,000	MMS USA 0.625% 13/6/2025	409,319	0.03
USD 42,000	ModivCare 5.875% 15/11/2025	39,894	0.00
USD 87,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	80,111	0.01
EUR 100,000	Morgan Stanley 0.406% 29/10/2027	96,295	0.01
USD 2,755,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	2,484,938	0.15
USD 1,650,000	Morgan Stanley 5.164% 20/4/2029	1,617,444	0.10
USD 3,220,000	Morgan Stanley 5.449% 20/7/2029	3,197,605	0.20
USD 5,100,000	Morgan Stanley 6.296% 18/10/2028	5,228,217	0.32
USD 1,495,000	Morgan Stanley Bank 4.754% 21/4/2026	1,473,902	0.09
USD 1,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 4.039% 15/11/2046	1,471,291	0.09
USD 1,324,038	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 4.051% 15/4/2047	1,312,758	0.08
USD 456,325	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 3.621% 15/10/2047	451,867	0.03
USD 6,616,709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 3.249% 15/2/2048	6,344,139	0.39
USD 2,625,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.372% 15/10/2048	2,498,419	0.15
USD 4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.635% 15/10/2048	3,974,557	0.25

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 7,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 3.252% 15/10/2048	6,728,254	0.42
USD 1,834,904	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 2.729% 15/9/2049	1,755,334	0.11
USD 3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 3.102% 15/11/2049	2,733,798	0.17
USD 193,000	MPLX 1.75% 1/3/2026	175,657	0.02
USD 1,700,000	MPLX 4.25% 1/12/2027	1,616,616	0.10
USD 296,000	MPLX 4.875% 1/6/2025	291,194	0.02
USD 21,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	15,214	0.00
USD 29,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	24,681	0.00
USD 21,000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	18,551	0.00
USD 65,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	63,619	0.00
USD 2,900,000	Nasdaq 5.35% 28/6/2028	2,896,918	0.18
USD 46,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	43,857	0.00
USD 45,000	Navient 6.75% 15/6/2026	44,157	0.00
USD 28,000	Navient 9.375% 25/7/2030	28,081	0.00
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,678,891	0.10
USD 396,880	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 6.325% 15/11/2068	392,217	0.03
USD 279,782	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D 3.01% 15/12/2059	258,946	0.02
USD 191,502	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	186,274	0.01
USD 76,000	NCR 5% 1/10/2028	69,797	0.01
USD 32,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	29,837	0.00
USD 72,000	New Fortress Energy 6.5% 30/9/2026	66,962	0.00
USD 59,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	57,091	0.00
USD 306,639	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3.25% 25/9/2056	277,940	0.02
USD 1,519,390	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1,431,144	0.09
USD 2,000,000	Newell Brands 4.7% 1/4/2026*	1,908,452	0.12
USD 175,000	NextEra Energy Capital 1.875% 15/1/2027	156,385	0.01
USD 274,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	235,255	0.01
USD 229,000	NextEra Energy Capital 3.55% 1/5/2027	215,729	0.01
USD 125,000	NextEra Energy Capital 4.625% 15/7/2027	121,856	0.01
USD 27,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	26,518	0.00
USD 181,000	NFP 4.875% 15/8/2028	161,762	0.01
USD 54,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7.5% 1/2/2026	53,657	0.00
USD 1,515,000	NiSource 5.25% 30/3/2028	1,508,153	0.09
USD 1,727,000	Nissan Motor Acceptance 1.85% 16/9/2026	1,495,036	0.09
USD 380,000	Nissan Motor Acceptance 2.75% 9/3/2028	320,450	0.02
USD 1,584,000	Norfolk Southern 3.8% 1/8/2028	1,492,748	0.09
USD 116,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	116,384	0.01
USD 71,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	61,971	0.00
USD 251,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	227,806	0.01
USD 418,000	NRG Energy 3.75% 15/6/2024	406,784	0.03
USD 8,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	7,605	0.00
USD 62,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	60,838	0.00
USD 2,200,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	2,370,648	0.15
USD 1,330,000	Oncor Electric Delivery 4.3% 15/5/2028	1,288,550	0.08
USD 740,000	ONE Gas 1.1% 11/3/2024	721,378	0.05
USD 7,000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	5,459	0.00
