

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、原則が為替ヘッジを行いません。</p>
主要運用対象	<p>当ファンドは、「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35期 運用報告書(全体版) (決算日:2024年10月21日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、
期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

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

◇基準価額の推移

■最近5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
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
35期(2024年10月21日)	24,985	0	5.6	264.98	7.2	99.0	2,416

(注1) 基準価額は1万円当り。

(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。

(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) 2024年 4月22日	円 23,664	% -	247.18	% -	% 99.0
4 月 末	24,310	2.7	254.95	3.1	99.0
5 月 末	24,765	4.7	258.38	4.5	99.3
6 月 末	25,880	9.4	270.51	9.4	100.0
7 月 末	24,456	3.3	257.77	4.3	99.7
8 月 末	23,823	0.7	252.30	2.1	99.6
9 月 末	24,009	1.5	255.00	3.2	100.7
(期 末) 2024年10月21日	24,985	5.6	264.98	7.2	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。

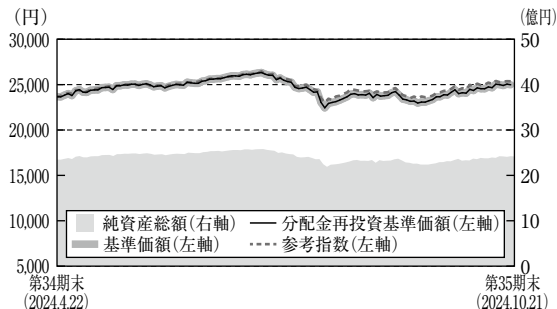
(注4) S&P500種指数は、米国の上場、店頭銘柄のうち主要業種から選ばれた500銘柄で構成される市場全体の動きを表す代表的指数であり、時価総額加重平均指数です。S&P500は、スタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLCの登録商標です。

(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。

■当期中の基準価額等の推移について

(第35期:2024年4月23日～2024年10月21日)



第35期首:23,664円

第35期末:24,985円(既払分配金0円)

騰落率:5.6%(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、底堅い景気見通しや良好な企業決算を背景に上昇となりました。期中は、予想比弱い米雇用統計等を受けて景気後退の可能性が警戒され、株式市場は上昇幅を一部縮小したものの、その後は底堅い経済データを受けた市場センチメントの回復や主要先進国中銀の利下げ姿勢が好感され、株式市場は上昇となりました。

<グローバル債券市場>

債券市場では、米インフレの鈍化や期中の軟調な米雇用統計等を背景に利下げ織り込みが拡大したことを受けて金利低下(債券価格上昇)となりました。FRB(米連邦準備制度理事会)は9月のFOMC(米連邦公開

市場委員会)で当初想定を上回る50bpsの利下げを実施したものの、発表した政策金利見通しが市場想定よりタカ派であったことや、期末にかけて底堅い経済データが発表されたこと等を受けて期前半の低下幅を一部巻き戻しました。

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、当ファンドは株式をオーバーウェイトとしました。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」を嗜好しており、セクター別では、テクノロジー、エネルギー、ヘルスケア中心にオーバーウェイトとしました。
- セクターのポジショニングでは、高い収益性を背景に情報技術セクターに対して建設的な見方を維持しており、オーバーウェイトとしました。一方、IT企業はAI関連の設備投資を継続する必要があることから、短期的には投資利益率が低下するリスクがあり、オーバーウェイト幅を縮小しました。
- エネルギー・セクターでは、潤沢なキャッシュフローを生み出すことができ、相対的に魅力的なバリュエーションを維持している企業に注目しています。
- ヘルスケアはディフェンシブ性の高いセクターであり、景気減速が続く中で市場全体をアウトパフォームする可能性があると考えます。したがって、同セクターに対しては依然として建設的な見方をしており、

オーバーウェイトを維持します。

- 債券ポートフォリオに関しては、2024年9月末において、ポートフォリオ全体のデュレーションは2.1年と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いるほか、国債の発行動向等を踏まえると今後長期金利が上昇する可能性がありますと考えます。
- 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拡大しました。
- 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・ボンド・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+5.6%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+10.4%と上昇したことがプラス要因となりました。一方で、当該ファンドは米ドル建てのため、米ドルが円に対して下落したことがマイナス要因となりました。

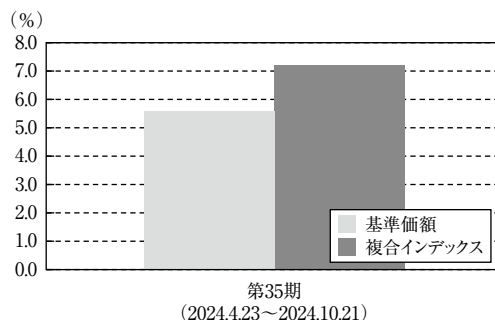
■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

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	10.4%

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
	2024年4月23日 ~ 2024年10月21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	14,985

(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却等損益」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>

この度、インフレ指標が予想を下回って推移したことや、雇用統計の内容が2ヵ月連続で予想をやや下回る結果となったことなどを受け、FRBは金融緩和に舵を切りました。コロナ禍後に米国の経済活動が急回復し、それに伴って雇用も大幅に増加しましたが、最近では労働市場が軟化の兆候を示していることや、米国のインフレ率が緩やかながらも着実にFRBの長期インフレ目標である2%に近づいていることを踏まえると、FRBの政策転換を正当化する根拠になっていると考えられます。一方、景気後退が差し迫っている可能性は低いと見ており、従ってFRBが近い将来において過度に積極的な利下げを行う可能性は低いと思われまます。株式市場においては、軟調な雇用統計や中東における軍事衝突の激化を背景に、ここ数ヵ月にわたりボラティリティが高まっています。当ファンドは引き続き株式市場に対して建設的な見通しを維持していますが、米大統領選挙が近づいていることや、株価が季節的に下落しやすい時期に差し掛かっていることなどを踏まえ、短期的に株価が調整する可能性に留意します。債券全般においては、デュレーション・エクスポージャーを機動的に調整しており、米国債については、イールドカーブの中期ゾーンを中心にポジションを維持しています。米国債を除く他の債券セクターも、ここ15年間と比べて魅力的な利回りを提供しているため、十分なインカム収入を確保することができるほか、株式リスクのヘッジとして機能する可能性を見えています。

<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35期		項目の概要
	(2024.4.23～2024.10.21)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	206	0.839	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24,562円です。
(投信会社)	(101)	(0.411)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(101)	(0.411)	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)	(0.016)	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	0.087	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)	(8)	(0.032)	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)	(13)	(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	227	0.926	

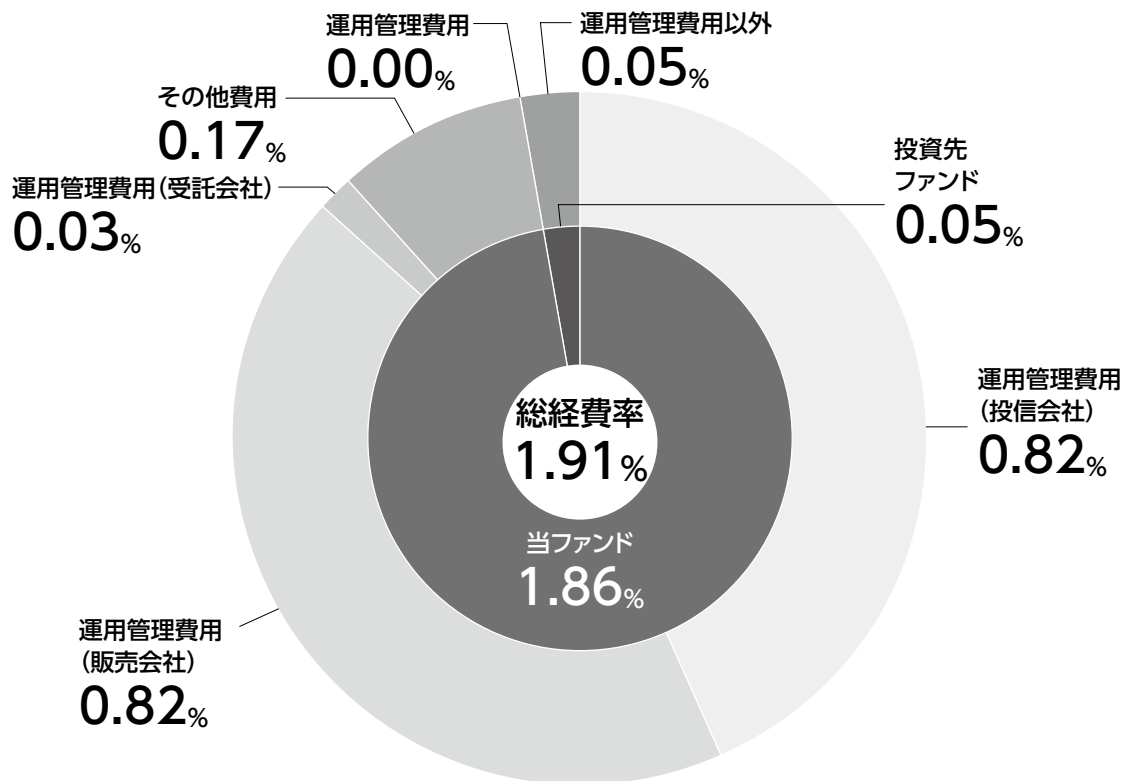
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(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1.91%です。

総経費率(①+②+③)	1.91%
①当ファンドの費用の比率	1.86%
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	0.05%

(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(2024年4月23日から2024年10月21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
			-	-	5	552

(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(2024年4月23日から2024年10月21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		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)	5	83,244

(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(2024年4月23日から2024年10月21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(2024年4月23日から2024年10月21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	%
	146	15,846	2,367	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	158	23	1.0
合 計	155	16,005	2,391	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10月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 証 券	2,391,644	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	46,667	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,438,312	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(2,391,644千円)の投資信託財産総額(2,438,312千円)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=149.43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10月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,438,312,246 円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	46,667,334
投 資 証 券 (評 価 額)	2,391,644,912
(B) 負 債	21,955,843
未 払 解 約 金	446,796
未 払 信 託 報 酬	20,189,521
そ の 他 未 払 費 用	1,319,526
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,416,356,403
元 本	967,109,912
次 期 繰 越 損 益 金	1,449,246,491
(D) 受 益 権 総 口 数	967,109,912 口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	24,985 円

(注記事項)

期首元本額

992,098,459 円

期中追加設定元本額

23,214,010 円

期中一部解約元本額

48,202,557 円

■損益の状況

自 2024年4月23日 至 2024年10月21日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	149,099,428 円
売 買 益	231,673,131
売 買 損	△ 82,573,703
(B) 信 託 報 酬 等	△ 22,282,792
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	126,816,636
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	913,815,559
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	408,614,296
(配 当 等 相 当 額)	(387,098,224)
(売 買 損 益 相 当 額)	(21,516,072)
(F) 合 計 (C + D + E)	1,449,246,491
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	1,449,246,491
追 加 信 託 差 損 益 金	408,614,296
(配 当 等 相 当 額)	(387,098,224)
(売 買 損 益 相 当 額)	(21,516,072)
分 配 準 備 積 立 金	1,040,632,195

(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35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(126,816,636円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(21,516,072円)、収益調整金(その他収益調整金)(387,098,224円)、分配準備積立金(913,815,559円)により、分配対象収益は1,449,246,491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:2023年9月1日～2024年2月29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、入手可能な最新のデータである半期末時点(2024年2月29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。

2023年9月1日から2024年2月29日までの会計期間(未監査)

	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	14,455,276,896
収益	
現金および現金同等物に係る利息	20,894,234
債券利息、源泉徴収税控除後	118,923,378
スワップ利息	24,782,061
短期金融商品預け入れによる利息	4,895,947
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	182,580
配当金、源泉徴収税控除後	52,233,849
有価証券貸付による収益	1,520,610
投資運用報酬リベート	24,473
その他の払戻し	9,809
収益合計	223,466,941
費用	
スワップ利息	23,667,652
年間サービス費用	12,391,347
ローン・コミットメント・フィー	44,055
保管および預託報酬	(183,739)
販売報酬	6,560,213
税金	3,141,304
投資運用報酬	87,692,585
費用合計	133,313,417
純利益	90,153,524
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	277,221,095
事後通告証券契約	5,021,084
上場先物取引	30,129,646
オプション／スワップション契約	96,929,794
スワップ取引	(47,291,007)
先渡為替予約	(69,452,456)
その他の取引に係る外国通貨	(69,887)
当期実現純評価益／(損)	292,488,269
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	674,436,086
事後通告証券契約	(3,529,380)
上場先物取引	18,632,394
オプション／スワップション契約	11,390,121
スワップ取引	4,427,216
先渡為替予約	25,011,548
その他の取引に係る外国通貨	(757,484)
当期末実現評価益／(損)の純変動	729,610,501
運用成績による純資産の増加	1,112,252,294
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	971,415,373
投資証券買戻しによる正味支払額	(1,645,202,369)
資本の変動による純資産の減少	(673,786,996)
配当金宣言額	(162,155)
期末純資産	14,893,580,039

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 2024年2月29日現在(未監査)

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 (%)
ライツ			
	ブラジル		
751,725	Magazine Luiza (4/03/2024)	28,720	0.00
ライツ合計		28,720	0.00
ファンド			
	アイルランド		
150,000	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	6,612,000	0.05
ファンド合計		6,612,000	0.05
普通／優先株式およびワラント			
	オーストラリア		
209,443	ANZ	3,888,914	0.03
359,998	BHP	10,321,468	0.07
28,346	CSL	5,295,442	0.04
24,559	Macquarie	3,122,497	0.02
816,780	Medibank Pvt	1,913,726	0.01
225,474	Metcash*	545,947	0.00
98,463	Northern Star Resources*	828,978	0.01
295,282	Qantas Airways	988,632	0.01
106,748	Wesfarmers	4,642,746	0.03
284,986	Woolworths*	6,067,191	0.04
		37,615,541	0.26
	ベルギー		
33,191	Ageas	1,406,905	0.01
21,474	KBC	1,526,468	0.01
3,212	Syensqo	288,401	0.00
		3,221,774	0.02
	バミューダ		
4,042	Credicorp	684,412	0.01
118,100	Hongkong Land	399,178	0.00
548,632	Invesco	8,564,146	0.06
8,200	Jardine Matheson	343,662	0.00
132,000	Orient Overseas International*	2,052,261	0.02
		12,043,659	0.09
	ブラジル		
1,801,159	Ambev	4,530,956	0.03
3,501,643	B3 - Brasil Bolsa Balcao	8,970,605	0.06
476,973	Cia Energetica de Minas Gerais	1,149,029	0.01
1,395,160	Cielo	1,509,339	0.01
462,601	Embraer	2,235,325	0.01
149,111	Gerdau	643,458	0.00
1,405,686	Lojas Renner	4,468,900	0.03
7,847,623	Magazine Luiza	3,392,791	0.02
58,617	Rumo	266,858	0.00
90,050	Telefonica Brasil	1,001,358	0.01
125,049	TIM	466,952	0.00
380,379	Vale	5,141,567	0.04
345,757	WEG	2,564,144	0.02
		36,341,282	0.24
	カナダ		
932,910	Cameco*	38,295,956	0.26

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)		
52,699	Canadian National Railway	6,856,451	0.05
1,541,467	Enbridge*	53,219,341	0.36
498	Fairfax Financial	527,066	0.00
41,560	First Quantum Minerals	383,796	0.00
91,241	Franco-Nevada	9,720,407	0.06
30,371	George Weston	4,005,926	0.03
228,166	Lions Gate Entertainment*	2,172,140	0.02
85,676	Metro	4,688,361	0.03
94,969	National Bank of Canada	7,395,389	0.05
193,219	Pembina Pipeline	6,756,489	0.04
497,313	Power of Canada	14,361,392	0.10
99,880	Shopify	7,665,010	0.05
1,475,754	Suncor Energy*	50,002,826	0.34
		206,050,550	1.39
	ケイマン諸島		
32,900	ASMPT*	403,282	0.00
253,500	Baidu	3,223,943	0.02
1,531,000	Haidilao International	2,804,739	0.02
354,328	JD.com	4,030,951	0.03
64,680	Lavoro (Wts 27/12/2027)	34,979	0.00
392,800	Li Auto	8,897,098	0.06
107,030	Meituan	1,091,130	0.01
32,000	NetEase	720,318	0.01
574,409	Sands China	1,636,418	0.01
513,000	SITC International	844,115	0.01
262,900	Sunny Optical Technology	1,706,170	0.01
741,000	Tencent	26,240,951	0.18
37,000	Trip.com*	1,686,533	0.01
473,000	Want Want China	261,043	0.00
7,485,279	Wynn Macau	6,320,881	0.04
		59,902,551	0.41
	中国		
803,600	Aier Eye Hospital	1,633,948	0.01
10,100	Anhui Gujing Distillery	142,991	0.00
2,236,935	BYD*	55,239,960	0.37
175,500	China Merchants Bank	684,946	0.01
3,782,000	China Tower	459,001	0.00
745,900	Contemporary Amperex Technology	16,927,216	0.11
183,400	Huadong Medicine	857,298	0.01
649,000	Hundsun Technologies	2,199,637	0.01
182,200	Nongfu Spring*	1,033,474	0.01
18,100	Oppein Home	174,542	0.00
1,816,000	PetroChina	1,431,427	0.01
2,665,000	PetroChina	3,269,716	0.02
270,000	Shanghai Fosun Pharmaceutical	488,422	0.00
155,144	Shenzhen Transsion	3,417,217	0.02
429,500	WuXi AppTec	3,247,587	0.02
278,800	WuXi AppTec	1,734,562	0.01
66,800	Zhongji Innolight	1,438,523	0.01
		94,380,467	0.62
	キュラソー		
78,565	Schlumberger	3,822,973	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 (%)
	デンマーク		
1,738	AP Moller - Maersk*	2,479,103	0.02
6,148	Genmab	1,724,833	0.01
591,570	Novo Nordisk	70,777,734	0.48
67,879	Orsted	3,817,607	0.02
71,585	Vestas Wind Systems	2,009,476	0.01
		80,808,753	0.54
	フィンランド		
128,330	Elisa	5,815,587	0.04
46,103	Kone	2,265,835	0.02
9,987	Neste	276,080	0.00
		8,357,502	0.06
	フランス		
620,954	Accor	26,833,085	0.18
297,915	AXA	10,691,995	0.07
625,150	BNP Paribas	37,642,467	0.25
41,480	Bolloré	284,193	0.00
63,764	Carrefour	1,078,852	0.01
606,491	Cie de Saint-Gobain	46,849,528	0.32
82,850	Dassault Systemes	3,908,705	0.02
252,029	EssilorLuxottica	53,724,172	0.36
6,029	Hermes International	15,145,755	0.10
83,987	La Francaise des Jeux SAEM	3,540,917	0.03
18,112	L' Oreal	8,708,975	0.06
92,727	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	84,827,696	0.57
451,428	Sanofi	43,314,977	0.29
13,755	Schneider Electric	3,138,345	0.02
33,787	SCOR	1,038,844	0.01
65,232	Societe Generale	1,593,786	0.01
7,892	Teleperformance	982,090	0.01
332,221	TotalEnergies	21,366,636	0.14
16,120	Vivendi	181,449	0.00
		364,852,467	2.45
	ドイツ		
152,292	adidas	31,078,980	0.21
60,704	BASF*	3,102,969	0.02
103,798	Bayer	3,188,084	0.02
93,213	Bayerische Motoren Werke	11,079,735	0.07
6,035	Bechtle*	313,496	0.00
8,118	Carl Zeiss Meditec*	997,883	0.01
3,100	CTS Eventim*	247,201	0.00
684,885	Deutsche Lufthansa	5,355,910	0.04
58,830	Dr Ing hc F Porsche	5,564,377	0.04
10,888	FUCHS	464,948	0.00
3,329	Knorr-Bremse	233,173	0.00
435,976	Mercedes-Benz	35,016,376	0.24
3,291	Merck	565,210	0.00
4,008	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	1,881,549	0.01
68	Rational*	56,106	0.00
331,770	RWE	11,241,130	0.08
9,023	Scout24	660,386	0.00
245,013	Siemens	48,570,892	0.33
40,862	Symrise	4,198,271	0.03
213,974	thyssenkrupp*	1,099,677	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
19,378	Volkswagen	2,637,217	0.02
231,736	Zalando	4,947,883	0.03
		<hr/>	<hr/>
	ギリシャ		
193,876	National Bank of Greece	1,515,721	0.01
		<hr/>	<hr/>
	ガーンジー		
480,079	Genius Sports*	3,355,752	0.02
		<hr/>	<hr/>
	香港		
3,460,600	ATA	28,117,497	0.19
37,900	Hang Seng Bank	432,857	0.00
169,000	MTR	561,343	0.00
		<hr/>	<hr/>
	インド		
8,157	Asian Paints	277,608	0.00
5,448	Bajaj Auto	519,683	0.01
576,762	Bharat Petroleum	4,200,356	0.03
7,770	Eicher Motors	355,382	0.00
23,043	HCL Technologies	462,396	0.00
1,081,280	HDFC Bank	18,301,221	0.12
6,274	Hindustan Aeronautics	233,360	0.00
951,828	Indian Oil	1,900,414	0.01
22,980	Kotak Mahindra Bank	468,226	0.01
		<hr/>	<hr/>
		26,718,646	0.18
		<hr/>	<hr/>
	インドネシア		
3,776,800	Bank Central Asia	2,373,267	0.01
3,665,400	Bank Mandiri Persero	1,632,695	0.01
7,216,400	Bank Syariah Indonesia	1,134,235	0.01
		<hr/>	<hr/>
		5,140,197	0.03
		<hr/>	<hr/>
	アイルランド		
462,993	CRH	38,759,244	0.26
40,058	James Hardie Industries	1,588,238	0.01
77,274	Kingspan	6,998,689	0.05
11,545	Linde	5,167,542	0.03
61,707	Seagate Technology	5,721,473	0.04
		<hr/>	<hr/>
		58,235,186	0.39
		<hr/>	<hr/>
	イスラエル		
230,992	Nice*	56,531,827	0.38
		<hr/>	<hr/>
	イタリア		
52,185	Enel	334,040	0.01
105,441	FinecoBank Banca Fineco	1,466,555	0.01
17,829,934	Intesa Sanpaolo	56,987,991	0.38
65,885	Mediobanca Banca di Credito Finanziario*	898,867	0.01
359,871	Snam	1,695,655	0.01
1,461,621	UniCredit	49,388,288	0.33
		<hr/>	<hr/>
		110,771,396	0.75
		<hr/>	<hr/>
	日本		
10,900	Ain	345,527	0.00
44,000	Alfresa*	658,388	0.01
72,500	ANA	1,583,247	0.01
126,300	Astellas Pharma	1,395,540	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)		
84,600	BayCurrent Consulting	1,898,427	0.01
33,100	Bic Camera*	285,014	0.00
74,000	Bridgestone	3,191,409	0.02
11,200	Brother Industries	188,047	0.00
20,100	Chugai Pharmaceutical	806,878	0.01
78,700	Daïichi Sankyo	2,619,033	0.02
97,500	Daikin Industries	13,813,014	0.09
8,300	Dowa*	290,373	0.00
53,100	Eisai	2,221,840	0.02
1,418,500	FANUC	41,492,530	0.28
253,700	FUJIFILM	16,164,217	0.11
11,200	Heiwa	154,888	0.00
2,805,800	Honda Motor	33,452,212	0.23
231,352	Hoya	30,160,192	0.20
41,900	Ito En	1,170,391	0.01
2,497,600	Japan Airlines	46,721,898	0.31
73,700	JFE	1,210,541	0.01
94,700	Kakaku.com*	1,088,196	0.01
21,000	Kamigumi	492,597	0.00
143,800	Kansai Paint*	2,087,753	0.01
12,800	Kewpie	238,975	0.00
134,719	Keyence	63,129,946	0.43
17,900	Koei Tecmo*	224,251	0.00
1,177,300	Komatsu*	34,232,396	0.23
9,900	Kusuri no Aoki	207,849	0.00
126,700	Kyushu Railway*	2,918,596	0.02
44,800	Lixil*	575,492	0.00
67,000	M3*	962,202	0.00
126,000	Makita	3,293,627	0.02
22,700	Mani	309,749	0.00
329,800	Mazda Motor*	3,879,091	0.03
19,800	MEIJI	447,359	0.00
480,000	Mitsubishi Electric	7,648,077	0.05
8,107,100	Mitsubishi UFJ Financial*	83,639,289	0.56
943,500	Mitsui*	41,365,902	0.28
126,600	Mitsui OSK Lines*	4,346,911	0.03
272,200	Mizuho Financial	5,101,074	0.03
97,600	Money Forward*	4,316,301	0.03
19,600	Morinaga Milk Industry*	407,566	0.00
80,600	NET One Systems	1,402,067	0.01
55,100	Nexon	894,340	0.01
334,900	NIDEC CORP	12,729,178	0.09
146,300	Nihon M&A Center*	981,761	0.01
95,600	Nintendo	5,372,762	0.04
928,500	Nippon Paint	6,898,599	0.05
208,800	Nippon Steel*	5,189,789	0.04
28,400	Nipro	235,424	0.00
322,900	Nomura Research Institute*	9,082,203	0.06
96,700	Ono Pharmaceutical	1,609,672	0.01
8,800	Oracle Japan	675,315	0.00
97,100	Otsuka	4,274,699	0.03
1,034,600	Panasonic*	9,832,730	0.07
26,200	Pigeon*	267,495	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 (%)
	日本(続き)		
346,100	Rakus*	5,459,008	0.04
28,700	Resorttrust*	495,503	0.00
36,300	Santen Pharmaceutical*	361,021	0.00
15,000	SCREEN	1,880,206	0.01
18,600	SCSK	343,465	0.00
112,900	Sekisui House	2,522,905	0.02
456,800	Shiseido	12,368,577	0.08
66,700	SMC*	40,230,182	0.27
22,500	SoftBank	1,323,219	0.01
172,000	Sojitz*	4,371,779	0.03
46,400	Sompo	2,726,289	0.02
22,000	Stanley Electric*	377,105	0.00
81,000	Sumitomo Mitsui Financial	4,521,887	0.03
53,200	Sumitomo Rubber Industries	620,753	0.00
17,200	Suzuken*	513,014	0.00
538,600	Sysmex	30,341,627	0.20
284,100	Takeda Pharmaceutical	8,338,718	0.06
53,800	Tokyo Electron	13,271,373	0.09
25,400	TOTO*	688,085	0.01
2,360,800	Toyota Motor*	57,193,694	0.38
3,800	Yaoko	218,951	0.00
19,400	Zensho	850,555	0.01
125,900	ZOZO*	2,858,894	0.02
		<hr/>	<hr/>
		712,059,649	4.78
	ジャージー		
67,045	Experian	2,887,035	0.02
13,937	Ferguson*	2,904,461	0.02
6,747,796	Glencore	32,203,610	0.22
		<hr/>	<hr/>
		37,995,106	0.26
	リベリア		
87,436	Royal Caribbean Cruises	10,675,936	0.07
	ルクセンブルグ		
156,373	ArcelorMittal	4,097,978	0.03
27,476	Tenaris	493,198	0.00
		<hr/>	<hr/>
		4,591,176	0.03
	メキシコ		
860,306	Fibra Uno Administracion	1,542,510	0.01
158,614	Fomento Economico Mexicano	1,983,488	0.02
53,742	Grupo Aeroportuario del Sureste	1,536,251	0.01
788,972	Wal-Mart de Mexico	3,159,403	0.02
		<hr/>	<hr/>
		8,221,652	0.06
	オランダ		
500,518	ABN AMRO Bank	8,082,941	0.05
159,495	ASML	150,874,074	1.01
14,902	BE Semiconductor Industries	2,716,156	0.02
64,509	Ferrari	27,274,173	0.18
522,227	ING Groep	7,195,548	0.05
550,641	Koninklijke Ahold Delhaize	16,458,529	0.11
870,808	Koninklijke KPN	3,200,860	0.02
118,829	Koninklijke Vopak	4,438,746	0.03
590,392	Prosus	17,358,437	0.12
31,639	STMicroelectronics	1,445,297	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	オランダ(続き)		
6,831	Wolters Kluwer	1,080,545	0.01
		240,125,306	1.61
	ニュージーランド		
36,258	Xero	3,012,635	0.02
	ノルウェー		
266,514	Equinor	6,612,620	0.04
	ポーランド		
323,791	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	4,013,722	0.03
	サウジアラビア		
2,093	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services	183,835	0.00
26,819	Saudi Arabian Oil	226,693	0.00
75,925	Saudi Telecom	859,405	0.01
		1,269,933	0.01
	シンガポール		
338,100	Genting Singapore*	229,054	0.00
309,000	NETLINK NBN TRUST	193,236	0.00
72,600	Oversea-Chinese Banking	701,557	0.01
183,300	Singapore Technologies Engineering	543,122	0.01
566,300	Singapore Telecommunications	990,755	0.01
23,800	United Overseas Bank	495,234	0.00
24,100	Venture	251,187	0.00
260,700	Wilmar International	644,364	0.00
		4,048,509	0.03
	南アフリカ		
9,075	Anglo American Platinum	350,082	0.00
17,039	Capitec Bank	1,777,480	0.01
319,486	FirstRand	1,077,854	0.01
64,510	Kumba Iron Ore	1,790,919	0.01
		4,996,335	0.03
	韓国		
142,824	Amorepacific	12,827,989	0.09
16,282	Fila	469,532	0.00
71,077	GS Engineering & Construction	851,365	0.01
32,691	Hanwha Aerospace	4,603,156	0.03
502,624	HD Hyundai Infracore	3,038,543	0.02
16,172	Hyundai Motor	3,042,269	0.02
78,403	KakaoBank	1,675,102	0.01
210,912	KB Financial	10,057,759	0.07
64,104	Meritz Financial	4,000,482	0.02
15,823	NCSOFT	2,305,243	0.01
88,891	Samsung Electronics	4,899,819	0.03
8,013	Samsung SDI	2,268,625	0.02
312,729	SK Hynix	36,683,890	0.25
		86,723,774	0.58
	スペイン		
3,521	Aena SME	667,741	0.00
446,121	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	4,441,267	0.03
2,415,654	Banco Santander	10,105,845	0.07
1,746,291	Cellnex Telecom	63,336,471	0.43
11,918	Endesa*	214,124	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 (%)
	スペイン(続き)		
104,494	Industria de Diseno Textil	4,660,577	0.03
73,874	Repsol	1,175,771	0.01
		84,601,796	0.57
	スウェーデン		
648,778	Assa Abloy	18,685,758	0.13
270,637	Atlas Copco	4,731,398	0.03
22,607	Evolution	2,958,059	0.02
82,891	Getinge	1,653,977	0.01
35,192	Industrivarden	1,195,357	0.01
305,270	SKF*	6,697,710	0.05
308,858	SSAB	2,414,852	0.01
145,905	SSAB	1,142,194	0.01
3,386,444	Telia	8,122,410	0.05
133,075	Trelleborg	4,833,502	0.03
620,000	Volvo Car*	2,298,206	0.02
		54,733,423	0.37
	スイス		
586,280	Alcon	50,046,789	0.34
282	Barry Callebaut*	401,421	0.00
345,175	Bunge Global	32,446,450	0.22
246,546	Chubb	62,055,628	0.42
221,370	Clariant*	2,783,397	0.02
88,031	Coca-Cola HBC	2,765,505	0.02
1,496	Flughafen Zurich*	317,301	0.00
489	Geberit	287,002	0.00
23,831	Holcim	1,961,077	0.02
48,689	Julius Baer*	2,628,268	0.02
31,958	Kuehne + Nagel International*	10,767,431	0.07
4,248	Lonza	2,241,864	0.01
620,985	Nestle	65,523,253	0.44
203,929	Novartis*	20,802,875	0.14
3,607	PSP Swiss Property*	461,735	0.00
7,528	Roche	1,990,290	0.01
1	Sandoz	32	0.00
27,167	SGS	2,623,863	0.02
16,018	Sika*	4,665,974	0.03
7,923	Swiss Prime Site*	764,954	0.00
893	Swisscom*	512,938	0.00
36,849	TE Connectivity	5,312,152	0.03
920,178	Transocean*	4,499,671	0.03
2,059,783	UBS	59,531,835	0.40
		335,391,705	2.24
	台湾		
1,781,000	Acer	2,543,923	0.02
37,000	Advantech	456,508	0.00
380,000	ASE Technology	1,671,016	0.01
364,000	Asustek Computer	5,239,563	0.03
196,000	Chunghwa Telecom	747,180	0.01
4,526,000	Compal Electronics	5,226,244	0.03
4,187,000	Eva Airways	4,165,871	0.03
286,000	Far EasTone Telecommunications	712,071	0.01
594,000	Lite-On Technology	2,057,704	0.01
195,000	MediaTek	7,032,694	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 (%)
	台湾(続き)		
140,000	Novatek Microelectronics	2,661,857	0.02
1,379,000	Quanta Computer	10,121,258	0.07
193,000	Taiwan Mobile	604,470	0.00
2,995,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	65,377,479	0.44
		<u>108,617,838</u>	<u>0.73</u>
	英国		
63,393	Anglo American	1,389,791	0.01
294,663	AstraZeneca	19,100,056	0.13
315,949	AstraZeneca	40,527,108	0.27
605,628	Auto Trader	5,737,696	0.04
9,259,094	BAE Systems	145,817,450	0.98
236,468	Barclays	495,464	0.00
961,415	BP	5,637,929	0.04
80,215	British American Tobacco	2,395,948	0.02
323,136	Burberry	5,272,237	0.03
636,185	Compass	17,534,968	0.12
563,725	Direct Line Insurance	1,436,762	0.01
316,131	GSK	6,730,366	0.04
28,728	Hargreaves Lansdown	265,688	0.00
25,763	Hikma Pharmaceuticals	645,781	0.00
727,082	J Sainsbury	2,329,286	0.02
645,917	JD Sports Fashion	972,833	0.01
436,055	Kingfisher	1,303,561	0.01
331,651	Legal & General*	1,025,495	0.01
112,160	London Stock Exchange	12,576,083	0.09
1,004,155	NatWest	3,065,490	0.02
313,376	Pearson	3,786,991	0.03
240,556	Prudential	2,396,079	0.02
848,265	RELX	37,247,496	0.25
60,892	Rightmove*	440,769	0.00
502,413	Shell*	31,772,598	0.21
2,834,634	Shell*	89,631,759	0.60
112,626	Spirax-Sarco Engineering	14,772,068	0.10
205,150	Standard Chartered	1,731,289	0.01
559,040	Tesco	1,980,808	0.01
1,118,704	Unilever	54,991,716	0.37
		<u>513,011,565</u>	<u>3.45</u>
	米国		
103,033	3M	9,478,006	0.06
35,946	A O Smith*	2,978,126	0.02
604,385	Abbott Laboratories	72,115,218	0.49
246,959	AbbVie	43,635,186	0.29
36,164	Adobe	20,131,052	0.14
421,360	Advanced Micro Devices	77,092,026	0.52
250,238	AES	3,828,641	0.02
1,251,476	Alphabet	174,818,683	1.17
91,615	Altair Engineering*	7,819,340	0.05
591,085	Altice USA	1,773,255	0.01
34,233	Altria	1,402,697	0.01
1,547,685	Amazon.com	270,752,014	1.82
226,245	American Tower	44,371,169	0.30
139,377	American Water Works	16,545,444	0.11
10,482	AMETEK	1,869,779	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)		
24,791	Amgen	6,860,909	0.04
37,696	ANSYS	12,598,757	0.08
147,445	APA	4,446,941	0.03
1,249,473	Apple	226,779,350	1.53
321,151	Applied Materials	63,841,607	0.43
30,764	Astra Space	44,300	0.00
774,853	AT&T	13,195,747	0.09
9,822	Atlassian	2,036,297	0.01
114,690	Autodesk	29,438,629	0.20
13,375	Ball*	858,407	0.01
48,627	Baxter International	2,001,487	0.01
7,488	Becton Dickinson	1,780,497	0.01
12,756	Berkshire Hathaway	5,243,226	0.04
102,341	Block	8,212,865	0.06
18,207	Boeing	3,729,704	0.02
5,259	BOK Financial	448,856	0.00
6,328	Booking	22,147,873	0.15
362,557	Booz Allen Hamilton	53,654,810	0.36
1,448,410	Boston Scientific	96,015,099	0.65
6,169	Boyd Gaming*	398,579	0.00
161,602	Bristol-Myers Squibb	8,192,413	0.06
4,104	Broadcom	5,346,773	0.04
22,568	Builders FirstSource	4,402,565	0.03
144,912	Cadence Design Systems	43,864,862	0.29
32,865	Caesars Entertainment	1,394,133	0.01
46,715	California Resources	2,455,340	0.02
178,074	Cano Health (Wts 3/6/2026)	54	0.00
31,025	Capital One Financial	4,266,558	0.03
14,578	Cardinal Health	1,620,053	0.01
17,381	Caterpillar	5,762,844	0.04
164,136	Centene	12,777,988	0.09
431,668	CF Industries	34,317,606	0.23
10,092	CH Robinson Worldwide	752,611	0.00
33,701	Cheniere Energy	5,225,677	0.03
11,965	Chesapeake Energy*	986,275	0.01
390,233	Chevron	59,643,212	0.40
20,683	Cincinnati Financial	2,344,625	0.02
147,755	Citigroup	8,188,582	0.05
357,929	Citigroup Capital XIII	10,462,265	0.07
19,764	Clorox	3,026,659	0.02
110,253	Coca-Cola	6,646,051	0.04
867,257	Comcast	36,997,183	0.25
14,085	Comerica	696,785	0.00
1,383,133	Confluent	46,203,558	0.31
526,113	ConocoPhillips	59,219,279	0.40
113,793	Costco Wholesale	85,203,647	0.57
113,586	Coterra Energy	2,921,432	0.02
95,375	Crowdstrike	31,179,041	0.21
20,706	Crown	1,573,656	0.01
21,820	Cummins	5,903,401	0.04
4,066	Customers Bancorp*	221,719	0.00
54,075	Dell Technologies	5,021,945	0.03
1,122,019	Delta Air Lines	47,652,147	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)		
213,967	Dexcom	24,467,126	0.16
24,047	DR Horton	3,556,311	0.02
133,400	Dynatrace	6,575,286	0.04
152,076	eBay	7,206,121	0.05
58,417	Edison International	4,008,575	0.03
46,310	Electronic Arts	6,460,245	0.04
117,424	Eli Lilly	87,775,614	0.59
74,498	EOG Resources	8,531,511	0.06
5,560	Equinix	4,974,032	0.03
21,773	Eversource Energy	1,282,212	0.01
92,280	EVgo (Wts 15/9/2025)	18,456	0.00
2,663	Expeditors International of Washington	316,924	0.00
159,338	F5	29,821,700	0.20
23,066	Fastenal	1,685,202	0.01
577	First Citizens BancShares	909,675	0.01
160,529	Floor & Decor*	19,854,227	0.13
463,119	Ford Motor	5,735,729	0.04
324,106	Fortinet	22,586,947	0.15
747,466	Fortive	64,050,362	0.43
614,388	Franklin Resources	16,901,814	0.11
965,701	Freeport-McMoRan	36,889,778	0.25
334,250	General Motors	13,667,482	0.09
80,631	Gilead Sciences	5,842,522	0.04
10,818	Golden Entertainment*	400,374	0.00
182,670	Green Plains*	4,027,874	0.03
58,746	Hartford Financial Services	5,623,755	0.04
5,834	HCA Healthcare	1,818,108	0.01
573,707	Healthpeak Properties	9,678,437	0.06
436,588	Hewlett Packard Enterprise	6,609,942	0.04
114,551	Hilton Worldwide	23,330,602	0.16
79,631	Hippo (Wts 2/8/2026)	1,593	0.00
9,979	Hormel Foods	347,768	0.00
105,969	Humana	37,074,314	0.25
94,856	Huntington Bancshares	1,240,716	0.01
30,059	Illinois Tool Works	7,895,598	0.06
37,130	Incyte	2,198,839	0.01
135,187	Informatica	4,407,096	0.03
884,775	Ingersoll Rand	79,789,009	0.54
30,530	Innovid (Wts 31/12/2027)	1,212	0.00
50,867	Insulet	8,231,298	0.06
237,779	Intel	10,179,319	0.07
6,574	International Bancshares*	344,412	0.00
133,911	International Paper	4,808,744	0.03
21,151	Intuit*	14,096,507	0.10
164,923	Intuitive Surgical	63,800,463	0.43
64,389	J M Smucker	7,800,727	0.05
293,744	Johnson & Johnson	47,400,001	0.32
763,495	JPMorgan Chase	141,414,544	0.95
120,594	Kellanova	6,703,217	0.05
930,675	Kenvue	17,701,438	0.12
63,715	Keysight Technologies	9,847,153	0.07
107,435	Kimberly-Clark	12,968,479	0.09
22,459	KLA	15,316,365	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)		
16,213	Lam Research	15,117,650	0.10
200,611	Las Vegas Sands	10,804,908	0.07
193,611	Latch (Wts 31/12/2026)	794	0.00
23,301	Latch (Wts 4/6/2026)	95	0.00
61,551	Leidos	7,820,055	0.05
7,118	Lennar	1,108,628	0.01
178,087	Lightning Emotors (Wts 15/12/2025)	462	0.00
1,092,335	LKQ	57,839,138	0.39
224,422	LPL Financial	59,940,872	0.40
10,077	Lululemon Athletica	4,723,191	0.03
40,754	M/I Homes	5,111,367	0.04
40,858	Marathon Petroleum	6,827,371	0.04
32,884	MarketAxess*	7,004,292	0.05
404,980	Marsh & McLennan	81,826,209	0.55
136,400	Marvell Technology	9,407,508	0.06
143,427	Masco	10,944,914	0.07
110,247	Masimo*	13,947,348	0.09
283,776	Mastercard	134,663,063	0.91
29,452	Match	1,061,156	0.01
46,895	McCormick	3,197,770	0.02
203,839	McDonald's	59,682,021	0.40
6,810	McKesson	3,544,469	0.02
730,455	Merck	93,206,058	0.63
138,932	Meta Platforms	68,029,443	0.46
8,099	Mettler-Toledo International	10,080,987	0.07
548,922	MGM Resorts International*	23,384,078	0.16
40,200	Microchip Technology	3,366,951	0.02
551,945	Micron Technology	49,277,650	0.34
1,052,119	Microsoft	431,168,887	2.90
1,755,970	Mirion Technologies	17,226,066	0.11
196,836	Mirion Technologies*	1,930,961	0.01
35,946	Molson Coors Beverage*	2,254,174	0.02
11,045	Motorola Solutions	3,668,818	0.02
58,991	Mr Cooper	4,265,049	0.03
26,492	MSCI	15,040,303	0.10
164,998	Nasdaq	9,299,287	0.06
21,352	Netflix	12,863,726	0.09
751,259	NextEra Energy	41,589,698	0.28
58,322	NIKE	6,133,725	0.04
54,558	Nucor	10,486,048	0.07
289,409	NVIDIA	230,022,273	1.54
155,458	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	1,088	0.00
65,865	Omnicom*	5,827,077	0.04
657,988	Oracle	73,431,461	0.49
31,803	Otis Worldwide	3,021,603	0.02
65,476	PACCAR*	7,289,443	0.05
34,638	Packaging of America	6,324,899	0.04
93,753	Palo Alto Networks*	29,542,507	0.20
61,416	Paramount Global*	715,496	0.00
57,635	Park Hotels & Resorts	963,657	0.01
46,968	Paychex*	5,765,792	0.04
8,177	Paycom Software	1,509,965	0.01
431,980	Peloton Interactive*	2,062,705	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)		
58,644	PepsiCo	9,720,243	0.07
248,499	Pfizer	6,718,171	0.04
27,250	Phillips 66	3,861,053	0.02
14,006	Principal Financial	1,133,926	0.01
329,944	Progressive	63,111,688	0.42
126,061	Prologis	17,061,096	0.11
47,906	QUALCOMM	7,542,800	0.05
1,098	Regeneron Pharmaceuticals	1,073,866	0.01
52,860	ResMed	9,226,713	0.06
183,126	Rollins	7,997,112	0.05
8,722	Roper Technologies	4,729,330	0.03
41,610	RXO*	872,562	0.01
57,494	S&P Global	24,842,008	0.17
288,857	Salesforce	86,980,620	0.59
5,911	Sarcos Technology & Robotics	11,231	0.00
338,691	Sarcos Technology & Robotics (Wts 15/6/2027)	37,256	0.00
167,667	Sarcos Technology & Robotics (Wts 24/9/2026)	18,443	0.00
1,089,302	Sempra	77,187,940	0.52
3,722	ServiceNow	2,874,463	0.02
78,512	Skyworks Solutions	8,153,471	0.06
70,332	Smith Douglas Homes	2,034,705	0.01
14,391	Snap-on*	3,987,027	0.03
16,852	Snowflake	3,127,563	0.02
26,705	Sonder	160,230	0.00
11,946	Southern Copper*	959,980	0.01
12,693	State Street	940,805	0.01
607,300	Sun Country	9,595,340	0.07
356,347	Synchrony Financial	14,652,989	0.10
89,694	T Rowe Price	10,149,773	0.07
44,637	Tapestry	2,113,339	0.01
7,881	Teleflex	1,769,285	0.01
43,208	Tesla	8,747,459	0.06
13,993	Texas Capital Bancshares*	828,246	0.01
136,880	Thermo Fisher Scientific	78,080,458	0.52
600,316	TJX	59,551,347	0.40
41,382	Travelers	9,101,971	0.06
54,346	Uber Technologies	4,279,748	0.03
209,187	United Parcel Service	31,160,496	0.21
182,786	UnitedHealth	91,085,920	0.61
19,260	Universal Health Services	3,170,196	0.02
301,816	Valero Energy	42,024,860	0.28
473,393	Veralto	41,237,264	0.28
77,935	VeriSign	15,140,432	0.10
74,503	Verisk Analytics	17,969,379	0.12
217,110	Verizon Communications*	8,675,716	0.06
46,589	Vertex Pharmaceuticals	19,743,486	0.13
126,217	VICI Properties	3,766,315	0.02
153,305	Visa*	43,529,422	0.29
139,230	Vulcan Materials	36,777,604	0.25
1,598,487	Walmart	94,166,869	0.63
724,735	Walt Disney	81,170,320	0.54
949,278	Wells Fargo	52,580,508	0.35
3,520	Wells Fargo	4,193,728	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)		
8,457	Whirlpool	908,366	0.01
15,285	Williams	544,910	0.00
32,587	Workday	9,523,551	0.06
154,887	Wynn Resorts	16,086,564	0.11
16,387	Zimmer Biomet	2,029,366	0.01
91,484	Zoetis	18,296,800	0.12
78,600	Zscaler	18,895,047	0.13
		5,625,225,802	37.76
普通/優先株式およびワラント合計		9,217,207,876	61.89

