

ブラックロック・ グローバル・フレキシブル・ バランス・ファンド

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／資産複合
信託期間	無期限(設定日:2007年6月29日)
決算日	4月20日および10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) グローバル・アロケーション・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 グローバル・アロケーション・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、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行います。</p> <p>②外貨建資産については、原則が替ヘッジを行いません。</p>
主要運用対象	<p>当ファンドは、「BGF グローバル・アロケーション・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。</p> <p>「BGF グローバル・アロケーション・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>年2回の毎決算時(4月20日および10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> <p>■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。</p> <p>■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。</p> <p>■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> <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34期 運用報告書(全体版) (決算日:2024年4月22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/

NM0624U-3636153-1/94

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期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数)		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	複合インデックス	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
30期(2022年4月20日)	19,131	0	3.5	201.06	5.3	99.5	2,531
31期(2022年10月20日)	19,238	0	0.6	198.23	△ 1.4	98.9	2,221
32期(2023年4月20日)	18,999	0	△ 1.2	201.00	1.4	98.9	2,213
33期(2023年10月20日)	20,614	0	8.5	217.45	8.2	99.2	2,102
34期(2024年4月22日)	23,664	0	14.8	247.18	13.7	99.0	2,347

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 複合インデックスとは、以下の指数を円換算し、それぞれの割合で合成した指数です。

S&P500種指数36%、FTSE World Index (Ex-US) 24%、5Yr US Treasury Note 24%、FTSE Non-USD World Govt Bond Index16%。

(注3) 複合インデックスを構成する指数は、各種金融機関等で公表されており、その機関等の知的財産です。またこれらの機関等は、当ファンドの運用成果等に関する一切の責任を負いません。

(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLCの登録商標です。

(注5) FTSE World Index (Ex-US) は、FTSEインターナショナルリミテッドにより算出される指数です。FTSE®は、ロンドン証券取引所(London Stock Exchange Plc)およびフィナンシャル・タイムズ社(The Financial Times Limited)の商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSEの指数(インデックス)は、いずれもFTSEの商標であり、そのあらゆる権利はFTSEおよび/又は、その許諾者に帰属します。すべての情報は、参考のために提供されるだけです。FTSEは、FTSEの指数又はその基礎データのいかなる誤りもしくは欠落等に関して一切責任を負うものではありません。

(注6) FTSE Non-USD World Govt Bond Indexは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(注7) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参考指数)		投資信託証券 組入比率
		騰落率	複合インデックス	騰 落 率	
(期 首) 2023年10月20日	円 20,614	% -	217.45	% -	% 99.2
10月末	20,236	△ 1.8	214.76	△ 1.2	99.5
11月末	21,391	3.8	225.87	3.9	100.0
12月末	21,519	4.4	227.32	4.5	100.1
2024年1月末	22,445	8.9	236.41	8.7	99.6
2月末	23,305	13.1	244.57	12.5	100.0
3月末	24,103	16.9	251.19	15.5	100.6
(期 末) 2024年4月22日	23,664	14.8	247.18	13.7	99.0

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

(注2) 複合インデックスとは、以下の指数を円換算し、それぞれの割合で合成した指数です。

S&P500種指数36%、FTSE World Index (Ex-US) 24%、5Yr US Treasury Note 24%、FTSE Non-USD World Govt Bond Index16%。

(注3) 複合インデックスを構成する指数は、各種金融機関等で公表されており、その機関等の知的財産です。またこれらの機関等は、当ファンドの運用成果等に関する一切の責任を負いません。

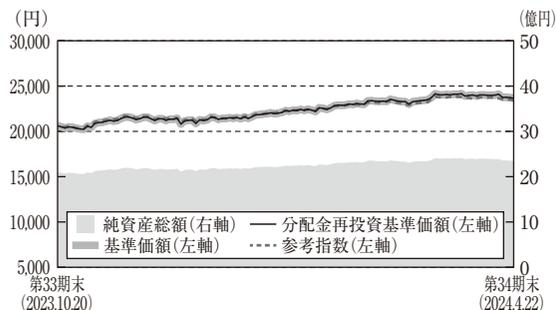
(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスLLCの登録商標です。

(注5) FTSE World Index (Ex-US) は、FTSEインターナショナルリミテッドにより算出される指数です。FTSE®は、ロンドン証券取引所 (London Stock Exchange Plc) およびフィナンシャル・タイムズ社 (The Financial Times Limited) の商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSEの指数(インデックス)は、いずれもFTSEの商標であり、そのあらゆる権利はFTSEおよび/又は、その許諾者に帰属します。すべての情報は、参考のために提供されるだけです。FTSEは、FTSEの指数又はその基礎データのいかなる誤りもしくは欠落等に関して一切責任を負うものではありません。

(注6) FTSE Non-USD World Govt Bond Indexは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

■当期中の基準価額等の推移について

(第34期:2023年10月21日～2024年4月22日)



第34期首:20,614円

第34期末:23,664円(既払分配金0円)

騰落率:14.8%(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利用する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。

* 参考指数は、複合インデックスです。

* 分配金再投資基準価額および参考指数は、前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

<グローバル株式市場>

世界の株式市場は、米国の景気見通しが改善したことや、インフレが減速しFRB(米連邦準備制度理事会)による金融政策スタンスの転換が見られた中、2024年3月末にかけて堅調に推移しましたが、その後インフレが予想を上振れ、FRBによる利下げ時期が後ろ倒しになるとの観測が高まったことや、中東情勢の緊迫化を背景に、グローバルの株式市場は期末にかけて上昇幅を一部縮小しました。

<グローバル債券市場>

債券市場では、米国インフレの鈍化が見られ始めたことから年末にかけて堅調に推移しましたが、2024年初以降は、米国の経済指標が底堅くFRBによる利下

げ時期が後ろ倒しになるとの観測が高まり、米国金利は上昇(債券価格は下落)しました。

ポートフォリオについて

<当ファンド>

当期、当ファンドは、主要投資対象である「BGF グローバル・アロケーション・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。

投資先ファンドにおける運用経過は以下の通りです。

<BGF グローバル・アロケーション・ファンド>

- 株式ポートフォリオに関しては、市場が上昇した中で、当ファンドは株式のオーバーウェイトを拡大しました。長期的な構造的トレンドを見据え、安定した収益を生み出すことができる「安定成長企業」および「優良企業」をオーバーウェイトとしているほか、航空、資本財、エネルギー、米国大手銀行などの景気循環セクターの優良企業への配分を維持しています。
- セクターのポジショニングでは、米国の大手金融機関やウェルス・マネジメント会社、および決済会社などを主に選好しています。これらの会社は、効率的な預金管理や大きな投資利益による恩恵を受ける可能性があります。また、金融機関を取り巻く規制環境は従来予想ほど悪化していません。さらに、決済会社は底堅い個人消費(決済額)やクロスボーダー取引(旅行や商取引)による恩恵を受ける可能性があります。
- テクノロジー・セクターでは、人工知能(AI)関連のソフトウェア企業や半導体企業を引き続き選好しています。ソフトウェアでは、グローバル・コマース、ソフトウェア・アズ・ア・サービス(SaaS)、サイバー・セキュリティ、およびデータ管理などに関連するプラットフォーム・プロバイダーを選好します。半導体では、主にチップ・メーカーに注目し、株式とオプションを保有しています。

- 債券ポートフォリオに関しては、2024年3月末において、ポートフォリオ全体のデュレーションは1.7年とし参照ベンチマーク対比でアンダーウェイトを継続しました。米国経済は底堅さを維持しており、今後長期金利が上昇する可能性があると考えます。
- クレジットについては、インカム収入の獲得を企図して保有を継続しました。
- 現金等については、株式やクレジット資産に資金を振り向ける中で低位の保有としています。

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・バンド・ファンド>

主に米ドル建ての短期の投資適格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は+14.8%と上昇しました。当期、主要投資対象ファンドである「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」が+12.4%と上昇したことに加え、当該ファンドは米ドル建てのため、米ドルが円に対して上昇したことが更なるプラス要因となりました。

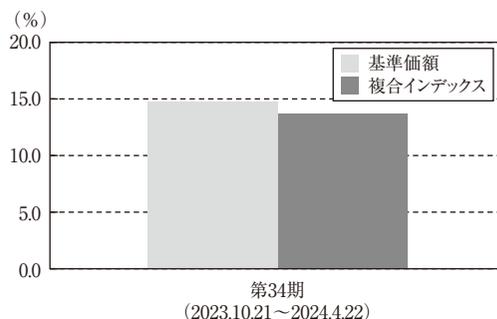
■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
BGF グローバル・アロケーション・ファンド	12.4%

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。下記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

■基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)



分配金について

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して見送り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います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期
	2023年10月21日 ～ 2024年4月22日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	13,663

(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

<当ファンド>

引き続き主要投資対象ファンドである「BGF グローバル・アロケーション・ファンド」を高位に組入れる運用を行う方針です。

投資先ファンドにおける市場見通しおよび今後の運

用方針は以下の通りです。

<BGF グローバル・アロケーション・ファンド>

最近の米国の経済指標は底堅さを維持しています。インフレ指標は予想を上回っているものの、堅調な労働市場、予想を上回る生産性、および予想を上回る賃金の伸びなどが経済を下支えしています。名目国内総生産(GDP)成長率が4.5～5.0%と高水準で推移していることから、企業業績も2024年に拡大すると予想されます。コンセンサス予想によると、S&P 500構成企業の2024年の収益の伸びは13%以上となり、2025年も12%以上になると見込まれています。これらは妥当な予想であると考えられますが、米国の最近の経済指標を踏まえると、保守的な予想であるとも言えます。米国以外では、日本経済が長年のデフレから脱却しつつある中で、当ファンドは引き続き日本を選好しています。一方で、欧州と中国についてはアンダーウェイトとしています。日本では堅調な内需や企業改革を背景に株価が上昇しています。また、オートメーション(自動化)や人工知能(AI)サプライチェーンに特化した企業の株価も堅調に推移しています。株価は2024年に上昇基調を維持する可能性があると考えられますが、昨年とは異なる展開になる可能性もあります。株式については、安定成長企業や優良企業を引き続き選好しており、これらの企業は景気減速局面でアウトパフォームする可能性があると考えられます。その他では、景気減速に耐えうると考えられる景気敏感セクターへの配分を増やしました。債券については、デュレーションのポジションを減らす一方で、米国のイールドカーブの中期ゾーンへの配分を維持しています。米国は巨額の財政赤字を補填するために大量の国債を発行する必要があることから、米長期国債については慎重な姿勢を維持しています。一方、米国債を除く他の債券セクターは、ここ15年間と比べて非常に魅力的な名目利回りを提供しています。当ファンドは、社債、証券化資産、および新興国

のソブリン債への配分を維持しており、これらが債券配分の大部分を占めています。また、リスク許容度を踏まえ、デュレーションを含む様々な手段でポートフォリオ・ヘッジを行っており、デリバティブを保有するとともに、一定のキャッシュ比率と為替ポジションを維持しています。

<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34期		項目の概要
	(2023.10.21～2024.4.22)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	190	0.851	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22,311円です。
(投信会社)	(93)	(0.417)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(93)	(0.417)	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)	(4)	(0.017)	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	21	0.095	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)	(9)	(0.039)	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)	(12)	(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	211	0.946	

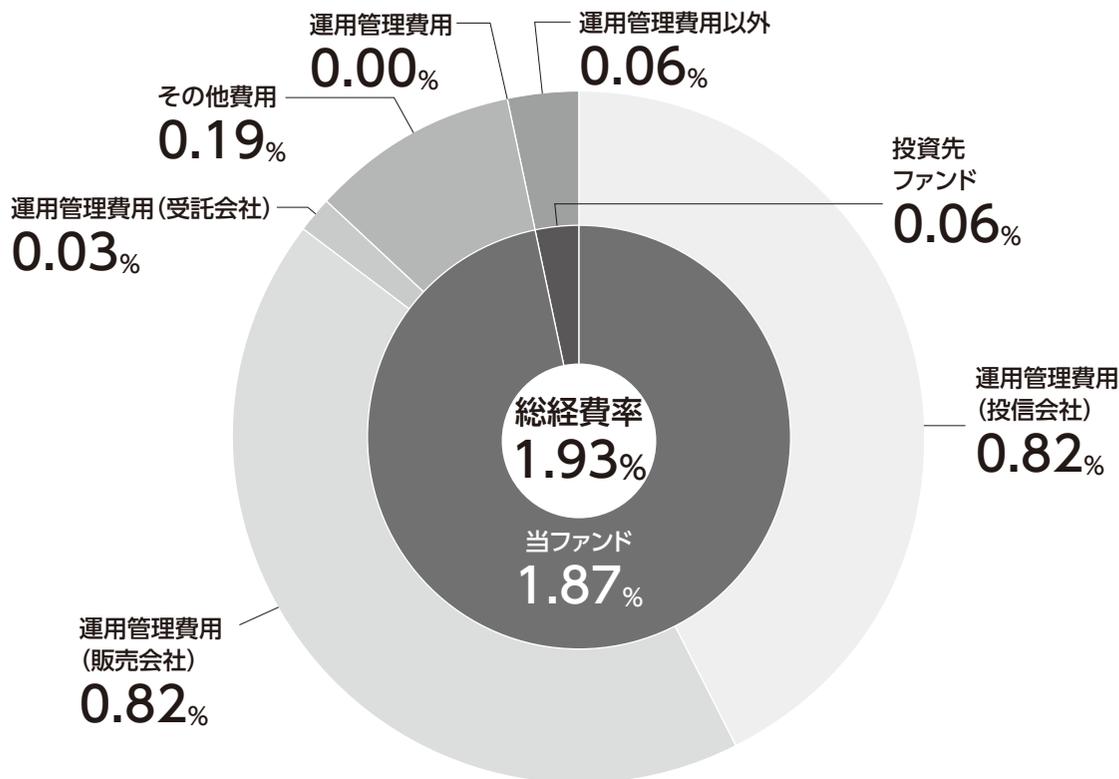
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(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1.93%です。

総経費率(①+②+③)	1.93%
①当ファンドの費用の比率	1.87%
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10月21日から2024年4月22日まで)

投資信託証券

外国	アメリカ	銘柄	買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
		BGF グローバル・アロケーション・ファンド(ルクセンブルグ)	千口	千米ドル	千口	千米ドル
			-	-	6	602

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2023年10月21日から2024年4月22日まで)

投資信託証券

買 付			売 付		
銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額
-	千口	千円	BGF グローバル・アロケーション・ファンド (ルクセンブルグ)	千口	千円
	-	-		6	91,490

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(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10月21日から2024年4月22日まで)

当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10月21日から2024年4月22日まで)

上期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 期 末			比 率
	口 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
BGF グローバル・アロケーション・ファンド	千口	千米ドル	百万円	%
	151	14,857	2,299	98.0
BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	9	152	23	1.0
合 計	160	15,009	2,323	99.0

(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) 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4月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 証 券	2,323,513	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	45,605	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,369,118	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(2,323,513千円)の投資信託財産総額(2,369,118千円)に対する比率は、98.1%です。

(注2) 外貨建資産は、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。換算レートは、1米ドル=154.80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

2024年4月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,369,118,984 円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	45,605,443
投 資 証 券 (評 価 額)	2,323,513,541
(B) 負 債	21,428,200
未 払 解 約 金	1,084,555
未 払 信 託 報 酬	19,095,620
そ の 他 未 払 費 用	1,248,025
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,347,690,784
元 本	992,098,459
次 期 繰 越 損 益 金	1,355,592,325
(D) 受 益 権 総 口 数	992,098,459 口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	23,664 円

(注記事項)

期首元本額	1,019,953,958 円
期中追加設定元本額	19,391,958 円
期中一部解約元本額	47,247,457 円

■損益の状況

自 2023年10月21日 至 2024年4月22日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	320,379,462 円
売 買 益	330,131,707
売 買 損	△ 9,752,245
(B) 信 託 報 酬 等	△ 21,233,405
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	299,146,057
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	660,834,799
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	395,611,469
(配 当 等 相 当 額)	(374,546,638)
(売 買 損 益 相 当 額)	(21,064,831)
(F) 合 計 (C + D + E)	1,355,592,325
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	1,355,592,325
追 加 信 託 差 損 益 金	395,611,469
(配 当 等 相 当 額)	(374,546,638)
(売 買 損 益 相 当 額)	(21,064,831)
分 配 準 備 積 立 金	959,980,856

(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。

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第34期計算期末における、費用控除後の配当等収益(0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(299,146,057円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(21,064,831円)、収益調整金(その他収益調整金)(374,546,638円)、分配準備積立金(660,834,799円)により、分配対象収益は1,355,592,325円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。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
グローバル・アロケーション・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)グローバル・アロケーション・ファンド(以下BGF グローバル・アロケーション・ファンド)はブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(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 グローバル・アロケーション・ファンド	
商 品 分 類	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	トータル・リターンを最大化することを目指します。ファンドは、世界の株式、債券および短期証券に特に制限なく投資します。通常の市況では、純資産の70%以上を国や企業が発行する有価証券に投資します。ファンドは、割安と判断される有価証券へ投資します。ファンドは、小規模企業および新興国の成長企業の株式に、また債券の投資部分においてはハイ・イールド債券にも投資することができます。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	1997年1月3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・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー ブラックロック(シンガポール)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。

損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドは、BGF グローバル・アロケーション・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 グローバル・ アロケーション・ファンド 米ドル
期首純資産	15,096,811,718
収益	
現金および現金同等物に係る利息	7,871,309
債券利息、源泉徴収税控除後	259,728,067
スワップ利息	33,911,443
差金決済契約に係る受取利息	6,085,802
短期金融商品預け入れによる利息	9,485,987
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	244,153
配当金、源泉徴収税控除後	132,026,774
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	21,162
有価証券貸付による収益	3,580,255
投資運用報酬リベート	27,921
その他の払戻し	60,690
収益合計	453,043,563
費用	
スワップ利息	20,617,760
差金決済契約に係る支払配当金、源泉徴収税控除後	4,527,005
年間サービス費用	26,727,093
ローン・コミットメント・フィー	45,211
保管および預託報酬	1,794,818
販売報酬	14,088,725
税金	6,379,364
投資運用報酬	181,432,387
費用合計	255,612,363
純利益	197,431,200
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(32,087,780)
事後通告証券契約	(19,687,135)
差金決済契約	(25,171,502)
上場先物取引	(66,106,311)
オプション／スワップション契約	68,578,153
スワップ取引	(129,249,995)
先渡為替予約	1,249,433
その他の取引に係る外国通貨	14,730,566
当期実現純評価損	(187,744,571)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	708,298,430
事後通告証券契約	1,164,722
差金決済契約	(1,568,236)
上場先物取引	32,457,417
オプション／スワップション契約	7,951,698
スワップ取引	38,830,171
先渡為替予約	53,364,185
その他の取引に係る外国通貨	1,598,251
当期末実現評価益／(損)の純変動	842,096,638
運用成績による純資産の増加	851,783,267
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	1,844,669,591
投資証券買戻しによる正味支払額	(3,309,238,264)
資本の変動による純資産の(減少)／増加	(1,464,568,673)
配当金宣言額	(28,749,416)
期末純資産	14,455,276,896