USD 83,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	77,783	0.01
USD 6,000	OneMain Finance 6.875% 15/3/2025	5,976	0.00
USD 29,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	28,585	0.00
USD 987,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	905,863	0.06
USD 9,856,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	8,976,657	0.56
USD 1,320,000	Oracle 2.65% 15/7/2026	1,225,021	0.08
USD 285,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	257,987	0.02

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,365,000	Otis Worldwide 5.25% 16/8/2028	1,373,471	0.09
USD 19,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	15,604	0.00
USD 108,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	97,853	0.01
USD 953,000	Pacific Gas and Electric 3.45% 1/7/2025	904,776	0.06
USD 3,180,000	Pacific Gas and Electric 6.1% 15/1/2029	3,141,620	0.19
USD 575,000	Parker-Hannifin 2.7% 14/6/2024	561,460	0.04
USD 61,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	55,701	0.00
USD 13,000	PBF / PBF Finance 7.875% 15/9/2030	12,980	0.00
USD 29,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	28,982	0.00
USD 535,000	PeaceHealth Obligated 1.375% 15/11/2025	487,321	0.03
USD 34,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	32,474	0.00
USD 606,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.2% 15/11/2025	545,447	0.04
USD 1,285,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.7% 15/6/2026	1,144,747	0.07
USD 359,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	345,824	0.02
USD 166,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.4% 1/7/2027	156,905	0.01
USD 200,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.45% 29/1/2026	192,687	0.01
USD 43,000	Performance Food 5.5% 15/10/2027	41,304	0.00
USD 2,000	Permian Resources Operating 5.875% 1/7/2029	1,936	0.00
USD 84,000	Permian Resources Operating 6.875% 1/4/2027	83,533	0.01
USD 170,000	Permian Resources Operating 7.75% 15/2/2026	171,918	0.01
USD 520,000	Piedmont Natural Gas 3.5% 1/6/2029	471,954	0.03
USD 1,676,000	Pioneer Natural Resources 1.125% 15/1/2026	1,518,408	0.09
USD 1,025,000	Pioneer Natural Resources 5.1% 29/3/2026	1,016,453	0.06
USD 6,000	Playtika 4.25% 15/3/2029	5,188	0.00
USD 3,100,000	PNC Financial Services 5.582% 12/6/2029	3,070,642	0.19
USD 6,000	Post 4.625% 15/4/2030	5,321	0.00
USD 77,000	Post 5.625% 15/1/2028	74,307	0.01
USD 200,000	PRA Health Sciences 2.875% 15/7/2026	182,089	0.01
USD 6,000	Presidio 4.875% 1/2/2027	5,611	0.00
USD 3,000	Prime Healthcare Services 7.25% 1/11/2025	2,814	0.00
USD 34,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	33,768	0.00
USD 51,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	50,114	0.00
USD 45,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	43,033	0.00
EUR 1,084,000	Procter & Gamble 3.25% 2/8/2026	1,167,548	0.07
USD 3,085,000	Prologis 4.875% 15/6/2028	3,048,755	0.19
USD 39,000	PTC 3.625% 15/2/2025	37,722	0.00
USD 1,160,000	Public Storage Operating 5.125% 15/1/2029	1,155,951	0.07
USD 59,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	46,090	0.00
USD 40,000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4.875% 1/11/2026	37,535	0.00
USD 177,000	Realty Income 2.2% 15/6/2028	153,657	0.01
USD 175,000	Realty Income 3.4% 15/1/2028	162,276	0.01
USD 43,000	Regal Rexnord 6.05% 15/4/2028	42,568	0.00
USD 57,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	49,917	0.00
USD 41,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	38,067	0.00
USD 29,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7.25% 15/7/2028	29,171	0.00
USD 8,000	Ritchie Bros 6.75% 15/3/2028	8,065	0.00
USD 82,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	75,206	0.01
USD 4,000	Rockcliff Energy II 5.5% 15/10/2029	3,688	0.00
USD 95,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	84,527	0.00
USD 16,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	14,677	0.00
USD 14,000	Ryan Specialty 4.375% 1/2/2030	12,538	0.00
USD 207,000	Ryder System 1.75% 1/9/2026	186,040	0.01
USD 2,043,000	Ryder System 2.85% 1/3/2027	1,879,359	0.12

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 198,000	Ryder System 2.9% 1/12/2026	182,300	0.01
USD 1,500,000	Ryder System 3.65% 18/3/2024	1,481,903	0.09
USD 141,000	Ryder System 4.3% 15/6/2027	135,752	0.01
USD 397,000	Sabine Pass Liquefaction 5.75% 15/5/2024	396,247	0.03
USD 51,000	Sabre GBLB 7.375% 1/9/2025	50,179	0.00