債券

	アルゼンチン		
USD 21,885,365	Argentine Republic Government International Bond 0.75% 9/7/2030	10,191,358	0.07
USD 2,291,190	Argentine Republic Government International Bond 1% 9/7/2029	1,050,511	0.01
USD 26,992,679	Argentine Republic Government International Bond 3.625% 9/7/2035*	9,919,809	0.06
USD 8,980,835	Argentine Republic Government International Bond 4.25% 9/1/2038	3,767,460	0.03
USD 1,164,000	YPF 9.5% 17/1/2031	1,173,219	0.01
		26,102,357	0.18
	オーストラリア		
AUD 328,974,000	Australia Government Bond 1% 21/11/2031	171,929,159	1.15
USD 1,786,000	Mineral Resources 9.25% 1/10/2028*	1,876,354	0.01
		173,805,513	1.16
	オーストリア		
EUR 6,500,000	ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	5,223,219	0.03
EUR 4,908,000	ams-OSRAM 10.5% 30/3/2029	5,806,883	0.04
USD 960,000	ams-OSRAM 12.25% 30/3/2029	973,200	0.01
USD 1,034,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032*	850,677	0.01
		12,853,979	0.09
	バハマ		
USD 328,000	Intercorp Peru 3.875% 15/8/2029	287,779	0.00
	バーレーン		
USD 854,000	Bahrain Government International Bond 5.45% 16/9/2032*	771,803	0.01
USD 650,000	Bahrain Government International Bond 7.5% 20/9/2047	611,172	0.00
		1,382,975	0.01
	ベルギー		
GBP 599,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	747,241	0.01
GBP 600,000	KBC 1.25% 21/9/2027	687,028	0.00
		1,434,269	0.01
	ベナン		
USD 301,000	Benin Government International Bond 7.96% 13/2/2038	294,604	0.00
	バミューダ		
USD 253,000	Inkia Energy 5.875% 9/11/2027	246,924	0.00
	ブラジル		
USD 589,000	Banco Votorantim 4.5% 24/9/2024	583,708	0.00
BRL 1,989,860	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/4/2024	39,682,562	0.27
BRL 4,043,570	Brazil Letras do Tesouro Nacional 0% 1/7/2024	78,678,069	0.53
BRL 961,360	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	19,317,044	0.13
BRL 32,984,330	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	42,202,326	0.28
USD 1,520,000	Brazilian Government International Bond 7.125% 13/5/2054	1,518,480	0.01
USD 667,000	Samarco Mineracao 9.5% 30/6/2031	614,023	0.00
		182,596,212	1.22

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 (%)
英領バージン諸島			
USD 514,000	Fortune Star BVI 6.85% 2/7/2024*	504,797	0.00
USD 900,000	HKT Capital No 6 3% 18/1/2032*	763,385	0.01
USD 300,000	Huarong Finance 2019 4.25% 30/9/2025	287,062	0.00
USD 261,078	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033*	262,040	0.00
USD 417,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029*	365,917	0.00
		2,183,201	0.01
カナダ			
USD 315,000	Bausch + Lomb 8.375% 1/10/2028	329,339	0.00
USD 1,850,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	1,848,317	0.01
USD 2,666,000	First Quantum Minerals 6.875% 15/10/2027*	2,544,417	0.02
USD 2,542,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	2,522,337	0.02
USD 4,412,000	First Quantum Minerals 9.375% 1/3/2029	4,582,965	0.03
USD 638,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	648,283	0.00
USD 1,107,000	Garda World Security 9.5% 1/11/2027	1,107,183	0.01
USD 1,632,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	1,455,524	0.01
GBP 599,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027	708,266	0.01
		15,746,631	0.11
ケイマン諸島			
USD 828,928	AGL CLO 5 6.979% 20/7/2034	832,946	0.01
USD 1,153,674	AGL CLO 5 7.279% 20/7/2034	1,154,251	0.01
USD 725,000	AIMCO CLO Series 2017-A 6.629% 20/4/2034	723,068	0.01
USD 278,501	AIMCO CLO Series 2018-A 6.978% 17/4/2031	278,526	0.00
USD 318,000	Allegro CLO IV 7.126% 15/1/2030	318,303	0.00
USD 250,000	Allegro CLO XI 7.421% 19/1/2033	251,614	0.00
USD 975,721	Apidos CLO XV 6.589% 20/4/2031	977,255	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 7.126% 15/4/2031	250,158	0.00
USD 400,000	Atrium XIII 7.077% 21/11/2030	400,110	0.00
USD 279,432	BlueMountain CLO 2014-2 7.329% 20/10/2030	279,292	0.00
USD 250,000	Canyon CLO 2020-3 7.276% 15/1/2034	249,252	0.00
USD 250,000	CARLYLE US CLO 2018-1 7.079% 20/4/2031	250,219	0.00
USD 541,794	Catskill Park CLO 6.929% 20/4/2029	543,845	0.00
USD 692,352	Chenango Park CLO 7.126% 15/4/2030	693,831	0.01
USD 387,293	CIFC Funding 2017-III 7.379% 20/7/2030	387,866	0.00
USD 237,706	CIFC Funding 2018-II 6.619% 20/4/2031	238,008	0.00
USD 405,000	CK Hutchison International 23 4.875% 21/4/2033*	398,806	0.00
USD 138,646	Clear Creek CLO 6.779% 20/10/2030	138,918	0.00
USD 692,561	Cook Park CLO 6.978% 17/4/2030	693,081	0.01
USD 400,000	DIB Sukuk 5.243% 4/3/2029	399,244	0.00
USD 1,014,000	DP World Salaam 6% 1/10/2025*	1,010,087	0.01
USD 350,000	Fantasia 0% 5/7/2022	9,625	0.00
USD 352,000	Fantasia 0% 9/1/2023	9,680	0.00
USD 399,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	10,972	0.00
USD 319,000	Fantasia 9.875% 19/10/2023	8,773	0.00
USD 2,470,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022	67,925	0.00
USD 956,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	26,290	0.00
USD 690,000	Gaci First Investment 5.125% 14/2/2053*	593,838	0.01
USD 400,000	Geely Automobile 4% 9/12/2024	392,554	0.00
USD 250,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 6.599% 20/4/2034	250,050	0.00
USD 400,000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6.879% 20/4/2030	403,009	0.00
USD 578,000	IHS 6.25% 29/11/2028	473,963	0.00
USD 458,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	476,437	0.00
USD 450,000	Madison Park Funding XIII 7.071% 19/4/2030	451,057	0.00
USD 264,386	Madison Park Funding XXVI 6.781% 29/7/2030	265,206	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 452,000	MAF Global 6.375% 20/3/2026	449,688	0.00
USD 300,000	Melco Resorts Finance 4.875% 6/6/2025	293,063	0.00
USD 758,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029*	686,865	0.01
USD 200,000	MGM China 4.75% 1/2/2027*	188,861	0.00
USD 378,000	MGM China 5.875% 15/5/2026	372,236	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.971% 19/10/2031	251,084	0.00
USD 292,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 37 7.029% 20/7/2031	292,003	0.00
USD 160,892	Palmer Square CLO 2018-1 6.59% 18/4/2031	160,974	0.00
USD 370,796	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 7.384% 23/8/2031	371,534	0.00
USD 632,414	Pikes Peak CLO 1 6.76% 24/7/2031	632,990	0.01
USD 400,000	Pikes Peak CLO 8 6.749% 20/7/2034	401,491	0.00
USD 204,258	Rockford Tower CLO 2018-1 6.681% 20/5/2031	204,255	0.00
USD 402,000	Sands China 4.05% 8/1/2026	386,336	0.00
USD 590,000	Sands China 4.625% 18/6/2030*	536,124	0.00
USD 300,000	Sands China 5.125% 8/8/2025	295,910	0.00
USD 640,000	Sands China 5.4% 8/8/2028	623,510	0.01
USD 4,254,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	4,556,672	0.03
USD 2,591,000	Seagate HDD Cayman 8.5% 15/7/2031*	2,797,487	0.02
USD 4,030,000	Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	4,565,426	0.03
USD 9,238,000	Shelf Drilling 9.625% 15/4/2029	8,957,026	0.06
USD 2,777,000	Shelf Drilling North Sea 10.25% 31/10/2025	2,808,824	0.02
USD 400,000	Tencent 3.925% 19/1/2038*	338,998	0.01
USD 400,000	Tencent Music Entertainment 2% 3/9/2030*	325,194	0.00
USD 1,088,100	Transocean 8.75% 15/2/2030	1,118,207	0.01
USD 1,126,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	1,156,481	0.01
USD 1,075,805	Trinitas CLO XIV 7.586% 25/1/2034	1,075,859	0.01
USD 627,088	Trinitas CLO XIV 8.586% 25/1/2034	627,119	0.01
USD 235,918	Voya CLO 2013-3 6.709% 18/10/2031	236,627	0.00
USD 300,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026	291,750	0.00
USD 922,000	Wynn Macau 5.625% 26/8/2028*	869,446	0.01
		49,780,099	0.33
チリ			
USD 320,000	Banco de Credito e Inversiones 8.75% 8/2/2029	330,702	0.00
USD 374,000	Banco del Estado de Chile 2.704% 9/1/2025	365,138	0.01
USD 1,383,000	Chile Government International Bond 4.34% 7/3/2042*	1,195,016	0.01
USD 709,000	Empresa Nacional del Petroleo 3.75% 5/8/2026*	676,000	0.01
USD 525,000	Empresa Nacional del Petroleo 6.15% 10/5/2033*	524,945	0.00
USD 704,000	Engie Energia Chile 3.4% 28/1/2030*	614,476	0.00
		3,706,277	0.03
中国			
CNY 171,910,000	China Government Bond 2.29% 25/12/2024	24,004,760	0.16
コロンビア			
USD 1,095,000	Colombia Government International Bond 3.125% 15/4/2031	865,384	0.01
EUR 372,000	Colombia Government International Bond 3.875% 22/3/2026*	397,554	0.00
USD 1,006,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	947,536	0.01
USD 1,797,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	1,752,084	0.01
USD 949,000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	992,052	0.01
USD 385,000	Colombia Government International Bond 8% 14/11/2035	399,339	0.00
USD 270,000	Colombia Government International Bond 8.75% 14/11/2053	288,847	0.00
USD 890,000	Ecopetrol 8.375% 19/1/2036	890,369	0.00
USD 1,090,000	Ecopetrol 8.875% 13/1/2033*	1,142,707	0.01
USD 1,314,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024	1,309,309	0.01
		8,985,181	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 (%)
	コスタリカ		
USD 548,000	Costa Rica Government International Bond 6.55% 3/4/2034*	564,081	0.00
USD 542,000	Costa Rica Government International Bond 7.3% 13/11/2054	570,230	0.01
		1,134,311	0.01
	コートジボワール		
EUR 391,000	Ivory Coast Government International Bond 5.875% 17/10/2031	383,377	0.00
USD 2,359,000	Ivory Coast Government International Bond 6.375% 3/3/2028*	2,288,230	0.02
USD 368,000	Ivory Coast Government International Bond 8.25% 30/1/2037*	360,640	0.00
		3,032,247	0.02
	チェコ共和国		
CZK 400,790,000	Czech Republic Government Bond 2.75% 23/7/2029	16,465,588	0.11
CZK 365,850,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	16,891,062	0.11
		33,356,650	0.22
	ドミニカ共和国		
USD 758,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6.75% 30/3/2029	765,819	0.01
USD 1,445,000	Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030	1,311,272	0.01
USD 1,166,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	1,038,819	0.01
USD 1,266,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027*	1,264,740	0.01
USD 901,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026*	913,024	0.00
USD 365,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031	376,850	0.00
		5,670,524	0.04
	エジプト		
USD 758,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061*	537,088	0.01
USD 664,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047*	516,081	0.00
		1,053,169	0.01
	フランス		
EUR 1,133,000	Altice France 2.125% 15/2/2025*	1,195,420	0.01
EUR 2,386,000	Altice France 2.5% 15/1/2025	2,511,393	0.02
EUR 3,383,000	Altice France 5.875% 1/2/2027	3,313,300	0.02
EUR 4,400,000	Altice France 11.5% 1/2/2027	4,881,090	0.03
GBP 600,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027	673,709	0.00
EUR 2,900,000	BNP Paribas 2.125% 23/1/2027	3,041,456	0.02
GBP 599,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	731,660	0.01
USD 695,000	BNP Paribas 4.625% 12/1/2027	618,691	0.00
EUR 5,512,000	Chrome Holdco 5% 31/5/2029*	4,428,639	0.03
EUR 9,782,000	Forvia 2.75% 15/2/2027*	10,074,220	0.07
EUR 4,306,000	Goldstory 6.75% 1/2/2030	4,698,935	0.03
EUR 3,161,000	Goldstory 7.906% 1/2/2030	3,456,893	0.02
EUR 11,986,000	Iliad 5.125% 15/10/2026*	12,928,523	0.09
EUR 9,570,000	Iliad 5.625% 15/10/2028*	10,364,382	0.07
EUR 21,789,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	23,109,496	0.16
GBP 600,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024	744,793	0.01
GBP 600,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	709,324	0.00
		87,481,924	0.59
	ドイツ		
EUR 13,668,000	Adler Pelzer 9.5% 1/4/2027	15,006,072	0.10
EUR 6,140,000	APCOA Parking 8.942% 15/1/2027	6,744,725	0.05
EUR 159,513,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	164,302,393	1.10
EUR 266,280,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.3% 15/2/2033*	286,904,136	1.93
EUR 5,377,000	Douglas 6% 8/4/2026	5,891,702	0.04
EUR 9,534,000	Douglas 6% 8/4/2026*	10,441,968	0.07
EUR 3,148,000	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027*	3,334,102	0.02
EUR 3,351,988	IHO Verwaltungs 8.75% 15/5/2028*	3,953,419	0.03
EUR 1	Kirk Beauty SUN 8.25% 1/10/2026	1	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 (%)
ドイツ(続き)			
EUR 8,285,811	Kirk Beauty SUN 8.25% 1/10/2026	9,141,070	0.06
EUR 9,042,300	TK Elevator Holdco 6.625% 15/7/2028*	9,472,771	0.06
EUR 16,480,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027*	17,364,678	0.12
EUR 3,163,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	3,078,993	0.02
		535,636,030	3.60
グアテマラ			
USD 577,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033*	471,868	0.00
USD 379,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	300,909	0.00
USD 651,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	625,354	0.01
USD 1,169,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029*	1,122,947	0.01
USD 525,000	Guatemala Government Bond 6.6% 13/6/2036*	530,675	0.00
USD 1,080,000	Guatemala Government Bond 7.05% 4/10/2032	1,136,160	0.01
		4,187,913	0.03
ホンジュラス			
USD 538,000	Honduras Government International Bond 5.625% 24/6/2030	471,605	0.00
香港			
USD 700,000	AIA 2.7% 7/4/2026*	653,607	0.00
USD 800,000	Dah Sing Bank 7.375% 15/11/2033	833,040	0.01
USD 306,000	Yanlord Land HK 5.125% 20/5/2026*	235,620	0.00
		1,722,267	0.01
ハンガリー			
HUF 3,111,880,000	Hungary Government Bond 6.75% 22/10/2028	8,831,150	0.06
USD 1,342,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	1,320,548	0.01
USD 224,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/3/2024	224,224	0.00
EUR 1,014,000	Hungary Government International Bond 5.375% 12/9/2033	1,144,457	0.01
USD 318,000	Hungary Government International Bond 5.5% 26/3/2036*	305,523	0.00
EUR 1,045,000	Magyar Export-Import Bank Zrt 6% 16/5/2029*	1,191,577	0.01
		13,017,479	0.09
インド			
USD 210,000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	194,198	0.00
USD 470,000	Indian Railway Finance 3.249% 13/2/2030	416,192	0.01
USD 300,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029*	285,803	0.00
USD 700,000	REC 2.75% 13/1/2027	648,112	0.01
USD 300,000	REC 5.625% 11/4/2028	301,589	0.00
USD 460,000	Shriram Finance 6.625% 22/4/2027	463,544	0.00
		2,309,438	0.02
インドネシア			
USD 820,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026	783,735	0.01
USD 250,000	Bank Negara Indonesia Persero 4.3% 24/3/2027	229,324	0.00
USD 618,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027	603,684	0.00
USD 2,639,000	Indonesia Government International Bond 4.65% 20/9/2032*	2,554,701	0.02
USD 800,000	Indonesia Government International Bond 5.1% 10/2/2054*	766,644	0.01
IDR 52,859,000,000	Indonesia Treasury Bond 5.5% 15/4/2026	3,316,511	0.02
IDR 243,654,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/5/2027	15,776,899	0.11
IDR 341,601,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	22,435,007	0.15
IDR 259,564,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	18,620,557	0.12
IDR 83,313,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.375% 15/9/2026	5,558,617	0.04
USD 510,000	Pertamina Geothermal Energy 5.15% 27/4/2028	507,769	0.00
USD 1,406,000	Pertamina Persero 3.65% 30/7/2029*	1,305,314	0.01
USD 703,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	691,889	0.00
		73,150,651	0.49