BGF グローバル・アロケーション・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			
	アイルランド		
150,000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	6,676,500	0.05
1,474,946	iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF	13,160,206	0.09
ファンド合計		19,836,706	0.14
普通/優先株式およびワラント			
	オーストラリア		
63,078	AGL Energy*	453,125	0.00
274,257	BHP	7,967,622	0.05
17,503	CSL	3,101,173	0.02
300,913	Endeavour*	1,072,043	0.01
711,593	Medibank Pvt	1,687,024	0.01
367,508	Metcash*	887,941	0.01
332,908	Origin Energy	1,878,239	0.01
270,012	Qantas Airways	1,033,663	0.01
595,950	South32	1,312,494	0.01
		19,393,324	0.13
	ベルギー		
34,352	KBC	2,263,782	0.02
7,287	UCB	654,300	0.00
		2,918,082	0.02
	バミューダ		
359,304	Bunge*	41,208,576	0.29
7,440	Credicorp	1,065,296	0.01
162,700	Hongkong Land	577,585	0.00
151,362	Invesco	2,395,304	0.02
132,000	Orient Overseas International	1,770,552	0.01
		47,017,313	0.33
	ブラジル		
2,356,691	Ambev	6,725,431	0.04
117,988	Bradespar	544,818	0.00
1,455,060	Cia Energetica de Minas Gerais	3,688,718	0.03
3,381,184	Cielo	2,594,136	0.02
134,498	Cosan	490,565	0.00
567,764	Embraer	2,228,725	0.02
42,672	Engie Brasil Energia	367,146	0.00
511,132	Lojas Renner	1,668,212	0.01
138,628	Petroreconcavo	651,942	0.01
204,853	Telefonica Brasil	1,754,220	0.01
120,978	Transmissora Alianca de Energia Eletrica	848,372	0.01
		21,562,285	0.15
	カナダ		
279,043	Barrick Gold	4,564,576	0.03
59,886	Brookfield*	2,050,194	0.01
594,289	Cameco	22,113,494	0.15
63,259	Canadian National Railway	7,179,460	0.05
2,661,062	Enbridge*	94,179,642	0.65
8,883	George Weston	992,926	0.01
196,385	Lions Gate Entertainment	1,520,020	0.01
10,698	Loblaw	940,068	0.01
65,012	Metro*	3,332,155	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 (%)
カナダ(続き)			
147,133	Pembina Pipeline*	4,612,392	0.03
92,053	Rogers Communications*	3,792,057	0.03
78,188	Royal Bank of Canada	7,123,196	0.05
34,104	Shopify	2,211,825	0.02
929,135	Suncor Energy*	31,613,144	0.22
161,385	Teck Resources	6,750,735	0.05
42,052	TELUS	745,080	0.00
		193,720,964	1.34
ケイマン諸島			
522,600	Alibaba	6,010,284	0.04
96,800	ASMPT	969,484	0.01
263,350	Baidu	4,680,747	0.03
262,500	CK Asset	1,449,227	0.01
107,600	JD Health International*	580,326	0.00
79,278	JD.com	1,301,930	0.01
64,680	Lavoro (Wts 27/12/2027)	50,450	0.00
187,600	Li Auto	3,865,389	0.03
168,430	Meituan	2,759,571	0.02
4,194,945	Microport Cardioflow Medtech	1,000,200	0.01
513,000	SITC International	956,277	0.01
701,900	Tencent	29,085,575	0.20
53,900	Trip.com	2,126,318	0.02
473,000	Want Want China	313,002	0.00
1,532,000	WH	789,150	0.01
		55,937,930	0.40
中国			
2,930,000	Agricultural Bank of China	1,004,937	0.01
10,100	Anhui Gujing Distillery	168,003	0.00
1,188,000	BYD	37,232,086	0.26
4,307,000	China Construction Bank	2,306,446	0.01
365,500	China Merchants Bank	1,444,668	0.01
7,510,000	China Tower	727,734	0.01
170,600	COSCO SHIPPING Energy Transportation	310,700	0.00
270,200	Dongfang Electric	623,194	0.00
3,307,000	Industrial & Commercial Bank of China	1,517,944	0.01
103,700	JA Solar Technology	396,678	0.00
1,659,900	LONGi Green Energy Technology	6,057,486	0.04
321,840	Ningbo Deye Technology	4,079,097	0.03
117,400	Nongfu Spring*	659,376	0.01
2,316,000	PetroChina*	1,671,376	0.01
144,450	Pharmaron Beijing*	337,045	0.00
270,000	Shanghai Fosun Pharmaceutical	635,499	0.00
35,100	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory	1,167,772	0.01
566,568	Trina Solar	2,646,192	0.02
		62,986,233	0.43
キュラソー			
165,799	Schlumberger	9,755,613	0.07
デンマーク			
1,688	AP Moller - Maersk*	3,097,837	0.02
26,348	DSV	4,981,188	0.04
189,102	Novo Nordisk	35,180,523	0.24

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(続き)		
11,472	Novozymes*	497,902	0.00
		43,757,450	0.30
	フィンランド		
32,678	Elisa*	1,611,731	0.01
32,347	Kesko	634,162	0.01
71,207	Kone	3,279,504	0.02
		5,525,397	0.04
	フランス		
344,387	Accor	12,412,355	0.09
1,274,816	BNP Paribas	83,055,487	0.57
144,479	Bolloré	847,243	0.01
62,608	Carrefour	1,202,974	0.01
960,680	Cie de Saint-Gobain	62,568,379	0.43
106,802	Dassault Systemes	4,252,587	0.03
260,016	EssilorLuxottica*	49,616,296	0.34
4,908	Hermès International	10,209,985	0.07
75,466	Kering*	40,811,329	0.28
68,690	La Française des Jeux SAEM	2,495,093	0.02
21,440	L'Oréal	9,546,407	0.07
81,308	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton*	70,042,493	0.48
3,542	Remy Cointreau*	555,296	0.00
317,167	Sanofi	34,242,269	0.24
13,755	Schneider Electric	2,379,987	0.02
33,787	SCOR*	1,055,723	0.01
101,275	Société Générale*	2,894,731	0.02
7,892	Teleperformance*	1,096,414	0.01
332,221	TotalEnergies	20,970,492	0.14
335,990	Vinci	37,779,967	0.26
		448,035,507	3.10
	ドイツ		
604,248	Bayer	33,381,929	0.23
90,709	Bayerische Motoren Werke	9,607,203	0.07
10,881	Brenntag*	886,813	0.01
11,111	Carl Zeiss Meditec	1,121,581	0.01
1,097,322	Commerzbank	12,149,402	0.08
30,505	Continental	2,279,008	0.01
151,017	Dr Ing hc F Porsche*	16,704,015	0.11
50,846	Fresenius	1,639,508	0.01
79,385	LANXESS*	2,517,532	0.02
676,218	Mercedes-Benz	49,822,816	0.34
34,612	Merck	6,267,449	0.04
636,022	SAP	89,692,573	0.62
49,622	SAP	7,000,176	0.05
16,405	Scout24	1,132,698	0.01
485,115	Siemens	73,337,875	0.51
62,723	Symrise	6,577,812	0.04
849,909	Telefonica Deutschland*	1,628,898	0.01
40,938	United Internet*	787,043	0.01
33,039	Volkswagen	4,071,333	0.03
120,519	Zalando	3,798,477	0.03
		324,404,141	2.24
	ガーンジー		
480,079	Genius Sports*	3,202,127	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 (%)
	香港		
3,460,600	AIA	31,415,968	0.22
146,500	BOC Hong Kong	407,205	0.00
21,500	BYD Electronic International	99,646	0.00
66,800	Hang Seng Bank	851,717	0.01
826,000	Lenovo	934,163	0.01
221,500	MTR	924,920	0.00
		<hr/>	<hr/>
		34,633,619	0.24
	インド		
29,061	Bajaj Auto	1,619,612	0.01
19,433	Eicher Motors	783,224	0.01
81,264	HCL Technologies	1,150,597	0.01
439,628	Indian Oil	473,157	0.00
53,648	Kotak Mahindra Bank	1,139,723	0.01
17,896	Tata Consultancy Services	725,643	0.00
		<hr/>	<hr/>
		5,891,956	0.04
	インドネシア		
3,776,800	Bank Central Asia	2,275,255	0.02
	アイルランド		
48,003	Allegion	5,479,062	0.04
6,644	Aon	2,229,461	0.02
27,705	Johnson Controls International	1,642,906	0.01
77,274	Kingspan	6,522,601	0.04
19,320	Linde	7,511,809	0.05
63,858	Seagate Technology	4,477,084	0.03
7,881	Trane Technologies	1,624,432	0.01
33,039	Willis Towers Watson	6,899,534	0.05
		<hr/>	<hr/>
		36,386,889	0.25
	イスラエル		
186,456	Nice*	36,897,778	0.26
	イタリア		
306,459	Enel*	2,073,415	0.02
105,441	FinecoBank Banca Fineco	1,458,571	0.01
11,386,019	Intesa Sanpaolo*	30,771,839	0.21
359,871	Snam*	1,868,257	0.01
1,085,116	UniCredit*	26,789,266	0.19
		<hr/>	<hr/>
		62,961,348	0.44
	日本		
6,700	AGC	234,389	0.00
50,400	Alfresa*	860,030	0.01
84,300	Aozora Bank*	1,650,759	0.01
348,200	Astellas Pharma	5,275,831	0.04
15,800	Bank of Kyoto	910,456	0.01
115,100	BayCurrent Consulting*	3,947,839	0.03
700	Capcom	29,422	0.00
47,900	Coca-Cola Bottlers Japan	622,204	0.00
10,900	East Japan Railway*	613,929	0.00
1,329,500	FANUC	37,777,801	0.26
19,000	Heiwa	288,988	0.00
924,700	Honda Motor*	29,755,157	0.21
256,052	Hoya	28,302,288	0.20
23,800	Ito En	701,681	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)		
2,466,600	Japan Airlines	50,646,697	0.35
330,100	Japan Post Bank*	2,639,129	0.02
14,000	Jeol*	445,418	0.00
41,300	Kakaku.com*	490,271	0.00
25,900	Kamigumi*	581,600	0.00
66,700	Kawasaki Heavy Industries*	1,706,348	0.01
135,500	Kawasaki Kisen Kaisha*	4,529,801	0.03
33,600	Kewpie*	557,835	0.00
139,319	Keyence	57,689,354	0.40
465,900	Komatsu*	13,229,006	0.09
197,300	Kose*	16,320,738	0.11
13,300	Kyocera	680,493	0.01
260,800	Lixil*	3,255,651	0.02
27,300	Mani	354,430	0.00
303,400	Mazda Motor*	3,181,284	0.02
35,700	Medipal*	609,920	0.00
34,100	MEIJI*	852,063	0.01
46,400	Mitsubishi Heavy Industries	2,625,487	0.02
667,400	Mitsubishi Motors*	2,615,169	0.02
8,881,700	Mitsubishi UFJ Financial*	70,704,799	0.49
793,400	Mitsui*	29,487,528	0.20
118,400	Mitsui OSK Lines*	3,269,560	0.02
22,900	Money Forward*	859,406	0.00
29,900	NET One Systems	584,068	0.00
154,200	Nihon M&A Center*	854,692	0.01
126,100	Nintendo*	5,407,060	0.04
270,000	Nippon Yusen	7,178,818	0.05
175,800	Nomura Research Institute*	5,033,855	0.04
5,100	Oracle Japan	354,877	0.00
13,100	Otsuka	582,153	0.00
207,400	Rakus	3,364,548	0.02
78,000	Santen Pharmaceutical	722,870	0.01
112,400	Sega Sammy*	2,236,772	0.02
55,600	SG*	800,400	0.01
6,600	Shimano*	966,371	0.01
109,200	Shin-Etsu Chemical*	3,480,982	0.03
99,100	Shiseido	4,011,328	0.03
57,200	Skylark	797,407	0.01
70,800	SMC*	34,199,863	0.24
80,100	SoftBank*	915,241	0.01
39,900	Stanley Electric*	698,465	0.00
18,300	Suzuken*	540,655	0.00
564,700	Systemex	29,947,594	0.21
158,700	Takeda Pharmaceutical*	4,894,938	0.03
100,800	Terumo*	3,043,553	0.02
40,300	Tokyo Electron*	5,948,977	0.04
50,700	TOTO*	1,385,834	0.01
2,439,600	Toyota Motor*	41,980,057	0.29
10,000	Yakult Honsha*	522,322	0.00
223,900	ZOZO*	4,457,166	0.03
		543,213,627	3.76
	ジャージー		
297,414	Aptiv	30,297,564	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(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ジャージー(続き)		
67,045	Experian	2,365,261	0.02
13,937	Ferguson*	2,283,491	0.02
7,005,143	Glencore	37,398,413	0.26
		<hr/>	<hr/>
		72,344,729	0.51
	リベリア		
52,049	Royal Caribbean Cruises*	5,165,863	0.04
		<hr/>	<hr/>
	ルクセンブルグ		
40,249	ArcelorMittal	1,076,415	0.01
		<hr/>	<hr/>
	メキシコ		
158,614	Fomento Economico Mexicano	1,864,548	0.01
53,742	Grupo Aeroportuario del Sureste	1,557,268	0.01
231,625	Grupo Financiero Banorte	2,049,063	0.02
1,831,992	Wal-Mart de Mexico	7,479,911	0.05
		<hr/>	<hr/>
		12,950,790	0.09
	オランダ		
291,137	ABN AMRO Bank*	4,341,601	0.03
16,263	Adyen	13,746,802	0.10
154,386	ASML	102,828,467	0.71
31,782	BE Semiconductor Industries*	3,703,338	0.03
315,555	CNH Industrial	4,377,071	0.03
55,667	Ferrari	17,852,953	0.12
6,586,334	ING Groep*	94,567,671	0.65
120,519	Koninklijke Vopak	4,339,809	0.03
70,943	LyondellBasell Industries	7,051,025	0.05
15,374	NXP Semiconductors	3,171,195	0.02
170,215	STMicroelectronics	8,113,650	0.06
		<hr/>	<hr/>
		264,093,582	1.83
	ノルウェー		
279,829	Equinor	8,634,883	0.06
		<hr/>	<hr/>
	サウジアラビア		
10,393	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services	673,351	0.01
51,208	Saudi Arabian Oil	476,495	0.00
144,560	Saudi Telecom	1,534,001	0.01
		<hr/>	<hr/>
		2,683,847	0.02
	シンガポール		
21,100	DBS*	519,807	0.00
1,971,100	Genting Singapore	1,275,945	0.01
227,100	Keppel	1,165,982	0.01
388,100	NETLINK NBN TRUST	248,356	0.00
96,100	Oversea-Chinese Banking	892,241	0.01
9,519,143	Seatrium	1,021,130	0.01
227,900	Singapore Airlines*	1,158,288	0.01
394,400	Singapore Technologies Engineering	1,111,673	0.00
777,700	Singapore Telecommunications	1,369,318	0.01
346,000	Wilmar International	967,572	0.01
		<hr/>	<hr/>
		9,730,312	0.07
	南アフリカ		
17,944	Anglo American Platinum*	628,814	0.00
17,039	Capitec Bank	1,439,872	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 (%)
	南アフリカ(続き)		
64,510	Kumba Iron Ore*	1,417,915	0.01
		3,486,601	0.02
	韓国		
142,824	Amorepacific	14,468,798	0.10
10,204	DB Insurance	630,729	0.00
16,282	Fila	466,872	0.00
71,077	GS Engineering & Construction	781,350	0.01
22,132	Hana Financial	662,244	0.01
558,543	HD Hyundai Infracore	4,449,750	0.03
6,739	HD Korea Shipbuilding & Offshore Engineering	630,690	0.00
28,565	Hyundai Marine & Fire Insurance	653,748	0.00
129,009	KB Financial	5,280,414	0.04
27,958	Meritz Financial	1,157,028	0.01
22,304	NCSOFT	4,243,961	0.03
13,569	Samsung C&T	1,074,843	0.01
123,576	Samsung Electronics	6,254,764	0.05
18,520	Samsung Fire & Marine Insurance	3,453,891	0.02
283,260	SK Hynix	26,102,567	0.18
		70,311,649	0.49
	スペイン		
7,049	Aena SME	1,113,517	0.01
1,810,699	Cellnex Telecom	69,818,658	0.48
36,117	Endesa*	758,033	0.01
83,093	Industria de Diseno Textil	3,204,880	0.02
		74,895,088	0.52
	スウェーデン		
567,746	Assa Abloy	12,890,968	0.09
80,810	Atlas Copco*	1,078,529	0.01
74,763	Epiroc	1,443,280	0.01
24,961	Getinge	437,134	0.00
35,192	Industrivarden	926,798	0.01
579,291	Nibe Industrier	4,355,339	0.03
127,369	SKF	2,092,803	0.01
762,363	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3,938,567	0.03
1,802,376	Telia*	3,661,176	0.02
		30,824,594	0.21
	スイス		
653,085	Alcon	54,866,857	0.38
530	Barry Callebaut*	929,531	0.01
261,334	Chubb	52,867,868	0.36
2,828	Cie Financiere Richemont (Wts 22/11/2023)	2,674	0.00
198,920	Clariant	3,315,299	0.02
88,031	Coca-Cola HBC	2,572,207	0.02
4,645	DSM-Firmenich*	429,573	0.00
4,237	Flughafen Zurich*	879,821	0.00
2,313	Geberit	1,201,009	0.01
17,437	Kuehne + Nagel International*	5,249,604	0.04
50,518	Lonza	28,118,652	0.19
1,082,954	Nestle*	130,880,118	0.91
134,695	Novartis	13,664,570	0.09
83,557	Roche	24,800,999	0.17
1,934	Swisscom*	1,181,147	0.01
290,037	TE Connectivity	38,548,818	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 (%)
	スイス(続き)		
838,996	Transocean*	6,896,547	0.05
		366,405,294	2.53
	台湾		
312,000	ASE Technology	1,156,044	0.01
695,000	Chunghwa Telecom	2,531,516	0.02
631,000	Compal Electronics	632,060	0.00
1,748,000	Eva Airways	1,728,980	0.01
423,000	Far EasTone Telecommunications	937,741	0.01
117,000	Lite-On Technology	503,320	0.01
64,000	MediaTek	1,416,795	0.01
488,000	Quanta Computer	3,884,505	0.03
291,000	Taiwan Mobile	851,622	0.00
3,081,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	53,113,139	0.37
536,000	Wistron	1,969,194	0.01
29,000	Wiwynn	1,420,563	0.01
		70,145,479	0.49
	英国		
63,393	Anglo American	1,704,438	0.01
243,045	AstraZeneca	16,723,926	0.11
307,436	AstraZeneca	41,910,623	0.29
605,628	Auto Trader	4,675,441	0.03
9,982,733	BAE Systems	128,039,739	0.89
12,619,428	Barclays	23,774,768	0.16
546,271	BP	3,396,270	0.02
71,393	British American Tobacco	2,395,570	0.02
95,935	Burberry	2,690,057	0.02
1,111,214	Compass	28,338,278	0.20
563,725	Direct Line Insurance	1,161,592	0.01
385,936	Dowlais*	558,213	0.00
144,124	GSK	2,557,418	0.02
25,763	Hikma Pharmaceuticals	718,486	0.00
436,055	Kingfisher	1,296,787	0.01
331,651	Legal & General*	927,020	0.01
9,036,287	Lloyds Banking	4,874,611	0.03
83,312	London Stock Exchange	8,626,262	0.06
44,434	National Grid	561,916	0.00
1,004,155	NatWest	2,960,805	0.02
163,418	Pearson	1,752,133	0.01
892,855	RELX	29,223,790	0.20
526,074	Shell*	32,706,021	0.23
2,840,288	Shell*	88,317,421	0.61
102,061	Spirax-Sarco Engineering	13,151,236	0.09
85,213	Standard Chartered*	775,586	0.01
1,565,419	Unilever	80,894,204	0.56
		524,712,611	3.62
	米国		
64,979	3M	6,994,989	0.05
624,922	Abbott Laboratories	65,241,857	0.45
119,520	AbbVie	17,761,867	0.12
88,011	Activision Blizzard	8,097,012	0.05
22,265	Adobe	12,417,636	0.09
340,210	Advanced Micro Devices	36,538,554	0.25
169,728	Air Products and Chemicals	50,197,056	0.35