USD 5,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	4,931	0.00
USD 3,745,000	San Diego Gas & Electric 4.95% 15/8/2028	3,709,420	0.23
USD 120,000	Santander USA 3.5% 7/6/2024	117,526	0.01
USD 59,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	50,475	0.00
USD 61,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	56,482	0.00
USD 10,000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6.625% 1/3/2030	8,824	0.00
USD 3,000	Sealed Air 5% 15/4/2029	2,782	0.00
USD 106,000	Sealed Air 5.5% 15/9/2025	104,511	0.01
USD 14,000	Sealed Air/Sealed Air US 6.125% 1/2/2028	13,826	0.00
USD 1,633,700	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3.5% 25/8/2057	1,527,943	0.09
USD 2,735,013	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2,486,327	0.15
USD 1,282,000	Semptra 3.3% 1/4/2025	1,235,238	0.08
USD 4,000	Sensata Technologies 4.375% 15/2/2030	3,541	0.00
USD 103,494	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 3.5% 25/8/2047	94,941	0.01
USD 15,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	14,894	0.00
USD 739,200	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	700,647	0.04
USD 243,000	Sherwin-Williams 4.25% 8/8/2025	237,448	0.02
USD 72,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	67,386	0.01
USD 160,000	Simon Property 3.3% 15/1/2026	152,504	0.01
USD 376,000	Simon Property 3.5% 1/9/2025	362,130	0.02
USD 20,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	17,964	0.00
USD 50,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	46,171	0.00
USD 36,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	36,023	0.00
USD 26,000	SLM 3.125% 2/11/2026	23,165	0.00
USD 4,422,878	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 5.862% 15/12/2038	4,288,689	0.27
USD 3,070,650	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5.882% 15/6/2039	2,976,602	0.18
USD 3,199,343	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5.842% 15/6/2039	3,073,518	0.19
USD 1,705,729	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5.822% 15/12/2039	1,639,590	0.10
USD 846,443	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 5.792% 16/12/2041	819,524	0.05
USD 3,519,576	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.175% 15/10/2041	3,724,675	0.23
USD 772,560	SLM Student Loan Trust 2013-4 5.952% 25/6/2027	765,607	0.05
USD 6,000	SM Energy 5.625% 1/6/2025	5,910	0.00
USD 22,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	21,470	0.00
USD 3,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	2,978	0.00
USD 44,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	43,799	0.00
USD 1,083,287	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 6.325% 15/9/2034	1,078,966	0.07
USD 635,958	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 6.175% 15/10/2035	631,631	0.04
USD 204,600	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 3.44% 15/7/2036	195,231	0.01
USD 397,371	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 6.255% 15/9/2037	393,880	0.03
USD 3,697,471	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1.6% 15/9/2054	3,294,259	0.20
USD 950,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.31% 15/1/2053	859,961	0.05
USD 1,312,205	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 6.155% 15/1/2053	1,284,009	0.08
USD 2,306,280	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1.39% 15/1/2053	2,006,293	0.12
USD 4,375,109	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6.639% 16/2/2055	4,358,184	0.27
USD 1,905,335	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	1,827,770	0.11
USD 1,831,595	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 7.039% 16/5/2050	1,848,032	0.11
USD 9,615,401	SMB Private Education Loan Trust 2022-D 6.989% 15/10/2058	9,695,587	0.60
USD 151,000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	144,943	0.01

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 744,503	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2.65% 25/9/2040	709,962	0.04
USD 659,327	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	634,592	0.04
USD 1,144,537	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.34% 25/8/2047	1,108,290	0.07
USD 1,149,533	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 3.59% 25/1/2048	1,105,535	0.07
USD 1,081,200	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 3.6% 25/2/2048	1,036,050	0.06
USD 1,515,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	1,353,919	0.08