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			
EUR 6,763,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	6,632,173	0.05
GBP 3,382,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	3,093,262	0.02
EUR 116,000	Avoca CLO XV 4.992% 15/4/2031	122,292	0.00
EUR 1,524,000	Dell Bank International 0.5% 27/10/2026	1,519,775	0.01
EUR 404,000	Harvest CLO XVIII 5.142% 15/10/2030	432,439	0.00
EUR 410,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 5.87% 21/1/2035	442,278	0.01
EUR 280,000	OAK Hill European Credit Partners VI 5.17% 20/1/2032	300,932	0.00
EUR 472,000	OCF Euro CLO 2017-2 5.292% 15/1/2032	509,894	0.01
USD 405,172	Prodigy Finance CM2021-1 7.935% 25/7/2051	408,628	0.00
USD 236,148	Prodigy Finance CM2021-1 9.185% 25/7/2051	239,326	0.00
USD 264,101	Prodigy Finance CM2021-1 11.335% 25/7/2051	265,397	0.00
GBP 11,123,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028*	12,577,664	0.08
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 5.612% 15/7/2035	268,275	0.00
		26,812,335	0.18
マン島			
USD 1,141,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	991,603	0.01
USD 1,070,000	Gohl Capital 4.25% 24/1/2027	1,026,371	0.01
		2,017,974	0.02
イスラエル			
USD 656,080	Energean Israel Finance 8.5% 30/9/2033*	633,445	0.01
USD 252,759	Leviathan Bond 6.75% 30/6/2030*	231,890	0.00
		865,335	0.01
イタリア			
EUR 13,130,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	14,150,231	0.09
EUR 2,005,000	Cerved 6% 15/2/2029	1,985,270	0.01
EUR 6,400,000	Cerved 9.175% 15/2/2029	6,728,948	0.05
EUR 13,500,000	Forno d' Asolo 9.425% 30/4/2027	14,609,910	0.10
EUR 6,654,000	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ 5.5% 17/5/2027	7,075,955	0.05
EUR 3,943,000	Marcolin 6.125% 15/11/2026	4,262,898	0.03
EUR 5,010,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026*	4,919,443	0.03
EUR 6,914,000	Shiba Bidco 4.5% 31/10/2028*	7,166,788	0.05
		60,899,443	0.41
日本			
EUR 1,737,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026*	1,826,213	0.01
EUR 2,758,000	Takeda Pharmaceutical 2.25% 21/11/2026	2,887,052	0.02
		4,713,265	0.03
ジャージー			
EUR 11,370,000	Ardonagh Finco 6.875% 15/2/2031	12,254,646	0.08
EUR 3,187,000	Kane Bidco 5% 15/2/2027*	3,400,199	0.02
GBP 5,786,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	7,172,684	0.05
		22,827,529	0.15
ヨルダン			
USD 470,000	Jordan Government International Bond 4.95% 7/7/2025	457,160	0.00
ケニア			
USD 797,000	Republic of Kenya Government International Bond 9.75% 16/2/2031	795,008	0.00
ルクセンブルグ			
USD 575,000	3R Lux 9.75% 5/2/2031	596,749	0.00
GBP 10,081,000	Allied Universal Holdco/Allied Universal Finance/Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028	11,276,367	0.08
EUR 4,738,000	Becton Dickinson Euro Finance 3.553% 13/9/2029	5,128,973	0.03
EUR 17,000,000	Birkenstock Financing 5.25% 30/4/2029*	18,399,232	0.12
GBP 6,704,000	CK Hutchison Telecom Finance 2.625% 17/10/2034*	6,021,836	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
USD 10,856,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	10,656,379	0.08
USD 735,000	Cosan Luxembourg 7.25% 27/6/2031*	745,419	0.01
EUR 7,733,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	5,993,719	0.04
USD 441,000	Kenbourne Invest 4.7% 22/1/2028*	254,678	0.00
USD 967,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	748,298	0.00
EUR 19,588,000	Matterhorn Telecom 3.125% 15/9/2026*	20,726,228	0.14
USD 314,699	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031*	287,005	0.00
USD 429,739	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	391,922	0.00
USD 945,000	MHP Lux 6.25% 19/9/2029	694,575	0.00
USD 732,600	Millicom International Cellular 5.125% 15/1/2028	699,278	0.00
USD 858,000	Minerva Luxembourg 8.875% 13/9/2033*	900,295	0.01
USD 1,276,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026*	1,215,384	0.01
USD 861,000	Raizen Fuels Finance 6.45% 5/3/2034	864,655	0.01
EUR 5,376,000	Sani/Ikos Financial I 5.625% 15/12/2026	5,695,274	0.04
		91,296,266	0.61
マレーシア			
USD 600,000	CIMB Bank 2.125% 20/7/2027	543,465	0.00
USD 730,000	Dua Capital 2.78% 11/5/2031	623,427	0.00
USD 885,000	Khazanah Capital 4.876% 1/6/2033	864,968	0.01
USD 800,000	TNB Global Ventures Capital 4.851% 1/11/2028	789,580	0.01
		2,821,440	0.02
モーリシャス			
USD 500,000	Azure Power Solar Energy Pvt 5.65% 24/12/2024	495,632	0.01
USD 223,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026*	213,457	0.00
USD 430,000	Diamond II 7.95% 28/7/2026*	436,820	0.00
USD 300,000	Greenko Wind Projects Mauritius 5.5% 6/4/2025	295,706	0.00
USD 244,525	India Green Power 4% 22/2/2027	226,943	0.00
		1,668,558	0.01
メキシコ			
USD 615,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2027	584,788	0.01
USD 1,933,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	1,402,942	0.01
MXN 26,132,000	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	141,910,208	0.95
MXN 3,192,666	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	16,757,896	0.11
MXN 1,682,888	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	9,131,648	0.06
MXN 667,176	Mexican Bonos 8.5% 1/3/2029	3,783,265	0.03
MXN 552,215	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	3,036,293	0.02
MXN 27,051,998	Mexico Cetes 0% 30/5/2024	15,423,422	0.10
USD 1,688,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/5/2031*	1,400,221	0.01
USD 1,243,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028*	1,178,010	0.01
USD 305,000	Mexico Government International Bond 6.338% 4/5/2053	296,486	0.00
USD 1,130,000	Mexico Government International Bond 6.35% 9/2/2035*	1,156,933	0.01
USD 560,000	Mexico Government International Bond 6.4% 7/5/2054*	549,671	0.01
USD 615,000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/1/2025	600,422	0.00
USD 1,520,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031*	1,183,540	0.01
USD 257,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027	240,055	0.00
USD 874,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	705,882	0.01
USD 1,356,834	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	1,298,551	0.01
USD 728,000	Trust Fibra Uno 4.869% 15/1/2030*	661,559	0.00
		201,301,792	1.36
モロッコ			
USD 558,000	Morocco Government International Bond 5.95% 8/3/2028	564,448	0.00
USD 359,000	OCP 3.75% 23/6/2031*	305,390	0.00
		869,838	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 (%)
	オランダ		
USD 858,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 12/1/2031	849,012	0.01
USD 452,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	441,457	0.00
GBP 600,000	Cooperatieve Rabobank 1.875% 12/7/2028	682,017	0.00
EUR 6,550,000	Dufry One 2.5% 15/10/2024	7,036,991	0.05
USD 939,000	Embraer Netherlands Finance 7% 28/7/2030	982,715	0.01
USD 462,500	Greenko Dutch 3.85% 29/3/2026	436,348	0.00
GBP 600,000	ING Groep 3% 18/2/2026	727,742	0.01
USD 629,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028	560,801	0.00
USD 725,000	MEGlobal 2.625% 28/4/2028	646,392	0.01
USD 662,000	MEGlobal 4.25% 3/11/2026*	638,218	0.00
EUR 2,863,000	Mercedes-Benz International Finance 1.375% 26/6/2026*	2,967,302	0.02
USD 452,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	334,480	0.00
USD 781,032	Minejesa Capital 4.625% 10/8/2030	740,688	0.01
USD 500,000	Minejesa Capital 5.625% 10/8/2037*	437,582	0.00
USD 1,632,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,465,724	0.01
USD 3,738,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.4% 1/6/2027	3,658,680	0.03
USD 2,992,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033*	2,895,822	0.02
EUR 2,995,000	Sigma Holdco 5.75% 15/5/2026	3,090,140	0.02
EUR 1,656,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	1,641,698	0.01
EUR 23,281,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	24,384,019	0.16
EUR 5,532,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.375% 15/9/2029	6,583,638	0.05
EUR 2,893,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 7.875% 15/9/2031*	3,602,235	0.03
USD 1,644,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	1,604,266	0.01
USD 941,000	Trivium Packaging Finance 8.5% 15/8/2027	917,282	0.00
EUR 3,383,000	United 8.134% 15/2/2031	3,675,486	0.02
GBP 300,000	Volkswagen Financial Services 1.875% 3/12/2024	371,222	0.00
GBP 300,000	Volkswagen Financial Services 4.25% 9/10/2025	372,953	0.00
EUR 25,365,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030*	24,607,114	0.17
		96,352,024	0.65
	ナイジェリア		
USD 2,000,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047	1,545,810	0.01
USD 815,000	Nigeria Government International Bond 8.375% 24/3/2029*	773,745	0.01
		2,319,555	0.02
	北マケドニア		
EUR 493,000	North Macedonia Government International Bond 6.96% 13/3/2027*	559,931	0.00
	オマーン		
USD 615,000	Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047*	607,340	0.01
USD 1,520,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048*	1,525,145	0.01
USD 581,000	Oman Sovereign Sukuk 4.397% 1/6/2024*	578,563	0.00
		2,711,048	0.02
	パナマ		
USD 452,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	318,283	0.00
USD 1,398,000	Panama Government International Bond 6.4% 14/2/2035*	1,293,464	0.01
USD 1,122,000	Panama Government International Bond 6.853% 28/3/2054*	988,762	0.00
USD 1,775,000	Panama Government International Bond 7.5% 1/3/2031	1,814,716	0.01
USD 1,051,000	Panama Government International Bond 8% 1/3/2038	1,076,224	0.01
		5,491,449	0.03
	パラグアイ		
USD 784,000	Paraguay Government International Bond 2.739% 29/1/2033*	630,195	0.00
	ペルー		
USD 1,344,000	Financiera de Desarrollo 4.75% 15/7/2025	1,330,533	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 (%)
ペルー(続き)			
USD 2,376,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032*	1,798,311	0.01
USD 1,247,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031*	1,059,283	0.01
PLN 33,393,000	Peruvian Government International Bond 6.95% 12/8/2031	9,072,228	0.06
		13,260,355	0.09
フィリピン			
USD 400,000	Globe Telecom 4.2% 2/8/2026	385,000	0.00
USD 800,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045*	522,548	0.00
USD 500,000	Rizal Commercial Banking 5.5% 18/1/2029*	500,600	0.00
USD 756,000	Rizal Commercial Banking 6.5% 27/8/2025	743,938	0.01
		2,152,086	0.01
ポーランド			
USD 418,000	Bank Gospodarstwa Krajowego 6.25% 31/10/2028	435,124	0.00
PLN 122,976,000	Republic of Poland Government Bond 2.75% 25/10/2029*	27,436,977	0.19
USD 537,000	Republic of Poland Government International Bond 4.875% 4/10/2033*	525,844	0.00
USD 821,000	Republic of Poland Government International Bond 5.5% 4/4/2053	819,772	0.01
		29,217,717	0.20
ルーマニア			
EUR 810,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031*	709,119	0.01
EUR 1,460,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	1,384,863	0.01
EUR 1,387,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029*	1,374,231	0.01
USD 668,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	655,131	0.00
		4,123,344	0.03
サウジアラビア			
USD 1,559,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030*	1,515,387	0.01
USD 1,183,000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1,043,992	0.01
		2,559,379	0.02
セネガル			
USD 793,000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/5/2033*	663,146	0.00
シンガポール			
USD 250,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028*	249,062	0.00
USD 500,000	BOC Aviation 3.5% 18/9/2027	471,088	0.00
USD 545,000	Continuum Energy Aura 9.5% 24/2/2027*	569,492	0.00
USD 500,000	DBS 3.3% 27/2/2025*	488,112	0.00
USD 805,168	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039	780,301	0.01
USD 427,000	Medco Maple Tree 8.96% 27/4/2029*	444,548	0.01
USD 1,882,000	Pfizer Investment Enterprises 4.75% 19/5/2033	1,836,314	0.01
USD 656,000	Theta Capital 8.125% 22/1/2025*	632,063	0.01
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	191,351	0.00
		5,662,331	0.04
南アフリカ			
ZAR 187,797,000	Republic of South Africa Government Bond 7% 28/2/2031	8,078,521	0.05
ZAR 209,437,636	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	9,906,341	0.07
ZAR 21,627,528	Republic of South Africa Government Bond 8.25% 31/3/2032*	966,202	0.01
ZAR 87,889,802	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044	3,335,526	0.02
ZAR 209,101,280	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040*	8,362,107	0.06
ZAR 455,980,110	Republic of South Africa Government Bond 10.5% 21/12/2026*	24,682,697	0.16
USD 509,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029	456,632	0.00
USD 1,757,000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1,192,564	0.01
USD 1,064,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 20/4/2032*	957,600	0.01
		57,938,190	0.39
韓国			
USD 400,000	Hana Bank 3.5% 19/10/2026	375,546	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
韓国(続き)			
USD 400,000	Hanwha Life Insurance 3.379% 4/2/2032*	369,546	0.00
USD 375,000	Hyundai Capital Services 5.125% 5/2/2027*	372,175	0.01
USD 350,000	Hyundai Capital Services 5.125% 5/2/2029*	346,148	0.00
USD 200,000	Korea National Oil 4.75% 3/4/2026*	198,124	0.00
USD 200,000	Korea National Oil 4.875% 3/4/2028	198,031	0.00
USD 730,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031*	601,830	0.01
USD 305,000	POSCO 4.875% 23/1/2027	300,445	0.00
USD 267,000	POSCO 5.625% 17/1/2026	267,693	0.00
USD 304,000	POSCO 5.75% 17/1/2028	307,105	0.00
USD 200,000	POSCO 5.875% 17/1/2033	205,091	0.00
USD 750,000	SK Hynix 2.375% 19/1/2031	614,918	0.01
USD 600,000	SK Hynix 5.5% 16/1/2027	600,117	0.00
USD 540,000	SK Hynix 5.5% 16/1/2029*	539,603	0.00
USD 200,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028*	205,839	0.00
USD 400,000	Woori Card 1.75% 23/3/2026	369,400	0.00
		5,871,611	0.04
スペイン			
GBP 2,100,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	2,551,520	0.02
EUR 18,049,000	Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046	17,067,249	0.12
EUR 13,935,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	13,578,334	0.09
GBP 1,204,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	1,529,699	0.01
		34,726,802	0.24
スウェーデン			
GBP 599,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	680,594	0.01
EUR 16,053,000	Verisure 3.25% 15/2/2027*	16,745,992	0.11
EUR 1,603,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,715,226	0.01
EUR 1,660,000	Verisure 7.125% 1/2/2028	1,888,400	0.01
EUR 3,262,000	Verisure 9.25% 15/10/2027	3,801,277	0.03
EUR 11,473,000	Verisure Midholding 5.25% 15/2/2029*	12,151,752	0.08
		36,983,241	0.25
スイス			
USD 3,048,000	Credit Suisse 2.95% 9/4/2025	2,962,651	0.02
USD 3,025,000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	2,997,885	0.02
USD 2,777,000	Credit Suisse 7.95% 9/1/2025	2,827,525	0.02
EUR 5,840,000	UBS 0.65% 14/1/2028	5,768,275	0.04
USD 726,000	UBS 4.875% 12/2/2027	662,965	0.00
		15,219,301	0.10
タイ			
USD 372,000	Bangkok Bank 3.733% 25/9/2034	330,524	0.00
USD 1,160,000	Bangkok Bank 5.3% 21/9/2028	1,162,651	0.01
USD 1,160,000	Bangkok Bank 5.5% 21/9/2033	1,159,130	0.01
USD 462,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/3/2026*	436,960	0.00
USD 600,000	Minor International 2.7% 19/4/2026	564,363	0.01
USD 201,000	Muang Thai Life Assurance 3.552% 27/1/2037	186,545	0.00
		3,840,173	0.03
トルコ			
USD 395,000	Turkiye Varlik Fonu Yonetimi 8.25% 14/2/2029	402,900	0.00
ウクライナ			
USD 1,860,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	489,413	0.01
USD 758,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	235,359	0.00
USD 1,064,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2026	317,588	0.00
USD 837,000	VF Ukraine PAT via VFU Funding 6.2% 11/2/2025	720,958	0.00
		1,763,318	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アラブ首長国連邦			
USD 230,000	Abu Dhabi Commercial Bank 8% 27/11/2028*	245,778	0.00
USD 341,000	Abu Dhabi National Energy 4.696% 24/4/2033	333,026	0.00
USD 895,000	GEMS MENASA Cayman / GEMS Education Delaware 7.125% 31/7/2026	889,867	0.01
USD 244,000	GEMS MENASA Cayman / GEMS Education Delaware 7.125% 31/7/2026*	242,601	0.00
USD 778,000	MDGH GMTN RSC 4.375% 22/11/2033	738,128	0.01
		2,449,400	0.02
英国			
GBP 599,000	Barclays 3% 8/5/2026	720,439	0.00
GBP 599,000	Barclays 3.25% 12/2/2027	709,565	0.00
USD 695,000	Barclays 4.375% 15/3/2028*	547,640	0.00
EUR 9,844,000	BCP V Modular Services Finance 6.75% 30/11/2029	9,600,226	0.06
EUR 6,665,000	BCP V Modular Services Finance II 4.75% 30/11/2028*	6,867,503	0.05
GBP 9,011,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028*	10,655,931	0.07
GBP 8,806,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	10,420,093	0.07
GBP 23,215,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	27,893,676	0.19
GBP 6,676,000	Bellis Finco 4% 16/2/2027*	7,690,286	0.05
GBP 1,099,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	1,393,752	0.01
GBP 8,872,000	Boparan Finance 7.625% 30/11/2025*	10,699,666	0.07
EUR 3,586,000	BP Capital Markets 2.519% 7/4/2028	3,755,328	0.03
GBP 9,803,000	Deuce Finco 5.5% 15/6/2027	11,705,184	0.08
GBP 11,619,000	Deuce Finco 5.5% 15/6/2027*	13,869,439	0.09
EUR 3,410,000	eG Global Finance 11% 30/11/2028	3,873,263	0.03
USD 3,478,000	eG Global Finance 12% 30/11/2028	3,660,769	0.02
GBP 669,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	775,266	0.01
EUR 15,000,000	INEOS Finance 6.375% 15/4/2029	16,328,517	0.11
EUR 3,111,000	INEOS Finance 6.625% 15/5/2028*	3,442,884	0.02
GBP 602,000	Informa 3.125% 5/7/2026	724,074	0.00
GBP 1,223,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	1,517,757	0.01
EUR 2,028,000	Market Bidco Finco 4.75% 4/11/2027*	2,077,087	0.01
GBP 8,388,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	9,689,071	0.07
GBP 5,895,000	Marks & Spencer 3.75% 19/5/2025*	7,168,222	0.05
EUR 4,020,000	National Grid 0.163% 20/1/2028*	3,807,284	0.03
GBP 602,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	731,698	0.01
GBP 599,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	721,895	0.01
GBP 24,711,000	Punch Finance 6.125% 30/6/2026*	30,369,614	0.20
GBP 599,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026	731,636	0.01
GBP 3,380,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025*	4,203,893	0.03
GBP 1,511,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	1,890,200	0.01
GBP 83,525,396	United Kingdom Gilt 0.5% 22/10/2061	31,419,260	0.21
GBP 160,970,000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/7/2027*	185,602,663	1.25
GBP 14,813,349	United Kingdom Gilt 3.75% 22/10/2053	16,249,981	0.11
USD 235,000	Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2027	224,578	0.00
USD 847,560	Vedanta Resources Finance II 13.875% 9/12/2028*	783,442	0.01
USD 357,840	Vedanta Resources Finance II 13.875% 9/12/2028*	330,769	0.00
GBP 8,339,000	Virgin Media Secured Finance 4.125% 15/8/2030*	8,781,991	0.06
GBP 3,991,000	Virgin Media Secured Finance 4.25% 15/1/2030*	4,349,987	0.03
GBP 3,039,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027*	3,762,557	0.03
GBP 3,333,000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	3,677,994	0.02
GBP 10,028,000	Vmed O2 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	10,528,437	0.07
		473,953,517	3.19
米国			
USD 2,640,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.142% 10/8/2035	2,447,341	0.02
EUR 2,771,000	AbbVie 1.375% 17/5/2024	2,990,281	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 3,870,000	AbbVie 4.95% 15/3/2031	3,878,052	0.03
USD 3,100,000	AbbVie 5.05% 15/3/2034	3,118,380	0.02
USD 812,328	AccessLex Institute 5.885% 25/5/2036	797,759	0.01
USD 1,206,000	Affinity Interactive 6.875% 15/12/2027	1,113,563	0.01
USD 1,125,000	Alexander Funding Trust II 7.467% 31/7/2028	1,179,635	0.01
USD 1,769,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,723,409	0.01
USD 1,301,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 9.75% 15/7/2027	1,296,567	0.01
USD 1,260,000	Alteryx 8.75% 15/3/2028	1,279,107	0.01
USD 1,076,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	1,026,953	0.01
EUR 7,005,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	6,906,047	0.05
USD 6,695,000	American Tower 5.25% 15/7/2028	6,682,824	0.04
USD 1,632,000	Amgen 2% 15/1/2032	1,312,244	0.01
USD 1,605,000	Amgen 2.3% 25/2/2031	1,346,791	0.01
USD 4,943,000	Amgen 3.35% 22/2/2032	4,378,744	0.03
USD 9,986,000	Amgen 5.15% 2/3/2028	10,018,885	0.07
GBP 602,000	Amgen 5.5% 7/12/2026	772,811	0.00
USD 1,360,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	1,367,256	0.01
EUR 11,266,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028*	10,650,396	0.07
EUR 3,352,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029*	2,884,868	0.02
USD 5,690,000	AREIT 2022-CRE7 7.562% 17/6/2039	5,666,086	0.04
GBP 1,201,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	1,434,678	0.01
GBP 600,000	AT&T 5.5% 15/3/2027	765,439	0.00
USD 527,000	Azul Secured Finance 11.93% 28/8/2028	537,037	0.01
USD 460,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.596% 14/4/2033	435,985	0.00
USD 1,210,000	BANK 2017-BNK9 3.538% 15/11/2054	1,137,374	0.01
USD 783,000	Bank of America 1.898% 23/7/2031	636,131	0.00
USD 2,317,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	1,871,965	0.01
EUR 2,844,000	Bank of America 1.949% 27/10/2026	2,993,117	0.02
USD 3,641,000	Bank of America 2.496% 13/2/2031	3,109,214	0.02
USD 2,552,000	Bank of America 2.592% 29/4/2031	2,183,017	0.01
USD 5,655,000	Bank of America 5.468% 23/1/2035	5,644,032	0.04
USD 172,872	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 6.485% 25/11/2035	166,091	0.00
USD 187,371	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 5.945% 25/10/2036	176,207	0.00
USD 2,951,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 6.636% 15/3/2037	2,663,250	0.02
EUR 2,217,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	2,278,202	0.02
USD 3,692,000	Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027	3,542,034	0.02
USD 610,912	BHMS 2018-ATLS 6.865% 15/7/2035	609,317	0.00
USD 1,715,558	BHMS 2018-ATLS 7.515% 15/7/2035	1,678,308	0.01
USD 2,145,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	2,158,691	0.02
USD 4,247,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	3,774,214	0.03
USD 1,724,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	1,441,944	0.01
USD 1,605,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	1,504,505	0.01
USD 2,289,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,215,090	0.02
USD 2,281,200	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	1,993,964	0.01
USD 1,975,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	2,082,673	0.01
USD 5,393,000	Calumet Specialty Products Partners / Calumet Finance 9.75% 15/7/2028	5,357,330	0.04
USD 860,545	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 7.765% 15/12/2037	855,089	0.01
USD 550,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	561,659	0.00
USD 527,428	CD 2017-CD6 Mortgage Trust 3.911% 13/11/2050	450,385	0.00
USD 1,179,000	Champions Financing 8.75% 15/2/2029	1,202,140	0.01
USD 1,246,000	Churchill Downs 5.75% 1/4/2030	1,198,197	0.01
EUR 2,840,000	Citigroup 1.25% 6/7/2026	2,974,294	0.02
GBP 938,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	1,086,482	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 2,148,000	Citigroup 2.561% 1/5/2032	1,772,291	0.01
USD 3,264,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	2,768,354	0.02
USD 2,979,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	2,560,112	0.02
USD 802,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	753,003	0.01
USD 651,000	Citigroup 4.15% 15/11/2026	588,720	0.00
USD 1,223,900	Citigroup CCommercial Mortgage Trust 2018-C6 4.412% 10/11/2051	1,126,432	0.01
USD 750,000	Citizens Bank 4.119% 23/5/2025	744,667	0.01
USD 1,250,000	Citizens Bank 6.064% 24/10/2025	1,243,079	0.01
USD 3,026,000	Civitas Resources 5% 15/10/2026	2,936,540	0.02
USD 7,442,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	7,794,021	0.05
USD 3,330,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	3,097,400	0.02
USD 1,302,000	Cloud Software 9% 30/9/2029	1,214,009	0.01
USD 1,963,000	Clydesdale Acquisition 8.75% 15/4/2030	1,872,158	0.01
USD 3,176,000	CNX Resources 7.25% 1/3/2032	3,175,124	0.02
EUR 1,666,000	Comcast 0.25% 14/9/2029	1,523,581	0.01
USD 2,167,179	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	2,118,285	0.01
USD 921,000	CommScope 6% 1/3/2026	834,606	0.01
USD 3,067,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025*	2,395,266	0.02
EUR 8,101,000	Coty 3.875% 15/4/2026	8,753,229	0.06
EUR 1,067,000	Coty 5.75% 15/9/2028*	1,205,902	0.01
USD 2,696,000	Crown Castle 2.9% 15/3/2027	2,514,599	0.02
USD 402,545	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust 4.642% 15/11/2048	382,305	0.00
USD 5,256,000	CSC 5.5% 15/4/2027	4,723,173	0.03
USD 1,168,000	CSC 11.25% 15/5/2028	1,205,230	0.01
USD 2,545,000	CSC 11.75% 31/1/2029	2,659,546	0.02
USD 571,000	DAE Funding 1.55% 1/8/2024	560,605	0.00
USD 390,000	DAE Funding 2.625% 20/3/2025	376,145	0.00
USD 593,946	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.417% 15/5/2035	591,597	0.00
USD 1,200,964	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.914% 15/5/2035	1,189,775	0.01
USD 5,354,649	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 7.614% 15/5/2035	5,227,843	0.04
USD 2,204,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	2,186,106	0.01
USD 2,884,000	Dell International / EMC 5.25% 1/2/2028	2,907,953	0.02
USD 4,155,000	DISH DBS 5.875% 15/11/2024	3,901,670	0.03
USD 3,327,000	DISH Network 0% 15/12/2025	2,428,913	0.02
EUR 2,798,000	Duke Energy 3.1% 15/6/2028	2,955,073	0.02
USD 1,205,000	Edison International 7.875% 15/6/2054	1,229,956	0.01
USD 8,288,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	7,930,344	0.05
USD 655,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2027	670,771	0.00
USD 700,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	744,418	0.01
USD 3,387,000	Equinix 1.55% 15/3/2028	2,950,609	0.02
USD 8,907,000	EquipmentShare.com 9% 15/5/2028	9,138,928	0.06
USD 1,032,503	Fannie Mae-Aces 3.739% 25/9/2030	979,217	0.01
EUR 2,958,000	Fidelity National Information Services 1.5% 21/5/2027	2,992,851	0.02
USD 1,289,000	Fiesta Purchaser 7.875% 1/3/2031*	1,330,147	0.01
USD 2,900,000	First Horizon Bank 5.75% 1/5/2030	2,712,167	0.02
USD 35,292,201	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.802% 25/5/2029	1,082,452	0.01
USD 31,449,435	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.036% 25/10/2030	1,634,407	0.01
USD 4,861,363	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.422% 25/7/2030	337,827	0.00
USD 22,551,957	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.522% 25/1/2030	1,609,574	0.01
USD 9,599,552	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.579% 25/4/2030	726,294	0.01
USD 5,497,814	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.695% 25/4/2030	434,395	0.00
USD 1,530,711	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 8.722% 25/1/2042	1,559,459	0.01
USD 3,945,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	3,816,589	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 5,945,000	Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	6,007,060	0.04
USD 7,070,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	7,197,359	0.05
USD 6,545,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	6,305,780	0.04
USD 3,810,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	3,646,646	0.02
USD 6,367,781	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.896% 17/8/2037	6,398,070	0.04
USD 190,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028*	178,327	0.00
USD 823,000	GCI 4.75% 15/10/2028	740,247	0.00
EUR 4,691,000	General Mills 0.125% 15/11/2025*	4,790,925	0.03
EUR 3,663,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	3,746,753	0.02
EUR 1,377,000	Global Payments 4.875% 17/3/2031	1,538,881	0.01
EUR 3,236,000	Goldman Sachs 0.25% 26/1/2028	3,090,618	0.02
EUR 3,078,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029*	2,875,063	0.02
GBP 612,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028	829,540	0.01
USD 2,169,945	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	1,702,884	0.01
USD 6,124,984	GoTo 5.5% 1/5/2028	5,290,455	0.04
USD 5,692,055	GoTo 5.5% 1/5/2028	3,386,773	0.02
USD 661,000	Gran Tierra Energy 9.5% 15/10/2029	614,053	0.00
USD 4,197,000	HCA 3.5% 1/9/2030	3,751,954	0.03
USD 855,000	HCA 5.45% 1/4/2031	852,157	0.01
USD 4,011,000	HCA 5.625% 1/9/2028*	4,043,861	0.03
USD 546,920	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust 2.977% 10/8/2038	486,811	0.00
USD 1,684,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	1,594,061	0.01
EUR 2,721,000	International Business Machines 3.375% 6/2/2027*	2,949,666	0.02
USD 772,280	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-WPT 7.813% 5/7/2033	639,469	0.01
GBP 1,522,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	1,835,748	0.01
EUR 2,960,000	JPMorgan Chase 1.09% 11/3/2027	3,041,516	0.02
USD 651,000	JPMorgan Chase 3.65% 1/6/2026	606,203	0.00
USD 4,330,000	JPMorgan Chase 5.336% 23/1/2035	4,317,257	0.03
USD 2,538,000	JPMorgan Chase 6.087% 23/10/2029	2,628,463	0.02
GBP 360,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	445,181	0.00
USD 537,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	550,425	0.00
USD 4,256,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	2,660,000	0.02
USD 796,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	822,865	0.01
USD 5,840,000	LGI Homes 8.75% 15/12/2028	6,090,626	0.04
USD 2,048,000	Lightning eMotors 7.5% 15/5/2024	122,880	0.00
USD 13,096,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029*	9,825,955	0.06
USD 1,632,000	Lowe's 2.625% 1/4/2031	1,390,333	0.01
USD 13,761,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	13,934,058	0.09
EUR 3,595,000	Morgan Stanley 1.342% 23/10/2026	3,744,244	0.03
USD 866,000	Morgan Stanley 2.239% 21/7/2032	699,912	0.00
USD 327,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	283,460	0.00
USD 4,116,000	Morgan Stanley 3.772% 24/1/2029	3,901,629	0.03
USD 3,470,000	Morgan Stanley 5.466% 18/1/2035*	3,471,626	0.02
USD 395,094	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.323% 15/5/2048	347,917	0.00
USD 2,057,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32 3.72% 15/12/2049	1,949,306	0.01
USD 1,299,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.276% 11/7/2040	1,149,496	0.01
EUR 1,984,000	Nasdaq 4.5% 15/2/2032	2,235,379	0.02
USD 2,268,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	2,027,787	0.01
USD 2,606,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	2,464,510	0.02
USD 321,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	315,676	0.00
USD 1,988,000	Nationstar Mortgage 7.125% 1/2/2032	1,962,053	0.01
USD 3,265,000	NCR Atleos 9.5% 1/4/2029	3,455,856	0.02
EUR 5,362,000	Netflix 3.625% 15/5/2027	5,816,627	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,974,000	Netflix 4.875% 15/4/2028	2,971,186	0.02
USD 1,384,000	New Home 8.25% 15/10/2027	1,306,122	0.01
USD 3,562,000	Northern States Power 4.5% 1/6/2052	3,116,677	0.02
USD 1,476,000	Olympus Water US 7.125% 1/10/2027	1,469,976	0.01
USD 11,580,000	Olympus Water US 9.75% 15/11/2028	12,305,915	0.08
USD 2,070,000	Oncor Electric Delivery 4.1% 15/11/2048	1,703,559	0.01
USD 5,974,000	ONEOK Partners 4.9% 15/3/2025	5,932,104	0.04
USD 4,065,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	3,649,767	0.02
USD 5,808,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	5,018,953	0.04
USD 2,571,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	2,271,493	0.02
USD 3,248,000	Pacific Gas and Electric 3.3% 1/12/2027	3,007,528	0.02
USD 545,000	Palomino Funding Trust I 7.233% 17/5/2028	568,381	0.00
USD 4,150,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	3,606,599	0.02
USD 1,582,000	PennyMac Financial Services 7.875% 15/12/2029	1,622,592	0.01
USD 557,000	Periana 5.95% 19/4/2026	549,536	0.00
USD 1,478,000	Permian Resources Operating 7% 15/1/2032	1,519,368	0.01
USD 3,652,000	Permian Resources Operating 8% 15/4/2027	3,772,494	0.03
USD 9,263,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027	8,325,060	0.05
USD 1,794,000	PNC Financial Services 5.3% 21/1/2028	1,792,984	0.01
USD 1,299,000	Post 6.25% 15/2/2032	1,307,489	0.01
EUR 2,739,000	PPG Industries 1.875% 1/6/2025	2,898,783	0.02
EUR 1,884,000	Procter & Gamble 4.875% 11/5/2027	2,149,877	0.01
USD 3,175,000	Rand Parent 8.5% 15/2/2030*	3,094,846	0.02
USD 9,160,643	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7.873% 25/10/2039	9,226,659	0.06
USD 400,000	Resorts World Las Vegas / RWLV Capital 4.625% 16/4/2029*	361,438	0.00
USD 6,398,000	RingCentral 8.5% 15/8/2030	6,578,967	0.04
USD 5,325,000	Sabre GBLB 8.625% 1/6/2027*	4,712,649	0.03
USD 728,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	683,323	0.00
USD 4,311,000	Sabre GBLB 11.25% 15/12/2027	4,060,423	0.03
USD 4,013,000	Sally / Sally Capital 6.75% 1/3/2032	4,021,736	0.03
USD 326,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026*	304,867	0.00
USD 987,000	Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028*	928,200	0.00
USD 697,000	Sasol Financing USA 8.75% 3/5/2029*	699,422	0.01
USD 1,723,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,689,147	0.01
USD 2,654,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,686,222	0.02
USD 4,525,000	Service Properties Trust 8.625% 15/11/2031*	4,789,889	0.03
USD 362,000	SierraCol Energy Andina 6% 15/6/2028	314,035	0.00
USD 2,092,000	Sitio Royalties Operating Partnership / Sitio Finance 7.875% 1/11/2028	2,147,302	0.01
USD 860,000	SK Battery America 2.125% 26/1/2026	799,108	0.01
USD 285,000	SK Battery America 4.875% 23/1/2027*	282,286	0.00
USD 6,715,536	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.182% 15/10/2041	7,224,712	0.05
USD 6,074,197	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	5,214,061	0.03
USD 3,584,000	Southern California Edison 5.3% 1/3/2028	3,622,512	0.02
USD 3,806,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	4,115,904	0.03
USD 8,929,000	Spirit AeroSystems 9.75% 15/11/2030	9,576,400	0.07
USD 971,875	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	965,563	0.00
USD 526,000	Stem 0.5% 1/12/2028	259,617	0.00
USD 1,847,000	STL 8.75% 15/2/2029	1,891,435	0.01
USD 957,000	Talos Production 9.375% 1/2/2031	988,569	0.01
USD 1,420,000	Tapestry 7.35% 27/11/2028	1,489,274	0.01
USD 4,256,000	Tenneco 8% 17/11/2028	3,864,806	0.03
USD 1,349,000	Texas Capital Bancshares 4% 6/5/2031	1,153,602	0.01
EUR 2,978,000	Thermo Fisher Scientific 1.375% 12/9/2028	2,956,313	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 3,787,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	3,158,497	0.02
USD 2,434,000	T-Mobile USA 3.5% 15/4/2031	2,176,315	0.01
USD 2,579,000	T-Mobile USA 4.95% 15/3/2028	2,568,660	0.02
USD 1,791,000	Truist Financial 5.435% 24/1/2030	1,774,525	0.01
USD 11,655,000	Uber Technologies 0.875% 1/12/2028	14,579,749	0.10
USD 15,000,000	United States Cash Management Bill - Reopening 0% 4/4/2024	14,925,207	0.10
USD 15,000,000	United States Treasury Bill 0% 5/3/2024	14,991,225	0.10
USD 26,000,000	United States Treasury Bill 0% 7/3/2024	25,977,228	0.18
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 0% 14/3/2024	4,990,483	0.03
USD 12,000,000	United States Treasury Bill 0% 19/3/2024	11,968,238	0.08
USD 20,000,000	United States Treasury Bill 0% 26/3/2024	19,926,649	0.13
USD 12,000,000	United States Treasury Bill 0% 2/4/2024	11,943,598	0.08
USD 15,000,000	United States Treasury Bill 0% 11/4/2024	14,909,890	0.10
USD 6,000,000	United States Treasury Bill 0% 16/4/2024	5,959,547	0.04
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 0% 18/4/2024	4,964,885	0.03
USD 23,000,000	United States Treasury Bill 0% 23/4/2024	22,821,213	0.15
USD 11,800,000	United States Treasury Bill 0% 25/4/2024	11,704,967	0.08
USD 15,000,000	United States Treasury Bill 0% 2/5/2024	14,864,013	0.10
USD 12,000,000	United States Treasury Bill 0% 9/5/2024	11,879,273	0.08
USD 15,500,000	United States Treasury Bill 0% 16/5/2024	15,328,732	0.10
USD 15,400,000	United States Treasury Bill 0% 21/5/2024	15,218,942	0.10
USD 18,000,000	United States Treasury Bill 0% 23/5/2024	17,782,737	0.12
USD 22,961,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042*	16,899,206	0.11
USD 55,520,200	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042*	46,756,250	0.32
USD 27,945,800	United States Treasury Note/Bond 3.375% 15/8/2042*	23,931,866	0.16
USD 119,770,000	United States Treasury Note/Bond 4% 30/6/2028*	118,380,481	0.80
USD 43,135,600	United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052*	40,407,611	0.27
USD 192,652,100	United States Treasury Note/Bond 4.125% 31/7/2028*	191,414,160	1.29
USD 54,001,800	United States Treasury Note/Bond 4.5% 30/9/2028	54,762,255	0.37
USD 93,000,000	United States Treasury Note/Bond 4.875% 31/10/2028*	95,328,633	0.64
USD 17,964,600	United States Treasury Note/Bond 5% 30/9/2025*	72,207,762	0.49
USD 69,850,000	United States Treasury Note/Bond 5% 31/10/2025*	70,122,852	0.47
USD 4,006,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	4,160,231	0.03
USD 2,610,000	Univision Communications 8% 15/8/2028	2,610,702	0.02
USD 1,325,000	US Bancorp 5.678% 23/1/2035	1,324,304	0.01
USD 2,381,000	USB Capital IX 6.596% 1/4/2024	1,914,241	0.01
GBP 599,000	Verizon Communications 1.125% 3/11/2028	645,447	0.00
GBP 138,000	Verizon Communications 4.073% 18/6/2024	174,093	0.00
EUR 2,587,000	Verizon Communications 4.25% 31/10/2030	2,903,231	0.02
USD 4,043,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	3,804,033	0.02
USD 7,002,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	6,868,786	0.05
USD 3,125,000	Vistra Operations 7.75% 15/10/2031	3,236,035	0.02
USD 1,350,000	VNDO Trust 2016-350P 3.903% 10/1/2035	1,215,789	0.01
EUR 2,955,000	Wells Fargo 1.375% 26/10/2026	3,015,911	0.02
EUR 4,515,000	Wells Fargo 1.5% 24/5/2027	4,562,408	0.03
USD 5,938,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	5,842,278	0.04
USD 7,205,000	Wells Fargo 5.499% 23/1/2035	7,165,251	0.05
USD 2,000,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28 3.872% 15/5/2048	1,890,365	0.01
USD 796,545	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38 3.903% 15/7/2050	700,193	0.01
USD 1,318,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.749% 15/6/2036	1,151,074	0.01
USD 5,185,000	Xerox 5% 15/8/2025	5,086,580	0.03
USD 1,660,000	Zayo 4% 1/3/2027*	1,382,763	0.01
		1,628,327,266	10.92