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)		
158,358	Albemarle*	31,489,488	0.22
53,622	Allstate	5,839,972	0.04
1,818,994	Alphabet	250,711,943	1.73
1,363,958	Amazon.com	187,898,855	1.30
60,461	American Airlines*	892,404	0.01
37,868	American International	2,212,627	0.01
248,256	American Tower	45,314,168	0.31
9,759	Amgen	2,507,966	0.01
68,773	ANSYS	21,835,427	0.15
25,128	APA	1,099,601	0.01
1,465,863	Apple	275,670,196	1.91
222,776	Applied Materials	33,850,813	0.23
579,723	Archer-Daniels-Midland	46,569,148	0.33
15,208	Assurant	2,114,368	0.01
461,453	Astra Space	122,055	0.00
155,036	AT&T	2,296,083	0.02
58,775	Atlas Energy Solutions	1,247,793	0.01
21,477	Atlassian	4,416,316	0.03
40,626	Autodesk	9,033,597	0.06
1,803	AutoZone	4,612,363	0.03
17,835	Ball*	969,867	0.01
16,068	Berkshire Hathaway	5,806,012	0.04
11,914	Boeing	2,737,361	0.02
6,099	Booking	18,921,538	0.13
477,407	Booz Allen Hamilton	54,830,194	0.38
1,468,614	Boston Scientific	79,980,718	0.55
126,908	Cadence Design Systems	30,643,206	0.21
73,972	California Resources*	4,114,323	0.03
20,223	Campbell Soup*	856,849	0.01
77,170	Cano Health (Wts 3/6/2026)	3,936	0.00
100,904	Cano Health (Wts 6/7/2025)	5,146	0.00
18,994	Cencora	3,375,804	0.02
77,713	Centene	4,892,033	0.03
452,611	CF Industries	34,801,260	0.24
69,823	Charter Communications*	30,576,190	0.21
11,965	Chesapeake Energy*	1,054,715	0.01
28,253	Chevron	4,543,082	0.03
4,185	Chipotle Mexican Grill	8,127,270	0.06
29,253	Cigna	8,227,406	0.06
9,339	Cintas	4,725,720	0.03
33,614	Citigroup	1,395,989	0.01
387,410	Citigroup Capital XIII	11,335,616	0.08
16,654	Clorox	2,602,188	0.02
23,784	CME	4,816,974	0.03
85,038	Coca-Cola	5,132,894	0.04
75,238	Colgate-Palmolive	5,560,840	0.04
691,806	Comcast	32,694,752	0.23
430,078	ConocoPhillips	51,106,169	0.35
47,292	Constellation Brands	12,310,581	0.09
112,513	Costco Wholesale	61,218,323	0.42
106,727	Crowdstrike	17,156,365	0.11
15,138	Crown*	1,406,926	0.01
4,087	Cummins	947,775	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)		
107,261	CVS Health	7,142,510	0.05
249,206	Datadog	23,903,840	0.17
46,589	Deere	19,288,312	0.13
20,895	Dell Technologies	1,175,135	0.01
865,047	Delta Air Lines	37,153,769	0.25
163,747	Dexcom	16,867,578	0.12
34,628	DR Horton	4,107,227	0.03
47,925	Duke Energy*	4,317,563	0.03
372,647	Dynatrace	18,047,294	0.13
57,932	eBay	2,597,671	0.02
36,447	Edison International*	2,557,122	0.02
355,759	Edwards Lifesciences	27,596,226	0.19
25,910	Electronic Arts	3,123,710	0.02
128,209	Element Solutions*	2,666,747	0.02
110,903	Eli Lilly	60,885,747	0.42
50,722	EOG Resources	6,490,894	0.04
130,945	EQT*	5,616,231	0.04
22,290	Equitrans Midstream*	215,321	0.00
109,375	Equity Residential	7,133,437	0.05
31,564	Estee Lauder	5,211,532	0.04
114,734	Eversource Energy	7,410,669	0.05
92,280	EVgo (Wts 15/9/2025)	53,476	0.00
11,983	Expedia	1,302,552	0.01
27,984	Exxon Mobil	3,101,747	0.02
226,251	F5	36,937,738	0.26
4,048	FactSet Research Systems	1,763,147	0.01
4,785	Fair Isaac	4,352,532	0.03
55,441	Fastenal	3,218,905	0.02
104,131	Fidelity National Information Services	5,863,617	0.05
1,875	First Citizens BancShares	2,556,187	0.02
22,836	First Solar	4,306,641	0.03
110,909	Floor & Decor	11,205,136	0.08
629,942	Ford Motor	7,653,795	0.05
395,642	Fortinet	24,233,073	0.17
1,034,860	Fortive*	81,940,215	0.57
982,950	Freeport-McMoRan	39,612,885	0.27
37,660	General Mills*	2,562,763	0.02
490,401	General Motors	16,448,050	0.11
89,054	Gilead Sciences	6,842,910	0.04
19,240	Goldman Sachs	6,353,240	0.05
182,670	Green Plains*	5,693,824	0.04
40,053	Halliburton	1,557,261	0.01
69,306	Hartford Financial Services	4,983,101	0.03
19,944	HCA Healthcare	5,581,927	0.04
273,470	Healthpeak Properties	5,659,461	0.04
3,217	Hershey	696,255	0.00
89,191	Hewlett Packard Enterprise	1,541,666	0.01
208,391	Hilton Worldwide	31,283,657	0.22
79,631	Hippo (Wts 2/8/2026)	1,513	0.00
179,100	Humana	84,490,425	0.58
7,829	Illinois Tool Works*	1,952,240	0.02
158,732	Informatica*	3,317,499	0.02
236,452	Ingersoll Rand	16,527,995	0.11

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)		
30,530	Innovid (Wts 31/12/2027)	2,137	0.00
7,326	Insulet	1,438,021	0.01
21,452	International Flavors & Fragrances	1,523,736	0.01
79,417	International Paper	2,772,447	0.02
41,837	Intuit	22,635,072	0.16
129,207	Intuitive Surgical	41,366,913	0.29
265,743	Johnson & Johnson	42,978,615	0.30
477,655	JPMorgan Chase	70,602,186	0.49
19,322	Kellogg	1,182,120	0.01
1,008,529	Kenvue	23,377,702	0.16
146,156	Keurig Dr Pepper	4,941,534	0.03
60,554	Keysight Technologies	8,059,132	0.06
27,945	Kimberly-Clark	3,625,025	0.03
137,330	Kinder Morgan	2,384,736	0.02
52,150	KLA	26,155,832	0.18
13,782	Kraft Heinz	456,873	0.00
36,256	Kroger	1,681,916	0.01
6,277	Lam Research	4,362,954	0.03
93,167	Las Vegas Sands	5,156,794	0.04
68,942	Lennar	8,197,893	0.06
88,538	Liberty Media-Liberty Live	2,970,450	0.02
92,150	Liberty Media-Liberty Live*	3,064,909	0.02
354,155	Liberty Media-Liberty SiriusXM	8,687,422	0.06
368,601	Liberty Media-Liberty SiriusXM*	8,912,772	0.06
178,087	Lightning Emotors (Wts 15/12/2025)	3,778	0.00
101,820	Lincoln National	2,623,901	0.02
21,926	Lowe's*	5,064,687	0.03
316,560	LPL Financial	74,002,232	0.51
3,921	Lululemon Athletica	1,495,469	0.01
62,659	M/I Homes*	6,119,905	0.04
102,878	Marathon Oil	2,717,008	0.02
45,057	Marathon Petroleum	6,382,774	0.04
21,092	MarketAxess	5,101,733	0.04
612,669	Marsh & McLennan	120,401,712	0.83
49,863	Marvell Technology	2,916,487	0.02
91,939	Masco	5,457,499	0.04
39,394	Masimo*	4,521,840	0.03
289,998	Mastercard	120,198,371	0.83
139,947	McDonald's	39,589,607	0.27
16,165	McKesson	6,774,752	0.05
3,261	MercadoLibre	4,408,872	0.03
664,263	Merck	73,009,146	0.50
37,620	Meritage Homes*	5,201,341	0.04
39,583	Meta Platforms	11,821,858	0.08
99,706	MetLife	6,318,369	0.04
4,441	Mettler-Toledo International	5,438,537	0.04
174,928	MGM Resorts International*	7,721,322	0.06
31,962	Microchip Technology	2,634,308	0.02
488,526	Micron Technology	34,323,837	0.24
1,073,701	Microsoft	353,312,051	2.44
1,755,970	Mirion Technologies	15,066,222	0.11
196,836	Mirion Technologies*	1,688,853	0.01
18,715	Moderna	2,149,418	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)		
13,766	Moody's	4,649,467	0.03
68,519	Morgan Stanley*	5,848,097	0.04
78,649	Mr Cooper*	4,454,679	0.03
3,933	MSCI	2,144,193	0.02
106,851	Nasdaq	5,659,897	0.04
3,921	Netflix	1,707,595	0.01
72,100	New York Community Bancorp*	879,620	0.01
1,065,811	NextEra Energy	71,974,217	0.50
102,318	NIKE	10,492,711	0.07
13,078	Nucor	2,242,223	0.02
154,780	NVIDIA	76,955,068	0.53
309	NVR	1,962,156	0.01
155,458	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	3,109	0.00
11,670	Omnicom*	941,769	0.01
705	O'Reilly Automotive	664,907	0.00
120,628	Otis Worldwide	10,442,766	0.07
9,549	PACCAR	793,617	0.01
98,165	Palo Alto Networks*	23,726,481	0.16
94,598	Park Hotels & Resorts*	1,223,152	0.01
23,665	Paycom Software	7,004,840	0.05
431,980	Peloton Interactive	2,730,114	0.02
83,248	PepsiCo	14,895,565	0.10
595,560	Pfizer	21,380,604	0.15
27,250	Phillips 66	3,084,428	0.02
224,852	Progressive*	30,168,393	0.21
41,926	Public Service Enterprise	2,596,058	0.02
148,080	Rockwell Automation*	46,230,575	0.31
179,877	Rollins	7,175,294	0.05
41,610	RXO*	769,369	0.00
49,449	S&P Global	19,446,314	0.14
269,022	Salesforce	60,971,146	0.42
5,911	Sarcos Technology & Robotics	6,502	0.00
338,691	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	8,501	0.00
167,667	Sarcos Technology & Robotics (Wts 24/9/2026)	4,209	0.00
36,365	Sealed Air	1,355,687	0.01
1,151,360	Sempra	82,114,995	0.57
2,186	ServiceNow	1,295,599	0.01
534,112	Sonder	267,056	0.00
28,679	Southern Copper	2,333,897	0.02
303,988	Starbucks	30,088,732	0.21
607,300	Sun Country	8,927,310	0.06
12,396	Symbotic	493,113	0.00
57,001	Synchrony Financial	1,853,103	0.01
76,926	Tapestry	2,556,251	0.02
356,024	Tesla	91,580,053	0.64
16,123	Texas Capital Bancshares	1,002,689	0.01
3,114	Texas Instruments	527,543	0.00
128,393	Thermo Fisher Scientific	72,150,446	0.50
379,250	TJX	35,126,135	0.24
36,382	Travelers	5,884,425	0.04
258,300	Uber Technologies	12,083,274	0.08
693,382	United Airlines	34,599,762	0.23
276,223	United Parcel Service	47,532,454	0.33

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)		
115,781	United States Steel*	3,573,002	0.02
252,390	UnitedHealth	123,671,100	0.85
261,825	Valero Energy	33,880,155	0.23
84,920	VeriSign	17,858,676	0.12
67,409	Verisk Analytics	16,338,593	0.11
2,363	Vertex Pharmaceuticals	821,284	0.01
132,293	Visa*	32,672,402	0.23
146,549	Vulcan Materials	31,947,682	0.22
108,523	Walgreens Boots Alliance*	2,784,700	0.02
251,518	Walmart	40,723,279	0.28
556,689	Walt Disney	46,990,118	0.33
41,987	WEC Energy	3,584,430	0.02
187,458	Wells Fargo	7,811,375	0.05
3,520	Wells Fargo	4,075,280	0.03
32,645	Western Digital	1,483,062	0.01
109,802	Williams*	3,830,443	0.03
59,784	Xcel Energy	3,466,276	0.02
12,043	Yum China	648,154	0.00
7,564	Yum! Brands	986,648	0.01
117,940	Zoetis	22,763,599	0.16
78,600	Zscaler	11,958,204	0.08
		4,830,847,846	33.39
普通/優先株式およびワラント合計		8,308,786,421	57.48
債券			
	アルゼンチン		
USD 21,885,365	Argentine Republic Government International Bond 0.75% 9/7/2030	7,391,344	0.05
USD 2,291,190	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	748,589	0.00
USD 26,992,679	Argentine Republic Government International Bond 3.625% 9/7/2035*	8,098,749	0.06
USD 8,980,835	Argentine Republic Government International Bond 4.25% 9/1/2038	3,166,238	0.02
		19,404,920	0.13
	オーストラリア		
AUD 328,974,000	Australia Government Bond 1% 21/11/2031	169,183,417	1.17
	オーストリア		
EUR 6,339,000	Benteler International 9.375% 15/5/2028	7,017,184	0.05
USD 978,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	783,847	0.00
USD 1,331,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	1,049,946	0.01
		8,850,977	0.06
	バハマ		
USD 528,000	Intercorp Peru 3.875% 15/8/2029	448,171	0.01
	バーレーン		
USD 1,102,000	Bahrain Government International Bond 5.45% 16/9/2032*	991,618	0.01
USD 850,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047*	785,073	0.00
		1,776,691	0.01
	ベルギー		
GBP 900,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1,106,740	0.01
GBP 900,000	KBC 1.25% 21/9/2027	982,674	0.00
		2,089,414	0.01
	バミューダ		
USD 453,000	Inkia Energy 5.875% 9/11/2027	436,468	0.00
USD 1,020,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	897,483	0.01
		1,333,951	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 (%)
ブラジル			
USD 1,105,000	Banco do Brasil 6.25% 18/4/2030*	1,097,431	0.01
USD 789,000	Banco Votorantim 4.5% 24/9/2024	772,920	0.00
BRL 404,357,000	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	75,235,235	0.52
BRL 109,247,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	22,010,371	0.15
BRL 238,448,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	48,115,124	0.34
USD 1,305,000	BRF 4.875% 24/1/2030	1,129,302	0.01
		148,360,383	1.03
英領バージン諸島			
USD 514,000	Fortune Star BVI 6.85% 2/7/2024*	469,346	0.00
USD 900,000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032*	746,060	0.01
USD 352,000	New Metro Global 4.5% 2/5/2026*	95,311	0.00
USD 585,000	RKPF Overseas 2020 A 5.2% 12/1/2026	214,590	0.00
USD 261,078	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	254,652	0.00
USD 417,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	313,732	0.00
		2,093,691	0.01
カナダ			
CAD 104,431,000	Canadian Government Bond 0.25% 1/3/2026	69,676,547	0.48
USD 2,405,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	2,366,772	0.02
USD 3,466,000	First Quantum Minerals 6.875% 15/10/2027	3,376,958	0.02
USD 3,092,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	3,090,099	0.03
USD 470,000	First Quantum Minerals 8.625% 1/6/2031	478,828	0.00
USD 638,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	637,049	0.00
USD 6,195,000	Rogers Communications 2.95% 15/3/2025	5,913,364	0.04
USD 1,632,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	1,392,394	0.01
GBP 900,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027*	1,024,269	0.01
		87,956,280	0.61
ケイマン諸島			
USD 828,928	AGL CLO 5 6.988% 20/7/2034	805,681	0.01
USD 1,153,674	AGL CLO 5 7.288% 20/7/2034	1,140,214	0.01
USD 725,000	AIMCO CLO Series 2017-A 6.638% 20/4/2034	718,258	0.01
USD 278,501	AIMCO CLO Series 2018-A 6.97% 17/4/2031	276,288	0.00
USD 318,000	Allegro CLO IV 7.12% 15/1/2030	315,081	0.00
USD 250,000	Allegro CLO XI 7.432% 19/1/2033	247,472	0.00
USD 1,081,525	Apidos CLO XV 6.598% 20/4/2031	1,077,510	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 7.12% 15/4/2031	247,955	0.00
USD 400,000	Atrium XIII 7.107% 21/11/2030	396,929	0.00
USD 279,432	BlueMountain CLO 2014-2 7.338% 20/10/2030	272,650	0.00
USD 250,000	Canyon CLO 2020-3 7.27% 15/1/2034	247,281	0.00
USD 250,000	CARLYLE US CLO 2018-1 7.088% 20/4/2031	247,193	0.00
USD 541,794	Catskill Park CLO 6.938% 20/4/2029	544,734	0.01
USD 692,352	Chenango Park CLO 7.12% 15/4/2030	685,759	0.01
USD 387,293	CIFC Funding 2017-III 7.388% 20/7/2030	385,388	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2018-II 6.628% 20/4/2031	248,937	0.00
USD 405,000	CK Hutchison International 23 4.75% 21/4/2028	394,806	0.00
USD 405,000	CK Hutchison International 23 4.875% 21/4/2033	390,460	0.00
USD 204,845	Clear Creek CLO 6.788% 20/10/2030	204,050	0.00
USD 692,561	Cook Park CLO 6.97% 17/4/2030	683,921	0.01
USD 1,305,000	DP World Salaam 6% 1/10/2025	1,299,692	0.01
USD 350,000	Fantasia 7.95% 5/7/2022	16,779	0.00
USD 399,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	19,950	0.00
USD 319,000	Fantasia 9.875% 19/10/2023	15,950	0.00
USD 352,000	Fantasia 10.875% 9/1/2023	17,600	0.00
USD 2,470,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022	123,500	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 956,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	47,800	0.00
USD 250,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6.608% 20/4/2034	248,203	0.00
USD 400,000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6.888% 20/4/2030	393,247	0.00
USD 1,082,000	IHS 5.625% 29/11/2026	934,350	0.01
USD 778,000	IHS 6.25% 29/11/2028	626,131	0.00
USD 658,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	661,981	0.01
USD 450,000	Madison Park Funding XIII 7.082% 19/4/2030	448,760	0.00
USD 418,056	Madison Park Funding XLI 6.957% 22/4/2027	416,141	0.00
USD 275,277	Madison Park Funding XXVI 6.831% 29/7/2030	274,562	0.00
USD 652,000	MAF Global 6.375% 20/3/2026	634,601	0.00
USD 758,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	634,833	0.01
USD 200,000	MGM China 5.25% 18/6/2025	192,417	0.00
USD 378,000	MGM China 5.875% 15/5/2026	361,891	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.982% 19/10/2031	245,089	0.00
USD 292,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7.038% 20/7/2031	289,691	0.00
USD 236,204	Palmer Square CLO 2018-1 6.602% 18/4/2031	235,319	0.00
USD 370,796	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7.439% 23/8/2031	365,823	0.00
USD 653,058	Pikes Peak CLO 1 6.787% 24/7/2031	648,934	0.01
USD 400,000	Pikes Peak CLO 8 6.758% 20/7/2034	397,753	0.00
USD 241,914	Rockford Tower CLO 2018-1 6.741% 20/5/2031	241,128	0.00
USD 402,000	Sands China 4.3% 8/1/2026*	376,594	0.00
USD 590,000	Sands China 4.875% 18/6/2030	515,619	0.00
USD 640,000	Sands China 5.65% 8/8/2028	602,736	0.01
USD 2,006,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	2,107,800	0.01
USD 2,591,000	Seagate HDD Cayman 8.5% 15/7/2031	2,716,161	0.02
USD 4,030,000	Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	4,468,001	0.03
USD 3,669,000	Shelf Drilling North Sea 10.25% 31/10/2025	3,684,113	0.02
USD 1,148,550	Transocean 8.75% 15/2/2030	1,180,305	0.01
USD 1,126,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	1,158,374	0.01
USD 1,075,805	Trinitas CLO XIV 7.613% 25/1/2034	1,063,443	0.01
USD 627,088	Trinitas CLO XIV 8.613% 25/1/2034	625,800	0.01
USD 249,139	Voya CLO 2013-3 6.721% 18/10/2031	247,990	0.00
USD 822,000	Wynn Macau 5.625% 26/8/2028	722,090	0.01
		38,791,718	0.26
チリ			
USD 1,782,000	Chile Government International Bond 4.34% 7/3/2042*	1,532,573	0.01
USD 913,000	Empresa Nacional del Petroleo 3.75% 5/8/2026*	858,891	0.01
USD 725,000	Empresa Nacional del Petroleo 6.15% 10/5/2033*	717,627	0.00
USD 907,000	Engie Energia Chile 3.4% 28/1/2030*	760,220	0.01
		3,869,311	0.03
コロンビア			
USD 3,588,000	Colombia Government International Bond 3.125% 15/4/2031*	2,767,245	0.02
EUR 479,000	Colombia Government International Bond 3.875% 22/3/2026	500,593	0.00
USD 1,424,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,314,153	0.01
USD 2,315,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026*	2,234,183	0.02
USD 1,655,000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033*	1,712,859	0.01
USD 1,784,000	Ecopetrol 4.125% 16/1/2025	1,728,607	0.01
USD 890,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	622,462	0.01
USD 1,403,000	Ecopetrol 8.875% 13/1/2033	1,420,537	0.01
USD 709,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029*	598,042	0.00
USD 1,693,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024*	1,674,385	0.01
		14,573,066	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 (%)
	コスタリカ		
USD 748,000	Costa Rica Government International Bond 6.55% 3/4/2034	754,698	0.01
	コートジボワール		
EUR 504,000	Ivory Coast Government International Bond 5.875% 17/10/2031	458,458	0.00
USD 3,040,000	Ivory Coast Government International Bond 6.375% 3/3/2028	2,881,282	0.02
		3,339,740	0.02
	チェコ共和国		
CZK 403,320,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	16,646,356	0.12
CZK 415,750,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	19,483,396	0.13
		36,129,752	0.25
	ドミニカ共和国		
USD 978,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6.75% 30/3/2029	956,572	0.01
USD 1,861,000	Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030	1,627,370	0.01
USD 3,004,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	2,548,413	0.02
USD 1,631,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	1,596,725	0.01
USD 1,161,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	1,170,392	0.01
USD 515,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031*	511,722	0.00
		8,411,194	0.06
	エジプト		
USD 978,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	495,782	0.01
USD 864,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	460,551	0.00
		956,333	0.01
	フランス		
GBP 900,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027*	954,029	0.00
EUR 2,900,000	BNP Paribas 2.125% 23/1/2027	2,980,655	0.02
GBP 900,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	1,069,487	0.01
EUR 5,512,000	Chrome Holdco 5% 31/5/2029	4,723,684	0.03
EUR 9,782,000	Forvia 2.75% 15/2/2027	9,689,609	0.07
EUR 21,789,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	21,835,204	0.15
GBP 900,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024*	1,087,990	0.01
GBP 900,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	1,031,294	0.01
		43,371,952	0.30
	ドイツ		
EUR 14,568,000	Adler Pelzer 9.5% 1/4/2027	14,481,931	0.10
EUR 6,140,000	APCOA Parking 8.663% 15/1/2027	6,625,924	0.05
EUR 365,895,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	373,653,691	2.59
EUR 266,280,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.3% 15/2/2033*	285,148,098	1.97
EUR 5,377,000	Douglas 6% 8/4/2026	5,586,691	0.04
EUR 1	Kirk Beauty SUN 8.25% 1/10/2026	1	0.00
EUR 9,782,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027*	9,691,095	0.07
EUR 4,900,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	5,054,035	0.03
EUR 3,163,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	2,969,332	0.02
		703,210,798	4.87
	グアテマラ		
USD 1,554,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	1,257,318	0.01
USD 579,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	456,310	0.00
USD 851,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	810,816	0.01
USD 1,505,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029*	1,433,934	0.01
USD 725,000	Guatemala Government Bond 6.6% 13/6/2036	728,262	0.00
		4,686,640	0.03
	香港		
USD 700,000	AIA 2.7% 7/4/2026*	609,542	0.01
USD 500,000	AIA 4.95% 4/4/2033	490,407	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 (%)
	香港(続き)		
USD 645,000	Bank of East Asia 5.825% 21/10/2025	498,163	0.00
USD 306,000	Yanlord Land HK 5.125% 20/5/2026	175,185	0.00
		<u>1,773,297</u>	<u>0.01</u>
	ハンガリー		
USD 1,729,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	1,692,553	0.01
USD 290,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/3/2024*	289,504	0.00
		<u>1,982,057</u>	<u>0.01</u>
	インド		
USD 210,000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	187,529	0.00
USD 470,000	Indian Railway Finance 3.249% 13/2/2030*	407,878	0.00
USD 300,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	279,174	0.00
USD 700,000	REC 2.75% 13/1/2027	633,318	0.01
USD 300,000	REC 5.625% 11/4/2028	296,380	0.00
		<u>1,804,279</u>	<u>0.01</u>
	インドネシア		
USD 820,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026*	763,686	0.01
USD 1,743,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027*	1,681,821	0.01
USD 3,400,000	Indonesia Government International Bond 4.65% 20/9/2032*	3,289,238	0.02
IDR 388,189,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	27,055,981	0.19
IDR 294,964,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	22,009,581	0.15
USD 510,000	Pertamina Geothermal Energy 5.15% 27/4/2028	504,263	0.00
USD 1,813,000	Pertamina Persero 3.65% 30/7/2029*	1,660,874	0.01
USD 905,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027*	885,742	0.01
		<u>57,851,186</u>	<u>0.40</u>
	アイルランド		
EUR 116,000	Avoca CLO XV 4.713% 15/4/2031	121,400	0.00
EUR 1,524,000	Dell Bank International 0.5% 27/10/2026	1,479,794	0.01
EUR 404,000	Harvest CLO XVIII 4.863% 15/10/2030	426,484	0.00
EUR 410,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5.546% 21/1/2035	433,742	0.00
EUR 280,000	OAK Hill European Credit Partners VI 4.905% 20/1/2032	296,058	0.00
EUR 472,000	OCP Euro CLO 2017-2 5.013% 15/1/2032	502,047	0.01
USD 512,813	Prodigy Finance CM2021-1 7.929% 25/7/2051	508,566	0.01
USD 298,886	Prodigy Finance CM2021-1 9.179% 25/7/2051	297,426	0.00
USD 442,484	Prodigy Finance CM2021-1 11.329% 25/7/2051	444,580	0.00
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 5.333% 15/7/2035	263,215	0.00
		<u>4,773,312</u>	<u>0.03</u>
	マン島		
USD 1,469,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	1,221,914	0.01
USD 1,070,000	Gohl Capital 4.25% 24/1/2027	997,079	0.01
		<u>2,218,993</u>	<u>0.02</u>
	イスラエル		
USD 730,000	Bank Leumi Le-Israel 7.129% 18/7/2033	722,609	0.00
USD 1,641,000	Energian Israel Finance 8.5% 30/9/2033*	1,663,563	0.01
USD 1,303,000	Leviathan Bond 6.75% 30/6/2030*	1,223,478	0.01
		<u>3,609,650</u>	<u>0.02</u>
	イタリア		
EUR 13,130,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	13,882,004	0.09
EUR 2,005,000	Castor 6% 15/2/2029	1,871,891	0.01
EUR 6,400,000	Castor 8.776% 15/2/2029	6,567,512	0.05
EUR 13,500,000	Forno d' Asolo 9.098% 30/4/2027	13,218,702	0.09
EUR 6,765,000	Marcolin 6.125% 15/11/2026	6,775,198	0.05
EUR 6,914,000	Shiba Bidco 4.5% 31/10/2028*	6,712,848	0.05
		<u>49,028,155</u>	<u>0.34</u>