USD 219,000	Sotheby's 7.375% 15/10/2027	199,461	0.01
USD 24,979	Soundview Home Loan Trust 2003-2 6.729% 25/11/2033	24,523	0.00
USD 4,291,000	Southern 4.475% 1/8/2024	4,240,894	0.26
USD 23,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	21,879	0.00
USD 878,000	Spectra Energy Partners 3.5% 15/3/2025	847,047	0.05
USD 6,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025	5,929	0.00
USD 64,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	66,661	0.00
USD 3,900,000	Sprint 7.125% 15/6/2024	3,932,577	0.24
USD 1,301,562	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	1,288,345	0.08
USD 139,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	123,989	0.01
USD 140,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	135,048	0.01
USD 37,000	Standard Industries 4.375% 15/7/2030	31,539	0.00
USD 31,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	28,578	0.00
USD 175,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	166,486	0.01
USD 24,000	Staples 7.5% 15/4/2026	19,913	0.00
USD 11,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	9,868	0.00
USD 23,000	Starwood Property Trust 5.5% 1/11/2023	22,925	0.00
USD 105,000	State Street 3.55% 18/8/2025	101,320	0.01
USD 296,000	State Street 5.751% 4/11/2026	296,406	0.02
USD 46,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	41,168	0.00
USD 34,000	Synaptics 4% 15/6/2029	28,823	0.00
USD 1,873,000	Synchrony Financial 4.875% 13/6/2025	1,804,459	0.11
USD 15,000	Talen Energy Supply 8.625% 1/6/2030	15,619	0.00
USD 13,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5.5% 15/1/2028	12,057	0.00
USD 9,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8,613	0.00
USD 2,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7.5% 1/10/2025	2,005	0.00
USD 25,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	24,589	0.00
USD 101,000	TCI Communications 7.125% 15/2/2028	108,459	0.01
USD 4,000	TEGNA 4.75% 15/3/2026	3,815	0.00
USD 72,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	66,299	0.01
USD 71,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	61,238	0.01
USD 80,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	73,727	0.01
USD 52,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	50,448	0.00
USD 2,000	Tenet Healthcare 5.125% 1/11/2027	1,907	0.00
USD 30,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	29,093	0.00
USD 31,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	30,580	0.00
USD 20,000	Tenneco 8% 17/11/2028	16,457	0.00
USD 1,213,607	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4.265% 1/8/2034	1,153,097	0.07
EUR 461,000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025	485,255	0.03
USD 272,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	256,260	0.02
USD 136,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	123,875	0.01
USD 88,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	76,782	0.01
USD 3,475,000	T-Mobile USA 2.25% 15/2/2026	3,215,024	0.20
USD 2,181,000	T-Mobile USA 2.625% 15/4/2026	2,025,848	0.13
USD 3,439,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	3,257,563	0.20
USD 66,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	62,930	0.01
USD 5,940,000	Truist Financial 6.047% 8/6/2027	5,932,665	0.37

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 40,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	41,274	0.00
USD 86,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	73,928	0.01
USD 24,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	22,033	0.00
USD 229,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	226,940	0.01
USD 28,000	Uber Technologies 7.5% 15/5/2025	28,275	0.00
USD 66,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	67,276	0.00
USD 68,000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	69,288	0.00
USD 3,191,957	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3.225% 15/8/2050	2,956,572	0.18
USD 4,151,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3.212% 15/11/2050	3,812,577	0.24
USD 101,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	89,932	0.01
USD 833,057	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15/10/2027	831,970	0.05
USD 142,230	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4.875% 15/1/2026	136,896	0.01
USD 7,000	United Natural Foods 6.75% 15/10/2028	5,835	0.00
USD 45,200,000	United States Treasury Note/Bond 3.5% 15/9/2025*	43,990,547	2.72