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
USD 1,377,802	ウルグアイ Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034*	1,445,693	0.01
USD 517,000	ウズベキスタン Republic of Uzbekistan International Bond 7.85% 12/10/2028	541,632	0.00
債券合計		4,112,146,516	27.61
コマーシャル・ペーパー			
USD 12,174,000	フランス Societe Generale 0% 6/3/2024	12,161,339	0.08
USD 8,710,000	スイス UBS 0% 18/6/2024	8,566,139	0.06
USD 8,710,000	UBS 0% 25/6/2024	8,557,439	0.06
		17,123,578	0.12
USD 5,750,000	米国 HSBC USA 0% 24/6/2024	5,648,460	0.04
USD 9,025,000	HSBC USA 0% 1/7/2024	8,856,140	0.06
USD 8,630,000	HSBC USA 0% 12/8/2024	8,411,412	0.06
USD 8,673,000	HSBC USA 0% 11/10/2024	8,372,132	0.05
		31,288,144	0.21
コマーシャル・ペーパー合計		60,573,061	0.41
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		13,396,568,173	89.96

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			
9,488,465	オーストラリア Quintis Pty	62	0.00
609	ケイマン諸島 Marco Polo Investment	–	0.00
2,463	インド Byju's	190,258	0.00
3,482	Byju's	268,973	0.00
		459,231	0.00
413,408	英国 10x Series D	8,188,421	0.05
498,077	10x Wts 17/11/30 (Wts 17/11/2030)	984,653	0.00
652,238	NMC Health	–	0.00
		9,173,074	0.05
63,622	米国 Aiven	5,122,843	0.03
12,637	Breeze Aviation	2,295,132	0.02
188,149	ByteDance	30,314,758	0.20
45,635	Caresyntax	4,364,531	0.03
6,574	Caresyntax	531,442	0.00
5,179	Caresyntax (Wts 21/6/2033)	495,268	0.00
488,757	Databricks	40,366,441	0.27
136,950	Databricks	11,310,701	0.08
1,209,710	Deep Instinct	5,552,569	0.04
82,654	Deep Instinct (Wts 20/9/2032)	10,745	0.00
1,172,341	Deep Instinct Series D-4	6,178,237	0.04
24,969	Epic Games	16,608,130	0.11
941,683	eXo Imaging	2,693,213	0.02
420,195	Fanatics	29,636,353	0.20
181,250	Farmer's Business Network	654,313	0.00
25,662	FLYR (Wts 31/12/2049)	136,009	0.00
235,953	GM Cruise	2,602,562	0.02
137,209	Hawkeye 360 (Wts 7/7/2033)	650,371	0.00
21,779	Hawkeye 360 ATM (Wts 7/7/2033)	53,141	0.00
54,448	Hawkeye 360 MGR (Wts 7/7/2033)	258,083	0.00
448,109	Hawkeye 360 Series D1	4,167,414	0.03
6,145,462	Included Health	5,961,098	0.04
3,924,026	JumpCloud	9,025,260	0.06
258,097	JumpCloud	593,623	0.00
798,390	Lessen	5,109,696	0.03
760,471	Loadsmart	5,475,391	0.04
95,378	Loadsmart	1,018,637	0.01
107,909	Lookout Series F	227,688	0.00
1,919,121	Lookout Series F	7,810,822	0.05
231,287	Mountain Digital	3,041,424	0.02
5,610	Mythic	–	0.00
4,980	NCB Warrant	–	0.00
24,103	Neon Payments	14,676,317	0.10
750,669	Noodle	2,912,596	0.02
129,448	Psiquantum	3,866,612	0.03
4,244,994	RapidSOS	3,990,294	0.03
2,353,706	RapidSOS (Wts 13/12/2033)	2,188,946	0.02

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	5,531,390	0.04
134,315	SambaNova Systems	9,083,724	0.06
46,362	SambaNova Systems	3,135,462	0.02
167,805	Snorkel AI	1,369,289	0.01
46,853	Snorkel AI	382,320	0.00
337,227	Source Global	6,252,188	0.04
24,317	Source Global	689,144	0.01
3,662	Teya	1,660,351	0.01
1,121,246	Ursa Major Technologies	3,431,013	0.02
137,361	Ursa Major Technologies Series D	436,808	0.00
1,197,196	Verge Genomics	7,745,858	0.05
141,697	Verge Genomics	1,020,219	0.01
178,954	Versa Networks (Wts 7/10/2032)	545,810	0.01
1,451,933	Versa Networks Series E	5,154,362	0.04
		276,338,598	1.86
普通/優先株式およびワラント合計		285,970,965	1.91
	債券		
	オーストラリア		
USD 19,413,818	Quintis Australia 7.5% 1/10/2026	10,786,317	0.07
USD 17,943,829	Quintis Australia 0% 1/10/2028	2	0.00
		10,786,319	0.07
	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
	多国籍		
EUR 8,182,400	Natra Foods 0% 13/10/2029	8,788,541	0.06
	英国		
GBP 4,698,138	10x 15% 19/6/2026	5,968,600	0.04
	米国		
USD 2,360,033	Breeze Aviation 20% 30/1/2028	2,454,434	0.02
USD 4,720,066	Breeze Aviation 20% 30/1/2028	4,908,869	0.03
USD 2,090,000	Calpine Escrow 0% 31/12/2049	-	0.00
USD 4,906,275	FLYR 10% 20/1/2027	4,624,164	0.03
USD 10,356,085	FLYR 8% 10/8/2027	12,178,756	0.08
USD 15,563,890	Lessen 0% 5/1/2028	14,261,192	0.09
USD 8,618,829	Level 3 11% 15/11/2029	8,618,829	0.06
AUD 3,169,000	Oceana 12% 31/8/2025	2,067,006	0.01
AUD 4,756,000	Oceana 12.5% 31/8/2026	3,109,900	0.02
AUD 7,927,000	Oceana 12.5% 31/8/2027	5,193,214	0.04
USD 11,585,349	Pioneer Midco 10.5% 18/11/2030	11,455,593	0.08
		68,871,957	0.46
債券合計		94,415,419	0.63
その他の譲渡可能な有価証券合計		380,386,384	2.54
投資有価証券合計		13,776,954,557	92.50
その他の純資産		1,116,625,482	7.50
純資産合計(米ドル)		14,893,580,039	100.00

* 当該有価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 2024年2月29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	7,743,415	USD	11,767,000	Citigroup	14/3/2024	(61,169)
AUD	231,914,490	USD	345,426,975	HSBC Bank	20/3/2024	(6,353,440)
BRL	45,329,413	EUR	248,595,567	UBS	20/3/2024	691,358
BRL	2,672,811	USD	13,253,000	Citigroup	14/3/2024	(10,691)
BRL	20,658,784	USD	102,839,784	Morgan Stanley	20/3/2024	(14,770)
CAD	174,699,066	USD	233,923,326	HSBC Bank	20/3/2024	(1,976,169)
CHF	237,980,281	USD	204,143,055	UBS	20/3/2024	(5,279,710)
CLP	6,895,169	USD	6,100,156,000	Goldman Sachs	14/3/2024	(602,541)
CLP	5,293,949	USD	4,858,054,000	Citigroup	14/3/2024	(282,615)
CNH	61,517,125	USD	435,639,670	UBS	20/3/2024	(988,036)
CNH	57,808,060	USD	416,588,004	Bank of America	20/3/2024	73,933
COP	8,889,794	USD	39,017,305,000	BNP Paribas	17/5/2024	908,502
COP	6,652,041	USD	28,332,704,400	Barclays	15/8/2024	360,054
COP	16,848,714	USD	72,855,525,600	BNP Paribas	15/8/2024	1,182,385
COP	2,760,471	USD	11,221,589,000	Citigroup	14/3/2024	87,507
COP	25,194,374	USD	104,805,000,000	BNP Paribas	23/10/2024	495,621
COP	12,813,069	USD	53,148,609,000	HSBC Bank	24/2/2025	1,562
DKK	54,560,398	USD	368,223,067	HSBC Bank	20/3/2024	(918,658)
EUR	157,225,235	USD	145,823,705	Morgan Stanley	20/3/2024	1,087,407
EUR	21,766,789	USD	19,732,738	UBS	20/3/2024	(344,058)
EUR	27,220,041	NOK	2,388,000	Barclays	14/3/2024	18,363
EUR	4,161,091	GBP	4,793,000	BNP Paribas	14/3/2024	(71,276)
EUR	30,295,711	CHF	32,728,237	Bank of America	20/3/2024	997,447
EUR	30,260,406	CHF	32,615,855	HSBC Bank	20/3/2024	915,683
EUR	776,624	USD	711,538	Morgan Stanley	14/3/2024	(4,339)
EUR	957,818,974	HUF	2,484,000	UBS	14/3/2024	54,320
EUR	77,697,976	USD	72,242,000	Citigroup	20/3/2024	731,124
EUR	5,372,680	USD	4,979,000	Citigroup	14/3/2024	31,404
EUR	43,221,005	USD	40,066,156	Bank of America	20/3/2024	276,580
EUR	101,241	USD	93,528	JP Morgan	14/3/2024	271
GBP	27,485,660	EUR	23,757,912	Barclays	20/3/2024	270,661
GBP	44,191,247	USD	34,969,375	JP Morgan	20/3/2024	128,244
HUF	5,180,421	USD	1,845,525,000	Citigroup	14/3/2024	(90,294)
HUF	8,415,305	USD	3,014,119,269	State Street	14/3/2024	(102,087)
HUF	15,492,979	USD	5,402,290,196	Barclays	20/3/2024	(600,971)
HUF	2,485,000	EUR	968,081,450	UBS	14/3/2024	(27,100)
IDR	2,647,369	USD	40,888,610,000	Citigroup	14/3/2024	(46,449)
IDR	13,772,522	USD	215,471,106,690	Morgan Stanley	20/3/2024	(69,450)
INR	8,535,071	USD	713,660,000	JP Morgan	14/3/2024	68,515
INR	13,772,522	USD	1,143,945,677	Morgan Stanley	20/3/2024	15,125
JPY	87,492,885	EUR	13,494,337,378	Deutsche Bank	21/3/2024	(4,455,913)
JPY	643,987,116	USD	89,960,291,868	BNP Paribas	21/3/2024	(40,439,337)
JPY	2,619,000	USD	392,162,250	UBS	22/3/2024	12,462
KRW	15,348,229	USD	20,055,112,000	Citigroup	14/3/2024	(287,699)
KRW	54,658,573	USD	70,288,191,667	BNP Paribas	20/3/2024	(1,875,880)
MXN	12,416,988	USD	216,981,900	Citigroup	20/3/2024	267,553
MXN	45,163,772	EUR	870,764,841	Citigroup	20/3/2024	1,872,244
MXN	5,273,072	USD	90,391,000	Goldman Sachs	14/3/2024	16,322
MXN	20,658,783	USD	354,156,141	Morgan Stanley	20/3/2024	44,824
MYR	16,069,689	USD	74,748,160	Barclays	14/3/2024	(314,466)
NOK	199,834	EUR	2,353,264	Citigroup	14/3/2024	5,594
NOK	2,188,166	EUR	25,763,168	Barclays	14/3/2024	60,793
NOK	59,080,097	CHF	722,510,865	State Street	20/3/2024	975,579
NOK	4,866,000	EUR	54,769,750	BNP Paribas	14/3/2024	(103,241)

未決済先渡為替予約 2024年2月29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)
NZD	7,627,563	USD	12,293,471	State Street	20/3/2024	(118,595)
PEN	5,394,585	USD	20,521,000	Citigroup	14/3/2024	32,579
PEN	2,732,952	USD	10,500,000	Deutsche Bank	14/3/2024	43,971
PLN	23,583,800	USD	92,653,017	BNP Paribas	20/3/2024	(301,526)
PLN	24,831,134	USD	100,086,428	Goldman Sachs	14/3/2024	321,076
PLN	5,459,207	USD	21,709,000	BNP Paribas	14/3/2024	(3,629)
RON	5,150,409	USD	23,822,000	BNP Paribas	14/3/2024	46,934
SEK	47,916,099	USD	488,820,872	Barclays	20/3/2024	(512,116)
SGD	27,570,219	USD	36,470,550	JP Morgan	20/3/2024	(398,537)
THB	12,970,099	EUR	489,718,513	Citigroup	20/3/2024	(408,305)
THB	30,300,448	USD	1,075,090,200	Barclays	14/3/2024	(299,581)
TRY	3,740,615	USD	145,449,318	Goldman Sachs	4/12/2024	(265,166)
TRY	1,564,315	USD	62,632,682	Barclays	4/12/2024	(67,734)
TWD	50,608,815	USD	1,553,690,613	Morgan Stanley	20/3/2024	(1,432,936)
USD	126,384,567	BRL	24,093,443	Morgan Stanley	2/4/2024	(1,241,426)
USD	62,765,553	BRL	12,222,611	JP Morgan	2/4/2024	(359,282)
USD	2,290,803	EUR	2,481,985	Deutsche Bank	14/3/2024	(4,397)
USD	3,291,897	EUR	3,554,859	Barclays	14/3/2024	(18,086)
USD	4,805,469,000	CLP	5,256,677	Citigroup	14/3/2024	299,586
USD	534,746,540	CZK	23,563,625	Barclays	14/3/2024	653,613
USD	594,871,157	ZAR	30,987,004	State Street	14/3/2024	18,810
USD	342,953,310	MXN	19,402,626	Barclays	14/3/2024	(665,912)
USD	190,455,837	BRL	38,086,719	Goldman Sachs	14/3/2024	(170,003)
USD	13,360,811	PLN	3,312,954	Citigroup	14/3/2024	(44,683)
USD	586,527,896,846	IDR	37,396,531	UBS	14/3/2024	87,553
USD	52,115,218	PLN	12,965,971	HSBC Bank	14/3/2024	(130,838)
USD	1,349,540,081	INR	16,153,432	Citigroup	20/3/2024	(112,185)
USD	199,716,571	BRL	40,254,887	Citigroup	20/3/2024	163,868
USD	214,495,163,808	IDR	13,856,545	BNP Paribas	20/3/2024	215,539
USD	611,655,076	NOK	58,334,218	Deutsche Bank	20/3/2024	496,328
USD	229,465,348	GBP	292,982,804	Deutsche Bank	20/3/2024	2,162,980
USD	230,728,302	AUD	154,907,521	HSBC Bank	20/3/2024	4,243,787
USD	2,537,381,312	MXN	145,203,971	Citigroup	20/3/2024	(3,128,756)
USD	1,028,654,700	HKD	131,917,706	Barclays	20/3/2024	439,076
USD	386,954,063	EUR	426,350,381	UBS	20/3/2024	6,255,993
USD	11,840,000	AUD	8,050,324	Goldman Sachs	14/3/2024	320,418
USD	100,854,000	ZAR	5,341,142	Barclays	14/3/2024	90,818
USD	20,466,708,000	COP	5,202,518	BNP Paribas	14/3/2024	8,181
USD	89,279,000	MXN	5,226,037	Goldman Sachs	14/3/2024	1,713
USD	4,757,279,786	JPY	32,987,985	HSBC Bank	21/3/2024	1,071,174
USD	10,535,453,000	COP	2,613,284	Citigroup	14/3/2024	(60,556)
USD	6,274,920,444	JPY	42,698,588	UBS	21/3/2024	599,855
USD	11,460,749	GBP	14,544,965	JP Morgan	20/3/2024	19,839
USD	10,351,871,245	JPY	70,508,813	Bank of America	21/3/2024	1,057,628
USD	104,805,000,000	COP	26,145,691	BNP Paribas	20/3/2024	(424,911)
USD	172,670,054	CNY	24,374,655	JP Morgan	29/4/2024	49,221
USD	2,499,978,000	CLP	2,670,917	Morgan Stanley	14/3/2024	92,060
USD	12,225,000	EUR	13,301,143	JP Morgan	14/3/2024	32,428
USD	72,088,414	BRL	14,503,252	Morgan Stanley	20/3/2024	32,255
USD	251,351,509	MXN	14,503,252	Bank of America	20/3/2024	(190,501)
USD	35,723,000	PEN	9,381,106	Citigroup	14/3/2024	(66,513)
USD	970,637,000	HUF	2,686,364	UBS	14/3/2024	9,258
USD	384,636,000	THB	10,715,680	Citigroup	14/3/2024	(17,758)
USD	59,730,364	CHF	68,862,614	Morgan Stanley	20/3/2024	776,586

未決済先渡為替予約 2024年2月29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	34,192,741	GBP	43,166,763	Bank of America	20/3/2024	(168,438)
USD	2,594,628,000	CLP	2,677,635	Société Générale	14/3/2024	1,141
USD	39,017,305,000	COP	9,899,728	Société Générale	21/3/2024	9,664
USD	82,089,412	TWD	2,619,000	BNP Paribas	22/3/2024	20,634
USD	70,431,786,000	COP	17,857,279	Citigroup	22/3/2024	7,494
USD	53,148,609,000	COP	13,462,160	HSBC Bank	22/3/2024	(7,486)
USD	4,977,000	EUR	5,401,245	Citigroup	14/3/2024	(669)
ZAR	30,760,986	USD	568,309,215	Citigroup	20/3/2024	(1,190,922)
ZAR	30,630,113	EUR	624,793,045	Deutsche Bank	20/3/2024	(744,390)
ZAR	5,437,120	USD	104,185,000	BNP Paribas	14/3/2024	(13,388)
未実現純評価損						(46,556,087)
豪ドル・ヘッジ投資証券クラス						
AUD	183,148,081	USD	281,267,742	BNY Mellon	15/3/2024	487,243
USD	4,274,315	AUD	2,770,390	BNY Mellon	15/3/2024	(20,240)
未実現純評価益						467,003
スイス・フラン・ヘッジ投資証券クラス						
CHF	31,482,581	USD	27,282,944	BNY Mellon	15/3/2024	(399,736)
USD	748,373	CHF	855,152	BNY Mellon	15/3/2024	2,557
未実現純評価損						(397,179)
オフショア中国人民元ヘッジ投資証券クラス						
CNY	46,921,974	USD	337,807,635	BNY Mellon	15/3/2024	(2,034)
USD	26,035,094	CNY	3,613,602	BNY Mellon	15/3/2024	(2,552)
未実現純評価損						(4,586)
ユーロ・ヘッジ投資証券クラス						
EUR	1,748,028,117	USD	1,622,775,149	BNY Mellon	15/3/2024	13,358,825
USD	37,389,267	EUR	40,239,884	BNY Mellon	15/3/2024	(343,027)
未実現純評価益						13,015,798
英債券・ヘッジ投資証券クラス						
GBP	148,091,192	USD	117,724,026	BNY Mellon	15/3/2024	1,105,032
USD	1,581,689	GBP	1,990,802	BNY Mellon	15/3/2024	(13,732)
未実現純評価益						1,091,300
香港ドル・ヘッジ投資証券クラス						
HKD	18,279,616	USD	142,781,499	BNY Mellon	15/3/2024	(32,684)
USD	6,595,488	HKD	844,068	BNY Mellon	15/3/2024	1,190
未実現純評価損						(31,494)
日本円ヘッジ投資証券クラス						
JPY	21,855,397	USD	3,227,088,797	BNY Mellon	15/3/2024	(225,399)
USD	153,056,008	JPY	1,028,583	BNY Mellon	15/3/2024	2,719
未実現純評価損						(222,680)
ポーランド・ズロチ・ヘッジ投資証券クラス						
PLN	9,425,968	USD	37,981,553	BNY Mellon	15/3/2024	118,872
USD	758,926	PLN	188,137	BNY Mellon	15/3/2024	(2,583)
未実現純評価益						116,289
シンガポール・ドル・ヘッジ投資証券クラス						
SGD	67,275,716	USD	90,387,343	BNY Mellon	15/3/2024	49,988

未決済先渡為替予約 2024年2月29日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	1,353,344	SGD	1,003,230	BNY Mellon	15/3/2024	(4,816)
未実現純評価益						45,172
南アフリカ・ランド・ヘッジ投資証券クラス						
ZAR	4,847	USD	91,877	BNY Mellon	15/3/2024	(65)
未実現純評価損						(65)
未実現純評価損合計						(32,476,529)

未決済上場先物取引 2024年2月29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)
6,909	EUR	Euro BOBL	2024年3月	(17,424,747)
(409)	EUR	Euro Bund	2024年3月	2,417,145
(69)	EUR	Euro BUXL	2024年3月	(151,217)
1,466	EUR	Euro Schatz	2024年3月	(103,383)
107	EUR	Euro-BTP	2024年3月	290,652
642	EUR	Euro-OAT	2024年3月	62,828
1,095	JPY	Nikkei 225 (Ose)	2024年3月	40,860,833
(348)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2024年3月	(1,062,657)
87	CAD	S&P/TSX 60 Index	2024年3月	801,387
39	EUR	Dax Index	2024年3月	856,822
(1,158)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2024年3月	(3,339,847)
1,657	EUR	EURO STOXX Banks Index	2024年3月	220,665
(767)	GBP	FTSE 100 Index	2024年3月	(482,446)
248	USD	MSCI Emerging Markets Index	2024年3月	392,993
(1,400)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2024年3月	(44,928,505)
52	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2024年3月	399,704
2,724	USD	S&P 500 E-Mini Index	2024年3月	43,752,175
(81)	USD	US Long Bond (CBT)	2024年6月	(125,296)
816	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2024年6月	226,434
173	USD	US Ultra 10 Year Note	2024年6月	74,425
(1,934)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2024年6月	(3,859,944)
638	GBP	Long Gilt	2024年6月	(85,933)
4,382	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2024年6月	(427,462)
3,351	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2024年6月	957,948
合計				19,322,574

スワップ 2024年2月29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	(4,492)	1,774
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	(10,959)	(61)
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	(27,481)	(16,818)
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	(13,313)	63,887
CDS	USD 600,000	ファンドはPanama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	20/12/2028	6,353	24,608