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			
EUR 1,737,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026*	1,789,748	0.01
USD 1,505,000	Rakuten 10.25% 30/11/2024*	1,519,952	0.01
EUR 2,758,000	Takeda Pharmaceutical 2.25% 21/11/2026	2,850,272	0.02
		6,159,972	0.04
ジャージー			
USD 1,632,000	Aptiv / Aptiv 3.25% 1/3/2032	1,384,252	0.01
EUR 3,187,000	Kane Bidco 5% 15/2/2027	3,297,663	0.02
GBP 5,786,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	6,709,933	0.04
		11,391,848	0.07
ヨルダン			
USD 670,000	Jordan Government International Bond 4.95% 7/7/2025	654,205	0.00
ルクセンブルグ			
USD 570,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	5,700	0.00
EUR 4,738,000	Becton Dickinson Euro Finance 3.553% 13/9/2029	5,065,814	0.04
EUR 17,000,000	BK LC Lux Finco1 5.25% 30/4/2029*	17,869,259	0.12
USD 11,206,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	10,636,893	0.08
EUR 7,733,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	4,516,399	0.03
USD 1,014,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	853,991	0.00
USD 1,286,081	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031*	835,232	0.01
USD 629,996	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	409,145	0.00
USD 573,000	MHP Lux 6.25% 19/9/2029	317,665	0.00
USD 400,000	MHP Lux 6.95% 3/4/2026	234,272	0.00
USD 1,174,500	Millicom International Cellular 5.125% 15/1/2028*	1,057,784	0.01
USD 1,438,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1,324,125	0.01
USD 202,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024	200,180	0.00
EUR 5,376,000	Sani/Ikos Financial 1 5.625% 15/12/2026	5,381,188	0.04
		48,707,647	0.34
マレーシア			
USD 600,000	CIMB Bank 2.125% 20/7/2027	536,358	0.00
USD 730,000	Dua Capital 2.78% 11/5/2031	616,857	0.00
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 800,000	TNB Global Ventures Capital 4.851% 1/11/2028	784,552	0.01
		3,682,442	0.03
モーリシャス			
USD 223,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	200,308	0.00
USD 630,000	Diamond II 7.95% 28/7/2026	620,643	0.00
USD 360,000	HTA 7% 18/12/2025	341,647	0.00
USD 652,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	642,220	0.01
USD 262,000	India Green Power 4% 22/2/2027	232,090	0.00
		2,036,908	0.01
メキシコ			
USD 815,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2027	719,686	0.01
USD 1,378,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032*	822,438	0.00
USD 1,722,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	1,711,728	0.01
MXN 2,613,200,000	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	141,314,742	0.98
MXN 645,539,900	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	34,107,684	0.24
MXN 891,090,700	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	48,475,551	0.33
MXN 3,074,136,800	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	16,908,722	0.12
MXN 9,485,316,300	Mexico Cetes 0% 25/7/2024	51,399,968	0.36
USD 2,175,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/5/2031	1,801,052	0.01
USD 1,601,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	1,518,909	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 (%)
メキシコ(続き)			
USD 305,000	Mexico Government International Bond 6.338% 4/5/2053*	304,085	0.00
USD 310,000	Mexico Government International Bond 6.35% 9/2/2035	321,965	0.00
EUR 343,000	Petroleos Mexicanos 3.75% 21/2/2024	366,859	0.00
USD 792,000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/1/2025*	749,553	0.01
USD 1,957,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	1,417,944	0.01
USD 1,631,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027*	1,432,671	0.01
USD 2,251,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	1,704,232	0.01
USD 1,747,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029*	1,563,146	0.01
USD 1,205,000	Trust Fibra Uno 4.869% 15/1/2030	1,052,893	0.01
		307,693,828	2.13
モロッコ			
USD 758,000	Morocco Government International Bond 5.95% 8/3/2028	759,069	0.01
オランダ			
USD 590,000	Braskem Netherlands Finance 7.25% 13/2/2033*	561,392	0.00
USD 652,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	652,688	0.00
GBP 900,000	Cooperatieve Rabobank 1.875% 12/7/2028*	981,725	0.00
EUR 6,550,000	Dufry One 2.5% 15/10/2024*	6,964,619	0.05
USD 1,210,000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	1,225,367	0.01
USD 470,000	Greenko Dutch 3.85% 29/3/2026*	425,453	0.00
EUR 2,800,000	ING Groep 2.125% 23/5/2026	2,926,965	0.02
GBP 900,000	ING Groep 3% 18/2/2026	1,060,434	0.01
USD 829,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	732,152	0.01
USD 934,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028*	824,885	0.01
USD 862,000	MEGlobal 4.25% 3/11/2026	827,934	0.01
EUR 2,863,000	Mercedes-Benz International Finance 1.375% 26/6/2026*	2,935,985	0.02
USD 652,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	406,027	0.00
USD 840,000	Minejesa Capital 4.625% 10/8/2030*	761,548	0.01
USD 1,632,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,431,770	0.01
USD 3,738,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.4% 1/6/2027	3,596,405	0.02
USD 2,992,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	2,843,926	0.02
EUR 6,048,000	Sigma Holdco 5.75% 15/5/2026*	5,669,351	0.04
EUR 1,656,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	1,545,728	0.01
EUR 23,281,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	23,152,926	0.16
EUR 5,532,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029	6,161,118	0.04
EUR 2,893,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.875% 15/9/2031	3,292,718	0.02
USD 700,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 8.125% 15/9/2031	742,598	0.01
USD 1,644,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	1,553,781	0.01
GBP 400,000	Volkswagen Financial Services 1.875% 3/12/2024	480,422	0.00
GBP 400,000	Volkswagen Financial Services 4.25% 9/10/2025	486,991	0.01
EUR 25,365,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030*	22,806,623	0.16
		95,051,531	0.66
ナイジェリア			
USD 1,575,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047*	1,081,789	0.01
USD 1,050,000	Nigeria Government International Bond 8.375% 24/3/2029	925,323	0.00
		2,007,112	0.01
オマーン			
USD 1,631,000	Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047*	1,535,203	0.01
USD 1,957,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048*	1,892,488	0.01
USD 781,000	Oman Sovereign Sukuk 4.397% 1/6/2024*	769,101	0.01
USD 652,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	624,427	0.00
		4,821,219	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 (%)
パナマ			
USD 652,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	489,313	0.00
USD 2,115,000	Panama Government International Bond 3.16% 23/1/2030*	1,840,610	0.01
USD 794,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	747,539	0.01
USD 1,802,000	Panama Government International Bond 6.4% 14/2/2035	1,850,490	0.01
USD 1,445,000	Panama Government International Bond 6.853% 28/3/2054	1,472,166	0.01
		6,400,118	0.04
パラグアイ			
USD 1,381,000	Paraguay Government International Bond 5.6% 13/3/2048	1,186,804	0.01
ペルー			
USD 1,732,000	Financiera de Desarrollo 4.75% 15/7/2025*	1,698,685	0.01
USD 3,061,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032*	2,311,361	0.02
USD 1,606,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	1,363,486	0.01
		5,373,532	0.04
フィリピン			
USD 800,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	519,192	0.00
USD 756,000	Rizal Commercial Banking 6.5% 27/8/2025	692,526	0.00
		1,211,718	0.00
ポーランド			
EUR 920,000	Republic of Poland Government International Bond 4.25% 14/2/2043	975,706	0.01
USD 692,000	Republic of Poland Government International Bond 4.875% 4/10/2033*	671,887	0.00
USD 1,058,000	Republic of Poland Government International Bond 5.5% 4/4/2053	1,031,116	0.01
		2,678,709	0.02
ルーマニア			
EUR 1,044,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031*	862,906	0.01
EUR 1,880,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	1,707,614	0.01
EUR 1,787,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029*	1,711,144	0.01
USD 1,722,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	1,692,330	0.01
		5,973,994	0.04
サウジアラビア			
USD 2,008,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030*	1,959,838	0.01
USD 1,523,000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1,356,041	0.01
		3,315,879	0.02
セネガル			
USD 1,022,000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/5/2033*	838,357	0.01
シンガポール			
USD 250,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028	245,602	0.00
USD 500,000	BOC Aviation 3.5% 18/9/2027*	466,845	0.00
USD 745,000	Continuum Energy Aura 9.5% 24/2/2027	740,820	0.00
USD 500,000	DBS 3.3% 27/2/2025	474,533	0.00
USD 836,784	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039*	742,960	0.01
USD 1,882,000	Pfizer Investment Enterprises 4.75% 19/5/2033	1,853,839	0.01
USD 656,000	Theta Capital 8.125% 22/1/2025	529,746	0.01
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	184,562	0.00
		5,238,907	0.03
南アフリカ			
ZAR 238,000,884	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	11,365,670	0.08
ZAR 24,577,105	Republic of South Africa Government Bond 8.25% 31/3/2032	1,111,333	0.01
ZAR 99,876,273	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044*	3,868,651	0.02
ZAR 566,637,510	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	23,105,021	0.16
ZAR 518,166,988	Republic of South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026	28,854,860	0.20
USD 1,419,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029*	1,252,225	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 (%)
南アフリカ(続き)			
USD 2,265,000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1,506,769	0.01
USD 1,370,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 20/4/2032*	1,215,724	0.01
		72,280,253	0.50
韓国			
USD 1,410,000	GS Caltex 5.375% 7/8/2028	1,399,947	0.01
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	0.00
USD 730,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031*	587,474	0.01
USD 467,000	POSCO 5.625% 17/1/2026*	467,432	0.00
USD 504,000	POSCO 5.75% 17/1/2028	507,684	0.00
USD 200,000	POSCO 5.875% 17/1/2033	206,239	0.00
USD 750,000	SK Hynix 2.375% 19/1/2031	581,539	0.01
USD 1,900,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028	1,922,743	0.01
		6,067,376	0.04
スペイン			
USD 777,333	AI Candelaria Spain 7.5% 15/12/2028*	722,360	0.00
GBP 3,100,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	3,636,338	0.03
EUR 2,700,000	Banco Santander 3.625% 27/9/2026	2,894,917	0.02
EUR 188,861,000	Spain Government Bond 2.55% 31/10/2032	191,276,710	1.32
EUR 18,049,000	Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046	16,497,879	0.12
EUR 165,320,000	Spain Government Bond 3.15% 30/4/2033	174,903,280	1.21
EUR 13,935,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	13,211,390	0.09
EUR 18,712,000	Spain Government Bond 3.9% 30/7/2039	20,361,384	0.14
GBP 1,800,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	2,252,801	0.02
		425,757,059	2.95
スウェーデン			
GBP 900,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	974,361	0.01
EUR 16,053,000	Verisure 3.25% 15/2/2027*	15,705,094	0.11
EUR 1,603,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,642,417	0.01
EUR 1,660,000	Verisure 7.125% 1/2/2028*	1,824,728	0.01
EUR 3,262,000	Verisure 9.25% 15/10/2027	3,773,804	0.03
EUR 9,192,000	Verisure Midholding 5.25% 15/2/2029*	8,711,754	0.06
		32,632,158	0.23
スイス			
USD 3,048,000	Credit Suisse 2.95% 9/4/2025	2,893,688	0.02
USD 3,025,000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	2,939,206	0.02
USD 2,777,000	Credit Suisse 7.95% 9/1/2025	2,831,047	0.02
EUR 5,840,000	UBS 0.65% 14/1/2028	5,607,684	0.04
		14,271,625	0.10
タイ			
USD 372,000	Bangkok Bank 3.733% 25/9/2034	316,390	0.00
USD 500,000	Bangkok Bank 5% 23/9/2025*	473,500	0.00
USD 550,000	GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031	437,660	0.00
USD 564,000	Kasikornbank 3.343% 2/10/2031	506,097	0.01
USD 262,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/3/2026	238,420	0.00
USD 600,000	Minor International 2.7% 19/4/2026	547,770	0.01
USD 201,000	Muang Thai Life Assurance 3.552% 27/1/2037	178,608	0.00
		2,698,445	0.02
ウクライナ			
USD 2,397,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	649,132	0.01
USD 978,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	317,850	0.00
USD 1,370,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2026	399,355	0.00
USD 1,079,000	VF Ukraine PAT via VFU Funding 6.2% 11/2/2025	798,460	0.01
		2,164,797	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 (%)
アラブ首長国連邦			
USD 341,000	Abu Dhabi National Energy 4.696% 24/4/2033	335,032	0.00
USD 1,002,000	MDGH GMTN RSC 4.375% 22/11/2033	947,391	0.01
		1,282,423	0.01
英国			
EUR 3,106,000	Barclays 0.877% 28/1/2028	2,987,188	0.02
GBP 900,000	Barclays 3% 8/5/2026	1,043,698	0.01
GBP 900,000	Barclays 3.25% 12/2/2027	1,024,514	0.01
EUR 11,535,000	BCP V Modular Services Finance 6.75% 30/11/2029	9,316,675	0.07
GBP 8,806,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	9,181,507	0.06
GBP 1,643,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	2,057,830	0.01
GBP 4,935,000	Boparan Finance 7.625% 30/11/2025	4,214,036	0.03
EUR 3,586,000	BP Capital Markets 2.519% 7/4/2028	3,693,092	0.03
GBP 9,803,000	Deuce Finco 5.5% 15/6/2027	10,694,543	0.07
GBP 1,000,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	1,114,570	0.01
EUR 2,773,000	HSBC 3.019% 15/6/2027	2,895,567	0.02
EUR 3,233,000	INEOS Finance 3.375% 31/3/2026*	3,316,936	0.02
EUR 3,111,000	INEOS Finance 6.625% 15/5/2028*	3,350,844	0.02
USD 6,536,000	INEOS Finance 6.75% 15/5/2028*	6,248,216	0.05
GBP 900,000	Informa 3.125% 5/7/2026	1,051,949	0.00
GBP 4,843,000	Inspired Entertainment Financing 7.875% 1/6/2026	5,858,175	0.04
GBP 1,800,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	2,186,590	0.01
GBP 5,895,000	Marks & Spencer 3.75% 19/5/2026*	6,925,115	0.05
EUR 4,020,000	National Grid 0.163% 20/1/2028*	3,706,789	0.02
GBP 900,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	1,054,898	0.01
GBP 900,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	1,045,274	0.01
GBP 18,068,000	Punch Finance 6.125% 30/6/2026*	20,010,909	0.14
GBP 900,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026	1,063,016	0.01
GBP 83,525,396	United Kingdom Gilt 0.5% 22/10/2061	31,308,473	0.22
GBP 160,970,000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/7/2027*	180,620,103	1.25
USD 1,161,000	Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	761,558	0.01
USD 500,000	Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2024*	430,375	0.00
GBP 9,782,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	11,327,539	0.08
		328,489,979	2.28
米国			
USD 2,640,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	2,328,909	0.02
EUR 2,771,000	AbbVie 1.375% 17/5/2024	2,950,299	0.02
USD 9,155,000	AbbVie 2.6% 21/11/2024	8,827,840	0.06
USD 988,959	AccessLex Institute 5.953% 25/5/2036	961,461	0.01
USD 1,206,000	Affinity Interactive 6.875% 15/12/2027	1,070,637	0.01
USD 425,000	Alexander Funding Trust II 7.467% 31/7/2028	429,662	0.00
USD 1,769,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,733,275	0.01
USD 11,736,000	Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	11,762,054	0.08
EUR 7,005,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	6,679,904	0.05
USD 6,695,000	American Tower 5.25% 15/7/2028	6,590,216	0.05
USD 1,632,000	Amgen 2% 15/1/2032	1,281,036	0.01
USD 1,605,000	Amgen 2.3% 25/2/2031	1,325,714	0.01
USD 4,943,000	Amgen 3.35% 22/2/2032	4,315,730	0.03
USD 9,986,000	Amgen 5.15% 2/3/2028	9,968,629	0.07
GBP 900,000	Amgen 5.5% 7/12/2026*	1,135,152	0.01
USD 970,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	970,940	0.01
EUR 9,782,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	8,815,156	0.06
USD 5,690,000	AREIT 2022-CRE7 7.556% 17/6/2039	5,692,237	0.04
USD 305,000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	311,091	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)		
GBP 1,770,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	2,032,327	0.01
GBP 900,000	AT&T 5.5% 15/3/2027*	1,112,370	0.01
USD 842,000	Azul Investments 5.875% 26/10/2024	774,640	0.01
USD 756,000	Azul Secured Finance 11.93% 28/8/2028*	752,866	0.01
USD 460,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033	409,741	0.00
USD 1,210,000	BANK 2017-BNK9 3.538% 15/11/2054	1,112,828	0.01
USD 783,000	Bank of America 1.898% 23/7/2031	618,706	0.00
USD 2,317,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	1,816,090	0.01
EUR 2,844,000	Bank of America 1.949% 27/10/2026	2,939,246	0.02
USD 3,641,000	Bank of America 2.496% 13/2/2031	3,028,660	0.02
USD 2,552,000	Bank of America 2.592% 29/4/2031	2,124,558	0.01
USD 189,655	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 6.129% 25/11/2035	173,068	0.00
USD 209,101	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5.769% 25/10/2036	194,651	0.00
USD 2,951,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.629% 15/3/2037	2,252,295	0.02
EUR 2,217,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025*	2,232,814	0.02
USD 3,692,000	Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027	3,493,155	0.02
USD 610,912	BHMS 2018-ATLS 6.857% 15/7/2035	600,449	0.00
USD 1,715,558	BHMS 2018-ATLS 7.507% 15/7/2035	1,648,765	0.01