USD 7,060,000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15/5/2026	6,879,639	0.42
USD 61,330,000	United States Treasury Note/Bond 3.75% 15/4/2026	59,954,866	3.71
USD 80,465,000	United States Treasury Note/Bond 3.875% 15/1/2026*	78,893,418	4.88
USD 36,645,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025*	36,025,184	2.23
USD 29,680,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/2/2026	29,190,744	1.80
USD 32,190,000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/6/2026	31,790,140	1.96
USD 34,110,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/10/2025	33,698,282	2.08
USD 55,000,000	United States Treasury Note/Bond 4.5% 15/7/2026	54,853,907	3.39
USD 25,285,000	United States Treasury Note/Bond 4.5% 15/8/2026	25,145,735	1.55
USD 34,125,000	United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/3/2026	34,071,680	2.11
USD 79,000,000	United States Treasury Note/Bond 4.63% 30/6/2025	78,509,336	4.85
USD 1,164,000	UnitedHealth 4.25% 15/1/2029	1,127,958	0.07
USD 73,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	72,759	0.01
USD 59,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	57,293	0.00
USD 15,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030	14,579	0.00
USD 37,000	Univision Communications 8% 15/8/2028	37,055	0.00
USD 2,810,000	US Bancorp 5.775% 12/6/2029	2,801,480	0.17
USD 53,000	US Foods 6.25% 15/4/2025	53,151	0.00
USD 182,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	180,256	0.01
USD 2,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/9/2027	1,952	0.00
USD 51,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	50,883	0.00
USD 468,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	405,213	0.03
USD 206,000	Venture Global LNG 8.125% 1/6/2028	207,622	0.01
USD 64,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	52,544	0.00
USD 1,260,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	1,100,029	0.07
USD 150,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	139,443	0.01
USD 86,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	77,294	0.01
USD 9,000	Viasat 5.625% 15/9/2025	8,500	0.00
USD 30,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	26,811	0.00
USD 1,626,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	1,580,414	0.10
USD 1,487,000	Virginia Electric and Power 3.75% 15/5/2027	1,419,623	0.09
USD 90,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	86,719	0.01
USD 2,566,000	VMware 1.4% 15/8/2026	2,272,202	0.14
USD 2,880,000	VMware 3.9% 21/8/2027	2,711,435	0.17
USD 52,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	44,138	0.00
USD 2,800,000	WEC Energy 4.75% 9/1/2026	2,760,731	0.17
USD 3,639,000	Wells Fargo 3.526% 24/3/2028	3,384,578	0.21
USD 910,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	882,502	0.06
USD 4,960,000	Wells Fargo 5.574% 25/7/2029	4,936,211	0.31

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,975,000	Wells Fargo Bank 5.45% 7/8/2026	3,991,227	0.25
USD 540,135	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 3.477% 15/8/2050	535,288	0.03
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 3.148% 15/5/2048	1,502,259	0.09
USD 121,000	WESCO Distribution 7.125% 15/6/2025	121,629	0.01
USD 4,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	4,061	0.00
USD 503,314	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3.393% 15/8/2047	499,937	0.03
USD 22,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	21,348	0.00
USD 310,000	Williams 4.3% 4/3/2024	307,273	0.02
USD 1,053,000	Williams 5.3% 15/8/2028	1,046,594	0.07
USD 7,302,000	Williams 5.4% 2/3/2026	7,286,419	0.45
USD 93,000	Williams Scotsman International 6.125% 15/6/2025	92,227	0.01
USD 684,000	Workday 3.5% 1/4/2027	646,522	0.04
USD 154,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	143,819	0.01
USD 52,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	49,207	0.00
USD 62,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	55,567	0.00
USD 13,000	XPO Escrow Sub 7.5% 15/11/2027	13,232	0.00
USD 411,000	Zayo 4% 1/3/2027	309,075	0.02
USD 70,000	ZoomInfo Technologies/ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	59,568	0.00
		1,254,858,146	77.57
債券合計		1,544,057,486	95.42
コマーシャル・ペーパー			
カナダ			
USD 5,500,000	Suncor Energy 0% 1/11/2023	5,446,417	0.34
英国			
USD 8,000,000	NatWest Markets 0% 26/2/2024	7,772,600	0.48
米国			
USD 5,450,000	AT&T 0% 21/2/2024	5,298,248	0.33
USD 6,000,000	Enel Finance America 0% 1/9/2023	5,998,182	0.37