スワップ 2024年2月29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 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	(23,032)	(12,572)
CDS	USD (11,067,653)	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	Bank of America	20/12/2027	204,189	222,058
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	(21,387)	88,459
CDS	USD (21,294,306)	ファンドはCDX HY CDS1 S41 5Y 12/20/2028に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2028	712,366	1,370,360
CDS	EUR 54,170,483	ファンドはITRAXX.XO.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	20/12/2028	(373,953)	(4,633,464)
CDS	USD 4,575,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2028	(96,858)	(62,569)
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	(86,860)	26,338
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	(9,755)	36,039
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	(16,197)	52,420
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	(15,710)	18,061
CDS	USD 6,700,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2028	(44,236)	(74,997)
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	(67,658)	16,362
CDS	USD 635,000	ファンドはPanamaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2028	5,417	26,044
CDS	USD 1,665,000	ファンドはPanamaに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2028	(14,228)	68,288
CDS	USD 1,195,000	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	Goldman Sachs	20/12/2028	28,352	84,167
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	(13,357)	63,887
CDS	USD 720,000	ファンドはAmerican Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(17,491)	(23,949)
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	(26,212)	29,943
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	26,103	86,515
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	6,252	18,763
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	5,815	17,449
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	(115,011)	(50,236)
CDS	USD 635,000	ファンドはPanama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	20/12/2028	2,931	26,044
CDS	USD 505,000	ファンドはPanama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	20/12/2028	(5,187)	20,712
CDS	USD 105,000	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	20/12/2028	(4,082)	8,165
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	(286,397)	(113,137)
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	(27,481)	(16,818)
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	(35,829)	(22,469)
CDS	USD 210,000	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	Morgan Stanley	20/12/2028	(8,147)	16,330

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 2024年2月29日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,525,306	ファンドはITRAXX.EUR.40.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2028	(2,091)	(32,848)
CDS	EUR (15,622,112)	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	Barclays	20/12/2027	2,232,892	1,674,367
CDS	USD (15,035,963)	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	BNP Paribas	20/12/2027	1,083,112	1,003,804
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	138,164	138,164
IRS	BRL 19,398,611	ファンドは11.59825%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	93,358	93,358
IRS	BRL 29,524,576	ファンドは11.856321%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	182,791	182,791
IRS	BRL 113,105,027	ファンドは10.001917%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	(227,511)	(227,511)
IRS	COP 49,027,207,093	ファンドは1日 COP-IBR-BANREP の変動金利を受け取り、10.1763%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(8,616)	(8,616)
IRS	BRL 14,985,367	ファンドは11.796128%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	87,704	87,704
IRS	BRL 110,099,446	ファンドは9.986859%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	(232,259)	(232,259)
IRS	MXN 1,019,580,000	ファンドは1ヶ月 MXN-TIIE の変動金利を受け取り、10.95%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	3/12/2024	(17,946)	(17,946)
IRS	MXN 821,469,000	ファンドは1ヶ月 MXN-TIIE の変動金利を受け取り、10.755%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	23/1/2025	11,294	11,294
IRS	PLN 229,590,000	ファンドは5.676%の固定金利を受け取り、3ヶ月 PLN-WIBOR の変動金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2025	(44,711)	(44,711)
IRS	CZK 625,807,000	ファンドは3ヶ月 CZK-PRIBOR の変動金利を受け取り、4.675%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2025	(74,097)	(74,097)
IRS	MXN 536,898,000	ファンドは10.835%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月 MXIBTIIE の変動金利を支払う	Goldman Sachs	25/9/2025	381,364	381,364
IRS	CZK 331,338,000	ファンドは6ヶ月 CZK-PRIBOR の変動金利を受け取り、4.098%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/3/2026	(96,229)	(96,229)
IRS	KRW 24,222,944,552	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	(12,903)	(12,903)
IRS	USD 297,385,900	ファンドは4.2138%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	27/10/2026	1,430,112	1,430,112
IRS	USD 56,662,731	ファンドは3.3%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	23/10/2027	(342,471)	(342,471)
IRS	USD 36,732,424	ファンドは3.9238%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	3/11/2027	188,000	188,000
IRS	USD 36,732,425	ファンドは3.9538%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	3/11/2027	207,581	207,581
IRS	USD 73,464,851	ファンドは3.9848%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	3/11/2027	455,628	455,628
IRS	USD 211,642,342	ファンドは3.485%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	23/1/2028	(475,507)	(475,507)
IRS	USD 187,598,828	ファンドは4%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	26/1/2028	1,284,775	1,284,775
IRS	CLP 13,465,041,000	ファンドはCLP 1日 Sinacofi Chile Interbank Rate の変動金利を受け取り、4.44%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	26/1/2028	99,608	99,608
IRS	USD 187,598,828	ファンドは1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を受け取り、3.45%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	26/1/2028	533,498	533,498
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	1,834,205	1,834,205
IRS	USD 104,682,112	ファンドは4.403%の固定金利を受け取り、1日 USD-SOFR-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	31/10/2028	1,681,528	1,681,528
IRS	GBP 47,089,124	ファンドは4.1238%の固定金利を受け取り、1日 GBP-SONIA-OIS Compound の変動金利を支払う	Goldman Sachs	17/11/2028	118,137	118,137

スワップ 2024年2月29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	GBP 47,178,000	ファンドは4.1289%の固定金利を受け取り、 1日GBP-SONIA-OIS Compoundの変動金利を支払う	Goldman Sachs	21/11/2028	134,790	134,790
IRS	MXN 366,625,000	ファンドは8.67%の固定金利を受け取り、 1ヶ月MXN-TIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	18/1/2029	(63,489)	(63,489)
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	(299,575)	(299,575)
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	(1,393,056)	(1,393,056)
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	328,406	328,406
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	164,580	164,580
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	172,680	172,680
IRS	USD 75,603,000	ファンドは4.01%の固定金利を受け取り、 1日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Goldman Sachs	12/1/2034	944,036	944,036
IRS	USD 11,192,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.249%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	29/9/2043	(656,086)	(649,593)
IRS	USD 41,424,423	ファンドは4.0075%の固定金利を受け取り、 1日USD-SOFR-OIS Compoundの変動金利を支払う	Goldman Sachs	3/11/2053	2,719,909	2,719,909
IRS	USD 41,424,423	ファンドは1日USD-SOFR-OIS Compoundの 変動金利を受け取り、3.658%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	3/11/2053	(142,546)	(142,546)
IRS	BRL 15,645,738	ファンドは11.811176%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	92,893	92,893
IRS	BRL 109,845,909	ファンドは10.062149%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	(177,844)	(177,844)
IRS	BRL 27,514,283	ファンドは11.866354%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	171,898	171,898
IRS	BRL 109,964,132	ファンドは10.027014%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	(203,217)	(203,217)
IRS	BRL 19,443,404	ファンドは11.305635%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	67,342	67,342
IRS	BRL 70,766,000	ファンドは9.785%の固定金利を受け取り、 BRL 1日BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	4/1/2027	(82,433)	(82,433)
TRS	USD 37,973,812	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	Barclays	20/3/2024	13,098	(96,600)
TRS	USD (108,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる 買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リ ターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・ スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオ に係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、 特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した 変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	10/2/2025	(20,369)	(361,002)
TRS	USD (397)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる 買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リ ターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・ スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオ に係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、 特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した 変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	1,694	(183,201)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (1,922)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(6,916)	(138,998)
TRS	USD (166)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	573	(262,829)
TRS	USD (56,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	15,204	(318,006)
TRS	USD (6,400)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	1,037	(123,703)
TRS	USD (819,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	30,387	(1,663,770)
TRS	USD (5,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	(693)	(154,653)
TRS	USD (100,114)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	595,441	(14,663,698)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (2,071)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	64	(254,050)
TRS	USD (1,589)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(17,066)	(219,282)
TRS	USD (20,138)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(10,228)	(1,602,179)
TRS	USD (18,331)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	6,316	(437,825)
TRS	USD (62,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	22,221	(893,111)
TRS	USD (6,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	6,308	(198,755)
TRS	USD (1,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	3,677	(147,029)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (258,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	(126,172)	(4,048,265)
TRS	USD (46,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	(43,225)	(1,861,556)
TRS	USD (11,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	(18,866)	(353,970)
TRS	USD (20,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	1/5/2024	(1,030)	(1,157,949)
TRS	USD (26,508)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/5/2024	81,343	(7,776,122)
TRS	USD (41,647)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/5/2024	(189,494)	(13,955,910)
TRS	USD (62,160)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/5/2024	2,486	(4,868,371)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (57,461)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (12,728)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	31/5/2024	8,535	(1,406,681)
TRS	USD (5,209)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	25/6/2024	75,578	(3,837,708)
TRS	USD (67,442)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	11/9/2024	(477)	(562,582)
TRS	USD (5,705)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	11/9/2024	(139,676)	(4,264,608)
TRS	USD (24,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	11/9/2024	3,408	(170,991)
TRS	USD (20,627,467)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	11/9/2024	(14,775)	(444,350)
			Citibank	11/9/2024	71,371	(6,277,248)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (22,116)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (3,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	11/9/2024	48,350	(16,155,740)
TRS	USD (1,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	10/2/2025	4,901	(171,036)
TRS	USD (3,622)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(2,636)	(328,291)
TRS	USD (234,067)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(6,774)	(516,810)
TRS	USD (7,590)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	53,950	(1,719,679)
TRS	USD (80,706)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	3,824	(201,249)
			Citibank	24/2/2025	(45,607)	(1,256,020)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (160,085)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (16,767)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	15,702	(1,005,913)
TRS	USD (134,991)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	15,569	(399,721)
TRS	USD (6,063)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	20,928	(2,711,033)
TRS	USD (1,490)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	45,711	(963,071)
TRS	USD (13,282)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(24,751)	(574,343)
TRS	USD (86,364)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	8,483	(361,702)
TRS	USD (86,364)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	33,350	(2,440,791)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (102,682)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(21,836)	(573,976)
TRS	USD (29,974)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	3,785	(321,221)
TRS	USD (51,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(84,959)	(1,510,827)
TRS	USD (52,140)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	123,669	(4,064,321)
TRS	USD (36,399)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	65,216	(239,213)
TRS	USD (52,796)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(41,641)	(2,454,381)
TRS	USD (880,567)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(417)	(3,114,847)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (11,471)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (20,580)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(40,509)	(1,874,308)
TRS	USD (1,814)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	72,419	(1,911,214)
TRS	USD (10,088)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(9,593)	(289,897)
TRS	USD (5,260)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	8,868	(399,227)
TRS	USD (360)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	558	(63,208)
TRS	USD (11,175)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(10,749)	(517,563)
			Citibank	24/2/2025	10,506	(1,810,355)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (12,028)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (723,571)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	5,440	(555,374)
TRS	USD (35,192)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(91,132)	(3,073,146)
TRS	USD (24,553)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	816	(197,055)
TRS	USD (33,402)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(27,335)	(737,595)
TRS	USD (76,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2025	(7,881)	(471,627)
TRS	USD (270,879)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	4,141	(213,131)
			Citibank	26/2/2025	13,306	(209,723)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (469,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (67,436)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	43,701	(698,217)
TRS	USD (6,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	239,467	(2,699,263)
TRS	USD (725,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	(900)	(30,088)
TRS	USD (228,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	53,304	(3,325,765)
TRS	USD (9,859)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	5,625	(492,290)
TRS	USD (100,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	(80,123)	(2,347,028)
TRS	USD (100,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	6,132	(552,049)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (3,078,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (45,709)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	100,057	(2,406,685)
TRS	USD (1,662,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	7,183	(267,532)
TRS	USD (70,134)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	37,405	(1,840,981)
TRS	USD (26,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	26/2/2025	(5,307)	(56,391)
TRS	USD (22,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	7,696	(354,628)
TRS	USD (167,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	135,670	(5,872,056)
			Citibank	27/2/2025	214,570	(2,769,835)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (33,600)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (26,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	8,112	(431,126)
TRS	USD (23,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	11,761	(1,252,104)
TRS	USD (3,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	3,016	(382,861)
TRS	USD (13,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	(6,437)	(244,914)
TRS	USD (10,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	(84)	(305,053)
TRS	USD (34,600)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	1,840	(480,577)
TRS	USD (34,600)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	12,237	(1,520,389)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (11,900)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (10,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	(8,173)	(463,995)
TRS	USD (19,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	1,628	(67,901)
TRS	USD (429,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	3,100	(275,527)
TRS	USD (54,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	(57,546)	(2,324,336)
TRS	USD (4,400)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	118,136	(1,996,412)
TRS	USD (83,854)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	27/2/2025	5,892	(112,973)
			Citibank	24/2/2028	4,456	(9,343,013)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (18,487)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (203,416)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(11,277)	(2,364,487)
TRS	USD (175,870)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	111,276	(3,212,607)
TRS	USD (50,820)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	58,758	(5,682,360)
TRS	USD (35,647)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	80,645	(3,791,172)
TRS	USD (18,705)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(191,207)	(4,582,065)
TRS	USD (10,046)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(135,050)	(2,670,513)
			Citibank	24/2/2028	(27,827)	(191,979)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (41,880)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (5,093)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	103,025	(4,242,444)
TRS	USD (9,402)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(8,967)	(370,312)
TRS	USD (25,387)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(846)	(937,661)
TRS	USD (17,755)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(107,895)	(2,201,561)
TRS	USD (1,527)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	29,296	(3,650,250)
TRS	USD (8,913)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(14,873)	(391,889)
			Citibank	24/2/2028	(50,537)	(693,164)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (29,935)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(36,521)	(2,243,329)
TRS	USD (355,697)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(152,950)	(12,332,015)
TRS	USD (19,768)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(23,722)	(1,916,903)
TRS	USD 57	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(11,727)	91,898
TRS	USD (4,331)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(21,179)	(473,205)
TRS	USD (25,022)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(65,057)	(3,949,973)
TRS	USD (89,786)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベースス・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(116,722)	(13,543,320)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (3,131)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (6,223)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	1,284	(306,055)
TRS	USD (1,102,956)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(10,905)	(479,226)
TRS	USD (100,898)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	2,722	(1,044,061)
TRS	USD (240,819)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(117,042)	(5,178,085)
TRS	USD (28,339)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	48,164	(5,189,649)
TRS	USD (130,376)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(273,471)	(2,404,848)
			Citibank	24/2/2028	40,251	(4,825,216)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (841)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(2,817)	(331,203)
TRS	USD (24,468)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(90,287)	(3,522,658)
TRS	USD (9,345)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(88,871)	(2,242,987)
TRS	USD (6,835)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(7,313)	(477,972)
TRS	USD (1,230)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	1,262	(349,209)
TRS	USD (10,622)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(139,679)	(2,685,879)
TRS	USD (134,099)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(302,729)	(7,776,401)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (174,749)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (7,806)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	47,182	(3,722,154)
TRS	USD (75,257)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	15,924	(1,017,980)
TRS	USD (2,927)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(215,235)	(4,119,568)
TRS	USD (1,202)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	117	(191,397)
TRS	USD (14,874)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	6,347	(277,362)
TRS	USD (5,239)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(5,503)	(1,866,241)
TRS	USD (5,239)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	11,421	(1,285,546)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (1,137)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (1,417)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(4,741)	(257,349)
TRS	USD (136,871)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	227	(185,570)
TRS	USD (80,739)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(567,330)	(12,562,705)
TRS	USD (3,286)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(23,039)	(1,251,454)
TRS	USD (105,254)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(6,401)	(360,047)
TRS	USD (6,931)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	116,686	(4,696,862)
TRS	USD (6,931)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	857	(266,669)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (689,199)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>				
TRS	USD (8,037)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて0から147ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(15,066)	(514,162)
TRS	USD (2,399)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	Citibank	24/2/2028	(778)	(330,759)
TRS	USD (33,090)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	1,172	(25,085)
TRS	USD (56,911)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	8/2/2024	(58,073)	(643,104)
TRS	USD (40,418)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	8/2/2024	(10,813)	(984,560)
TRS	USD (11,673)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	8/2/2024	3,140	(613,545)
			JP Morgan	8/2/2024	(11,323)	(498,087)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (23,460)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	8/2/2024	(16,657)	(790,837)
TRS	USD (84,448)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	8/2/2024	(220)	(302,389)
TRS	USD (134,301)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(40,123)	(270,330)
TRS	USD (41,474)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(500,912)	(3,319,902)
TRS	USD (609,625)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	12,832	(369,094)
TRS	USD (144,668)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(18,489)	(116,320)
TRS	USD (1,245,237)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	111,793	(4,734,555)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (274,800)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	481,634	(3,748,149)
TRS	USD (232,697)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(1,402,032)	(10,103,361)
TRS	USD (5,396)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	11,987	(364,726)
TRS	USD (5,736,538)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(97,335)	(1,745,715)
TRS	USD (82,422)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(754,705)	(11,940,475)
TRS	USD (14,617)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(369,715)	(3,479,715)
TRS	USD (2,100,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	41,133	(780,748)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (942,400)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(70,600)	(1,591,717)
TRS	USD (13,427,388)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(671,880)	(10,017,221)
TRS	USD (755,250)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(62,456)	(1,200,357)
TRS	USD (88,197)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(530,064)	(9,636,404)
TRS	USD (10,419)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(109,295)	(2,404,184)
TRS	USD (85,957)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(415,214)	(4,182,668)
TRS	USD (420,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	211,835	(5,992,533)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (668,944)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(65,121)	(7,129,305)
TRS	USD (325,908)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	51,301	(2,107,163)
TRS	USD (17,159)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(1,284)	(448,433)
TRS	USD (219,162)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(30,066)	(3,454,785)
TRS	USD (99,277)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(154,905)	(2,293,055)
TRS	USD (38,485)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(1,457,427)	(9,876,790)
TRS	USD (9,766)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(4,102)	(989,296)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (4,081)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(15,657)	(612,232)
TRS	USD (9,949)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(4,179)	(964,755)
TRS	USD (25,087)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(231,051)	(1,951,016)
TRS	USD (18,800)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	18,670	(223,327)
TRS	USD (7,909)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(32,408)	(343,697)
TRS	USD (22,038)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(2,835)	(636,420)
TRS	USD (2,804)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	1,804	(112,236)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (14,613)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	16,367	(876,780)
TRS	USD (36,645)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(979)	(561,768)
TRS	USD (22,530)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(35,147)	(1,027,368)
TRS	USD (3,730)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(26,595)	(406,160)
TRS	USD (9,485)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(8,537)	(426,825)
TRS	USD (26,350)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(22,134)	(990,233)
TRS	USD (3,983)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(836)	(17,246)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (4,375)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	10,452	(342,650)
TRS	USD (180,045)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(4,501)	(1,488,972)
TRS	USD (20,669)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	43,612	(255,676)
TRS	USD (20,693)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	621	(575,472)
TRS	USD (57)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	6,874	(91,898)
TRS	USD (254)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(3,747)	(47,396)
TRS	USD (2,636)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(30,736)	(338,831)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (27,943)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	13,971	(1,232,007)
TRS	USD (71,564)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	98,758	(196,801)
TRS	USD (6,190)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(45,311)	(977,153)
TRS	USD (33,901)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(32,375)	(808,200)
TRS	USD (398,117)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(258,541)	(6,718,310)
TRS	USD (37,400)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	21,462	(1,585,205)
TRS	USD (55,957)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	37,585	(233,886)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (25,807)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(16,269)	(257,065)
TRS	USD (1,712,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(240,515)	(2,344,755)
TRS	USD (132,799)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(80,300)	(1,423,161)
TRS	USD (35,952)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(19,116)	(387,605)
TRS	USD (20,388)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(345,751)	(7,858,868)
TRS	USD (29,435)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	22,097	(459,425)
TRS	USD (11,311)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	3,026	(2,184,294)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (60,800)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(104,211)	(2,806,935)
TRS	USD (147,493)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(43,021)	(2,098,601)
TRS	USD (1,513,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(26,438)	(605,038)
TRS	USD (133,620)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	9,897	(214,711)
TRS	USD (13,316)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(10,399)	(335,250)
TRS	USD (13,036)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	17,082	(257,668)
TRS	USD (4,399)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	724	(338,762)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (595,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(42,948)	(1,100,740)
TRS	USD (28,871)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(222,623)	(8,021,610)
TRS	USD (17,572)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(217,190)	(3,783,779)
TRS	USD (9,098)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(17,650)	(1,372,342)
TRS	USD 1	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	2	15
TRS	USD (6,392)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	109,510	(2,071,304)
TRS	USD (204,900)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(125,286)	(5,260,937)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (28,453)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	17,786	(626,820)
TRS	USD (18,239)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	10,943	(331,585)
TRS	USD (13,132)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	2,101	(451,084)
TRS	USD (48,151)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	12,583	(566,737)
TRS	USD (46,692)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(31,284)	(773,220)
TRS	USD (15,321)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(14,861)	(446,454)
TRS	USD (10,140)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(44,008)	(854,092)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (6,831)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(16,326)	(373,929)
TRS	USD 26,294	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	13,520	632,897
TRS	USD (429,758)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(356,636)	(6,979,270)
TRS	USD (27,945)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	28,783	(6,945,730)
TRS	USD 4,066	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	17,118	221,719
TRS	USD (1,621)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	470	(30,799)
TRS	USD (330,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(19,442)	(365,538)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (56,036)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	7,590	(328,026)
TRS	USD (8,900)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(1,663)	(257,114)
TRS	USD (345,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	169,428	(3,417,489)
TRS	USD (26,700)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(14,428)	(559,598)
TRS	USD (1,406)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(7,577)	(229,734)
TRS	USD (80,313)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(450,463)	(8,673,957)
TRS	USD (129,777)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(6,711)	(1,832,415)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (31,900)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	18,292	(1,828,642)
TRS	USD (32,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	1,019	(25,008)
TRS	USD (44,100)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(90,276)	(2,107,548)
TRS	USD (1,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	288	(19,550)
TRS	USD (32,300)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	49,359	(1,782,084)
TRS	USD (14,000)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(1,615)	(30,228)
TRS	USD (1,864)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	1,028	(10,437)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (17,809)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(36,664)	(346,677)
TRS	USD (21,318)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(45,220)	(244,966)
TRS	USD 331,912	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	247,505	5,920,836
TRS	USD (53,576)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	10,929	(296,486)
TRS	USD (900)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(6,053)	(27,702)
TRS	USD (170,200)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(45,989)	(780,644)
TRS	USD (82,800)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	26/2/2025	(31,851)	(415,211)

スワップ 2024年2月29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)
TRS	USD (1,973,500)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	27/2/2025	(2,519,718)	(10,811,893)
TRS	USD (26,400)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	27/2/2025	(31,537)	(709,938)
TRS	USD (2,830)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2028	17,603	(369,060)
TRS	USD (151,403)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(19,473)	(461,546)
TRS	USD (97,287)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	38,337	(1,536,481)
TRS	USD 24,852	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	12,247	671,998
TRS	USD (9,932)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(68,075)	(3,919,233)

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 2024年2月29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)
TRS	USD (43,774)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	(782)	(432,268)
TRS	USD (4,424)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	10/2/2025	1,170	(186,525)
TRS	USD (106,315)	ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる買建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを受け取る。ファンドは、トータル・リターン・スワップの基礎となる売建ポジションのポートフォリオに係るトータル・リターンを支払う。さらにファンドは、特定のベンチマークに基づいて15から184ベース・ポイントの範囲内のスプレッドを加算または減算した変動金利を支払うまたは受け取る。>	JP Morgan	24/2/2028	(14,036)	(6,951,938)
TRS	USD 120,161	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 75bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2024	(1,065,352)	(1,065,352)
TRS	USD 39,900,617	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2024	837,470	747,086
TRS	USD 37,857,307	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2024	82,147	(27,215)
TRS	USD 7,161,861	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	9,000	(11,690)
TRS	USD 18,480,000	ファンドはUSD SOFR 1D Overnight + 0bpsを受け取り、iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2024	411,429	470,351
TRS	USD 3,887	ファンドはSPXEWTR + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 47bpsを支払う	BNP Paribas	15/3/2024	1,641,917	1,641,917
TRS	USD 1,281	ファンドはSPXEWTR + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 52bpsを支払う	BNP Paribas	15/3/2024	488,673	488,673
TRS	USD 1,279	ファンドはSPXEWTR + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 58bpsを支払う	BNP Paribas	15/3/2024	368,273	368,273
TRS	USD 4,389,364	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/3/2024	87,825	77,882
TRS	USD 47,136,554	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/3/2024	131,026	(5,141)
TRS	USD 20,782,444	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを受け取り、USD SOFR 1D Overnight + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/3/2024	(67,839)	(107,620)
合計					<u>3,071,111</u>	<u>(529,803,005)</u>

> 当該ベンチマークおよびスプレッドは、基礎となる各ポジションの国および/または通貨に基づいて決定される。変動金利の決定に使用される特定のベンチマークは、以下の通りである。

インターコンチネンタル取引所LIBOR:

スワップ 2024年2月29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)
		米ドル-1日翌日物銀行調達金利 (OBFR01)				

- * 当該有価証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

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 2024年2月29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)
606,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.054	27/3/2024	(42,561)	23,973
31,898,946	プット	OTC EUR/MXN	Deutsche Bank	EUR 18.3	9/5/2024	(66,537)	155,106
2,821,550	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 1.02	13/3/2024	(279,598)	2
98,963,955	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank	USD 143	14/3/2024	(1,128,006)	5,923
197,019,751	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.07	18/3/2024	(513,268)	220,584
184,072,844	コール	OTC USD/CNH	Morgan Stanley	USD 7.7	7/3/2024	(317,526)	-
12,668	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 500	1/3/2024	7,303,202	10,881,812
9,405	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 512	1/3/2024	(1,553,486)	409,118
9,405	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 514	1/3/2024	(1,500,635)	155,183
2,319	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 505	1/3/2024	237,551	940,354
3,927	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 110.25	1/3/2024	(1,696,927)	276,115
774	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 185	15/3/2024	124,342	458,595
1,552	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 190	15/3/2024	(789,289)	632,440
2,323	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 160	15/3/2024	(937,857)	8,131
3,104	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 175	15/3/2024	(184,151)	1,125,200
1,552	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 180	15/3/2024	(171,072)	257,632
3,432	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 210	15/3/2024	(1,164,227)	576,576
622	コール	Autodesk	Exchange Traded	USD 280	15/3/2024	(222,195)	177,270
623	コール	Chubb	Exchange Traded	USD 250	15/3/2024	1,621	267,890
430	コール	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 730	15/3/2024	559,117	1,243,775
1,479	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 7.82	15/3/2024	(23,181)	1,479
916	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 8.82	15/3/2024	(26,765)	1,832
236	コール	Lam Research	Exchange Traded	USD 800	15/3/2024	2,268,143	3,149,420
620	コール	Mastercard	Exchange Traded	USD 475	15/3/2024	20,394	396,800
1,536	プット	Merck	Exchange Traded	USD 125	15/3/2024	31,023	141,312
837	コール	Meta Platforms	Exchange Traded	USD 500	15/3/2024	132,056	623,565
386	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 410	15/3/2024	80,882	260,550
997	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 420	15/3/2024	(364,855)	280,656
2,317	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 430	15/3/2024	(926,021)	231,700
554	コール	Nice	Exchange Traded	USD 250	15/3/2024	(233,914)	216,060
773	コール	Novo Nordisk	Exchange Traded	USD 125	15/3/2024	(45,849)	96,239
347	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 730	15/3/2024	1,226,740	2,452,422
773	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 725	15/3/2024	2,806,201	5,795,567
1,395	コール	Oracle	Exchange Traded	USD 120	15/3/2024	(234,676)	214,830
570	コール	Paramount Global	Exchange Traded	USD 17.5	15/3/2024	(24,924)	2,565
689	コール	Paramount Global	Exchange Traded	USD 22.5	15/3/2024	(26,066)	1,723
624	コール	Salesforce	Exchange Traded	USD 290	15/3/2024	438,343	890,760
233	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 475	15/3/2024	(40,886)	7,107
3,592	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 180	15/3/2024	(2,987,483)	285,564
409	コール	UnitedHealth	Exchange Traded	USD 520	15/3/2024	(278,648)	72,189
1,544	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 115	15/3/2024	(154,750)	146,680
1,271	コール	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 20	20/3/2024	(44,773)	31,775
1,274	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 18	20/3/2024	(27,023)	42,042
98	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 105.25	22/3/2024	(11,253)	5,742
1,856	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 185	19/4/2024	(18,053)	580,000
2,325	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 180	19/4/2024	(69,115)	1,110,187
2,310	コール	AstraZeneca	Exchange Traded	USD 67.5	19/4/2024	(134,701)	247,170
2,097	コール	Bayerische Motoren Werke	Exchange Traded	EUR 110	19/4/2024	139,385	879,324
217	コール	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 735	19/4/2024	582,704	758,958
173	コール	Deckers Outdoor	Exchange Traded	USD 860	19/4/2024	494,481	973,990
70	コール	Deckers Outdoor	Exchange Traded	USD 900	19/4/2024	(35,166)	242,550
4,853	コール	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 45	19/4/2024	(32,645)	521,698
3,118	コール	Exxon Mobil	Exchange Traded	USD 105	19/4/2024	184,094	1,106,890
4,257	コール	JPMorgan Chase	Exchange Traded	USD 190	19/4/2024	(30,509)	1,394,167

買建オプション 2024年2月29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)
3,332	コール	Mercedes-Benz	Exchange Traded	EUR 75	19/4/2024	159,679	690,461
1,936	コール	Merck	Exchange Traded	USD 125	19/4/2024	461,821	924,440
2,780	コール	Merck	Exchange Traded	USD 130	19/4/2024	(259,171)	594,920
463	コール	Meta Platforms	Exchange Traded	USD 495	19/4/2024	114,798	917,897
765	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 95	19/4/2024	(92,356)	260,100
386	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 425	19/4/2024	66,009	254,760
709	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 440	19/4/2024	(263,356)	204,901
626	コール	Norfolk Southern	Exchange Traded	USD 270	19/4/2024	(156,329)	195,625
699	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 685	19/4/2024	6,088,900	8,662,357
693	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 820	19/4/2024	(1,122,471)	2,732,152
691	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 840	19/4/2024	(485,239)	2,218,110
1,652	コール	PNC Financial Services	Exchange Traded	USD 160	19/4/2024	(190,757)	322,140
11,487	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 485	19/4/2024	(464,335)	2,561,601
831	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 170	19/4/2024	(699,019)	222,293
6,973	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 80	19/4/2024	19,337	2,510,280
556	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 110	19/4/2024	126,142	303,020
4,344	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 115	19/4/2024	149,751	1,259,760
13,796	コール	Wells Fargo	Exchange Traded	USD 57.5	19/4/2024	(85,906)	1,765,888
2,307	コール	Amazon.com	Exchange Traded	USD 190	17/5/2024	110,213	1,141,965
1,600	プット	Dax Index	Exchange Traded	EUR 17,300	17/5/2024	(257,178)	1,473,332
766	コール	Dexcom	Exchange Traded	USD 120	17/5/2024	(119,760)	494,070
555	コール	DR Horton	Exchange Traded	USD 155	17/5/2024	110,404	338,550
966	コール	DR Horton	Exchange Traded	USD 165	17/5/2024	(389,575)	299,460
232	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 760	17/5/2024	5,863	912,340
416	コール	Shell	Exchange Traded	GBP 2,625	17/5/2024	(101,398)	168,696
637	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 190	17/5/2024	(86,407)	678,405
4,182	コール	UBS	Exchange Traded	USD 32.5	17/5/2024	(302,038)	100,368
539	コール	Meta Platforms	Exchange Traded	USD 500	21/6/2024	795,515	2,033,377
1,544	コール	Novo Nordisk	Exchange Traded	USD 130	21/6/2024	(30,653)	656,200
1,355	コール	Sabre	Exchange Traded	USD 4.5	19/7/2024	(7,780)	18,970
3,848	コール	Apple	Exchange Traded	USD 220	16/8/2024	(231,258)	509,860
						3,155,134	76,405,490