USD 2,648,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	2,636,468	0.02
USD 4,247,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	3,682,664	0.03
USD 1,870,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	1,508,360	0.01
USD 1,605,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	1,467,767	0.01
USD 2,289,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,173,310	0.01
USD 2,281,200	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,058,903	0.01
USD 5,393,000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9.75% 15/7/2028	5,373,358	0.04
USD 860,545	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7.575% 15/12/2037	849,869	0.01
USD 1,986,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	1,710,939	0.01
USD 527,428	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3.911% 13/11/2050	426,692	0.00
USD 1,661,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,552,099	0.01
USD 670,000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	679,048	0.00
EUR 2,840,000	Citigroup 1.25% 6/7/2026	2,922,547	0.02
GBP 1,372,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	1,538,160	0.01
USD 2,148,000	Citigroup 2.561% 1/5/2032	1,730,854	0.01
USD 3,264,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	2,697,681	0.02
USD 2,979,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	2,497,590	0.02
USD 802,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	737,209	0.01
USD 1,223,900	Citigroup CCommercial Mortgage Trust 2018-C6 4.412% 10/11/2051	1,154,155	0.01
USD 6,657,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	6,843,419	0.05
USD 3,330,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	2,978,560	0.02
EUR 1,666,000	Comcast 0.25% 14/9/2029	1,481,746	0.01
USD 2,220,256	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	2,154,477	0.02
USD 1,270,000	Concentrix 6.6% 2/8/2028	1,243,544	0.01
USD 2,580,000	Concentrix 6.65% 2/8/2026	2,581,773	0.02
EUR 8,101,000	Coty 3.875% 15/4/2026*	8,549,461	0.06
USD 644,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	642,198	0.00
USD 2,696,000	Crown Castle 2.9% 15/3/2027	2,473,245	0.02
USD 402,545	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4.798% 15/11/2048	362,059	0.00
USD 4,695,000	CSC 5.25% 1/6/2024	4,459,794	0.03
USD 5,958,000	CSC 5.5% 15/4/2027	5,141,846	0.04
USD 771,000	DAE Funding 1.55% 1/8/2024	737,747	0.01
USD 390,000	DAE Funding 2.625% 20/3/2025*	367,023	0.00
USD 593,946	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.409% 15/5/2035	592,015	0.00
USD 1,200,964	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.906% 15/5/2035	1,178,059	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 5,354,649	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7.606% 15/5/2035	5,219,043	0.04
USD 1,341,475	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 6.811% 19/12/2030	1,330,248	0.01
USD 1,010,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 7.211% 19/12/2030	999,874	0.01
USD 2,204,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	2,171,451	0.01
USD 2,884,000	Dell International / EMC 5.25% 1/2/2028	2,874,596	0.02
USD 3,327,000	DISH Network 0% 15/12/2025	2,158,859	0.02
EUR 2,798,000	Duke Energy 3.1% 15/6/2028	2,888,106	0.02
USD 3,652,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027*	3,728,345	0.03
USD 8,288,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	7,813,173	0.05
USD 2,968,000	Elevance Health 4.9% 8/2/2026	2,927,326	0.02
USD 2,034,000	Emerald Debt Merger Sub 6.625% 15/12/2030	2,001,582	0.01
USD 655,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2027	661,357	0.00
USD 700,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	718,691	0.00
USD 3,245,000	Equinix 1% 15/9/2025	2,959,600	0.02
USD 3,387,000	Equinix 1.55% 15/3/2028	2,858,997	0.02
USD 2,335,000	Equinix 2.9% 18/11/2026	2,156,997	0.01
USD 11,876,000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	11,812,530	0.08
USD 1,055,346	Fannie Mae-Aces 3.866% 25/9/2030	995,763	0.01
EUR 2,958,000	Fidelity National Information Services 1.5% 21/5/2027	2,945,996	0.02
USD 35,443,780	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.941% 25/5/2029	1,220,241	0.01
USD 31,539,450	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.132% 25/10/2030	1,756,634	0.01
USD 4,873,647	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.528% 25/7/2030	360,140	0.00
USD 22,579,134	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.644% 25/1/2030	1,723,621	0.01
USD 9,628,434	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.697% 25/4/2030	776,541	0.01
USD 5,508,048	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.813% 25/4/2030	465,644	0.00
USD 1,530,711	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8.688% 25/1/2042	1,521,151	0.01
USD 2,204,000	Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	2,195,856	0.02
USD 1,102,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	1,085,740	0.01
USD 3,945,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027*	3,594,929	0.02
USD 5,945,000	Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	5,708,053	0.04
USD 7,070,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	6,863,538	0.05
USD 6,385,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	5,955,481	0.04
USD 3,810,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	3,475,349	0.02
USD 6,367,781	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.894% 17/8/2037	6,399,632	0.05
USD 254,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028*	226,223	0.00
USD 823,000	GCI 4.75% 15/10/2028	714,878	0.01
USD 662,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	662,350	0.00
USD 4,602,000	Gen Digital 7.125% 30/9/2030	4,642,746	0.04
EUR 4,691,000	General Mills 0.125% 15/11/2025	4,698,851	0.03
EUR 3,663,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	3,667,807	0.03
USD 3,325,000	General Motors Financial 5.4% 6/4/2026	3,285,772	0.02
EUR 1,377,000	Global Payments 4.875% 17/3/2031	1,494,405	0.01
EUR 3,236,000	Goldman Sachs 0.25% 26/1/2028*	2,975,936	0.02
USD 3,244,000	Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,910,176	0.02
USD 3,264,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	2,544,031	0.02
USD 2,407,000	Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	1,949,570	0.01
GBP 900,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028*	1,187,209	0.01
USD 3,602,965	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	2,753,806	0.02
USD 11,074,000	GoTo 5.5% 1/9/2027	6,488,079	0.04
USD 667,000	GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028	647,244	0.00
USD 4,197,000	HCA 3.5% 1/9/2030	3,668,003	0.03
USD 5,133,000	HCA 5.375% 1/2/2025	5,099,319	0.04
USD 4,011,000	HCA 5.625% 1/9/2028	4,000,578	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 546,920	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 3.076% 10/8/2038	449,649	0.00
USD 1,684,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	1,567,875	0.01
EUR 2,721,000	International Business Machines 3.375% 6/2/2027	2,920,202	0.02
USD 772,280	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-WPT 8.055% 5/7/2033	651,596	0.00
GBP 2,250,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	2,632,462	0.02
EUR 2,960,000	JPMorgan Chase 1.09% 11/3/2027	2,974,253	0.02
USD 3,264,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	2,555,470	0.02
GBP 549,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	658,327	0.01
USD 1,333,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	1,220,443	0.01
USD 2,048,000	Lightning eMotors 7.5% 15/5/2024	921,600	0.01
USD 10,668,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	6,456,850	0.04
USD 1,632,000	Lowe's 2.625% 1/4/2031	1,370,350	0.01
USD 7,438,000	Lowe's 4.8% 1/4/2026	7,347,950	0.05
USD 13,761,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	13,535,747	0.09
USD 1,752,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	1,526,813	0.01
EUR 3,595,000	Morgan Stanley 1.342% 23/10/2026*	3,659,722	0.03
USD 866,000	Morgan Stanley 2.239% 21/7/2032	681,292	0.00
USD 327,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	275,267	0.00
USD 4,538,000	Morgan Stanley 3.62% 17/4/2025*	4,468,347	0.03
USD 6,196,000	Morgan Stanley Bank 4.754% 21/4/2026	6,108,558	0.04
USD 395,094	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.468% 15/5/2048	337,984	0.00
USD 2,057,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3.72% 15/12/2049	1,920,011	0.01
USD 1,299,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	1,121,315	0.01
EUR 1,984,000	Nasdaq 4.5% 15/2/2032	2,190,158	0.02
USD 3,024,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	2,554,728	0.02
USD 3,475,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	3,161,816	0.02
USD 428,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	408,059	0.00
EUR 5,362,000	Netflix 3.625% 15/5/2027*	5,743,972	0.04
USD 2,974,000	Netflix 4.875% 15/4/2028	2,927,415	0.02
USD 1,384,000	New Home 8.25% 15/10/2027	1,325,533	0.01
USD 3,562,000	Northern States Power 4.5% 1/6/2052	3,079,680	0.02
USD 2,805,000	NRG Energy 7% 15/3/2033	2,771,284	0.02
USD 1,968,000	Olympus Water US 7.125% 1/10/2027*	1,841,453	0.01
USD 11,580,000	Olympus Water US 9.75% 15/11/2028	11,675,442	0.08
USD 2,070,000	Oncor Electric Delivery 4.1% 15/11/2048	1,698,321	0.01
USD 5,974,000	ONEOK Partners 4.9% 15/3/2025	5,878,754	0.04
USD 4,065,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	3,576,406	0.02
USD 5,808,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	4,908,741	0.04
USD 2,571,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	2,227,320	0.02
USD 133,000	Pacific Gas and Electric 3.25% 16/2/2024	131,375	0.00
USD 3,248,000	Pacific Gas and Electric 3.3% 1/12/2027	2,892,602	0.02
USD 1,265,000	Pacific Gas and Electric 6.1% 15/1/2029	1,249,732	0.01
USD 1,632,000	Pacific Gas and Electric 6.4% 15/6/2033	1,615,297	0.01
USD 545,000	Palomino Funding Trust I 7.233% 17/5/2028	552,012	0.00
USD 3,600,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,977,740	0.02
USD 2,957,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 5.75% 24/5/2026	2,935,157	0.02
USD 557,000	Periana 5.95% 19/4/2026*	531,244	0.00
USD 8,963,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027*	6,797,539	0.05
EUR 2,739,000	PPG Industries 1.875% 1/6/2025	2,866,646	0.02
EUR 1,884,000	Procter & Gamble 4.875% 11/5/2027*	2,147,617	0.02
USD 1,025,000	Prologis 2.25% 15/1/2032	823,230	0.01
USD 1,357,000	Rain Carbon 12.25% 1/9/2029	1,403,125	0.01
USD 6,812,000	Rand Parent 8.5% 15/2/2030*	6,503,172	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 9,475,028	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7.867% 25/10/2039	9,481,628	0.07
USD 3,745,000	Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	3,726,594	0.03
USD 4,173,000	RingCentral 8.5% 15/8/2030	4,116,936	0.03
USD 5,325,000	Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	5,239,326	0.03
USD 728,000	Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	717,893	0.00
USD 3,656,000	Sabre GLBL 11.25% 15/12/2027	3,487,683	0.02
USD 326,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	292,147	0.00
USD 1,272,000	Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028*	1,154,664	0.02
USD 1,796,000	Sasol Financing USA 8.75% 3/5/2029*	1,762,325	0.01
USD 558,000	Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	537,279	0.00
USD 1,723,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,633,856	0.01
USD 2,654,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,635,240	0.02
USD 562,000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	424,681	0.00
USD 860,000	SK Battery America 2.125% 26/1/2026	771,411	0.01
USD 7,349,990	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.175% 15/10/2041	7,778,304	0.05
USD 7,193,108	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	5,984,472	0.04
USD 1,499,000	Southern California Edison 1.1% 1/4/2024	1,458,033	0.01
USD 3,584,000	Southern California Edison 5.3% 1/3/2028	3,593,986	0.03
USD 6,575,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025*	6,497,468	0.04
USD 715,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	744,729	0.01
USD 5,513,000	Sprint 7.875% 15/9/2023	5,509,334	0.04
USD 1,360,625	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	1,346,808	0.01
USD 324,000	Steel Dynamics 5% 15/12/2026	317,887	0.00
USD 526,000	Stem 0.5% 1/12/2028	321,148	0.00
USD 4,256,000	Tenneco 8% 17/11/2028	3,502,092	0.02
EUR 2,978,000	Thermo Fisher Scientific 1.375% 12/9/2028	2,902,688	0.02
USD 3,787,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	3,084,392	0.02
USD 2,434,000	T-Mobile USA 3.5% 15/4/2031	2,126,114	0.01
USD 2,579,000	T-Mobile USA 4.95% 15/3/2028	2,540,518	0.02
USD 2,919,915	Topaz Solar Farms 5.75% 30/9/2039	2,763,685	0.02
USD 217,000,000	United States Treasury Bill 0% 5/9/2023	216,873,958	1.50
USD 94,000,000	United States Treasury Bill 0.00% 12/9/2023	93,849,532	0.65
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 0% 19/9/2023	49,868,219	0.34
USD 116,000,000	United States Treasury Bill 0% 21/9/2023	115,660,055	0.80
USD 72,000,000	United States Treasury Bill 0% 28/9/2023	71,714,542	0.50
USD 18,000,000	United States Treasury Bill 0% 3/10/2023*	17,915,146	0.12
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 0% 5/10/2023	49,750,352	0.34
USD 118,000,000	United States Treasury Bill 0% 10/10/2023	117,325,680	0.81
USD 100,000,000	United States Treasury Bill 0% 12/10/2023	99,396,104	0.69
USD 1,186,000	United States Treasury Bill 0% 14/11/2023	1,173,161	0.01
USD 18,591,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	18,560,540	0.13
USD 111,120,200	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024*	131,528,176	0.91
USD 178,516,800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2024*	230,262,646	1.59
USD 61,108,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/7/2032	57,608,859	0.40
USD 22,961,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042*	17,077,244	0.12
USD 55,520,200	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042	47,402,539	0.33
USD 27,945,800	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15/8/2042	24,253,898	0.17
USD 219,770,000	United States Treasury Note/Bond 4% 30/6/2028*	216,894,103	1.50
USD 292,652,100	United States Treasury Note/Bond 4% 31/7/2028*	290,525,801	2.01
USD 43,135,600	United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052*	41,649,444	0.29
USD 4,006,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	3,992,792	0.03
USD 2,381,000	USB Capital IX 6.59% 2/10/2023	1,794,226	0.01
GBP 900,000	Verizon Communications 1.125% 3/11/2028*	903,057	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 7,003,000	Verizon Communications 2.55% 21/3/2031	5,762,606	0.04
GBP 238,000	Verizon Communications 4.073% 18/6/2024	297,718	0.00
EUR 2,587,000	Verizon Communications 4.25% 31/10/2030	2,835,561	0.02
USD 395,000	Viasat 5.625% 15/9/2025	373,062	0.00
USD 3,568,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	3,188,731	0.02
USD 1,550,000	Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,510,824	0.01
USD 7,002,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	6,746,716	0.05
USD 3,286,000	VMware 1.4% 15/8/2026	2,909,765	0.02
USD 1,632,000	VMware 2.2% 15/8/2031	1,272,809	0.01
USD 1,350,000	VNDO Trust 2016-350P 4.033% 10/1/2035	1,180,037	0.01
EUR 2,955,000	Wells Fargo 1.375% 26/10/2026	2,947,013	0.02
EUR 4,515,000	Wells Fargo 1.5% 24/5/2027	4,458,955	0.03
USD 5,938,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	5,758,568	0.04
USD 2,000,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 3.872% 15/5/2048	1,877,353	0.01
USD 796,545	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3.903% 15/7/2050	660,664	0.00
USD 1,318,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.874% 15/6/2036	1,114,821	0.01
USD 2,226,000	Welltower 4% 1/6/2025	2,157,191	0.01
USD 175,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	172,781	0.00
USD 9,250,000	Xerox 5% 15/8/2025	8,828,061	0.06
		<hr/>	<hr/>
		2,550,837,981	17.65
	ウルグアイ		
USD 1,774,000	Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034*	1,905,728	0.01
債券合計		<hr/>	<hr/>
		5,376,205,649	37.18
	コマーシャル・ペーパー		
	フランス		
USD 12,174,000	Societe Generale 0% 6/3/2024	11,813,984	0.08
	ドイツ		
USD 33,182,000	Bayer 0% 1/9/2023	33,171,944	0.23
	スイス		
USD 8,710,000	UBS (London Branch) 0% 18/6/2024	8,307,701	0.06
USD 8,710,000	UBS (London Branch) 0% 25/6/2024	8,298,307	0.06
		<hr/>	<hr/>
		16,606,008	0.12
	米国		
USD 16,241,000	3M 0% 7/9/2023	16,221,958	0.11
USD 31,041,000	AT&T 0% 19/12/2023	30,501,484	0.21
USD 5,475,000	AT&T 0% 20/12/2023	5,378,949	0.04
USD 33,182,000	AT&T 0% 23/1/2024	32,416,289	0.22
USD 42,335,000	AT&T 0% 21/2/2024	41,156,206	0.28
USD 6,130,000	Enel Finance America 0% 6/9/2023	6,123,498	0.04
USD 9,580,000	General Motors 0% 22/1/2024	9,354,040	0.06
USD 7,052,000	General Motors 0% 25/1/2024	6,882,109	0.05
USD 10,895,000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	10,824,124	0.08
USD 5,748,000	HSBC USA 0% 20/11/2023	5,675,048	0.04
USD 5,750,000	HSBC USA 0% 24/6/2024	5,462,455	0.04
USD 9,025,000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8,562,424	0.06
USD 8,630,000	HSBC USA 0% 12/8/2024	8,123,787	0.06
		<hr/>	<hr/>
		186,682,371	1.29
コマーシャル・ペーパー合計		<hr/>	<hr/>
		248,274,307	1.72