USD 5,000,000	General Motors Financial 0% 16/10/2023	4,962,687	0.31
USD 6,000,000	Harley-Davidson Bank 0% 14/11/2023	5,925,457	0.36
USD 2,250,000	HSBC USA 0% 24/6/2024	2,137,482	0.13
USD 5,000,000	HSBC USA 0% 22/8/2024	4,698,087	0.29
		29,020,143	1.79
コマーシャル・ペーパー合計		42,239,160	2.61
預託証券			
米国			
USD 7,000,000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	6,997,401	0.43
預託証券合計		6,997,401	0.43
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,593,294,047	98.46
投資有価証券合計		1,593,294,047	98.47
その他の純資産		24,828,531	1.53
純資産合計(米ドル)		1,618,122,578	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2023年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益／(損) (米ドル)
EUR	11,757,561	USD	12,852,649	Société Générale	20/9/2023	(86,455)
EUR	6,227,000	USD	6,814,173	UBS	20/9/2023	(52,984)
EUR	10,888,000	USD	11,948,226	JP Morgan	20/9/2023	(126,189)
EUR	601,000	USD	663,845	BNY Mellon	20/9/2023	(11,288)
EUR	271,000	USD	293,290	Morgan Stanley	20/9/2023	958
GBP	2,674,000	USD	3,401,540	Toronto-Dominion	20/9/2023	(11,598)
GBP	1,015,425	USD	1,291,424	Goldman Sachs	20/9/2023	(4,127)
GBP	23,374,000	USD	29,671,082	HSBC Bank	20/9/2023	(38,874)
GBP	2,395,000	USD	3,059,968	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(23,725)
GBP	1,800,000	USD	2,317,730	Barclays	20/9/2023	(35,794)
GBP	994,000	USD	1,269,368	RBS	20/9/2023	(9,232)
GBP	463,000	USD	583,929	BNY Mellon	20/9/2023	3,036
JPY	72,096,000	USD	496,207	Morgan Stanley	20/9/2023	(1,657)
USD	2,625,854	EUR	2,424,000	Deutsche Bank	20/9/2023	(6,091)
USD	366,986	EUR	340,000	Royal Bank of Canada	20/9/2023	(2,181)
USD	15,720,685	EUR	14,595,304	JP Morgan	20/9/2023	(126,691)
USD	4,532,911	GBP	3,610,000	JP Morgan	20/9/2023	(43,638)
USD	86,586,632	GBP	67,525,000	BNP Paribas	20/9/2023	982,336
USD	60,918,891	EUR	55,513,133	BNP Paribas	20/9/2023	643,512
USD	34,577,169	EUR	31,504,867	Toronto-Dominion	20/9/2023	369,628
USD	605,597	GBP	474,000	State Street	20/9/2023	4,687
USD	2,076,799	EUR	1,850,000	Barclays	20/9/2023	68,095
USD	1,325,840	GBP	1,038,790	HSBC Bank	20/9/2023	8,922
未実現純評価益						1,500,650
ヘッジを使用したオンショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	35,938	USD	4,981	BNY Mellon	15/9/2023	(38)
未実現純評価損						(38)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	263,977,437	USD	289,669,585	BNY Mellon	15/9/2023	(3,114,294)
USD	33,697,155	EUR	31,001,885	BNY Mellon	15/9/2023	43,865
未実現純評価損						(3,070,429)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	1,674,032	USD	1,243,697	BNY Mellon	15/9/2023	(4,624)
未実現純評価損						(4,624)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 602,855,034米ドル)						(1,574,441)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

未決済上場先物取引 2023年8月31日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益/(損) (米ドル)
(5)	EUR	Euro Bund	2023年9月	721,489	2,929
(23)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年9月	23,125,111	148,319
(101)	EUR	Euro BOBL	2023年12月	12,861,342	(44,927)
(96)	EUR	Euro Schatz	2023年12月	10,981,555	(16,144)
(59)	USD	US Long Bond (CBT)	2023年12月	7,172,187	(74,679)
40	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年12月	4,435,625	23,851
(487)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年12月	56,484,391	(440,578)
(12)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年12月	1,553,625	(28,300)
2,794	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2023年12月	569,059,216	509,383
(2,070)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年12月	221,085,702	(1,617,185)
合計				907,480,243	(1,537,331)

スワップ 2023年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 6,130,000	ファンドはCDX.NA.HY.40.V1に係る デフォルト・プロテクションを受け取り、 5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	2,554	(181,375)
CDS	USD 38,590,000	ファンドはCDX.NA.IG.40に係る デフォルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2028	(263,748)	(609,428)
合計	(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 45,631,595米ドル)				(261,194)	(790,803)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

事後通告証券契約 2023年8月31日現在

保有高	摘要	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
TBA			
	米国		
USD 16,655,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	15,372,762	0.95
USD 18,555,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	17,596,864	1.09
USD 16,215,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	15,726,308	0.97
TBA合計			
(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 48,695,934米ドル)		48,695,934	3.01