合計

売建オプション 2024年2月29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)
(98,963,955)	プット	OTC USD/JPY	HSBC Bank	USD 137	14/3/2024	248,399	-
(12,668)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 508	1/3/2024	(1,493,848)	(2,451,258)
(3,927)	プット	US Treasury 6-7 Year Note	Exchange Traded	USD 109	1/3/2024	542,692	-
(569)	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 180	15/3/2024	(149,899)	(473,692)
(2,660)	コール	Applied Materials	Exchange Traded	USD 230	15/3/2024	323,914	(45,220)
(622)	プット	Autodesk	Exchange Traded	USD 230	15/3/2024	18,829	(104,185)
(430)	コール	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 780	15/3/2024	(136,409)	(277,350)
(837)	コール	Meta Platforms	Exchange Traded	USD 540	15/3/2024	40,822	(82,026)
(554)	コール	Nice	Exchange Traded	USD 270	15/3/2024	36,161	(40,165)
(231)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 750	15/3/2024	(1,063,693)	(1,252,597)
(570)	コール	Paramount Global	Exchange Traded	USD 25	15/3/2024	2,151	(1,140)
(233)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 450	15/3/2024	12,471	(3,612)
(3,592)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 160	15/3/2024	1,145,954	(37,716)
(2,545)	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 35	20/3/2024	15,317	(19,088)
(1,856)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 155	19/4/2024	69,177	(171,680)
(2,310)	プット	AstraZeneca	Exchange Traded	USD 60	19/4/2024	(23,534)	(91,245)
(2,097)	プット	Bayerische Motoren Werke	Exchange Traded	EUR 100	19/4/2024	73,962	(178,595)
(173)	プット	Deckers Outdoor	Exchange Traded	USD 770	19/4/2024	130,230	(90,825)
(70)	プット	Deckers Outdoor	Exchange Traded	USD 800	19/4/2024	(2,480)	(51,800)
(4,853)	プット	Delta Air Lines	Exchange Traded	USD 37	19/4/2024	54,707	(167,429)
(766)	プット	Dexcom	Exchange Traded	USD 105	19/4/2024	(37,754)	(174,265)
(128)	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 700	19/4/2024	(574,687)	(820,800)
(3,118)	コール	Exxon Mobil	Exchange Traded	USD 115	19/4/2024	(9,316)	(168,372)
(3,118)	プット	Exxon Mobil	Exchange Traded	USD 95	19/4/2024	197,310	(149,664)
(833)	プット	Mercedes-Benz	Exchange Traded	EUR 65	19/4/2024	6,261	(22,142)
(2,780)	コール	Merck	Exchange Traded	USD 135	19/4/2024	118,907	(219,620)
(1,531)	コール	Micron Technology	Exchange Traded	USD 105	19/4/2024	81,559	(204,389)
(626)	プット	Norfolk Southern	Exchange Traded	USD 240	19/4/2024	7,056	(148,675)
(919)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 980	19/4/2024	326,488	(654,787)
(699)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 800	19/4/2024	(2,626,308)	(3,362,190)
(616)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 850	19/4/2024	(253,895)	(1,780,240)
(924)	コール	NVIDIA	Exchange Traded	USD 920	19/4/2024	919,615	(1,249,710)
(1,652)	プット	PNC Financial Services	Exchange Traded	USD 130	19/4/2024	57,742	(185,850)
(11,487)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 475	19/4/2024	238,361	(1,700,076)
(831)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 145	19/4/2024	256,172	(50,691)
(6,973)	コール	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 95	19/4/2024	(47,815)	(282,406)
(556)	プット	Walt Disney	Exchange Traded	USD 100	19/4/2024	29,842	(27,800)
(3,449)	プット	Wells Fargo	Exchange Traded	USD 50	19/4/2024	(784)	(134,511)
(1,844)	プット	Amazon.com	Exchange Traded	USD 150	17/5/2024	95,466	(330,076)
(1,600)	プット	Dax Index	Exchange Traded	EUR 16,300	17/5/2024	47,485	(553,313)
(766)	コール	Dexcom	Exchange Traded	USD 135	17/5/2024	44,506	(183,840)
(555)	プット	DR Horton	Exchange Traded	USD 125	17/5/2024	51,240	(95,738)
(966)	プット	DR Horton	Exchange Traded	USD 135	17/5/2024	(85,248)	(338,100)
(232)	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 840	17/5/2024	9,921	(335,240)
(155)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 650	17/5/2024	42,998	(127,875)
(416)	プット	Shell	Exchange Traded	GBP 2,250	17/5/2024	26,107	(104,117)
(637)	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 240	17/5/2024	(36,569)	(406,087)
(4,182)	プット	UBS	Exchange Traded	USD 25	17/5/2024	114,944	(115,005)
(539)	プット	Meta Platforms	Exchange Traded	USD 370	21/6/2024	105,665	(258,720)
(1,544)	プット	Novo Nordisk	Exchange Traded	USD 100	21/6/2024	(4,122)	(202,264)
合計						(1,054,380)	(19,926,186)

買建スワップション 2024年2月29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)
EUR 121,695,862	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を5/9/2024から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を5/3/2025より半年毎に支払う。	JP Morgan	1/3/2024	(712,137)	1,129,206
USD 12,050,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	20/3/2024	(26,376)	1,658
USD 17,330,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	20/3/2024	(48,227)	2,385
USD 197,462,595	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を27/1/2026から毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を27/1/2026より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/1/2025	(458,836)	2,271,981
EUR 68,708,445	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.EUR.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Deutsche Bank	20/3/2024	(98,397)	15,471
EUR 59,621,343	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.EUR.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Deutsche Bank	20/3/2024	(82,731)	22,274
USD 12,905,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	20/3/2024	(45,271)	4,555
EUR 12,870,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	20/3/2024	(31,776)	3,644
EUR 15,269,840	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/6/2024	(84,941)	72,060
EUR 45,809,521	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.EUR.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/6/2024	(58,433)	69,476

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

買建スワップション 2024年2月29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)
EUR 16,375,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.40.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	20/3/2024	(50,237)	6,023
USD 16,215,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	20/3/2024	(29,624)	16,528
USD 13,315,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	20/3/2024	(28,610)	13,572
USD 15,955,000	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.41.V2の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	20/3/2024	(9,799)	16,263
USD 115,765,000	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.IG.41.V1の変動金利を20/12/2028より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Exchange Traded	20/3/2024	(10,676)	50,101
合計				(1,776,071)	3,695,197

売建スワップション 2024年2月29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)
EUR (121,695,862)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR EURIBORの変動金利を5/3/2025より半年毎に受け取り、2.5%の固定金利を5/9/2024より毎年支払う。	JP Morgan	1/3/2024	724,517	-
EUR (68,708,445)	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1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.40.V1の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	20/3/2024	33,204	(5,002)
EUR (59,621,343)	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1%の固定金利を受け取り、ITRAXX.EUR.40.V1の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	20/3/2024	25,759	(4,706)
USD (12,905,000)	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5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.41.V2の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/3/2024	7,432	(1,511)
EUR (16,375,000)	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5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.40.V1の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	20/3/2024	14,120	(3,887)
USD (16,215,000)	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5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.41.V2の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Goldman Sachs	20/3/2024	1,680	(2,012)
USD (13,315,000)	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5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.41.V2の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	JP Morgan	20/3/2024	1,248	(1,652)
USD (15,955,000)	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5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY.41.V2の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	BNP Paribas	20/3/2024	1,843	(2,896)
USD (115,765,000)	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1%の固定金利を受け取り、CDX.NA.IG.41.V1の変動金利を20/12/2023より四半期毎に支払う。	Exchange Traded	20/3/2024	11,241	(336)
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29/3/2025から半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を29/3/2025より毎年支払う。	JP Morgan	27/3/2024	(210,256)	(3,113,469)

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

売建スワップション 2024年2月29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)
EUR (137,746,811)	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2.9%の固定金利を30/4/2025から毎年受け取り、EUR EURIBORの変動金利を31/10/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	26/4/2024	(208,615)	(601,175)
USD (197,462,595)	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27/1/2026より毎年受け取り、2.25%の固定金利を27/1/2026から毎年支払う。	Goldman Sachs	23/1/2025	176,452	(625,263)
合計				578,625	(4,361,909)

SPACに対するPIPEコミットメント 2024年2月29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	-

事後通告証券契約 2024年2月29日現在

保有高	摘要	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国		
USD 136,074,276	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	121,297,698	0.81
USD 20,900,000	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	18,643,490	0.13
T B A 合計		139,941,188	0.94

<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：2023年9月1日～2024年2月29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、入手可能な最新のデータである半期末時点(2024年2月29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。

2023年9月1日から2024年2月29日までの会計期間(未監査)

	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	1,618,122,578
収益	
現金および現金同等物に係る利息	652,000
債券利息、源泉徴収税控除後	35,515,161
スワップ利息	145,253
短期金融商品預け入れによる利息	941,687
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	-
配当金、源泉徴収税控除後	-
有価証券貸付による収益	94,381
投資運用報酬リベート	-
その他の払戻し	96
収益合計	37,348,578
費用	
スワップ利息	170,030
年間サービス費用	529,757
ローン・コミットメント・フィー	5,168
保管および預託報酬	(42,852)
販売報酬	317,755
税金	333,464
投資運用報酬	4,171,069
費用合計	5,484,391
純利益	31,864,187
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(8,097,613)
事後通告証券契約	(84,028)
上場先物取引	(488,014)
オプション／スワップション契約	-
スワップ取引	(12,822)
先渡為替予約	(6,745,754)
その他の取引に係る外国通貨	622,581
当期実現純評価益／(損)	(14,805,650)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	22,790,526
事後通告証券契約	8,679
上場先物取引	900,225
オプション／スワップション契約	-
スワップ取引	118,228
先渡為替予約	4,061,226
その他の取引に係る外国通貨	(53,282)
当期未実現評価益／(損)の純変動	27,825,602
運用成績による純資産の増加	44,884,139
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	310,448,110
投資証券買戻しによる正味支払額	(354,047,464)
資本の変動による純資産の減少	(43,599,354)
配当金宣言額	(2,970,145)
期末純資産	1,616,437,218

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 2024年2月29日現在(未監査)

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 5,000	Mineral Resources 9.25% 1/10/2028	5,253	0.00
USD 5,165,000	Westpac Banking 4.184% 22/5/2028*	5,030,730	0.31
		<u>5,035,983</u>	<u>0.31</u>
バミューダ			
USD 12,000	NCL 8.125% 15/1/2029	12,646	0.00
USD 15,000	NCL 8.375% 1/2/2028	15,713	0.00
USD 79,000	Valaris 8.375% 30/4/2030	81,328	0.01
USD 8,000	Viking Ocean Cruises Ship VII 5.625% 15/2/2029	7,727	0.00
USD 15,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	15,306	0.00
USD 42,000	Weatherford International 8.625% 30/4/2030	43,537	0.00
		<u>176,257</u>	<u>0.01</u>
カナダ			
USD 4,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	3,725	0.00
USD 2,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4% 15/10/2030	1,759	0.00
USD 125,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	117,327	0.01
USD 87,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	82,542	0.01
USD 215,000	Bank of Montreal 5.2% 12/12/2024	214,458	0.01
USD 181,000	Bausch + Lomb 8.375% 1/10/2028	189,239	0.01
USD 23,000	Baytex Energy 8.5% 30/4/2030	23,918	0.00
USD 94,000	Bombardier 6% 15/2/2028	91,122	0.00
USD 114,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	114,877	0.01
USD 21,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029	21,319	0.00
USD 41,000	Bombardier 7.875% 15/4/2027	41,077	0.00
USD 49,000	Bombardier 8.75% 15/11/2030	51,384	0.00
USD 70,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	62,704	0.00
USD 4,924,000	Canadian Pacific Railway 1.35% 2/12/2024	4,771,184	0.30
USD 613,000	Canadian Pacific Railway 4% 1/6/2028	590,909	0.04
USD 17,000	Clarios Global 6.75% 15/5/2025	16,986	0.00
USD 311,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	310,529	0.02
USD 5,030,000	CPPIB Capital 0.5% 16/9/2024	4,901,605	0.30
USD 2,682,000	Enbridge 2.5% 14/2/2025	2,607,444	0.16
USD 1,300,000	Enbridge 6% 15/11/2028	1,347,034	0.09
USD 26,000	Enerflex 9% 15/10/2027	26,300	0.00
USD 59,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	56,439	0.00
USD 62,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	62,999	0.01
USD 27,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	24,471	0.00
USD 15,000	GFL Environmental 3.75% 1/8/2025	14,563	0.00
USD 104,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	95,258	0.01
USD 61,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	59,702	0.00
USD 63,000	GFL Environmental 6.75% 15/1/2031	64,366	0.00
USD 79,000	Husky Injection Molding Systems / Titan Co-Borrower 9% 15/2/2029	80,856	0.01
USD 48,000	Jones Deslauriers Insurance Management 8.5% 15/3/2030	49,944	0.00
USD 5,000	Masonite International 5.375% 1/2/2028	4,986	0.00
USD 10,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	8,988	0.00
USD 51,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	50,510	0.00
USD 3,975,000	OMERS Finance Trust 1.1% 26/3/2026	3,674,297	0.23
USD 2,115,000	OMERS Finance Trust 4% 20/4/2028	2,049,311	0.13
USD 18,000	Ontario Gaming GTA 8% 1/8/2030	18,374	0.00
USD 3,985,000	Ontario Teachers' Finance Trust 4.25% 25/4/2028	3,914,512	0.24
USD 2,000	Precision Drilling 6.875% 15/1/2029	1,972	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ(続き)			
USD 204,000	Rogers Communications 2.9% 15/11/2026	192,098	0.01
USD 3,587,000	Rogers Communications 3.2% 15/3/2027	3,382,759	0.21
USD 1,575,000	Rogers Communications 5% 15/2/2029	1,562,057	0.10
USD 1,098,000	Royal Bank of Canada 6% 1/11/2027	1,131,705	0.07
EUR 730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	787,891	0.05
USD 2,329,000	Toronto-Dominion Bank/The 5.156% 10/1/2028	2,339,607	0.15
USD 58,000	Videotron 5.125% 15/4/2027	56,602	0.00
		35,271,709	2.18
ケイマン諸島			
USD 650,000	Allegro CLO IIS 7.729% 21/10/2028	651,426	0.04
USD 2,000,000	Allegro CLO IV 7.126% 15/1/2030	2,001,905	0.12
USD 550,000	Allegro CLO XI 7.421% 19/1/2033	553,551	0.04
USD 3,250,000	Apidos CLO XXIX 7.136% 25/7/2030	3,253,420	0.20
USD 1,121,833	ASSURANT CLO 6.619% 20/4/2031	1,123,682	0.07
USD 2,426,326	Bean Creek CLO 6.599% 20/4/2031	2,428,753	0.15
USD 471,075	Benefit Street Partners CLO V-B 6.669% 20/4/2031	472,230	0.03
USD 494,139	Canyon CLO 2018-1 6.646% 15/7/2031	494,015	0.03
USD 1,416,477	Carbone CLO 6.719% 20/1/2031	1,419,310	0.09
USD 2,157,591	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 6.716% 15/7/2031	2,160,180	0.13
USD 1,250,000	CARLYLE US CLO 2018- 4 7.649% 20/1/2031	1,250,711	0.08
USD 813,879	CIFC Funding 2017-V 6.758% 16/11/2030	816,301	0.05
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 6.766% 15/1/2032	251,067	0.02
USD 7,000,000	CIFC Funding 2019-I 6.679% 20/4/2032	6,996,449	0.43
USD 483,087	Clear Creek CLO 6.779% 20/10/2030	484,035	0.03
USD 2,985,184	Deer Creek CLO 2017-1 6.759% 20/10/2030	2,988,692	0.19
USD 25,000	Diamond Foreign Asset / Diamond Finance 8.5% 1/10/2030	25,621	0.00
USD 222,000	Fantasia 0% 9/1/2023	6,105	0.00
USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	5,500	0.00
USD 2,150,000	Galaxy XXII CLO 6.776% 16/4/2034	2,151,522	0.13
USD 5,000	GGAM Finance 7.75% 15/5/2026	5,084	0.00
USD 42,000	GGAM Finance 8% 15/2/2027	42,971	0.00
USD 9,000	GGAM Finance 8% 15/6/2028	9,323	0.00
USD 2,500,000	Goldentree Loan Management US CLO 3 6.879% 20/4/2030	2,518,806	0.16
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 6.649% 20/10/2032	500,700	0.03
USD 636,621	Goldentree Loan Opportunities XI 6.63% 18/1/2031	637,773	0.04
USD 338,615	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 6.656% 16/7/2031	339,404	0.02
USD 250,000	Marble Point CLO XXII 7.436% 25/7/2034	250,363	0.02
USD 200,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	181,231	0.01
USD 2,000,000	MidOcean Credit CLO XI 8.016% 18/10/2033	2,002,396	0.12
USD 208,164	Milos CLO 6.649% 20/10/2030	208,570	0.01
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 6.91% 18/10/2029	500,272	0.03
USD 4,577,553	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 6.48% 18/10/2030	4,583,046	0.28
USD 493,912	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.701% 19/10/2031	494,961	0.03
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 7.271% 19/10/2031	300,911	0.02
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 6.656% 16/10/2033	852,694	0.05
USD 750,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 7.068% 20/1/2035	750,079	0.05
USD 369,457	OCP CLO 2017-14 6.731% 20/11/2030	370,190	0.02
USD 8,600,000	Peace Park CLO 6.709% 20/10/2034	8,618,813	0.53
USD 3,796,086	Pikes Peak CLO 1 6.76% 24/7/2031	3,799,543	0.24
USD 2,980,290	Regatta VIII Funding 6.828% 17/10/2030	2,984,254	0.19
USD 1,000,000	Regatta VIII Funding 7.278% 17/10/2030	1,002,076	0.06
USD 250,000	Regatta X Funding 7.028% 17/1/2031	250,531	0.02
USD 1,750,000	Regatta XVI Funding 7.626% 15/1/2033	1,752,986	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 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 207,608	Rockford Tower CLO 2017- 3 6.769% 20/10/2030	207,726	0.01
USD 525,000	RR 19 6.716% 15/10/2035	526,467	0.03
USD 1,824,355	RR 3 6.666% 15/1/2030	1,827,825	0.11
USD 89,000	Seagate HDD Cayman 8.25% 15/12/2029	95,332	0.01
USD 1,000,000	Symphony CLO XXIII 7.176% 15/1/2034	999,204	0.06
USD 1,000,000	TICP CLO V 2016-1 7.328% 17/7/2031	1,005,372	0.06
USD 88,200	Transocean 8.75% 15/2/2030	90,640	0.01
USD 15,000	Transocean Aquila 8% 30/9/2028	15,212	0.00
USD 21,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	21,568	0.00
USD 2,000,000	Trinitas CLO XII 7.323% 25/4/2033	2,007,369	0.12
USD 900,000	Trinitas CLO XVIII 6.749% 20/1/2035	896,725	0.06
USD 200,000	Wynn Macau 5.625% 26/8/2028	188,600	0.01
		70,373,492	4.35
フランス			
USD 200,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	183,483	0.01
EUR 100,000	Banque Stellantis France SACA 0% 22/1/2025	105,082	0.01
USD 609,000	BNP Paribas 5.125% 13/1/2029	605,884	0.04
USD 215,000	BNP Paribas 5.335% 12/6/2029	215,225	0.01
EUR 100,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	104,607	0.01
USD 250,000	BPCE 3.375% 2/12/2026	239,495	0.01
USD 436,000	BPCE 5.975% 18/1/2027	436,522	0.03
USD 250,000	Constellium 5.875% 15/2/2026	248,251	0.02
EUR 1,000,000	Engie 3.625% 6/12/2026	1,084,049	0.07
EUR 52,234	FCT Autonoria 2019 4.714% 25/9/2035	56,756	0.00
EUR 52,156	FCT Autonoria 2019 6.564% 25/9/2035	56,704	0.00
EUR 379,214	FCT Noria 2021 4.564% 25/10/2049	409,703	0.03
EUR 237,009	FCT Noria 2021 4.964% 25/10/2049	256,117	0.02
EUR 331,812	FCT Noria 2021 5.364% 25/10/2049	353,149	0.02
EUR 141,077	FCT Pixel 2021 5.695% 25/2/2038	151,497	0.01
EUR 1,000,000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 5.283% 27/8/2061	1,088,095	0.07
EUR 400,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 4.883% 27/5/2061	430,793	0.02
USD 362,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	357,677	0.02
EUR 200,000	Schneider Electric 0.25% 9/9/2024	213,024	0.01
EUR 500,000	Teleperformance 5.25% 22/11/2028	546,714	0.03
		7,142,827	0.44
ドイツ			
EUR 600,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	629,084	0.04
EUR 1,240,000	Bayer 4% 26/8/2026	1,344,295	0.08
EUR 100,000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	106,079	0.01
USD 1,664,000	Deutsche Bank 1.447% 1/4/2025	1,657,013	0.10
USD 1,269,000	Deutsche Bank 5.371% 9/9/2027	1,272,696	0.08
USD 615,000	Deutsche Bank 6.819% 20/11/2029	637,167	0.04
EUR 210,000	E.ON 0.875% 8/1/2025*	222,359	0.01
EUR 184,019	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.612% 15/9/2030	199,300	0.01
EUR 245,358	Red & Black Auto Germany 8 UG 4.812% 15/9/2030	263,860	0.02
EUR 600,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	630,555	0.04
EUR 600,000	Volkswagen Bank 4.25% 7/1/2026	653,459	0.04
EUR 520,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	506,189	0.03
EUR 330,000	Volkswagen Leasing 0.375% 20/7/2026	330,070	0.02
		8,452,126	0.52
アイルランド			
GBP 799,701	Agora UK 2021 6.421% 22/7/2031	997,990	0.06
GBP 784,347	Atom Mortgage 7.121% 22/7/2031	842,936	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 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 270,000	CA Auto Bank 0% 16/4/2024	291,612	0.02
USD 2,000	Castlake Aviation Finance 5% 15/4/2027	1,900	0.00
EUR 1,837,000	Dilosk Rmbs No 8 Sts 4.571% 20/5/2062	1,995,462	0.12
EUR 453,000	Dilosk Rmbs No 8 Sts 4.821% 20/5/2062	492,075	0.03
GBP 725,433	Frost CMBS 2021-1 6.571% 20/11/2033	900,093	0.06
EUR 1,050,696	Haus European Loan Conduit No 39 4.562% 28/7/2051	1,074,926	0.07
EUR 796,770	Haus European Loan Conduit No 39 5.012% 28/7/2051	764,104	0.05
EUR 636,816	Haus European Loan Conduit No 39 5.312% 28/7/2051	585,187	0.04
EUR 987,744	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.665% 17/8/2033	1,059,907	0.07
EUR 906,253	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.315% 17/8/2033	967,387	0.06
EUR 320,085	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 5.815% 17/8/2033	338,012	0.02
EUR 1,000,794	Last Mile PE 2021 4.815% 17/8/2031	1,076,799	0.07
EUR 1,316,724	Last Mile PE 2021 4.965% 17/8/2031	1,415,247	0.09
EUR 678,857	Last Mile PE 2021 5.115% 17/8/2031	728,279	0.04
EUR 918,807	Last Mile PE 2021 5.515% 17/8/2031	985,760	0.06
USD 264,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	249,265	0.02
EUR 2,100,000	LT Autorahoitus V 4.464% 18/5/2035	2,282,273	0.14
EUR 1,500,000	LT Autorahoitus V 4.784% 18/5/2035	1,629,404	0.10
USD 623,524	Prodigy Finance CM2021-1 6.685% 25/7/2051	622,553	0.04
EUR 243,295	SCF Rahoituspalvelut IX 4.844% 25/10/2030	264,340	0.02
USD 1,150,000	SMBC Aviation Capital Finance 1.9% 15/10/2026	1,045,995	0.07
USD 605,000	SMBC Aviation Capital Finance 2.3% 15/6/2028	531,559	0.03
USD 387,000	SMBC Aviation Capital Finance 5.45% 3/5/2028	386,408	0.02
GBP 321,638	Taurus 2021-1 UK 6.87% 17/5/2031	403,640	0.02
GBP 262,075	Taurus 2021-1 UK 7.82% 17/5/2031	329,017	0.02
GBP 195,024	Taurus 2021-4 UK 7.32% 17/8/2031	245,235	0.01
EUR 1,476,663	Vita Scientia 2022-1 5.233% 27/2/2033	1,579,456	0.10
		24,086,821	1.50
イタリア			
EUR 327,209	AutoFlorence 2 4.614% 24/12/2044	352,972	0.02
EUR 222,804	AutoFlorence 2 5.014% 24/12/2044	240,682	0.01
EUR 119,474	AutoFlorence 2 6.214% 24/12/2044	128,701	0.01
EUR 167,000	AutoFlorence 3 6.214% 25/12/2046	183,730	0.01
EUR 143,000	Brignole 2021 4.664% 24/7/2036	155,244	0.01
EUR 100,000	Brignole 2021 5.464% 24/7/2036	108,247	0.01
EUR 979,765	Cassia 2022-1 6.443% 22/5/2034	1,053,301	0.07
EUR 468,531	Cassia 2022-1 7.443% 22/5/2034	487,878	0.03
EUR 1,040,000	Eni 3.625% 19/5/2027	1,126,881	0.07
EUR 184,065	Progetto Quinto 4.468% 27/10/2036	199,821	0.01
EUR 401,488	Red & Black Auto Italy 6.693% 28/12/2031	433,082	0.03
EUR 320,000	Snam 0% 15/8/2025	329,526	0.02
USD 310,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	309,131	0.02
		5,109,196	0.32
日本			
USD 2,070,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.788% 18/7/2025	2,061,609	0.13
EUR 237,000	Mizuho Financial 0.523% 10/6/2024	254,708	0.01
USD 391,000	NTT Finance 1.591% 3/4/2028	343,474	0.02
USD 910,000	NTT Finance 4.372% 27/7/2027	891,445	0.06
USD 200,000	Sumitomo Mitsui Financial 5.464% 13/1/2026	201,015	0.01
		3,752,251	0.23
ジャージー			
USD 1,342,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,301,783	0.08
EUR 830,000	Heathrow Funding 1.5% 12/10/2025	865,610	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 (%)
	ジャージー (続き)		
USD 1,850,000	Pikes Peak CLO 15 2023 7.086% 20/10/2036	1,859,313	0.12
		4,026,706	0.25
	リベリア		
USD 83,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	82,110	0.01
USD 5,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	4,905	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 7.25% 15/1/2030	31,162	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 8.25% 15/1/2029	31,846	0.00
USD 23,000	Royal Caribbean Cruises 9.25% 15/1/2029	24,751	0.00
USD 7,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	7,575	0.00
		182,349	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	178,210	0.01
USD 200,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	177,323	0.01
EUR 1,900,000	Bavarian Sky 0% 20/3/2032	2,061,363	0.13
USD 68,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	65,013	0.00
EUR 528,000	Compartment BL Consumer Credit 2021 4.964% 25/9/2038	572,850	0.03
EUR 681,000	Compartment BL Consumer Credit 2021 5.514% 25/9/2038	738,867	0.05
EUR 355,000	Compartment BL Consumer Credit 2021 6.714% 25/9/2038	385,265	0.02
EUR 1,073,000	Compartment BL Consumer Credit 2024 0% 25/9/2041	1,165,898	0.07
EUR 3,676,000	Compartment BL Consumer Credit 2024 0% 25/9/2041	3,992,374	0.25
GBP 2,900,000	Compartment Driver UK Eight 0% 25/9/2031	3,679,619	0.23
USD 200,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	196,322	0.02
EUR 700,000	FACT Master 4.831% 20/7/2028	759,808	0.05
EUR 471,141	Germany Compartment Consumer 2020-1 5.032% 14/11/2034	512,175	0.03
EUR 251,275	Germany Compartment Consumer 2020-1 5.632% 14/11/2034	272,943	0.02
EUR 188,457	Germany Compartment Consumer 2020-1 6.382% 14/11/2034	203,664	0.01
USD 200,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	174,923	0.01
USD 200,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028	188,563	0.01
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	536,139	0.03
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024	528,229	0.03
EUR 200,000	Traton Finance Luxembourg 4.125% 22/11/2025	217,773	0.02
		16,607,321	1.03
	マルタ		
USD 14,000	VistaJet Malta Finance / Vista Management 6.375% 1/2/2030	10,274	0.00
	オランダ		
EUR 340,000	ABB Finance 3.125% 15/1/2029*	365,067	0.02
EUR 600,000	Bayer Capital 1.5% 26/6/2026	612,609	0.04
EUR 490,000	Conti-Gummi Finance 1.125% 25/9/2024	523,194	0.03
EUR 446,607	Domi 2021-1 4.555% 15/6/2053	484,146	0.03
EUR 1,556,483	Domi 2022-1 4.792% 15/4/2054	1,695,269	0.11
EUR 562,420	Dutch Property Finance 2020- 2 4.715% 28/1/2058	611,730	0.04
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020- 2 5.275% 28/1/2058	315,380	0.02
EUR 957,214	Dutch Property Finance 2021- 1 4.575% 28/7/2058	1,039,485	0.06
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021- 1 5.025% 28/7/2058	802,318	0.05
EUR 825,780	Dutch Property Finance 2021- 2 4.625% 28/4/2059	897,099	0.06
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021- 2 4.725% 28/4/2059	880,649	0.05
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021- 2 4.975% 28/4/2059	536,836	0.03
EUR 700,000	Hill FL 2024-1BV 4.975% 18/2/2032	760,447	0.05
EUR 1,700,000	IMCD 4.875% 18/9/2028	1,900,115	0.12
USD 657,000	ING Groep 1.726% 1/4/2027	608,288	0.04
EUR 201,000	Jubilee Place 5.528% 17/1/2059	214,525	0.01
EUR 100,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025	105,517	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 62,787	Magoi 2019 5.151% 27/7/2039	67,620	0.00
USD 319,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.5% 11/5/2031	264,120	0.02
USD 742,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.7% 1/5/2025	719,243	0.04
USD 590,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	529,888	0.03
USD 470,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	449,205	0.03
EUR 200,000	Redexis Gas Finance 1.875% 28/5/2025	211,318	0.01
EUR 900,000	Sartorius Finance 4.25% 14/9/2026	984,539	0.06
USD 80,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	72,723	0.01
USD 94,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	87,154	0.00
EUR 100,000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	102,426	0.01
EUR 100,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	102,181	0.01
USD 194,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	189,742	0.01
		16,132,833	1.00
パナマ			
USD 23,000	Carnival 4% 1/8/2028	21,217	0.00
USD 111,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	109,781	0.01
USD 80,000	Carnival 6% 1/5/2029	78,144	0.01
USD 17,000	Carnival 7% 15/8/2029	17,659	0.00
USD 13,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	13,167	0.00
		239,968	0.02
ポルトガル			
EUR 135,840	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 6.114% 25/1/2035	144,907	0.01
EUR 588,638	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 8.114% 25/1/2035	631,727	0.04
EUR 521,868	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Ulisses Finance No. 2 6.736% 23/9/2038	544,313	0.03
EUR 892,214	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 4.543% 28/10/2040	964,631	0.06
EUR 118,962	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 4.793% 28/10/2040	125,620	0.01
EUR 416,366	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos/Viriato Finance No 1 5.393% 28/10/2040	437,270	0.03
		2,848,468	0.18
サウジアラビア			
USD 865,000	Saudi Arabian Oil 2.875% 16/4/2024*	861,549	0.05
シンガポール			
USD 954,000	Pfizer Investment Enterprises 4.45% 19/5/2028	937,285	0.06
スペイン			
EUR 407,287	Autonomia Spain 2021 FT 4.664% 31/1/2039	440,807	0.03
EUR 101,822	Autonomia Spain 2021 FT 5.414% 31/1/2039	108,544	0.00
EUR 254,555	Autonomia Spain 2021 FT 6.514% 31/1/2039	272,019	0.02
EUR 101,822	Autonomia Spain 2021 FT 7.764% 31/1/2039	108,703	0.01
EUR 100,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025	106,186	0.01
EUR 300,000	Banco de Sabadell 4% 15/1/2030	324,751	0.02
EUR 154,440	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 21/3/2033	160,476	0.01
EUR 185,329	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 4.888% 21/3/2033	200,031	0.01
EUR 92,664	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 5.888% 21/3/2033	100,406	0.00
		1,821,923	0.11
スイス			
USD 1,072,000	Credit Suisse 5% 9/7/2027	1,062,391	0.07
EUR 715,000	UBS 0.25% 29/1/2026	750,319	0.04
EUR 2,000,000	UBS 0.25% 5/11/2028	1,896,024	0.12
USD 3,220,000	UBS 1.494% 10/8/2027	2,919,536	0.18
USD 2,107,000	UBS 4.55% 17/4/2026	2,071,923	0.13
USD 2,300,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,255,873	0.14
		10,956,066	0.68