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 (%)
預託証書			
	米国		
USD 22,730,000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	22,721,561	0.16
預託証書合計		22,721,561	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合計		13,975,824,644	96.68

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			
	オーストラリア		
9,488,465	Quintis Pty	61	0.00
	ケイマン諸島		
609	Marco Polo Investment	-	0.00
	インド		
2,463	Think & Learn Pvt	1,860,851	0.01
3,482	Think & Learn Pvt	2,630,727	0.02
		4,491,578	0.03
	英国		
413,408	10X Future Technologies	7,955,180	0.06
	米国		
63,622	Aiven	5,370,333	0.04
21,376	Breeze Aviation	6,730,234	0.05
188,149	ByteDance	32,679,567	0.23
45,635	Caresyntax	4,360,424	0.03
6,574	Caresyntax	526,906	0.00
5,179	Caresyntax (Wts 21/6/2033)	494,802	0.00
488,757	Databricks	26,104,511	0.18
136,950	Databricks	7,314,499	0.05
1,209,710	Deep Instinct	8,528,455	0.06
82,654	Deep Instinct (Wts 20/9/2032)	491,791	0.00
1,172,341	Deep Instinct Series D-4	8,265,004	0.06
24,969	Epic Games	16,342,710	0.11
941,683	eXo Imaging	2,467,209	0.02
420,195	Fanatics	30,527,167	0.21
157,436	Farmer' s Business Network	3,838,290	0.03
23,814	Farmer' s Business Network	580,585	0.00
25,662	FLYR (Wts 31/12/2049)	348,233	0.00
235,953	GM Cruise	4,990,406	0.03
144,403	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)	651,257	0.01
22,921	Hawkeye 360 ATM (Wts 7/7/2033)	52,718	0.00
57,303	Hawkeye 360 MGR (Wts 7/7/2033)	258,437	0.00
448,109	Hawkeye 360 Series D1	4,041,943	0.03
6,145,462	Included Health	7,067,281	0.05
3,924,026	JumpCloud	10,202,468	0.07
258,097	JumpCloud	671,052	0.00
216,912	Latch (Wts 4/6/2026)	-	0.00
592,242	Lessen	5,300,566	0.04
206,148	Lessen Series C	1,845,025	0.01
760,471	Loadsmart	8,502,066	0.06
95,378	Loadsmart	1,066,326	0.01
107,909	Lookout	280,563	0.00
1,919,121	Lookout Series F	8,827,957	0.06
231,287	Mountain Digital	2,444,703	0.02
561,098	Mythic	6	0.00
4,980	NCB Warrant	-	0.00
24,103	Neon Payments	12,397,860	0.09
652,238	NMC Health	-	0.00
750,669	Noodle	3,903,479	0.03
129,448	Psiquantum	3,650,434	0.03

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 (%)
	米国(続き)		
261,161	Relativity Space	4,147,237	0.03
3,662	Salt Pay	2,124,253	0.01
134,315	SambaNova Systems	10,660,582	0.07
46,362	SambaNova Systems	3,679,752	0.03
167,805	Snorkel AI	1,579,045	0.01
46,853	Snorkel AI	440,887	0.00
337,227	Source Global	9,557,013	0.06
24,317	Source Global	923,560	0.01
1,121,246	Ursa Major Technologies	3,576,775	0.02
137,361	Ursa Major Technologies Series D	454,665	0.00
1,197,196	Verge Genomics	7,733,886	0.05
178,954	Versa Networks (Wts 7/10/2032)	493,913	0.01
1,451,933	Versa Networks Series E	4,500,992	0.03
		280,997,827	1.94
		293,444,646	2.03
	普通/優先株式およびワラント合計		
	債券		
	オーストラリア		
USD 19,413,818	Quintis Australia 7.5% 1/10/2026	12,436,492	0.09
USD 17,943,829	Quintis Australia 0% 1/10/2028	2	0.00
		12,436,494	0.09
	ケイマン諸島		
CNY 103,700,000	Fresh Express Delivery 0% 18/10/2010	-	0.00
	インド		
USD 19,051,000	REI Agro 5.5% 13/11/2014	2	0.00
	国際機関(International)		
EUR 8,182,400	Natra Foods 0% 13/10/2029	8,600,479	0.06
	米国		
USD 2,090,000	Calpine Escrow 0% 31/12/2049	-	0.00
USD 4,863,154	FLYR 10% 20/1/2027	4,498,418	0.03
USD 9,949,610	FLYR 8% 10/8/2027	9,742,658	0.07
USD 15,179,097	Lessen 0% 5/1/2028	14,230,403	0.10
USD 10,933,346	Pioneer Midco 10.5% 18/11/2030	10,769,346	0.07
		39,240,825	0.27
		60,277,800	0.42
	債券合計	353,722,446	2.45
	その他の譲渡可能な有価証券合計	14,329,547,090	99.13
	投資有価証券合計	125,729,806	0.87
	その他の純資産	14,455,276,896	100.00
	純資産合計(米ドル)		

* 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	342,358,442	USD	232,514,105	Barclays	20/9/2023	(10,620,251)
BRL	175,263,019	USD	35,364,071	Citigroup	14/9/2023	151,211
BRL	434,725,908	USD	86,981,714	Barclays	20/9/2023	1,024,965
CAD	136,011,631	USD	101,830,472	JP Morgan	20/9/2023	(1,269,158)
CHF	229,688,160	USD	254,959,207	HSBC Bank	20/9/2023	5,554,054
CNH	73,105,000	USD	10,347,781	Citigroup	14/9/2023	(294,270)
CNH	299,818,594	USD	42,310,321	Barclays	20/9/2023	(1,066,019)
CNH	256,565,678	USD	36,307,834	Bank of America	20/9/2023	(1,013,584)
CNH	148,095,000	USD	20,557,863	JP Morgan	14/9/2023	(191,614)
CNH	265,171,065	USD	36,721,814	JP Morgan	20/9/2023	(243,772)
CNH	264,904,600	USD	37,255,149	State Street	20/9/2023	(813,762)
COP	55,837,798,000	USD	13,742,424	Bank of America	14/9/2023	(189,595)
CZK	709,533,768	USD	32,408,359	HSBC Bank	14/9/2023	(421,019)
CZK	388,002,782	USD	18,129,421	UBS	14/9/2023	(637,403)
DKK	378,702,264	USD	54,969,062	BNP Paribas	20/9/2023	219,320
EUR	399,411,768	USD	431,643,898	Citigroup	20/9/2023	2,031,781
EUR	79,888,203	USD	88,182,008	JP Morgan	20/9/2023	(1,440,522)
EUR	18,390,000	USD	20,431,382	Citibank	14/9/2023	(469,577)
EUR	64,322,488	USD	70,881,401	HSBC Bank	20/9/2023	(1,040,948)
GBP	24,272,196	EUR	28,108,341	HSBC Bank	20/9/2023	251,248
GBP	37,645,271	USD	47,114,069	JP Morgan	20/9/2023	610,432
HUF	9,109,764,911	USD	25,836,708	JP Morgan	14/9/2023	98,690
HUF	5,520,114,152	USD	15,712,666	Goldman Sachs	20/9/2023	(16,472)
IDR	231,054,423,828	USD	15,449,462	Citigroup	20/9/2023	(281,610)
IDR	307,679,865,000	USD	20,525,675	JP Morgan	14/9/2023	(325,863)
INR	4,112,737,000	USD	49,648,400	Citigroup	14/9/2023	29,434
JPY	13,346,394,198	EUR	89,761,645	JP Morgan	20/9/2023	(5,910,989)
JPY	134,065,777,511	USD	974,591,472	UBS	20/9/2023	(54,953,698)
JPY	4,193,150,318	USD	29,848,204	JP Morgan	20/9/2023	(1,084,865)
KRW	74,148,133,571	USD	56,601,197	UBS	20/9/2023	(494,139)
KRW	13,344,080,000	USD	10,230,327	Citigroup	14/9/2023	(133,592)
MXN	518,410,474	USD	29,538,692	State Street	20/9/2023	1,352,084
MXN	1,378,410,156	USD	78,107,956	JP Morgan	20/9/2023	4,028,035
MXN	18,390,114	USD	1,049,614	Morgan Stanley	20/9/2023	46,207
MYR	36,803,160	USD	8,151,319	Barclays	14/9/2023	(213,900)
NOK	741,622,471	CHF	62,231,601	Goldman Sachs	20/9/2023	(904,789)
NOK	108,370,078	USD	9,855,709	Deutsche Bank	14/9/2023	324,181
NZD	12,625,121	USD	7,713,696	JP Morgan	20/9/2023	(204,628)
PLN	61,210,000	USD	14,687,463	Bank of America	14/9/2023	164,427
PLN	94,943,874	USD	22,824,802	Barclays	20/9/2023	204,557
SGD	13,869,490	USD	10,329,617	JP Morgan	14/9/2023	(64,288)
SGD	37,493,709	USD	27,998,635	JP Morgan	20/9/2023	(240,579)
THB	894,222,200	USD	25,889,467	HSBC Bank	14/9/2023	(327,682)
THB	703,665,000	USD	20,410,185	Citigroup	14/9/2023	(295,573)
TWD	1,613,158,500	USD	52,520,218	State Street	20/9/2023	(1,857,572)
USD	130,737,035	HKD	1,020,337,188	UBS	20/9/2023	539,804
USD	24,992,725	CZK	551,019,440	Deutsche Bank	14/9/2023	151,558
USD	89,447,767	MXN	1,580,080,930	JP Morgan	14/9/2023	(4,803,498)
USD	24,692,737	ZAR	476,550,643	State Street	14/9/2023	(646,865)
USD	17,884,337	IDR	266,222,658,292	UBS	14/9/2023	406,275
USD	46,145,257	INR	3,819,835,139	Citigroup	20/9/2023	6,030
USD	1,836,244	EUR	1,696,498	State Street	14/9/2023	(5,254)
USD	19,874,482	SEK	213,859,133	Deutsche Bank	20/9/2023	255,486
USD	30,318,705	NOK	326,441,556	Deutsche Bank	20/9/2023	(351,852)
USD	66,244,835	CNH	470,298,580	BNP Paribas	20/9/2023	1,548,592

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	475,818	EUR	438,375	Royal Bank of Canada	14/9/2023	(25)
USD	507,156	EUR	464,812	Citigroup	14/9/2023	2,616
USD	36,882,838	MXN	644,626,024	Goldman Sachs	20/9/2023	(1,528,804)
USD	44,323,303	ZAR	840,338,982	Citigroup	14/9/2023	(359,996)
USD	9,344,257	IDR	139,703,177,381	Morgan Stanley	14/9/2023	172,457
USD	180,773,545	AUD	262,728,302	Bank of America	20/9/2023	10,490,624
USD	94,361,190	BRL	460,831,743	Morgan Stanley	20/9/2023	1,069,599
USD	188,606,890	GBP	147,852,501	Deutsche Bank	20/9/2023	1,168,025
USD	1,088,863,677	EUR	992,660,030	Barclays	20/9/2023	11,047,381
USD	235,196,879	JPY	32,596,993,885	Morgan Stanley	20/9/2023	11,594,499
USD	12,993,007	BRL	63,509,688	HSBC Bank	14/9/2023	123,409
USD	7,511,759	ZAR	139,081,633	Société Générale	20/9/2023	120,288
USD	88,110,110	MXN	1,543,431,583	Citigroup	20/9/2023	(3,859,093)
USD	37,095,897	BRL	178,485,713	Goldman Sachs	20/9/2023	962,935
USD	103,865,023	EUR	93,746,426	JP Morgan	20/9/2023	2,076,472
USD	10,274,039	SGD	13,869,490	Citigroup	14/9/2023	8,709
USD	46,227,632	INR	3,802,685,000	Barclays	14/9/2023	294,923
USD	36,887,003	JPY	5,257,264,790	Citigroup	20/9/2023	824,263
USD	66,240,699	GBP	51,538,539	JP Morgan	20/9/2023	903,114
USD	44,601,794	GBP	34,113,967	Citigroup	20/9/2023	1,354,077
USD	29,837,765	EUR	26,459,191	Bank of America	20/9/2023	1,108,748
USD	29,709,094	NOK	298,071,341	Bank of America	20/9/2023	1,704,038
USD	10,758,236	NOK	108,370,078	Barclays	14/9/2023	578,346
USD	103,950,587	MXN	1,771,422,798	HSBC Bank	20/9/2023	(1,604,039)
USD	33,034,625	CZK	725,472,783	Barclays	14/9/2023	328,720
USD	12,002,031	HUF	4,202,283,000	Bank of America	14/9/2023	38,178
USD	20,775,095	BRL	99,436,459	JP Morgan	14/9/2023	625,299
USD	373,946	EUR	336,528	Morgan Stanley	14/9/2023	8,655
ZAR	722,340,081	USD	38,508,579	Morgan Stanley	20/9/2023	(119,931)
ZAR	182,326,000	USD	10,121,575	HSBC Bank	14/9/2023	(426,764)
BRL	18,177,000	USD	3,714,747	Barclays	14/9/2023	(31,361)
CLP	4,873,925,000	USD	5,621,597	BNP Paribas	14/9/2023	75,997
CLP	3,229,345,000	USD	3,732,190	Barclays	14/9/2023	42,898
CLP	3,229,345,000	USD	3,741,132	JP Morgan	14/9/2023	33,957
COP	39,017,305,000	USD	8,889,794	BNP Paribas	17/5/2024	95,459
COP	30,779,837,000	USD	7,433,131	Citigroup	14/9/2023	37,685
COP	30,756,444,000	USD	7,402,095	BNP Paribas	29/9/2023	25,612
HUF	1,982,864,000	USD	5,615,747	Citigroup	14/9/2023	29,445
IDR	199,747,050,676	USD	13,027,265	Deutsche Bank	14/9/2023	86,537
INR	2,429,474,500	USD	29,281,361	JP Morgan	20/9/2023	63,905
INR	770,819,000	USD	9,333,079	BNP Paribas	14/9/2023	(22,341)
SEK	859,500,000	USD	79,036,883	UBS	20/9/2023	(188,125)
USD	29,960,488	IDR	455,597,560,240	Morgan Stanley	20/9/2023	52,226
USD	11,587,710	IDR	176,654,645,000	Citigroup	14/9/2023	(10,028)
USD	10,156,538	BRL	49,635,000	Goldman Sachs	14/9/2023	98,506
USD	13,420,500	PLN	54,854,000	JP Morgan	14/9/2023	110,820
USD	14,777,041	MXN	256,165,500	Citigroup	14/9/2023	(503,139)
USD	18,371,256	MXN	313,605,794	Barclays	14/9/2023	(335,219)
USD	17,101,040	CNH	123,974,000	Citigroup	14/9/2023	51,948
USD	10,165,124	EUR	9,290,000	Goldman Sachs	14/9/2023	81,102
USD	10,165,640	CNH	73,910,000	JP Morgan	14/9/2023	1,425
USD	10,024,761	COP	40,575,220,000	Citigroup	14/9/2023	176,431
USD	9,336,517	COP	39,017,305,000	BNP Paribas	17/10/2023	(38,803)
USD	5,692,755	THB	201,700,000	BNP Paribas	14/9/2023	(72,940)
USD	43,561,630	JPY	6,344,799,327	Royal Bank of Canada	20/9/2023	38,837

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	25,989,992	BRL	129,040,545	Citigroup	14/9/2023	(158,773)
USD	49,847,229	JPY	7,250,608,449	Barclays	20/9/2023	110,946
ZAR	328,749,000	USD	17,427,248	Citigroup	14/9/2023	53,305
未実現純評価損						(35,217,796)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	271,883,860	USD	177,066,646	BNY Mellon	15/9/2023	(881,761)
USD	6,292,130	AUD	9,758,716	BNY Mellon	15/9/2023	(31,641)
未実現純評価損						(913,402)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	27,663,274	USD	31,673,211	BNY Mellon	15/9/2023	(314,063)
USD	1,060,227	CHF	929,498	BNY Mellon	15/9/2023	6,551
未実現純評価損						(307,512)
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	226,979,016	USD	31,442,335	BNY Mellon	15/9/2023	(226,095)
USD	3,648,668	CNY	26,360,827	BNY Mellon	15/9/2023	23,288
未実現純評価損						(202,807)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,687,048,350	USD	1,850,973,592	BNY Mellon	15/9/2023	(19,633,013)
USD	68,176,842	EUR	62,480,681	BNY Mellon	15/9/2023	352,424
未実現純評価損						(19,280,589)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	114,920,136	USD	146,219,045	BNY Mellon	15/9/2023	(533,216)
USD	6,237,980	GBP	4,905,498	BNY Mellon	15/9/2023	19,212
未実現純評価損						(514,004)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	227,917,464	USD	29,197,710	BNY Mellon	15/9/2023	(121,974)
USD	5,094,268	HKD	39,915,123	BNY Mellon	15/9/2023	2,252
未実現純評価損						(119,722)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	3,384,849,727	USD	23,755,069	BNY Mellon	15/9/2023	(553,936)
USD	778,500	JPY	112,869,772	BNY Mellon	15/9/2023	4,869
未実現純評価損						(549,067)
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	38,315,487	USD	9,432,003	BNY Mellon	15/9/2023	(135,796)
USD	328,435	PLN	1,344,839	BNY Mellon	15/9/2023	2,145
未実現純評価損						(133,651)
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	89,964,376	USD	66,832,427	BNY Mellon	15/9/2023	(243,278)
USD	2,296,124	SGD	3,110,614	BNY Mellon	15/9/2023	(6,259)
未実現純評価損						(249,537)
ヘッジを使用した南アフリカ・ランド建投資証券クラス						
USD	158	ZAR	3,023	BNY Mellon	15/9/2023	(2)
ZAR	90,902	USD	4,821	BNY Mellon	15/9/2023	12
未実現純評価益						10
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 - 9,451,760,978米ドル)						(57,488,077)

ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド

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	未実現評価益／(損) (米ドル)
2,019	EUR	Euro BOBL	2023年9月	254,164,226
(69)	EUR	Euro BUXL	2023年9月	9,990,978
(625)	EUR	Euro-BTP	2023年9月	78,597,501
358	EUR	Euro-OAT	2023年9月	49,603,891
536	JPY	Nikkei 225 Index	2023年9月	119,775,330
(288)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年9月	289,566,612
87	CAD	S&P/TSX 60 Index	2023年9月	15,737,532
39	EUR	Dax Index	2023年9月	16,988,615
92	EUR	EURO STOXX 50 Index	2023年9月	4,328,975
(916)	GBP	FTSE 100 Index	2023年9月	87,064,332
437	USD	MSCI Emerging Markets Index	2023年9月	21,528,805
(1,561)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2023年9月	485,986,130
(165)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2023年9月	15,808,650
2,947	USD	S&P 500 E-Mini Index	2023年9月	668,342,762
1,657	EUR	EURO STOXX Banks Index	2023年9月	10,125,851
(85)	USD	US Long Bond (CBT)	2023年12月	10,332,812
432	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年12月	47,904,750
(153)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年12月	17,745,609
(2,076)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年12月	268,777,125
514	GBP	Long Gilt	2023年12月	62,114,368
(467)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年12月	49,877,789
合計				2,584,362,643
				690,180