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		
USD 235,000	Barclays 3.932% 7/5/2025	234,098	0.02
USD 1,539,000	Barclays 5.829% 9/5/2027	1,543,399	0.10
USD 32,000	Barclays Bank 1% 16/2/2029	34,496	0.00
GBP 202,000	Barley Hill NO 2 6.598% 27/8/2058	255,280	0.02
GBP 115,000	Barley Hill NO 2 6.898% 27/8/2058	144,434	0.01
USD 4,749,000	BAT International Finance 5.931% 2/2/2029	4,856,902	0.30
GBP 229,655	Brants Bridge 2022-1 6.47% 12/12/2064	292,700	0.02
EUR 570,000	British Telecommunications 4.25% 6/1/2033	631,773	0.04
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021- 2 6.821% 17/6/2058	128,552	0.01
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 6.671% 17/1/2059	397,696	0.02
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 7.071% 17/1/2059	219,187	0.01
GBP 113,874	CMF 2020-1 5.799% 16/1/2057	144,486	0.01
GBP 220,000	CMF 2020-1 6.199% 16/1/2057	279,115	0.02
GBP 105,000	CMF 2020-1 6.449% 16/1/2057	133,203	0.01
GBP 44,464	Dowson 2021-2 6.398% 20/10/2028	56,437	0.00
GBP 800,000	Dowson 2021-2 6.798% 20/10/2028	1,015,888	0.06
GBP 331,000	Dowson 2022-1 6.948% 20/1/2029	421,237	0.03
GBP 172,000	Dowson 2022-1 7.448% 20/1/2029	220,149	0.01
GBP 100,000	Dowson 2022-1 7.898% 20/1/2029	127,805	0.01
GBP 1,716,000	Elstree Funding No 4 6.309% 21/10/2055	2,177,307	0.13
GBP 1,045,000	Finsbury Square 6.471% 16/12/2067	1,307,782	0.08
GBP 241,089	Finsbury Square 2021-2 6.021% 16/12/2071	306,308	0.02
GBP 730,000	Finsbury Square 2021-2 6.471% 16/12/2071	923,209	0.06
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 6.621% 16/12/2071	464,188	0.03
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 6.921% 16/12/2071	247,420	0.02
GBP 210,000	Funding VI 8.298% 15/7/2026	267,982	0.02
GBP 257,848	Gemgarto 2021-1 5.811% 16/12/2067	326,888	0.02
GBP 668,000	Gemgarto 2021-1 6.321% 16/12/2067	846,288	0.05
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 6.521% 16/12/2067	275,635	0.02
GBP 720,000	Harben Finance 6.121% 28/9/2055	902,100	0.06
GBP 730,000	Harben Finance 6.371% 28/9/2055	909,904	0.06
GBP 441,000	Harben Finance 6.721% 28/9/2055	542,708	0.03
GBP 521,284	Hops Hill No 1 6.148% 27/5/2054	662,128	0.04
GBP 124,993	Hops Hill No 1 6.798% 27/5/2054	159,165	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 7.048% 27/5/2054	254,444	0.02
GBP 99,998	Hops Hill No 1 7.548% 27/5/2054	127,000	0.01
USD 183,000	Howden UK Refinance PLC / Howden UK Refinance 2 / Howden US Refinance 7.25% 15/2/2031	183,601	0.01
USD 200,000	HSBC 2.013% 22/9/2028	177,571	0.01
USD 1,947,000	HSBC 2.251% 22/11/2027	1,784,854	0.11
USD 200,000	HSBC 2.999% 10/3/2026	194,462	0.01
USD 556,000	HSBC 4.583% 19/6/2029	536,137	0.03
USD 200,000	HSBC 4.755% 9/6/2028	195,492	0.01
USD 323,000	HSBC 7.39% 3/11/2028	342,983	0.02
EUR 239,000	Informa 2.125% 6/10/2025	251,714	0.02
GBP 1,561,000	Jupiter Mortgage NO 1 6.189% 20/7/2055	1,981,286	0.12
GBP 824,000	Jupiter Mortgage NO 1 6.889% 20/7/2055	1,051,349	0.07
GBP 260,000	Jupiter Mortgage NO 1 7.439% 20/7/2055	332,180	0.02
GBP 177,000	Jupiter Mortgage NO 1 8.189% 20/7/2055	224,558	0.01
GBP 1,645,000	Lanark Master Issuer 5.734% 22/12/2069	2,088,040	0.13
GBP 485,998	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 6.32% 12/6/2057	617,487	0.04
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 7.47% 12/6/2057	470,056	0.03
GBP 159,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.471% 20/7/2058	198,363	0.01
GBP 103,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 6.871% 20/7/2058	126,680	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 313,751	London Wall Mortgage Capital 6.021% 15/5/2052	397,356	0.02
USD 24,000	Macquarie Airfinance 8.125% 30/3/2029	24,870	0.00
USD 12,000	Macquarie Airfinance 8.375% 1/5/2028	12,525	0.00
GBP 305,000	Mortimer BTL 2021-1 6.321% 23/6/2053	384,538	0.02
GBP 108,000	Mortimer BTL 2021-1 6.671% 23/6/2053	135,440	0.01
GBP 655,000	Mortimer Btl 2023-1 6.359% 22/12/2056	835,504	0.05
EUR 600,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	630,705	0.04
USD 1,885,000	NatWest 7.472% 10/11/2026	1,937,788	0.12
USD 290,000	NatWest Markets 1.6% 29/9/2026	264,247	0.02
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 6.748% 15/3/2029	982,483	0.06
GBP 735,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.098% 15/11/2029	933,103	0.06
GBP 404,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 6.548% 15/11/2029	513,060	0.03
GBP 1,156,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 6.498% 15/4/2030	1,472,173	0.09
GBP 1,922,000	Permanent Master Issuer 5.737% 15/7/2073	2,442,302	0.15
GBP 1,404,000	PMF 2024-1 6.185% 16/7/2060	1,783,191	0.11
GBP 693,000	Polaris 2022-1 6.549% 23/10/2059	877,609	0.05
GBP 421,000	Polaris 2022-1 6.699% 23/10/2059	528,592	0.03
GBP 307,000	Polaris 2022-1 7.199% 23/10/2059	381,839	0.02
GBP 538,000	Polaris 2022-1 8.599% 23/10/2059	674,977	0.04
GBP 100,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	127,663	0.01
GBP 100,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	127,797	0.01
GBP 100,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	127,185	0.01
GBP 2,265,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	2,875,586	0.18
GBP 170,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	211,769	0.01
GBP 1,315,000	Polaris 2024-1 0% 26/2/2061	1,672,075	0.10
GBP 482,302	Precise Mortgage Funding 2019-1B 6.421% 12/12/2055	616,091	0.04
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6.649% 16/10/2056	145,859	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 6.899% 16/10/2056	126,592	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 7.149% 16/10/2056	125,872	0.01
GBP 310,393	Residential Mortgage 32 6.471% 20/6/2070	394,347	0.02
GBP 525,000	Residential Mortgage 32 7.421% 20/6/2070	666,976	0.04
GBP 273,414	RMAC No 1 5.49% 12/6/2044	336,744	0.02
GBP 905,000	Sage AR Funding No 1 6.47% 17/11/2030	1,135,419	0.07
GBP 385,000	Sage AR Funding No 1 7.17% 17/11/2030	479,072	0.03
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 7.37% 17/11/2030	657,363	0.04
GBP 743,000	Satus 2021-1 6.798% 17/8/2028	945,619	0.06
GBP 122,000	Satus 2021-1 7.098% 17/8/2028	154,954	0.01
GBP 247,000	Satus 2021-1 8.398% 17/8/2028	314,908	0.02
GBP 120,000	Stanlington No 2 6.97% 12/6/2045	151,797	0.01
GBP 110,000	Stanlington No 2 7.42% 12/6/2045	138,229	0.01
GBP 303,000	Stanlington No 2 8.52% 12/6/2045	381,240	0.02
GBP 286,428	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5.921% 12/7/2063	363,162	0.02
GBP 156,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.171% 12/7/2063	196,521	0.01
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 6.471% 12/7/2063	134,387	0.01
GBP 919,812	Tower Bridge Funding 2021- 1 6.121% 21/7/2064	1,167,421	0.07
GBP 381,999	Tower Bridge Funding 2021- 1 6.721% 21/7/2064	484,836	0.03
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021- 1 7.071% 21/7/2064	463,189	0.03
GBP 253,000	Tower Bridge Funding 2021- 1 7.371% 21/7/2064	320,914	0.02
GBP 140,000	Tower Bridge Funding 2021- 2 6.721% 20/11/2063	177,016	0.01
GBP 169,999	Tower Bridge Funding 2021- 2 7.021% 20/11/2063	212,885	0.01
GBP 293,000	Tower Bridge Funding 2022- 1 6.221% 20/12/2063	368,924	0.02
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022- 1 6.471% 20/12/2063	331,782	0.02
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 7.47% 12/12/2054	495,625	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 8.22% 12/12/2054	285,904	0.02
GBP 1,124,878	Twin Bridges 2021-1 6.07% 12/3/2055	1,428,428	0.09
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 6.82% 12/3/2055	552,332	0.03
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 7.32% 12/3/2055	276,115	0.02
GBP 338,000	Twin Bridges 2021-2 6.37% 12/9/2055	423,433	0.03
GBP 188,000	Twin Bridges 2021-2 6.72% 12/9/2055	232,018	0.01
GBP 740,815	Twin Bridges 2022-1 5.99% 1/12/2055	938,236	0.06
GBP 891,000	Twin Bridges 2022-1 6.22% 1/12/2055	1,118,554	0.07
GBP 723,000	Twin Bridges 2022-1 6.52% 1/12/2055	906,363	0.06
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 6.92% 1/12/2055	449,640	0.03
GBP 99,360	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	126,005	0.01
		71,173,255	4.41
米国			
USD 5,673,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3.901% 10/8/2035	5,466,173	0.34
USD 2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016- 225L 3.597% 10/2/2036	1,995,279	0.12
USD 26,000	AAR Escrow Issuer 6.75% 15/3/2029	26,267	0.00
EUR 320,000	AbbVie 1.25% 1/6/2024	344,840	0.02
USD 4,375,000	AbbVie 4.8% 15/3/2029	4,365,844	0.27
USD 5,000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	4,729	0.00
USD 200,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	180,067	0.01
USD 9,000	Acushnet 7.375% 15/10/2028	9,281	0.00
USD 53,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	51,260	0.00
USD 35,000	Advanced Drainage Systems 6.375% 15/6/2030	35,154	0.00
USD 55,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	55,211	0.00
USD 4,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.25% 15/3/2026	3,801	0.00
USD 76,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	67,731	0.00
USD 7,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	6,555	0.00
USD 68,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	67,053	0.00
USD 15,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028	15,091	0.00
USD 262,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 4.25% 15/10/2027	242,673	0.02
USD 61,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 6.75% 15/4/2028	60,590	0.00
USD 64,000	Alliant Intermediate / Alliant Co- Issuer 7% 15/1/2031	63,725	0.00
USD 158,000	Allied Universal Holdco 7.875% 15/2/2031	156,807	0.01
USD 84,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	83,880	0.01
USD 381,000	Altria 2.35% 6/5/2025	368,046	0.02
USD 3,796,000	Altria 6.2% 1/11/2028	3,948,939	0.25
USD 47,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	44,858	0.00
USD 32,000	Amer Sports 6.75% 16/2/2031	31,900	0.00
USD 47,000	American Airlines 8.5% 15/5/2029	49,325	0.00
USD 61,245	American Airlines/AAAdvantage Loyalty IP 5.75% 20/4/2029	59,896	0.00
USD 3,064,000	American Express 2.55% 4/3/2027	2,847,750	0.18
USD 1,440,000	American Express 5.098% 16/2/2028	1,435,657	0.09
EUR 1,400,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	1,373,183	0.09
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	1,035,168	0.06
USD 3,900,000	American Tower 1.45% 15/9/2026	3,549,339	0.22
USD 649,000	American Tower 4.4% 15/2/2026	638,483	0.04
USD 32,000	AmeriGas Partners / AmeriGas Finance 9.375% 1/6/2028	32,440	0.00
USD 296,000	Amgen 2.2% 21/2/2027	273,069	0.02
USD 49,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	45,248	0.00
USD 16,000	AmWINS 6.375% 15/2/2029	16,060	0.00
USD 17,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	14,590	0.00
USD 173,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7.875% 15/5/2026	176,787	0.01
USD 79,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	81,246	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 53,236	Anywhere Real Estate / Anywhere Co-Issuer 7% 15/4/2030	47,940	0.00
USD 1,425,000	Aon / Aon Global 2.85% 28/5/2027	1,329,041	0.08
USD 44,000	APX 6.75% 15/2/2027	44,040	0.00
USD 70,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	67,224	0.01
USD 123,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	120,051	0.01
USD 66,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	65,724	0.00
USD 58,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	53,279	0.00
USD 200,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	196,476	0.01
USD 10,000	Aretec 10% 15/8/2030	10,890	0.00
USD 24,000	Arsenal AIC Parent 8% 1/10/2030	25,015	0.00
USD 3,000	Asbury Automotive 4.75% 1/3/2030	2,737	0.00
USD 95,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	88,263	0.01
USD 89,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 8.25% 31/12/2028	90,384	0.01
USD 95,000	ATI 5.875% 1/12/2027	92,985	0.01
USD 58,000	ATI 7.25% 15/8/2030	59,473	0.00
USD 2,000	Avantor Funding 3.875% 1/11/2029	1,794	0.00
USD 154,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	145,224	0.01
USD 9,000	Avient 7.125% 1/8/2030	9,194	0.00
USD 15,000	Avis Budget Car Rental / Avis Budget Finance 8% 15/2/2031	14,529	0.00
USD 299,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	265,310	0.02
USD 13,000	B&G Foods 8% 15/9/2028	13,541	0.00
USD 19,000	Ball 6% 15/6/2029	19,083	0.00
USD 9,679	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 5.09% 25/11/2033	8,588	0.00
EUR 1,700,000	Bank of America 0.58% 8/8/2029	1,611,450	0.10
USD 1,706,000	Bank of America 1.197% 24/10/2026	1,590,881	0.10
USD 3,847,000	Bank of America 1.319% 19/6/2026	3,644,328	0.23
USD 7,077,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	6,859,715	0.43
USD 1,575,000	Bank of America 2.015% 13/2/2026	1,522,048	0.10
USD 6,673,000	Bank of America 5.819% 15/9/2029	6,808,778	0.42
USD 4,784,000	BAT Capital 3.222% 15/8/2024	4,728,242	0.29
USD 9,000	Beacon Roofing Supply 4.125% 15/5/2029	8,108	0.00
USD 29,000	Beacon Roofing Supply 6.5% 1/8/2030	29,215	0.00
EUR 100,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	102,761	0.01
USD 141,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	141,900	0.01
USD 205,000	Block 2.75% 1/6/2026	190,966	0.01
USD 4,000	Blue Owl Credit Income 3.125% 23/9/2026	3,645	0.00
USD 45,000	Blue Owl Credit Income 7.75% 16/9/2027	46,100	0.00
USD 1,998,000	Boeing 2.196% 4/2/2026	1,876,875	0.12
USD 2,275,000	Boeing 3.25% 1/3/2028	2,107,657	0.13
EUR 840,000	Booking 0.1% 8/3/2025	877,620	0.05
EUR 780,000	Booking 3.5% 1/3/2029	845,613	0.05
USD 212,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	212,384	0.01
USD 48,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	44,028	0.00
USD 148,000	Brand Industrial Services 10.375% 1/8/2030	157,315	0.01
USD 13,000	Bread Financial 9.75% 15/3/2029	13,307	0.00
USD 1,770,000	Bristol-Myers Squibb 4.9% 22/2/2029	1,768,149	0.11
USD 239,000	Broadcom 3.459% 15/9/2026	229,496	0.01
USD 2,256,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,183,155	0.14
USD 42,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GCSI Sellco LL 4.5% 1/4/2027	36,975	0.00
USD 6,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	5,891	0.00
USD 70,000	Buckeye Partners 4.5% 1/3/2028	65,064	0.00
USD 82,000	BWX Technologies 4.125% 30/6/2028	75,945	0.01
USD 1,130,000	BX Trust 2018-BILT 7.385% 15/5/2030	1,127,210	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 12,000	Cable One 4% 15/11/2030	9,041	0.00
USD 6,000	Caesars Entertainment 4.625% 15/10/2029	5,482	0.00
USD 203,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	207,957	0.01
USD 32,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	32,051	0.00
USD 44,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	46,399	0.00
USD 38,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	39,690	0.00
USD 85,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	78,185	0.01
USD 73,000	Calpine 5.25% 1/6/2026	71,992	0.00
USD 34,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	34,794	0.00
USD 3,100,000	Capital One Financial 4.166% 9/5/2025	3,088,171	0.19
USD 3,120,000	Capital One Financial 6.312% 8/6/2029	3,196,287	0.20
USD 36,000	Capstone Borrower 8% 15/6/2030	37,242	0.00
USD 261,000	Carnival Bermuda 10.375% 1/5/2028	284,779	0.02
USD 12,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	11,901	0.00
USD 5,000	Carpenter Technology 7.625% 15/3/2030	5,160	0.00
EUR 2,040,000	Carrier Global 4.375% 29/5/2025	2,224,363	0.14
USD 74,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	71,568	0.01
USD 22,000	Catalent Pharma Solutions 3.5% 1/4/2030	21,244	0.00
USD 26,000	Catalent Pharma Solutions 5% 15/7/2027	25,614	0.00
USD 298,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	281,888	0.02
USD 150,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	135,560	0.01
USD 90,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	84,545	0.01
USD 70,000	CCO / CCO Capital 7.375% 1/3/2031	67,784	0.00
USD 1,577,517	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2.622% 10/8/2049	1,518,769	0.09
USD 39,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	38,854	0.00
USD 77,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	77,718	0.01
USD 49,000	Central Parent / CDK Global II / CDK Financing 8% 15/6/2029	50,269	0.00
USD 3,180,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3.217% 10/11/2049	2,949,889	0.18
USD 28,000	Champions Financing 8.75% 15/2/2029	28,550	0.00
USD 33,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	30,905	0.00
USD 342,000	Charles Schwab 3.2% 2/3/2027	324,867	0.02
USD 3,830,000	Charles Schwab 6.196% 17/11/2029	3,964,155	0.25
USD 75,000	Chart Industries 7.5% 1/1/2030	77,428	0.01
USD 400,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	337,659	0.02
USD 203,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.75% 15/2/2028	187,698	0.01
USD 3,914,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	3,676,562	0.23
USD 15,000	Chemours 4.625% 15/11/2029	12,531	0.00
USD 19,000	Chemours 5.75% 15/11/2028	16,887	0.00
USD 97,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	97,471	0.01
USD 112,511	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 4.426% 20/12/2035	101,008	0.01
USD 140,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	129,577	0.01
USD 39,000	CHS/Community Health Systems 4.75% 15/2/2031	29,575	0.00
USD 79,000	CHS/Community Health Systems 5.25% 15/5/2030	62,867	0.00
USD 16,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	14,645	0.00
USD 39,000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	33,380	0.00
EUR 141,000	Chubb INA 0.3% 15/12/2024	148,519	0.01
USD 104,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	98,285	0.01
USD 158,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	155,075	0.01
USD 21,000	Churchill Downs 5.75% 1/4/2030	20,194	0.00
USD 67,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	66,802	0.00
USD 57,000	CITGO Petroleum 8.375% 15/1/2029	59,905	0.00
USD 4,049,000	Citigroup 3.4% 1/5/2026	3,895,091	0.24
USD 346,000	Citigroup 3.52% 27/10/2028	325,406	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 3,140,000	Citigroup 5.174% 13/2/2030	3,111,063	0.19
USD 538,000	Citigroup 5.61% 29/9/2026	539,300	0.03
USD 2,587,781	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3.251% 10/5/2035	2,485,841	0.15
USD 1,238,754	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3.855% 10/5/2047	1,235,375	0.08
USD 4,800,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3.137% 10/2/2048	4,709,204	0.29
USD 5,519,653	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2.935% 10/4/2048	5,388,121	0.33
USD 1,785,099	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.779% 10/7/2049	1,736,567	0.11
USD 145,000	Civitas Resources 8.375% 1/7/2028	151,859	0.01
USD 60,000	Civitas Resources 8.625% 1/11/2030	64,256	0.00
USD 88,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.75% 15/5/2028	89,097	0.01
USD 214,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	194,838	0.01
USD 10,000	Clarivate Science 4.875% 1/7/2029	9,085	0.00
USD 76,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	73,432	0.01
USD 100,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	93,893	0.01
USD 244,000	Clear Channel Outdoor 9% 15/9/2028	254,967	0.02
USD 62,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	57,982	0.00
USD 460,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	427,869	0.03
USD 80,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	79,638	0.01
USD 120,000	Comcast 3.3% 1/4/2027	114,559	0.01
USD 286,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	271,855	0.02
USD 349,763	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 3.599% 10/6/2046	340,419	0.02
USD 3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3.611% 10/8/2049	2,823,699	0.18
USD 4,238,460	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3.828% 15/7/2047	4,209,912	0.26
USD 4,631,007	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	4,526,525	0.28
USD 56,857	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3.548% 10/9/2047	56,759	0.00
USD 560,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3.178% 10/2/2035	531,093	0.03
USD 7,687,317	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 0.842% 10/5/2048	54,763	0.00
USD 604,810	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3.445% 10/8/2048	598,515	0.04
USD 3,509,897	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3.445% 10/7/2048	3,430,974	0.21
USD 75,000	CommScope 6% 1/3/2026	67,965	0.00
USD 6,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	4,686	0.00
USD 17,000	Comstock Resources 5.875% 15/1/2030	14,848	0.00
USD 109,000	Comstock Resources 6.75% 1/3/2029	100,424	0.01
USD 1,045,000	Consumers Energy 4.6% 30/5/2029	1,029,658	0.06
USD 85,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	75,422	0.01
USD 4,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	3,759	0.00
USD 26,000	Coty/HFC Prestige Products/HFC Prestige International US 6.625% 15/7/2030	26,331	0.00
USD 165,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	164,372	0.01
USD 65,000	Crescent Energy Finance 9.25% 15/2/2028	67,843	0.00
USD 29,000	Crocs 4.25% 15/3/2029	26,071	0.00
USD 89,000	CrowdStrike 3% 15/2/2029	78,576	0.01
USD 1,842,000	Crown Castle 1.05% 15/7/2026	1,667,256	0.10
USD 387,000	Crown Castle 4.45% 15/2/2026	380,080	0.02
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3.505% 15/4/2050	1,607,846	0.10
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	173,342	0.01
USD 149,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	146,680	0.01
USD 137,000	CVS Health 4.3% 25/3/2028	133,077	0.01
EUR 375,000	Danaher 1.7% 30/3/2024	406,126	0.03
USD 64,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	62,797	0.00
USD 2,238,719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.417% 15/5/2035	2,229,866	0.14
USD 1,064,065	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2.632% 10/8/2049	999,922	0.06
USD 1,810,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1,795,305	0.11
USD 3,875,000	Delta Air Lines 7% 1/5/2025	3,940,145	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 2,042,000	Diamondback Energy 3.5% 1/12/2029	1,877,915	0.12
USD 99,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	93,450	0.01
USD 78,000	DISH DBS 5.25% 1/12/2026	61,964	0.00
USD 113,000	DISH Network 11.75% 15/11/2027	118,130	0.01
USD 694,000	DR Horton 1.3% 15/10/2026	627,974	0.04
USD 12,000	Dream Finders Homes 8.25% 15/8/2028	12,521	0.00
USD 48,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	43,797	0.00
USD 1,685,000	DTE Electric 4.85% 1/12/2026	1,683,830	0.10
USD 1,331,000	Duke Energy 2.65% 1/9/2026	1,253,398	0.08
USD 755,000	Duke Energy 4.85% 5/1/2029	744,260	0.05
USD 65,000	Dun & Bradstreet 5% 15/12/2029	59,830	0.00
USD 13,000	Dycom Industries 4.5% 15/4/2029	11,980	0.00
USD 718,000	Edison International 3.55% 15/11/2024	707,214	0.04
USD 1,660,000	Edison International 4.7% 15/8/2025	1,637,735	0.10
USD 314,000	Edison International 4.95% 15/4/2025	311,408	0.02
USD 219,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	198,762	0.01
USD 388,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	371,256	0.02
USD 558,000	Elevance Health 5.35% 15/10/2025	558,100	0.04
USD 325,000	EMRLD Borrower / Emerald Co- Issuer 6.625% 15/12/2030	326,385	0.02
USD 66,000	Enact 6.5% 15/8/2025	65,964	0.00
USD 1,074,000	Enbridge Energy Partners 5.875% 15/10/2025	1,081,437	0.07
USD 29,000	Encompass Health 4.75% 1/2/2030	26,886	0.00
USD 850,000	Energy Transfer 2.9% 15/5/2025	823,684	0.05
USD 5,218,000	Energy Transfer 4.05% 15/3/2025	5,138,638	0.32
USD 438,000	Energy Transfer 4.5% 15/4/2024	437,243	0.03
USD 2,030,000	Energy Transfer 5.625% 1/5/2027	2,009,527	0.13
USD 837,000	Energy Transfer 5.95% 1/12/2025	842,556	0.05
USD 450,000	Energy Transfer 6% 1/2/2029	450,880	0.03
USD 2,274,000	Energy Transfer 6.1% 1/12/2028	2,352,305	0.15
USD 65,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	63,451	0.00
USD 127,000	Entegris 4.75% 15/4/2029	119,966	0.01
USD 32,000	EQM Midstream Partners 6.375% 1/4/2029	32,127	0.00
USD 116,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	117,194	0.01
USD 543,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	513,148	0.03
USD 1,084,000	Equinix 1.45% 15/5/2026	998,763	0.06
USD 827,000	Equinix 1.55% 15/3/2028	720,447	0.05
USD 966,000	Equinix 1.8% 15/7/2027	869,214	0.05
USD 2,960,000	Equinix 2.9% 18/11/2026	2,790,039	0.17
USD 1,220,000	Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	1,142,391	0.07
USD 2,000	Eversource Energy 4.6% 1/7/2027	1,960	0.00
USD 1,520,000	Eversource Energy 4.75% 15/5/2026	1,503,089	0.09
USD 1,062,000	Eversource Energy 5.45% 1/3/2028	1,070,237	0.07
USD 740,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	687,984	0.04
USD 1,302,000	Exelon 5.15% 15/3/2028	1,299,828	0.08
USD 41,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	38,103	0.00
USD 5,799,564	Fannie Mae Pool 1.5% 1/6/2031	5,276,283	0.33
USD 3,661,349	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2035	3,325,371	0.21
USD 11,983	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	11,618	0.00
USD 18,138	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	17,440	0.00
USD 255,671	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	244,216	0.02
USD 101,336	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	96,530	0.01
USD 25,458	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	24,262	0.00
USD 14,910	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	14,221	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 8,609	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	8,212	0.00
USD 32,233	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	30,732	0.00
USD 261,076	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	248,819	0.02
USD 40,165	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	38,143	0.00
USD 10,168	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	9,563	0.00
USD 6,952	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	6,615	0.00
USD 196,094	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	186,201	0.01
USD 186,300	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	176,930	0.01
USD 31,463	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	29,866	0.00
USD 11,480	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	10,897	0.00
USD 19,958	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	19,011	0.00
USD 189,881	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	180,287	0.01
USD 223,862	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	212,493	0.01
USD 18,076	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	17,007	0.00
USD 30,588	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	29,041	0.00
USD 30,100	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	28,399	0.00
USD 42,733	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	40,568	0.00
USD 190,081	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	180,648	0.01
USD 9,793	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	9,298	0.00
USD 22,937	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	21,850	0.00
USD 380,461	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	358,208	0.02
USD 257,031	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	241,927	0.02
USD 54,588	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	51,513	0.00
USD 29,698	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	28,146	0.00
USD 217,162	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	204,430	0.01
USD 90,883	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	85,311	0.01
USD 128,505	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	121,729	0.01
USD 265,301	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	251,232	0.02
USD 374,314	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	352,506	0.02
USD 16,480	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	15,566	0.00
USD 6,868	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	6,486	0.00
USD 1,619,173	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	1,530,932	0.10
USD 9,252	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	8,743	0.00
USD 181,556	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	170,935	0.01
USD 200,992	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	189,606	0.01
USD 276,464	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	259,206	0.02
USD 32,777	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	30,823	0.00
USD 15,522	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	14,661	0.00
USD 9,053	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	8,521	0.00
USD 52,157	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	48,832	0.00
USD 106,564	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	100,690	0.01
USD 28,880	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	27,187	0.00
USD 163,667	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	153,502	0.01
USD 13,902	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	13,010	0.00
USD 6,706,079	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2033	6,332,148	0.39
USD 3,158,282	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2034	2,983,792	0.18
USD 712,599	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	658,384	0.04
USD 315,010	Fannie Mae Pool 3.128% 1/9/2044	313,019	0.02
USD 72,211	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	69,299	0.00
USD 454,694	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	436,361	0.03
USD 644,060	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	628,099	0.04
USD 517,288	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	505,721	0.03
USD 226,616	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	221,946	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 289,040	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	282,372	0.02
USD 18,338	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	17,811	0.00
USD 149,345	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	145,231	0.01
USD 144,413	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	140,100	0.01
USD 208,060	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	199,842	0.01
USD 256,761	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	246,531	0.02
USD 177,006	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	169,469	0.01
USD 2,627,083	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	2,478,463	0.15
USD 8,521,057	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	8,038,978	0.50
USD 518,537	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2037	508,213	0.03
USD 2,343,196	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,305,934	0.14
USD 858,660	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	842,322	0.05
USD 2,088,421	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,051,092	0.13
USD 413,511	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	408,158	0.03
USD 535,799	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2037	528,936	0.03
USD 571,511	Fannie Mae Pool 4.5% 1/3/2047	554,288	0.03
USD 1,718,094	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2047	1,664,141	0.10
USD 232,110	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2047	224,989	0.01
USD 1,921,349	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2047	1,867,993	0.12
USD 308,648	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	301,303	0.02
USD 954,467	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2048	931,648	0.06
USD 2,850,212	Fannie Mae Pool 4.5% 1/2/2049	2,785,403	0.17
USD 811,043	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2049	792,209	0.05
USD 196	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	194	0.00
USD 415,955	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2037	415,600	0.03
USD 2,142,053	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2,127,679	0.13
USD 241,845	Fannie Mae Pool 5.325% 1/9/2042	249,195	0.02
USD 1,783,347	Fannie Mae REMICS 1.5% 25/11/2050	1,554,441	0.10
USD 6,917,378	Fannie Mae REMICS 6% 25/9/2052	6,678,238	0.41
USD 14,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 0.71% 1/4/2025	13,409,786	0.83
USD 2,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 1.3% 3/2/2031	1,600,816	0.10
USD 8,500,000	Federal Farm Credit Banks Funding 1.68% 17/9/2035	6,006,587	0.37
USD 2,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.17% 29/10/2029	1,759,314	0.11
USD 5,500,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.25% 15/8/2029	4,894,544	0.30
USD 1,150,000	Federal Farm Credit Banks Funding 2.78% 1/12/2036	905,067	0.06
USD 4,000,000	Federal Home Loan Banks 0.6% 30/12/2026	3,566,091	0.22
USD 2,560,000	Federal Home Loan Banks 1.4% 9/1/2031	2,075,152	0.13
USD 3,000,000	Federal Home Loan Banks 1.61% 27/1/2033	2,305,908	0.14
USD 4,000,000	Federal Home Loan Banks 2.06% 27/9/2029	3,496,004	0.22
USD 3,500,000	Federal Home Loan Banks 2.18% 6/11/2029	3,073,402	0.19
USD 1,150,000	Federal Home Loan Banks 2.5% 5/11/2036	884,220	0.05
USD 4,000,000	Federal Home Loan Mortgage 0.65% 28/5/2026	3,656,236	0.23
USD 189,000	Federal Home Loan Mortgage 1.55% 20/11/2031	149,703	0.01
USD 4,500,000	Federal Home Loan Mortgage 4.2% 28/8/2025	4,451,662	0.28
USD 16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	15,040,655	0.93
USD 4,000,000	Federal National Mortgage Association 0.74% 25/8/2027	3,517,230	0.22
USD 4,000,000	Federal National Mortgage Association 0.81% 25/9/2028	3,404,283	0.21
USD 61,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	55,185	0.00
USD 174,000	Fidelity National Information Services 4.7% 15/7/2027	172,766	0.01
USD 29,000	Fiesta Purchaser 7.875% 1/3/2031	29,926	0.00
USD 5,000	FirstEnergy 2.65% 1/3/2030	4,270	0.00
USD 615,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	571,321	0.04
USD 3,090,000	Ford Motor Credit 5.8% 5/3/2027	3,088,188	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 (%)
米国(続き)			
USD 2,085,000	Ford Motor Credit 6.95% 10/6/2026	2,128,267	0.13
USD 200,000	Ford Motor Credit 7.2% 10/6/2030	210,769	0.01
USD 2,595,000	Ford Motor Credit 7.35% 4/11/2027	2,718,359	0.17
USD 19,000	Fortrea 7.5% 1/7/2030	19,426	0.00
USD 37,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5.5% 1/5/2028	35,436	0.00
USD 108,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6.5% 1/10/2025	107,831	0.01
USD 71,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 7.875% 1/12/2030	74,401	0.01
USD 18,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 9.75% 1/8/2027	18,596	0.00
USD 603,957	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/9/2032	572,286	0.04
USD 400,413	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	369,982	0.02
USD 760,871	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	741,717	0.05
USD 895,873	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	879,304	0.05
USD 782,373	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	767,003	0.05
USD 43,349	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	41,877	0.00
USD 574,006	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	552,238	0.03
USD 189,120	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/7/2047	183,551	0.01
USD 5,663,868	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/3/2049	5,533,739	0.34
USD 93,896,547	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.647% 25/9/2024	194,319	0.01
USD 1,082,990	Freddie Mac Non Gold Pool 3.335% 1/5/2045	1,070,650	0.07
USD 376,003	Freddie Mac Pool 3.5% 1/9/2032	368,515	0.02
USD 466,821	Freddie Mac Pool 4.5% 1/10/2037	458,765	0.03
USD 462,744	Freddie Mac Pool 4.5% 1/1/2050	451,827	0.03
USD 3,150,235	Freddie Mac REMICS 1.5% 15/4/2044	3,014,958	0.19
USD 685,556	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	618,386	0.04
USD 1,956,383	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	1,743,371	0.11
USD 1,239,842	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1,122,957	0.07
USD 382,782	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	373,149	0.02
USD 1,303,277	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1,212,240	0.08
USD 877,939	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	762,941	0.05
USD 1,080,925	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1,008,336	0.06
USD 8,994	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/9/2041	8,924	0.00
USD 51,814	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/11/2041	50,497	0.00
USD 7,000	Freedom Mortgage 9.25% 1/2/2029	7,108	0.00
USD 11,000	Freedom Mortgage 12% 1/10/2028	11,918	0.00
USD 11,000	Freedom Mortgage 12.25% 1/10/2030	12,112	0.00
USD 69,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	63,898	0.00
USD 119,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	115,126	0.01
USD 20,000	Frontier Communications 8.625% 15/3/2031	20,209	0.00
USD 28,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	28,504	0.00
USD 12,000	FTAI Infra Escrow 10.5% 1/6/2027	12,444	0.00
USD 50,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	49,816	0.00
USD 22,000	GCI 4.75% 15/10/2028	19,788	0.00
USD 51,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	51,279	0.00
USD 297,000	General Mills 5.241% 18/11/2025	296,812	0.02
USD 176,000	General Motors Financial 1.25% 8/1/2026	163,319	0.01
USD 434,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	398,143	0.03
USD 772,000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	760,985	0.05
USD 2,010,000	General Motors Financial 5.4% 8/5/2027	2,013,605	0.13
USD 437,000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	446,953	0.03
USD 604,000	General Motors Financial 6.05% 10/10/2025	608,759	0.04
USD 9,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7.75% 1/2/2028	8,998	0.00
USD 19,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.25% 15/1/2029	19,313	0.00
USD 8,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 8.875% 15/4/2030	8,301	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 1,135,000	Georgia Power 5.004% 23/2/2027	1,134,792	0.07
USD 1,706,000	Glencore Funding 6.125% 6/10/2028	1,762,742	0.11
USD 36,000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3.75% 15/12/2027	30,363	0.00
USD 3,484,000	Global Payments 1.2% 1/3/2026	3,212,800	0.20
USD 48,000	Global Payments 1.5% 1/3/2031	48,945	0.00
USD 2,518,000	Global Payments 4.8% 1/4/2026	2,488,462	0.15
USD 15,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	13,362	0.00
USD 32,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	30,911	0.00
EUR 1,600,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029	1,494,510	0.09
EUR 1,600,000	Goldman Sachs 1.25% 7/2/2029*	1,541,049	0.10
USD 395,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	365,194	0.03
USD 2,334,000	Goldman Sachs 2.64% 24/2/2028	2,167,377	0.13
USD 3,522,000	Goldman Sachs 6.484% 24/10/2029	3,695,707	0.23
USD 618,000	Goldman Sachs 6.739% 15/5/2026	622,769	0.04
USD 621,957	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1.93% 20/7/2048	480,936	0.03
USD 211,597	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	169,313	0.01
USD 3,245,368	Government National Mortgage Association 0.641% 16/2/2053	50,815	0.00
USD 1,146,307	Government National Mortgage Association 1.5% 20/6/2050	889,918	0.06
USD 1,363,725	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1,284,588	0.08
USD 652,490	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	591,792	0.04
USD 16,000	GrafTech Global Enterprises 9.875% 15/12/2028	12,780	0.00
USD 56,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	51,325	0.00
USD 11,000	Gray Television 5.875% 15/7/2026	10,389	0.00
USD 31,000	Gray Television 7% 15/5/2027	27,744	0.00
USD 1,176,141	GS Mortgage Trust 2011- GC5 5.153% 10/8/2044	1,140,444	0.07
USD 2,960,000	GS Mortgage Trust 2014- GC24 3.931% 10/9/2047	2,919,507	0.18
USD 2,330,000	GS Mortgage Trust 2015- GC32 3.764% 10/7/2048	2,266,445	0.14
USD 1,319,781	GS Mortgage Trust 2016- GS3 2.777% 10/10/2049	1,283,162	0.08
USD 260,000	GTCR W-2 Merger Sub 7.5% 15/1/2031	270,837	0.02
USD 8,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	8,116	0.00
USD 20,000	GYP III 4.625% 1/5/2029	18,553	0.00
USD 13,000	Hanesbrands 4.875% 15/5/2026	12,555	0.00
USD 35,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	32,629	0.00
USD 20,000	HAT I / HAT II 8% 15/6/2027	20,774	0.00
USD 3,235,000	HCA 5.25% 15/4/2025	3,220,929	0.20
USD 1,628,000	HCA 5.25% 15/6/2026	1,619,830	0.10
USD 4,617,000	HCA 5.375% 1/2/2025	4,603,700	0.29
USD 593,000	HCA 5.375% 1/9/2026	592,257	0.04
USD 2,467,000	HCA 5.875% 15/2/2026	2,477,938	0.15
USD 74,000	HealthEquity 4.5% 1/10/2029	67,979	0.01
USD 820,000	Healthpeak 1.35% 1/2/2027	738,029	0.05
USD 61,000	Herc 5.5% 15/7/2027	59,762	0.00
USD 47,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	45,486	0.00
USD 15,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	14,900	0.00
USD 20,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	18,164	0.00
USD 5,000	Hilton Domestic Operating 4.875% 15/1/2030	4,734	0.00
USD 10,000	Hilton Domestic Operating 5.75% 1/5/2028	10,001	0.00
USD 82,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	80,084	0.01
EUR 710,000	Honeywell International 3.5% 17/5/2027	770,865	0.05
USD 43,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	40,459	0.00
USD 30,000	Howard Midstream Energy Partners 8.875% 15/7/2028	31,683	0.00
USD 121,000	HP 4.75% 15/1/2028	119,923	0.01
USD 3,220,000	HSBC USA 5.294% 4/3/2027	3,222,794	0.20