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 305,000	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	(8,538)	7,910
CDS	USD 605,000	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	(4,354)	24,255
CDS	USD 764,388	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	(24,104)	(11,834)
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	Barclays	20/12/2027	44,586	131,895
CDS	USD 985,000	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	(27,596)	(15,765)
CDS	USD 540,000	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	58,394	182,624
CDS	USD 990,000	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	(49,119)	107,270
CDS	USD 220,000	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	22,612	74,402
CDS	USD 320,000	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	30,620	108,221
CDS	USD 380,000	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	(11,080)	27,114
CDS	USD 615,000	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	(49,441)	66,637
CDS	USD 70,511,631	ファンドはCDX.NA.IG.37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	23,029	(1,080,643)
CDS	USD (15,189,391)	ファンドはCDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・ プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	583,922	503,805

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 (36,892,177)	ファンドはCDX.NA.IG.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	505,183	564,748
CDS	EUR (15,833,329)	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	Goldman Sachs	20/12/2027	1,410,892	844,816
CDS	USD 4,340,000	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	Goldman Sachs	20/6/2028	(88,346)	(128,413)
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	Goldman Sachs	20/12/2027	44,537	131,895
CDS	USD 630,000	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	(18,555)	44,952
CDS	USD 1,580,000	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	6,191	73,594
CDS	USD 342,657	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	2,002	15,960
CDS	USD 318,672	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	1,863	14,843
CDS	USD 3,260,000	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	20/6/2028	(88,844)	(16,574)
CDS	USD 3,255,000	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	JP Morgan	20/6/2028	(53,181)	(5,954)
CDS	EUR 9,900,000	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	(450,892)	(110,929)
CDS	EUR 5,840,000	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	(258,681)	(65,437)
CDS	USD 764,389	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	(24,104)	(11,834)
CDS	USD 1,021,223	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	(31,184)	(15,811)
CDS	USD 1,260,000	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	20/12/2027	(85,560)	(113,492)
CDS	USD 570,000	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	(25,065)	(52,019)
CDS	USD (33,871,714)	ファンドはCDX.NA.IG.33.V1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	Goldman Sachs	20/12/2024	(325,304)	312,769
IFS	EUR 11,180,000	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	Goldman Sachs	15/8/2032	(255,712)	(255,712)
IRS	BRL 154,497,000	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	(77,728)	(77,728)
IRS	BRL 22,044,207	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	117,764	117,764
IRS	BRL 33,551,158	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	223,489	223,489
IRS	BRL 22,095,109	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	89,439	89,439
IRS	BRL 113,105,027	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	(206,038)	(206,038)
IRS	BRL 701,231,454	ファンドはBRL 1日 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	(23,854)	(23,854)
IRS	BRL 17,029,082	ファンドは11.76%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2026	107,926	107,926
IRS	BRL 110,099,446	ファンドは9.95%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Citibank	4/1/2027	(210,841)	(210,841)
IRS	BRL 165,268,000	ファンドは10.1075%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	2/1/2026	1,313	1,313
IRS	KRW 27,526,486,255	ファンドは3.3725%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月 KORIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2026	(163,329)	(163,329)
IRS	KRW 27,526,486,256	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	Goldman Sachs	20/9/2026	(156,561)	(156,561)

ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド

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	KRW 27,522,357,489	ファンドは3.391%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/9/2026	(152,419)	(152,419)
IRS	ZAR 592,884,931	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	Goldman Sachs	20/9/2026	(265,598)	(265,598)
IRS	BRL 141,437,775	ファンドは10.005%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	4/1/2027	(292,061)	(292,061)
IRS	GBP 51,315,000	ファンドは4.86%の固定金利を受け取り、 GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2028	83,902	83,902
IRS	EUR 60,014,000	ファンドは2.34%の固定金利を受け取り、 EUR 1日ESTRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	19/1/2033	(1,066,070)	(1,066,070)
IRS	MXN 775,152,164	ファンドは8.17%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	10/6/2033	(1,821,757)	(1,821,757)
IRS	USD 99,369,997	ファンドは3.7565%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Goldman Sachs	9/8/2033	(592,403)	(592,403)
IRS	ZAR 225,749,716	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	Goldman Sachs	20/9/2033	462,398	462,398
IRS	ZAR 112,874,858	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	Goldman Sachs	20/9/2033	231,595	231,595
IRS	ZAR 112,874,857	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	Goldman Sachs	20/9/2033	240,114	240,114
IRS	USD 13,573,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.613%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	2/5/2042	2,051,741	2,082,647
IRS	BRL 17,779,514	ファンドは11.775%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2026	114,119	114,119
IRS	BRL 109,845,909	ファンドは10.025%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	4/1/2027	(159,051)	(159,051)
IRS	BRL 31,266,700	ファンドは11.83%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2026	209,958	209,958
IRS	BRL 109,964,132	ファンドは9.99%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	4/1/2027	(183,201)	(183,201)
TRS	USD 15,259,000	ファンドはiBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2023	(108,739)	(144,651)
TRS	USD 15,915,247	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2023	(122,742)	(139,106)
TRS	USD 166,890	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 75bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2023	(857,258)	(857,258)
TRS	USD 8,152,304	ファンドはUSD 1日SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2023	72,909	91,905
TRS	USD 25,000,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD 1日SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2023	(33,727)	(58,008)
TRS	USD 10,000,000	ファンドはUSD 1日SOFR + 0bpsを受け取り、 Markit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2023	15,346	37,968
合計	(米ドル建の基礎となる)	エクスポージャー-1,116,503,228米ドル)			<u>1,617,193</u>	<u>(1,122,104)</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)
36,612,000	プット	OTC USD/INR	Citibank	USD 82	9/10/2023	(30,443)	45,893
145,392,721	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.099	25/9/2023	1,087,434	2,309,796
120,773,063	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.6	12/9/2023	(364,840)	259,557
2,820,300	プット	OTC USD/EUR	Morgan Stanley	EUR 1.06	20/10/2023	488,060	957,535
80,640,000	コール	OTC USD/HKD	Morgan Stanley	USD 7.81	13/11/2023	38,344	187,206
1,992,995	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 239.439	10/11/2023	17,355	147,178
3,320,329	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 239.3	10/11/2023	23,662	246,734
1,329,992	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 239.43	10/11/2023	22,559	98,257
6,555	コール	NASDAQ 100 Index	UBS	USD 15,700	15/9/2023	(295,539)	907,303
416	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	(232,917)	42,432
697	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	(664,749)	5,925
358	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 15	15/9/2023	(9,800)	4,475
270	プット	Air Transport Services	Exchange Traded	USD 12.5	15/9/2023	(15,480)	5,400
330	コール	Albemarle	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(195,402)	14,850
1,239	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 100	15/9/2023	(542,023)	89,827
564	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(21,279)	7,050
1,496	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	1,357,277	1,974,720
1,672	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	819,083	1,417,020
1,330	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(167,884)	615,125
1,384	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	15/9/2023	(477,025)	86,500
1,842	コール	Apple	Exchange Traded	USD 195	15/9/2023	(839,453)	144,597
832	コール	Apple	Exchange Traded	USD 200	15/9/2023	(335,022)	22,880
1,958	コール	Apple	Exchange Traded	USD 205	15/9/2023	(520,297)	22,517
522	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	370,353	657,720
1,288	コール	Archer-Daniels-Midland	Exchange Traded	USD 82.5	15/9/2023	(170,311)	51,520
4,313	コール	Barclays	Exchange Traded	GBP 1.6	15/9/2023	(183,872)	13,668
493	プット	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(260,664)	9,121
4,326	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(578,512)	10,815
826	コール	Edwards Lifesciences	Exchange Traded	USD 85	15/9/2023	(223,524)	8,260
187	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	1,039,008	1,314,610
245	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	1,827,850	2,203,775
289	コール	First Solar	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	(231,651)	21,819
5,768	コール	Ford Motor	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(295,331)	5,768
1,730	コール	General Motors	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(263,730)	4,325
331	コール	Humana	Exchange Traded	USD 450	15/9/2023	520,995	830,810
83	コール	Humana	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	13,421	132,385
2,497	コール	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	(477,398)	8,740
1,728	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 60	15/9/2023	(438,069)	23,328
729	コール	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 62.5	15/9/2023	(184,454)	4,739
4,031	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(716,426)	18,140
671	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 360	15/9/2023	(696,624)	17,111
979	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 355	15/9/2023	(1,155,108)	39,649
1,252	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 365	15/9/2023	(1,266,208)	21,910
1,251	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	5,504,739	8,628,772
89	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 480	15/9/2023	9,719	238,742
89	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 485	15/9/2023	(60,039)	210,040
747	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(730,569)	1,155,982
427	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 470	15/9/2023	351,323	1,447,530
412	プット	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 210	15/9/2023	(438,514)	4,944
2,503	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 40	15/9/2023	(399,802)	6,258
3,069	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 42.5	15/9/2023	(321,395)	4,604
522	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(6,123)	2,088
633	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 14	15/9/2023	(8,143)	1,583
159	プット	RingCentral	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(4,926)	1,590

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)
429	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 5	15/9/2023	3,808	12,656
175	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 230	15/9/2023	(151,542)	56,437
175	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 240	15/9/2023	(133,680)	14,175
238	プット	Seagate Technology	Exchange Traded	USD 57.5	15/9/2023	(10,219)	714
233	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	15/9/2023	(32,499)	1,049
2,182	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	15/9/2023	(1,521,081)	94,917
378	コール	Starbucks	Exchange Traded	USD 105	15/9/2023	(96,551)	3,213
1,340	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	15/9/2023	(10,358)	10,050
565	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 17	15/9/2023	(10,017)	4,238
132	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 275	15/9/2023	(121,885)	45,870
132	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 280	15/9/2023	(199,949)	33,990
502	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 290	15/9/2023	(881,627)	70,782
830	コール	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	(16,375)	251,075
2,773	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	(551,076)	70,711
1,058	コール	UniCredit	Exchange Traded	EUR 23	15/9/2023	(226,886)	202,312
541	コール	United Rentals	Exchange Traded	USD 460	15/9/2023	116,650	1,311,925
319	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	136,459	319,000
1,661	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	377,364	971,685
1,294	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(371,029)	39,467
149	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 25	15/9/2023	(9,123)	2,608
80	プット	Viasat	Exchange Traded	USD 22.5	15/9/2023	(1,678)	800
729	コール	Vinci	Exchange Traded	EUR 110	15/9/2023	(161,384)	6,327
416	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	(114,698)	6,448
412	プット	Zscaler	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(170,869)	184,370
565	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 25	20/9/2023	(30,922)	7,628
82	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 108.5	22/9/2023	(19,986)	8,328
1,641	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	118,595	635,887
8,706	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 110	20/10/2023	(1,599,554)	831,423
347	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 23	20/10/2023	(8,851)	9,543
2,468	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	438,786	1,789,300
985	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 140	20/10/2023	98,766	480,187
1,974	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(614,638)	573,447
987	コール	Apple	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	767,074	1,149,855
1,317	コール	Apple	Exchange Traded	USD 185	20/10/2023	620,011	1,056,892
829	コール	Bunge	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	607,502	978,220
2,468	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 125	20/10/2023	(152,350)	445,474
313	コール	Equitrans Midstream	Exchange Traded	USD 12	20/10/2023	(11,340)	1,565
823	プット	Fortinet	Exchange Traded	USD 55	20/10/2023	(174,665)	49,380
2,496	コール	Freepoint-McMoRan	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	(535,632)	142,272
2,007	コール	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(229,253)	61,213
2,823	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	655,572	1,171,545
492	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 345	20/10/2023	(12,580)	265,680
414	コール	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 320	20/10/2023	(20,543)	335,340
24,620	コール	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 180	20/10/2023	2,222,446	9,294,050
208	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 435	20/10/2023	(83,617)	64,376
2,588	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 463	20/10/2023	103,716	976,970
567	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 16	20/10/2023	(8,635)	8,505
2,479	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	(211,267)	302,438
330	コール	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 530	20/10/2023	(350,371)	84,315
1,409	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/11/2023	37,047	602,347
106	コール	Broadcom	Exchange Traded	USD 900	17/11/2023	242,203	675,220
412	コール	Humana	Exchange Traded	USD 520	17/11/2023	(515,919)	206,000
8,478	コール	Kenvue	Exchange Traded	USD 25	17/11/2023	(167,313)	487,485
545	コール	Lennar	Exchange Traded	USD 135	17/11/2023	(271,788)	80,387

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)
1,345	コール	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 140	17/11/2023	48,599	662,412
1,120	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	15/12/2023	1,423	20,720
416	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 440	15/12/2023	1,796,193	3,565,120
569	プット	Stellantis	Exchange Traded	USD 14	15/12/2023	(8,097)	8,535
2,556	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 47	19/1/2024	(170,559)	24,282
4,258	コール	Pfizer	Exchange Traded	USD 50	19/1/2024	(169,872)	23,419
638	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 6	19/1/2024	22,187	35,728
563	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 7	19/1/2024	8,035	21,113
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 959,684,079米ドル)						(2,070,206)	57,564,543

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	未実現評益／(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
(145,392,721)	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.079	25/9/2023	(244,900)	(716,520)
(120,773,063)	プット	OTC USD/MXN	Morgan Stanley	USD 16.2	12/9/2023	168,888	(5,025)
(40,290,000)	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.11	20/10/2023	28,529	(81,795)
(1,992,995)	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 262.243	10/11/2023	16,407	(45,668)
(3,320,329)	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 262.09	10/11/2023	27,259	(76,743)
(1,329,992)	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 262.232	10/11/2023	(4)	(30,493)
(660)	プット	Albamarle	Exchange Traded	USD 180	15/9/2023	191,414	(36,300)
(1,239)	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 115	15/9/2023	204,349	(9,293)
(2,994)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 135	15/9/2023	(882,422)	(1,332,330)
(2,509)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 140	15/9/2023	(96,089)	(421,512)
(2,660)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	434,297	(51,870)
(1,938)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	15/9/2023	234,851	(6,783)
(1,449)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	119,209	(44,195)
(1,044)	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 150	15/9/2023	(248,982)	(493,290)
(454)	コール	CF Industries	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	66,781	(4,540)
(493)	コール	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	123,675	(40,919)
(493)	プット	Crowdstrike	Exchange Traded	USD 120	15/9/2023	68,151	(740)
(4,326)	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	141,766	(4,326)
(245)	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 500	15/9/2023	(1,158,778)	(1,240,312)
(289)	プット	First Solar	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	(142,255)	(232,645)
(5,768)	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 13	15/9/2023	(379,126)	(510,468)
(1,730)	プット	General Motors	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	(145,940)	(295,830)
(165)	コール	Humana	Exchange Traded	USD 490	15/9/2023	59,535	(30,938)
(2,497)	コール	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 170	15/9/2023	90,711	(3,746)
(336)	コール	KLA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	179,404	(23,520)
(1,728)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 50	15/9/2023	106,523	(18,144)
(729)	プット	Las Vegas Sands	Exchange Traded	USD 55	15/9/2023	8,751	(73,264)
(4,031)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 41	15/9/2023	122,021	(62,480)
(825)	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 80	15/9/2023	85,652	(4,538)
(1,095)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 380	15/9/2023	529,796	(6,023)
(669)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	15/9/2023	201,548	(21,074)
(671)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 320	15/9/2023	193,281	(146,278)
(178)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 550	15/9/2023	125,892	(45,390)
(178)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 560	15/9/2023	171,055	(30,616)
(418)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 600	15/9/2023	324,442	(16,511)
(658)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 540	15/9/2023	458,467	(250,040)
(845)	プット	NVIDIA	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	1,067,097	(23,660)
(412)	コール	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 260	15/9/2023	62,816	(22,866)
(412)	プット	Palo Alto Networks	Exchange Traded	USD 190	15/9/2023	173,914	(2,060)
(5,572)	プット	Pfizer	Exchange Traded	USD 35	15/9/2023	119,961	(108,654)
(350)	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 250	15/9/2023	149,621	(7,350)
(2,182)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	15/9/2023	623,393	(27,275)
(264)	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 305	15/9/2023	133,222	(15,972)
(753)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 220	15/9/2023	234,385	(50,075)
(830)	コール	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 90	15/9/2023	29,026	(12,450)
(499)	プット	Toll Brothers	Exchange Traded	USD 70	15/9/2023	56,771	(4,491)
(2,773)	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 42.5	15/9/2023	297,460	(37,436)
(1,058)	プット	UniCredit	Exchange Traded	EUR 20	15/9/2023	212,326	(22,670)
(637)	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 130	15/9/2023	341,918	(172,627)
(729)	プット	Vinci	Exchange Traded	EUR 100	15/9/2023	64,232	(32,428)
(831)	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 95	15/9/2023	115,871	(4,571)
(412)	コール	Zscaler	Exchange Traded	USD 175	15/9/2023	57,378	(102,382)
(412)	プット	Zscaler	Exchange Traded	USD 125	15/9/2023	96,930	(60,770)
(565)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 40	20/9/2023	9,475	(2,260)

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)
(3,282)	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	(35,219)	(346,251)
(820)	プット	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 95	20/10/2023	147,540	(149,240)
(8,706)	コール	Alibaba	Exchange Traded	USD 130	20/10/2023	415,880	(174,120)
(2,468)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 145	20/10/2023	(116,568)	(624,404)
(2,468)	プット	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	20/10/2023	227,720	(87,614)
(1,969)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 155	20/10/2023	(24,082)	(169,334)
(1,974)	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	258,981	(87,843)
(2,430)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	196,723	(184,680)
(1,641)	コール	Apple	Exchange Traded	USD 200	20/10/2023	(178,371)	(253,534)
(1,895)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 160	20/10/2023	246,837	(82,432)
(829)	コール	Bunge	Exchange Traded	USD 120	20/10/2023	(83,948)	(145,075)
(2,468)	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 135	20/10/2023	79,641	(75,274)
(2,468)	プット	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 105	20/10/2023	282,015	(159,186)
(823)	コール	Fortinet	Exchange Traded	USD 70	20/10/2023	33,553	(28,805)
(823)	プット	Fortinet	Exchange Traded	USD 45	20/10/2023	27,792	(8,230)
(2,496)	コール	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 50	20/10/2023	226,448	(33,696)
(1,664)	プット	Freeport-McMoRan	Exchange Traded	USD 38	20/10/2023	(35,328)	(178,048)
(2,007)	プット	MGM Resorts International	Exchange Traded	USD 40	20/10/2023	(5,799)	(103,360)
(2,823)	プット	Micron Technology	Exchange Traded	USD 52.5	20/10/2023	193,101	(57,871)
(985)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 370	20/10/2023	21,935	(124,602)
(246)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 300	20/10/2023	49,266	(56,457)
(414)	コール	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 350	20/10/2023	22,917	(49,680)
(414)	プット	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 270	20/10/2023	56,851	(48,645)
(24,620)	コール	SPDR Gold Shares	Exchange Traded	USD 190	20/10/2023	(239,566)	(1,711,090)
(2,479)	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 57.5	20/10/2023	87,433	(40,904)
(2,479)	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 37.5	20/10/2023	55,206	(45,862)
(330)	コール	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 560	20/10/2023	128,293	(17,820)
(330)	プット	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 450	20/10/2023	(14,762)	(122,925)
(1,409)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	96,348	(210,645)
(106)	プット	Broadcom	Exchange Traded	USD 760	17/11/2023	125,380	(98,580)
(412)	コール	Humana	Exchange Traded	USD 560	17/11/2023	194,779	(51,500)
(412)	プット	Humana	Exchange Traded	USD 440	17/11/2023	(77,141)	(327,540)
(8,478)	プット	Kenvue	Exchange Traded	USD 20	17/11/2023	40,403	(148,365)
(545)	プット	Lennar	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(97,597)	(242,525)
(931)	コール	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 82.5	17/11/2023	45,405	(9,310)
(931)	プット	NextEra Energy	Exchange Traded	USD 65	17/11/2023	(23,955)	(137,322)
(1,345)	プット	T-Mobile US	Exchange Traded	USD 115	17/11/2023	(40,964)	(175,522)
(416)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 530	15/12/2023	(884,933)	(1,649,440)
(416)	プット	NVIDIA	Exchange Traded	USD 310	15/12/2023	389,485	(71,344)
(461)	コール	SPDR S&P 500 ETF	TrustExchange Traded	USD 420	15/12/2023	(793,364)	(1,914,533)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 366,058,609米ドル)						6,028,289	(17,327,764)

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 405,809,161	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	(2,982,308)	635,136
USD 205,910,683	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	(1,347,871)	29,672
USD 61,700,555	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	(473,316)	6,714
USD 13,320,000	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	(30,063)	22,484
USD 12,290,000	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	(38,492)	9,930
USD 13,305,000	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	(64,411)	8,102
USD 8,860,000	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	(25,611)	10,095
USD 56,250,298	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	(1,050,129)	65
USD 24,511,164	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	(607,829)	36
USD 113,325,463	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	(476,659)	20,085

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 41,424,423	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	223,130	768,474
USD 36,229,829	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	(530,144)	27,102
USD 36,229,829	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	(396,697)	13,387
USD 28,169,866	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	(1,112,399)	49,225
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 343,272,013米ドル)				(8,912,799)	1,600,507

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 (205,910,683)	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	547,317	(406)
USD (61,700,555)	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	117,217	(14)
USD (13,305,000)	ファンドは、プット・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	7,523	(2,788)
USD (8,860,000)	ファンドは、プット・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	2,444	(2,429)
USD (96,857,671)	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3.93%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	37,924	(669,137)
USD (135,424,226)	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3.5%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	(2,564,638)	(3,966,279)
USD (302,911,482)	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4.05%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	(2,983,327)	(3,839,052)
USD (272,119,467)	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4.25%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	(1,677,173)	(2,534,349)
USD (56,662,731)	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3.3%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	(94,925)	(295,133)
USD (113,325,463)	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	306,057	(5,588)
USD (209,364,224)	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4.4%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	401,050	(520,153)

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 (207,122,114)	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	151,893	(262,351)
USD (41,424,423)	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%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	322,737	(228,208)
USD (112,679,426)	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4.75%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	38,203	(345,693)
USD (281,698,657)	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	967,759	(16,212)
USD (49,188,000)	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	881,065	(14,156)
USD (49,188,000)	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	(377,517)	(1,336,682)
USD (103,523,246)	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	231,417	(414,568)
USD (281,591,969)	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	(1,847,122)	(4,750,335)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー—987,956,843米ドル)				(5,532,096)	(19,203,533)

差金決済契約 2023年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
	オーストラリア		
(91,299)	Brambles	JP Morgan	(41,619)
(446,350)	Computershare	JP Morgan	(6,802)
(229,434)	Evolution Mining	JP Morgan	3,058
(30,204)	Fortescue Metals	JP Morgan	(187)
(46,896)	IDP Education	JP Morgan	(8,241)
(83,227)	IGO	JP Morgan	(24,478)
(136,330)	Lendlease	JP Morgan	48,230
(11,078)	Macquarie	JP Morgan	186
(57,949)	Mineral Resources	JP Morgan	(59,132)
(144,282)	Pilbara Minerals	JP Morgan	67,396
(91,341)	Santos	JP Morgan	17,424
(116,788)	Suncorp	JP Morgan	22,895
(14,684)	Woodside Energy	JP Morgan	17,985
			<u>36,715</u>
	ベルギー		
(4,320)	D'iereen	Citibank	3,815
(7,004)	D'iereen	JP Morgan	67,801
			<u>71,616</u>
	バミューダ		
(6,891)	Arch Capital	Citibank	(15,780)
			<u>(15,780)</u>
	ブラジル		
(298,858)	Alpargatas	JP Morgan	28,433
(89,414)	Banco BTG Pactual	JP Morgan	14,709
(365,537)	BRF	JP Morgan	53,352
(177,796)	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP	Citibank	44,306
(7,288,912)	Hapvida Participacoes e Investimentos	JP Morgan	895,160
(281,069)	Localiza Rent a Car	JP Morgan	207,733
(49,517)	Suzano	Citibank	(10,852)
			<u>1,232,841</u>
	カナダ		
(17,699)	Brookfield Asset Management	Citibank	(35,900)
(20,141)	Cenovus Energy	JP Morgan	(7,834)
(25,893)	Great-West Lifeco	JP Morgan	32,350
(25,701)	Intact Financial	JP Morgan	115,450
(10,495)	Intact Financial	Citibank	(7,853)
(79,815)	Power of Canada	JP Morgan	51,852
(90,213)	Power of Canada	Citibank	(98,426)
(27,399)	Restaurant Brands International	Citibank	(25,370)
(19,471)	Restaurant Brands International	JP Morgan	77,634
			<u>101,903</u>
	ケイマン諸島		
(170,800)	Sands China	JP Morgan	60,681
			<u>60,681</u>
	中国		
(2,100,000)	China Southern Airlines	JP Morgan	115,615
(407,279)	China Vanke	Citibank	3,613
(490,000)	Flat Glass	JP Morgan	134,070
(82,800)	Fuyao Glass Industry	JP Morgan	(5,103)
(6,000)	Fuyao Glass Industry	Citibank	220
(438,500)	Li Ning	JP Morgan	307,575
(100,000)	Li Ning	Citibank	3,044
(1,540,000)	PICC Property & Casualty	JP Morgan	(34,935)

差金決済契約 2023年8月31日現在(続き)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
	中国(続き)		
(755,250)	Shandong Gold Mining	JP Morgan	(31,400)
(3,756,200)	Xiaomi	JP Morgan	(117,495)
(1,060,000)	Xiaomi	Citibank	(117,297)
(684,500)	XPeng	Citibank	(731,427)
(115,400)	XPeng	JP Morgan	(41,810)
(191,100)	Zhuzhou CRRC Times Electric	JP Morgan	27,597
(204,200)	Zhuzhou CRRC Times Electric	Citibank	(50,073)
(131,800)	ZTE	Citibank	2,963
			<u>(534,843)</u>
	デンマーク		
(24,976)	Tryg	Citibank	(14,555)
			<u>(14,555)</u>
	フィンランド		
(102,710)	Metso	JP Morgan	(60,675)
(75,467)	Metso	Citibank	(37,177)
(86,377)	Nordea Bank	Citibank	(12,919)
			<u>(110,771)</u>
	フランス		
(23,709)	Pernod Ricard	JP Morgan	353,762
(19,305)	Sartorius Stedim Biotech	JP Morgan	5,069
			<u>358,831</u>
	ドイツ		
(35,363)	Delivery Hero	JP Morgan	142,653
(79,270)	HelloFresh	JP Morgan	(374,352)
(15,143)	HelloFresh	Citibank	(48,581)
(9,161)	HOCHTIEF	JP Morgan	(89,008)
(2,436)	Sartorius	Citibank	(71,539)
(12,313)	Sartorius	JP Morgan	(356,904)
(15,632)	Talanx	JP Morgan	(79,587)
(220,684)	Vonovia	Citibank	(588,567)
			<u>(1,465,885)</u>
	香港		
(469,500)	China Overseas Land & Investment	Citibank	(66,168)
(1,513,000)	Sino Biopharmaceutical	JP Morgan	26,001
			<u>(40,167)</u>
	アイルランド		
(19,125)	James Hardie Industries	JP Morgan	8,783
			<u>8,783</u>
	イタリア		
(111,338)	Nexi	Citibank	(24,087)
(1,618,527)	Telecom Italia	JP Morgan	(52,900)
(11,238,558)	Telecom Italia	Citibank	(128,059)
			<u>(205,046)</u>
	日本		
(3,100)	Advantest	Citibank	22,069
(25,200)	Advantest	JP Morgan	788
(372,400)	ENEOS	Citibank	(60,750)
(24,300)	Fujitsu General	JP Morgan	35,373
(17,200)	Hitachi	Citibank	(38,351)
(8,900)	Lasertec	Citibank	(40,501)
(71,500)	MatsukiyoCocokara	Citibank	120,796
(131,900)	Mercari	JP Morgan	143,312
(24,200)	Mercari	Citibank	(35,669)

差金決済契約 2023年8月31日現在(続き)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(37,100)	Mitsubishi Estate	Citibank	(27,164)
(32,100)	Mitsui Fudosan	JP Morgan	(23,576)
(12,500)	NEC	Citibank	(18,579)
(174,400)	Olympus	JP Morgan	470,248
(71,700)	Olympus	Citibank	(82,948)
(5,900)	Open House	Citibank	(7,095)
(43,500)	Park24	JP Morgan	3,390
(1,390,200)	Rakuten	JP Morgan	40,923
(87,800)	Recruit	Citibank	(207,227)
(10,900)	RENOVA	Citibank	(1,696)
(69,000)	RENOVA	JP Morgan	35,240
(62,100)	SBI	JP Morgan	37,825
(14,400)	Socionext	JP Morgan	(100,875)
(22,500)	SoftBank	JP Morgan	66,971
(17,200)	SoftBank	Citibank	14,314
(10,600)	Sony	Citibank	(4,970)
(42,400)	Square Enix	JP Morgan	48,311
(171,300)	SUMCO	Citibank	9,039
(51,700)	SUMCO	JP Morgan	23,339
(21,300)	Sumitomo	JP Morgan	4,231
(11,100)	TDK	Citibank	(21,317)
			<u>405,451</u>
	ルクセンブルグ		
(207,764)	InPost	JP Morgan	(75,859)
(27,818)	Reinet Investments	JP Morgan	25,833
			<u>(50,026)</u>
	マレーシア		
(478,405)	Lynas Rare Earths	JP Morgan	(51,685)
			<u>(51,685)</u>
	メキシコ		
(5,809,371)	America Movil	Citibank	(118,662)
			<u>(118,662)</u>
	オランダ		
(15,470)	Heineken	Citibank	(15,377)
(34,447)	Koninklijke Philips	JP Morgan	(79,071)
(126,191)	Koninklijke Philips	Citibank	(28,369)
			<u>(122,817)</u>
	ノルウェー		
(3,245)	Aker	Citibank	(940)
(74,445)	Aker BP	Citibank	(17,317)
(13,485)	Nordic Semiconductor	JP Morgan	19,281
(32,981)	Nordic Semiconductor	Citibank	3,044
(26,598)	Salmar	Citibank	(112,252)
			<u>(108,184)</u>
	ポーランド		
(24,945)	Bank Polska Kasa Opieki	JP Morgan	34,386
(39,578)	KGHM Polska Miedz	Citibank	(44,200)
(203)	LPP	Citibank	(58,361)
(45,166)	ORLEN	JP Morgan	80,474
			<u>12,299</u>
	シンガポール		
(112,145)	Sea	JP Morgan	1,622,294
			<u>1,622,294</u>

差金決済契約 2023年8月31日現在(続き)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
(45,055)	南アフリカ Sasol	JP Morgan	2,026
			<u>2,026</u>
	韓国		
(67,436)	Kakao	Citibank	2,506
(26,096)	Kakao	JP Morgan	76,966
(1,101)	LG Chem	Citibank	(13,244)
(7,016)	LG Electronics	JP Morgan	22,782
(17,159)	Lotte Energy Materials	JP Morgan	31,091
(757)	LS	JP Morgan	(161)
(3,407)	POSCO	JP Morgan	(34,783)
(15,943)	POSCO Future M	JP Morgan	(12,096)
(7,268)	SK	JP Morgan	46,228
(8,668)	SK Innovation	JP Morgan	82,179
(499)	SK Innovation	JP Morgan	(2,011)
			<u>199,457</u>
	スウェーデン		
(51,148)	Electrolux	Citibank	20,991
(46,105)	EQT	Citibank	14,270
(30,449)	Essity	Citibank	(18,851)
(328,437)	Fastighets Balder	Citibank	(153,142)
(30,436)	Sagax	Citibank	(35,726)
(66,844)	Securitas	JP Morgan	(791)
			<u>(173,249)</u>
	スイス		
(37,620)	Bachem	JP Morgan	145,497
(3,759)	Cie Financiere Richemont	JP Morgan	24,885
(207,377)	SIG	Citibank	(371,694)
(9,925)	Straumann	Citibank	(16,103)
(7,583)	Tecan	JP Morgan	(142,558)
(142,889)	UBS	JP Morgan	(695,591)
			<u>(1,055,564)</u>
	台湾		
(72,000)	Powerchip Semiconductor Manufacturing	JP Morgan	1,612
			<u>1,612</u>
	英国		
(596,643)	Centrica	JP Morgan	(88,591)
(360,658)	Ocado	JP Morgan	(26,593)
(157,501)	Rentokil Initial	Citibank	(45,611)
			<u>(160,795)</u>
	米国		
(11,026)	Aflac	Citibank	(20,839)
(20,669)	Air Transport Services	JP Morgan	21,082
(3,951)	Airbnb	JP Morgan	31,687
(1,114)	Align Technology	JP Morgan	(17,378)
(1,950)	Arista Networks	Citibank	(20,642)
(4,392)	Avery Dennison	JP Morgan	(28,601)
46,887	Banc of California	JP Morgan	35,301
(28,094)	Bank of America	JP Morgan	65,880
(21,750)	Bank of Hawaii	JP Morgan	33,930
(22,352)	BankUnited	JP Morgan	81,808
(16,262)	Banner	JP Morgan	65,698
(41,626)	Blackstone	Citibank	(311,427)
(9,276)	Block	JP Morgan	29,773

差金決済契約 2023年8月31日現在(続き)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(104,819)	Boston Properties	JP Morgan	85,190
(3,983)	Brandywine Realty Trust	JP Morgan	(518)
(20,935)	Broadridge Financial Solutions	JP Morgan	(202,416)
(5,516)	Broadridge Financial Solutions	Citibank	(53,505)
(4,507)	Capital One Financial	JP Morgan	51,019
(27,820)	Celanese	Citibank	(235,620)
(6,579)	Celanese	JP Morgan	(9,327)
(28,326)	Charles River Laboratories International	JP Morgan	(121,634)
(5,975)	Charles River Laboratories International	Citibank	(59,631)
(31,216)	Charles Schwab	JP Morgan	181,365
(15,208)	Church & Dwight	Citibank	(52,163)
(27,516)	Church & Dwight	JP Morgan	(17,610)
(152,616)	Cloudflare	JP Morgan	158,721
(32,774)	Community Bank System	JP Morgan	215,633
(84,268)	Constellation Energy	Citibank	64,284
(5,482)	CoStar	JP Morgan	(1,590)
(9,685)	Crown Castle	JP Morgan	3,297
(4,652)	Darden Restaurants	JP Morgan	35,960
(5,261)	Discover Financial Services	Citibank	(8,944)
(15,159)	DXC Technology	JP Morgan	(1,946)
(2,671)	Enphase Energy	JP Morgan	15,170
(6,621)	EPAM Systems	JP Morgan	(94,873)
(7,805)	Equifax	Citibank	(130,344)
(5,802)	Equifax	JP Morgan	(54,771)
(28,956)	FB Financial	JP Morgan	110,033
(8,893)	Fiserv	JP Morgan	22,686
(3,627)	Ford Motor	Citibank	(1,016)
(24,993)	Frontier Communications Parent	JP Morgan	55,235
(83,006)	Gen Digital	Citibank	(8,076)
(3,638)	Generac	JP Morgan	(31,746)
(26,350)	Glacier Bancorp	JP Morgan	86,428
(34,972)	Hasbro	Citibank	(116,312)
(154,632)	Huntington Bancshares	JP Morgan	139,169
(25,762)	Illumina	Citibank	(124,189)
(22,013)	Independent Bank	JP Morgan	38,633
(11,275)	International Business Machines	JP Morgan	(24,520)
(13,086)	Iron Mountain	Citibank	(52,606)
(31,736)	Iron Mountain	JP Morgan	(88,543)
(31,343)	J M Smucker	JP Morgan	95,596
(26,885)	Kimco Realty	Citibank	(10,754)
(26,840)	KKR	JP Morgan	(33,803)
(44,269)	KKR	Citibank	(136,229)
(40,494)	Lamb Weston	Citibank	(73,777)
(15,078)	Lamb Weston	JP Morgan	35,132
(1,132)	Martin Marietta Materials	JP Morgan	12,860
57	MercadoLibre	Citibank	6,228
(57)	MercadoLibre	JP Morgan	(1,347)
(10,325)	Mosaic	Citibank	(2,403)
(223,272)	Newell Brands	Citibank	(68,098)
(53,280)	Newell Brands	JP Morgan	7,726
(12,799)	Occidental Petroleum	Citibank	2,816
(27,909)	OceanFirst Financial	JP Morgan	35,724
(136)	Old Dominion Freight Line	Citibank	(2,877)

差金決済契約 2023年8月31日現在(続き)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益／(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,475)	Old Dominion Freight Line	JP Morgan	(59,266)
(6,022)	ON Semiconductor	JP Morgan	7,461
(19,157)	Oracle	Citibank	(83,525)
(7,621)	Oracle	JP Morgan	(41,484)
(41,404)	Pacific Premier Bancorp	JP Morgan	116,345
(71,376)	PacWest Bancorp	JP Morgan	(46,644)
(434,028)	Palantir Technologies	JP Morgan	865,886
(406,018)	Paramount Global	Citibank	(266,526)
(7,637)	PayPal	JP Morgan	(13,478)
(4,146)	Pool	JP Morgan	29,214
(12,334)	Prosperity Bancshares	JP Morgan	49,089
(6,465)	QUALCOMM	JP Morgan	22,687
(18,519)	Quanta Services	Citibank	(95,743)
(6,277)	Ralph Lauren	JP Morgan	89,755
(7,514)	Raymond James Financial	Citibank	(18,484)
(24,045)	Raymond James Financial	JP Morgan	82,234
(11,636)	Realty Income	JP Morgan	3,057
(22,872)	Republic Services	Citibank	14,638
(3,168)	Republic Services	JP Morgan	4,784
(28,174)	Revvity	JP Morgan	32,930
(5,684)	Revvity	Citibank	(30,921)
(15,130)	Sabre	JP Morgan	4,085
(45,598)	Simmons First National	JP Morgan	74,781
(6,483)	Simon Property	JP Morgan	36,436
(32,332)	Snowflake	JP Morgan	(33,302)
(210,835)	Southwest Airlines	Citibank	(19,258)
(20,076)	STERIS	JP Morgan	(134,500)
(62,931)	Take-Two Interactive Software	Citibank	(126,794)
(11,174)	Targa Resources	JP Morgan	(37,768)
(6,916)	Teledyne Technologies	Citibank	(99,106)
(53,288)	Truist Financial	JP Morgan	98,316
(15,292)	Tyson Foods	JP Morgan	19,934
(180,045)	Valley National Bancorp	JP Morgan	150,214
(29,031)	Washington Federal	JP Morgan	90,286
(30,509)	Western Alliance Bancorp	JP Morgan	61,323
(14,689)	Xerox	JP Morgan	(4,847)
(10,031)	Zions Bancorp	JP Morgan	28,789
			374,607
			261,087
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-414,987,986米ドル)			

SPACに対するPIPEコミットメント 2023年8月31日現在

保有高	銘柄	コミットメント額 (米ドル)	未実現評価益／(損) (米ドル)
	米国		
5,447,000	FLYR	5,447,000	-
合計		5,447,000	-

<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・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンド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	
商品分類	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。

■損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・グローバル・フレキシブル・バランス・ファンドは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	-
差金決済契約配当金、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
差金決済契約に係る支払配当金、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)
差金決済契約	-
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)
以下に係る未実現純評価益／(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)
差金決済契約	-
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
当期末実現純評価益／(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	Alice 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	Gulfport 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			
投資有価証券合計		1,593,294,047	98.46
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)

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