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 351,000	HUB International 7.25% 15/6/2030	357,821	0.02
USD 10,000	Hughes Satellite Systems 5.25% 1/8/2026	8,585	0.00
USD 2,471,000	Hyundai Capital America 1.65% 17/9/2026	2,253,327	0.14
USD 352,000	Hyundai Capital America 5.5% 30/3/2026	352,665	0.02
USD 13,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	10,931	0.00
USD 76,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	69,934	0.01
USD 37,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	36,057	0.00
USD 29,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 9.75% 15/1/2029	30,308	0.00
EUR 1,045,000	Illinois Tool Works 0.25% 5/12/2024*	1,104,221	0.07
USD 61,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	56,561	0.00
USD 1,052,000	Intel 4.875% 10/2/2028	1,052,325	0.07
USD 100,000	International Business Machines 4.5% 6/2/2026	99,168	0.01
USD 140,000	Iron Mountain 7% 15/2/2029	142,312	0.01
USD 868,967	JP Morgan Mortgage Trust 2014- 2 3% 25/6/2029	832,306	0.05
USD 414,762	JP Morgan Mortgage Trust 2016- 2 7.088% 25/6/2046	393,933	0.02
USD 408,469	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3.657% 15/9/2047	405,828	0.03
USD 129,248	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3.288% 15/1/2048	128,097	0.01
USD 879,964	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3.504% 15/12/2048	850,814	0.05
EUR 128,000	JPMorgan Chase 1.5% 27/1/2025	136,135	0.01
USD 412,000	JPMorgan Chase 1.578% 22/4/2027	381,203	0.02
USD 1,200,000	JPMorgan Chase 2.069% 1/6/2029	1,058,629	0.07
USD 1,581,000	JPMorgan Chase 3.782% 1/2/2028	1,521,708	0.10
USD 551,000	JPMorgan Chase 3.96% 29/1/2027	538,533	0.03
USD 2,965,000	JPMorgan Chase 5.04% 23/1/2028	2,954,102	0.18
USD 3,091,000	JPMorgan Chase 5.299% 24/7/2029	3,105,459	0.19
USD 3,615,000	JPMorgan Chase 6.087% 23/10/2029	3,743,851	0.23
USD 109,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	100,484	0.01
USD 6,000	KBR 4.75% 30/9/2028	5,533	0.00
USD 122,000	Kinder Morgan 4.3% 1/3/2028	118,595	0.01
USD 1,445,000	Kinder Morgan 5% 1/2/2029	1,436,598	0.09
USD 9,000	Kinetik 6.625% 15/12/2028	9,088	0.00
USD 55,000	Kodiak Gas Services 7.25% 15/2/2029	56,156	0.00
USD 46,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	43,486	0.00
USD 28,000	LABL 5.875% 1/11/2028	25,141	0.00
USD 4,000	LABL 6.75% 15/7/2026	3,883	0.00
USD 49,000	LABL 9.5% 1/11/2028	49,086	0.00
USD 48,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	44,235	0.00
USD 4,000	Ladder Capital Finance LLLP / Ladder Capital Finance 5.25% 1/10/2025	3,939	0.00
USD 5,000	Lamar Media 4% 15/2/2030	4,466	0.00
USD 81,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	78,360	0.01
USD 37,000	LCM Investments II 4.875% 1/5/2029	33,279	0.00
USD 21,000	Legacy LifePoint Health 4.375% 15/2/2027	19,509	0.00
USD 20,000	Legends Hospitality Co / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	19,900	0.00
USD 98,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	100,450	0.01
USD 76,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	49,400	0.00
USD 17,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	17,574	0.00
USD 70,000	Level 3 Financing 10.5% 15/5/2030	72,363	0.01
USD 34,000	Levi Strauss 3.5% 1/3/2031	29,411	0.00
USD 11,000	LGI Homes 8.75% 15/12/2028	11,472	0.00
USD 57,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	56,548	0.00
USD 19,000	LifePoint Health 9.875% 15/8/2030	19,730	0.00
USD 61,000	LifePoint Health 11% 15/10/2030	64,584	0.00
USD 31,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	31,154	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 28,000	Lindblad Expeditions 9% 15/5/2028	29,625	0.00
USD 21,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029*	15,756	0.00
USD 21,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	19,214	0.00
USD 43,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	40,888	0.00
USD 7,000	Live Nation Entertainment 5.625% 15/3/2026	6,921	0.00
USD 121,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	121,997	0.01
USD 169,000	Lowe' s 3.35% 1/4/2027	161,213	0.01
USD 3,240,000	Lowe' s 4.4% 8/9/2025	3,202,623	0.20
USD 34,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	20,641	0.00
USD 980,000	LYB International Finance III 1.25% 1/10/2025	916,223	0.06
USD 7,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	6,875	0.00
USD 56,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	55,484	0.00
USD 29,000	Matador Resources 6.875% 15/4/2028	29,529	0.00
USD 103,000	Match II 4.625% 1/6/2028	96,151	0.01
USD 314,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	317,949	0.02
EUR 1,270,000	McDonald' s 3.625% 28/11/2027*	1,381,420	0.09
USD 137,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	122,392	0.01
USD 160,000	Medline Borrower 5.25% 1/10/2029	148,105	0.01
USD 48,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	46,228	0.00
USD 48,000	ModivCare 5.875% 15/11/2025	46,658	0.00
USD 87,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	81,146	0.01
EUR 100,000	Morgan Stanley 0.406% 29/10/2027	99,301	0.01
USD 2,286,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	2,117,746	0.13
USD 1,142,000	Morgan Stanley 5.123% 1/2/2029	1,135,737	0.07
USD 3,485,000	Morgan Stanley 5.164% 20/4/2029	3,469,649	0.22
USD 2,154,000	Morgan Stanley 5.449% 20/7/2029	2,167,406	0.14
USD 4,970,000	Morgan Stanley Bank 4.952% 14/1/2028	4,949,455	0.31
USD 12,559	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014- C18 3.621% 15/10/2047	12,526	0.00
USD 6,616,709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015- C20 3.249% 15/2/2048	6,463,610	0.40
USD 2,625,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015- C25 3.372% 15/10/2048	2,547,845	0.16
USD 4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015- C25 3.635% 15/10/2048	4,051,245	0.25
USD 7,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015- C26 3.252% 15/10/2048	6,806,540	0.42
USD 1,436,046	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016- C30 2.729% 15/9/2049	1,397,540	0.09
USD 3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016- C31 3.102% 15/11/2049	2,785,547	0.17
USD 193,000	MPLX 1.75% 1/3/2026	180,136	0.02
USD 1,234,000	MPLX 4.25% 1/12/2027	1,195,357	0.07
USD 2,668,000	MPLX 4.875% 1/6/2025	2,645,468	0.17
USD 19,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	14,129	0.00
USD 29,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	25,874	0.00
USD 21,000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	18,987	0.00
USD 43,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	42,718	0.00
USD 21,000	Nabors Industries 9.125% 31/1/2030	21,546	0.00
EUR 1,280,000	National Grid North America 4.151% 12/9/2027	1,403,491	0.09
USD 875,000	National Rural Utilities Cooperative Finance 1.875% 7/2/2025	847,660	0.05
USD 109,000	Nationstar Mortgage 5% 1/2/2026	105,954	0.01
USD 46,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	45,237	0.00
USD 45,000	Navient 6.75% 15/6/2026	45,203	0.00
USD 36,000	Navient 9.375% 25/7/2030	37,735	0.00
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,700,634	0.11
USD 348,268	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 6.332% 15/11/2068	346,354	0.02
USD 246,932	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D 3.01% 15/12/2059	232,738	0.01
USD 152,078	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	149,083	0.01
USD 27,000	NCR Atleos 9.5% 1/4/2029	28,578	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 37,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	34,764	0.00
USD 44,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	43,302	0.00
USD 284,600	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3.25% 25/9/2056	258,683	0.02
USD 1,396,429	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1,322,770	0.08
USD 2,000,000	Newell Brands 5.2% 1/4/2026	1,937,332	0.12
USD 10,000	Newfold Digital 11.75% 15/10/2028	10,870	0.00
USD 8,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	7,600	0.00
USD 175,000	NextEra Energy Capital 1.875% 15/1/2027	159,832	0.01
USD 274,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	240,328	0.02
USD 229,000	NextEra Energy Capital 3.55% 1/5/2027	218,123	0.01
USD 125,000	NextEra Energy Capital 4.625% 15/7/2027	123,096	0.01
USD 235,000	NextEra Energy Capital 4.9% 28/2/2028	233,420	0.01
USD 1,411,000	NextEra Energy Capital 5.749% 1/9/2025	1,418,702	0.09
USD 27,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	26,690	0.00
USD 18,000	NextEra Energy Operating Partners 7.25% 15/1/2029	18,286	0.00
USD 175,000	NFP 4.875% 15/8/2028	174,342	0.01
USD 55,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 8.125% 15/2/2029	55,581	0.00
USD 314,000	NiSource 3.49% 15/5/2027	299,438	0.02
USD 3,304,000	NiSource 5.25% 30/3/2028	3,324,832	0.21
USD 1,434,000	Nissan Motor Acceptance 2% 9/3/2026	1,322,647	0.08
USD 102,000	Nissan Motor Acceptance 7.05% 15/9/2028	106,329	0.01
USD 836,000	Norfolk Southern 3.8% 1/8/2028	801,212	0.05
USD 14,000	Northern Oil & Gas 3.625% 15/4/2029	15,978	0.00
USD 119,000	Northern Oil & Gas 8.125% 1/3/2028	120,318	0.01
USD 71,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	68,211	0.00
USD 253,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	235,027	0.01
USD 64,000	Novelis 4.75% 30/1/2030	58,464	0.00
USD 8,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	7,893	0.00
USD 11,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	10,900	0.00
USD 118,000	Occidental Petroleum 3.4% 15/4/2026	112,943	0.01
USD 289,000	Occidental Petroleum 5.55% 15/3/2026	290,488	0.02
USD 3,120,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	3,369,830	0.21
USD 8,000	Oceaneering International 6% 1/2/2028	7,777	0.00
USD 126,000	Oncor Electric Delivery 4.3% 15/5/2028	123,046	0.01
USD 740,000	ONE Gas 1.1% 11/3/2024	739,260	0.05
USD 7,000	OneMain Finance 4% 15/9/2030	5,900	0.00
USD 83,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	82,524	0.01
USD 6,000	OneMain Finance 6.875% 15/3/2025	6,065	0.00
USD 24,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	24,401	0.00
USD 38,000	OneMain Finance 7.875% 15/3/2030	38,652	0.00
USD 35,000	OneMain Finance 9% 15/1/2029	36,862	0.00
USD 987,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	921,171	0.06
USD 198,000	ONEOK 4.35% 15/3/2029	191,232	0.01
USD 591,000	ONEOK 4.55% 15/7/2028	578,163	0.04
USD 2,237,000	ONEOK 5.55% 1/11/2026	2,256,732	0.14
USD 1,138,000	ONEOK 5.65% 1/11/2028	1,161,834	0.07
USD 6,882,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	6,400,004	0.40
USD 147,000	Oracle 2.65% 15/7/2026	138,674	0.01
USD 285,000	Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	261,288	0.02
USD 21,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	18,716	0.00
USD 2,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	1,767	0.00
USD 108,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	103,494	0.01
USD 492,000	Pacific Gas and Electric 3.45% 1/7/2025	478,243	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 575,000	Parker-Hannifin 2.7% 14/6/2024	570,207	0.04
USD 59,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	54,202	0.00
USD 17,000	PBF / PBF Finance 7.875% 15/9/2030	17,410	0.00
USD 535,000	PeaceHealth Obligated 1.375% 15/11/2025	497,664	0.03
USD 26,000	PennyMac Financial Services 7.875% 15/12/2029	26,667	0.00
USD 34,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	33,034	0.00
USD 606,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.2% 15/11/2025	563,517	0.04
USD 1,285,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.7% 15/6/2026	1,182,063	0.07
USD 359,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	351,046	0.02
USD 166,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.4% 1/7/2027	161,204	0.01
USD 200,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.45% 29/1/2026	195,235	0.01
USD 6,000	Performance Food 4.25% 1/8/2029	5,461	0.00
USD 43,000	Performance Food 5.5% 15/10/2027	42,112	0.00
USD 10,000	Permian Resources Operating 5.875% 1/7/2029	9,775	0.00
USD 76,000	Permian Resources Operating 7.75% 15/2/2026	76,979	0.01
USD 39,000	Permian Resources Operating 8% 15/4/2027	40,287	0.00
USD 1,136,000	PG&E 5.25% 1/7/2030	1,068,897	0.07
USD 544,000	Philip Morris International 4.875% 13/2/2026	541,888	0.03
USD 2,534,000	Philip Morris International 5.125% 15/11/2024	2,527,645	0.16
USD 287,000	Philip Morris International 5.125% 17/11/2027	287,844	0.02
USD 175,000	Piedmont Natural Gas 3.5% 1/6/2029	161,397	0.01
USD 1,676,000	Pioneer Natural Resources 1.125% 15/1/2026	1,556,725	0.10
USD 1,025,000	Pioneer Natural Resources 5.1% 29/3/2026	1,024,327	0.06
USD 6,000	Playtika 4.25% 15/3/2029	5,069	0.00
USD 6,000	Post 4.625% 15/4/2030	5,467	0.00
USD 20,000	Prairie Acquiror 9% 1/8/2029	20,149	0.00
USD 6,000	Presidio 4.875% 1/2/2027	5,771	0.00
USD 3,000	Prime Healthcare Services 7.25% 1/11/2025	2,994	0.00
USD 4,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	3,998	0.00
USD 51,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	50,666	0.00
USD 45,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	44,584	0.00
USD 39,000	PTC 3.625% 15/2/2025	38,161	0.00
USD 277,000	Public Storage Operating 5.125% 15/1/2029	280,663	0.02
USD 59,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	46,137	0.00
USD 15,000	Raising Cane's Restaurants 9.375% 1/5/2029	15,982	0.00
USD 40,000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4.875% 1/11/2026	38,409	0.00
USD 231,000	Realty Income 0.75% 15/3/2026	210,921	0.01
USD 104,000	Realty Income 4.125% 15/10/2026	101,316	0.01
USD 197,000	Realty Income 4.875% 1/6/2026	195,640	0.01
USD 263,000	Realty Income 5.05% 13/1/2026	262,015	0.02
USD 60,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	55,662	0.00
USD 45,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	43,015	0.00
USD 29,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 7.25% 15/7/2028	29,766	0.00
USD 8,000	Ritchie Bros 6.75% 15/3/2028	8,168	0.00
USD 82,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	77,148	0.01
USD 12,000	Rockcliff Energy II 5.5% 15/10/2029	11,042	0.00
USD 100,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	92,112	0.00
USD 16,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	14,966	0.00
USD 13,000	RXO 7.5% 15/11/2027	13,436	0.00
USD 11,000	Ryan Specialty 4.375% 1/2/2030	10,204	0.00
USD 207,000	Ryder System 1.75% 1/9/2026	189,890	0.01
USD 2,043,000	Ryder System 2.85% 1/3/2027	1,916,494	0.12
USD 198,000	Ryder System 2.9% 1/12/2026	186,489	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,500,000	Ryder System 3.65% 18/3/2024	1,496,393	0.09
USD 141,000	Ryder System 4.3% 15/6/2027	137,484	0.01
USD 593,000	Sabine Pass Liquefaction 5% 15/3/2027	589,191	0.04
USD 5,328,000	Sabine Pass Liquefaction 5.625% 1/3/2025	5,325,062	0.33
USD 297,000	Sabine Pass Liquefaction 5.75% 15/5/2024	296,837	0.02
USD 54,000	Sabre GBLB 8.625% 1/6/2027	47,790	0.00
USD 2,000	Sabre GBLB 11.25% 15/12/2027	1,884	0.00
USD 377,000	San Diego Gas & Electric 4.95% 15/8/2028	377,031	0.02
USD 63,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	55,800	0.00
USD 68,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	64,156	0.00
USD 10,000	Scientific Games/Scientific Games US FinCo 6.625% 1/3/2030	9,357	0.00
USD 5,000	Scotts Miracle-Gro 4.5% 15/10/2029	4,450	0.00
USD 40,000	Sealed Air 4% 1/12/2027	37,173	0.00
USD 3,000	Sealed Air 5% 15/4/2029	2,841	0.00
USD 14,000	Sealed Air Corp/Sealed Air US 6.125% 1/2/2028	13,971	0.00
USD 1,512,139	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3.5% 25/8/2057	1,419,996	0.09
USD 2,594,736	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2,356,454	0.15
USD 702,000	Sempra 3.3% 1/4/2025	686,376	0.04
USD 8,000	Sensata Technologies 4.375% 15/2/2030	7,291	0.00
USD 98,500	Sequoia Mortgage Trust 2017- CHI 3.5% 25/8/2047	90,135	0.01
USD 15,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	15,182	0.00
USD 735,350	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	716,958	0.04
USD 72,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	69,071	0.01
USD 10,000	Simon Property 3.3% 15/1/2026	9,658	0.00
USD 24,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	22,403	0.00
USD 9,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	8,114	0.00
USD 56,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	53,439	0.00
USD 39,000	Sitio Royalties Operating Partnership / Sitio Finance 7.875% 1/11/2028	40,031	0.00
USD 93,000	Six Flags Entertainment 5.5% 15/4/2027	91,098	0.01
USD 25,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	25,020	0.00
USD 26,000	SLM 3.125% 2/11/2026	23,910	0.00
USD 3,874,230	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 5.956% 15/12/2038	3,815,841	0.24
USD 2,742,231	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5.976% 15/6/2039	2,686,731	0.17
USD 2,880,025	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5.936% 15/6/2039	2,797,331	0.17
USD 1,534,768	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5.916% 15/12/2039	1,496,527	0.09
USD 736,257	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 5.886% 16/12/2041	725,871	0.05
USD 3,215,765	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 10.182% 15/10/2041	3,459,585	0.21
USD 691,230	SLM Student Loan Trust 2013- 4 5.986% 25/6/2043	684,230	0.04
USD 15,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	15,054	0.00
USD 3,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	2,984	0.00
USD 44,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	43,778	0.00
USD 754,496	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 6.332% 15/9/2034	753,528	0.05
USD 481,801	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 6.182% 15/10/2035	477,274	0.03
USD 170,290	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 3.44% 15/7/2036	164,181	0.01
USD 349,354	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 6.262% 15/9/2037	346,856	0.02
USD 3,236,212	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1.6% 15/9/2054	2,935,776	0.18
USD 907,789	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.31% 15/1/2053	845,578	0.05
USD 1,184,619	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 6.162% 15/1/2053	1,150,423	0.07
USD 2,092,389	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1.39% 15/1/2053	1,855,157	0.12
USD 3,861,798	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 6.775% 16/2/2055	3,881,793	0.24
USD 1,743,185	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	1,691,436	0.10
USD 1,675,720	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 7.175% 16/5/2050	1,694,434	0.11
USD 8,653,893	SMB Private Education Loan Trust 2022-D 7.125% 15/10/2058	8,780,785	0.54

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 151,000	Smyrna Ready Mix Concrete 6% 1/11/2028	146,680	0.01
USD 591,869	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2.65% 25/9/2040	569,485	0.04
USD 497,893	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	484,919	0.03
USD 874,838	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.34% 25/8/2047	854,300	0.05
USD 950,930	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 3.59% 25/1/2048	923,037	0.06
USD 899,833	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 3.6% 25/2/2048	872,347	0.05
USD 1,375,000	Solventum 5.4% 1/3/2029	1,374,139	0.09
USD 109,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	99,935	0.01
USD 219,000	Sotheby's 7.375% 15/10/2027	210,861	0.01
USD 23,883	Soundview Home Loan Trust 2003-2 6.735% 25/11/2033	23,865	0.00
USD 2,466,000	Southern 4.475% 1/8/2024	2,452,063	0.15
USD 240,000	Southern California Edison 5.65% 1/10/2028	246,390	0.02
USD 23,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	22,569	0.00
USD 878,000	Spectra Energy Partners 3.5% 15/3/2025	860,554	0.05
USD 55,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	59,478	0.00
USD 48,000	Spirit AeroSystems 9.75% 15/11/2030	51,480	0.00
USD 2,894,000	Sprint 7.125% 15/6/2024	2,902,410	0.18
USD 858,000	Sprint 7.625% 1/3/2026	887,331	0.06
USD 798,438	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/3/2025	793,252	0.05
USD 139,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	128,781	0.01
USD 147,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	143,201	0.01
USD 37,000	Standard Industries 4.375% 15/7/2030	33,022	0.00
USD 31,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	29,364	0.00
USD 175,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	168,647	0.01
USD 100,000	Star Parent 9% 1/10/2030	105,474	0.01
USD 11,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	10,308	0.00
USD 46,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	42,825	0.00
USD 12,000	STL 8.75% 15/2/2029	12,289	0.00
USD 44,000	Summit Materials / Summit Materials Finance 7.25% 15/1/2031	45,671	0.00
USD 22,000	Sunoco / Sunoco Finance 7% 15/9/2028	22,528	0.00
USD 34,000	Synaptics 4% 15/6/2029	30,006	0.00
USD 15,000	Talen Energy Supply 8.625% 1/6/2030	15,839	0.00
USD 15,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5.5% 15/1/2028	14,230	0.00
USD 9,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8,850	0.00
USD 52,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 7.375% 15/2/2029	51,847	0.00
USD 20,000	Talos Production 9% 1/2/2029	20,430	0.00
USD 17,000	Talos Production 9.375% 1/2/2031	17,561	0.00
USD 2,196,000	Targa Resources 5.2% 1/7/2027	2,186,267	0.14
USD 25,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	24,841	0.00
USD 101,000	TCI Communications 7.125% 15/2/2028	109,166	0.01
USD 4,000	TEGNA 4.75% 15/3/2026	3,865	0.00
USD 72,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	67,227	0.00
USD 74,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	65,969	0.01
USD 80,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	75,989	0.01
USD 52,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	51,974	0.00
USD 7,000	Tenet Healthcare 6.125% 1/10/2028	6,898	0.00
USD 30,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	29,725	0.00
USD 20,000	Tenneco 8% 17/11/2028	18,162	0.00
USD 1,168,135	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4.265% 1/8/2034	1,129,838	0.07
EUR 113,000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025*	120,457	0.01
USD 272,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	261,543	0.02
USD 136,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	126,453	0.01
USD 88,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	78,513	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,475,000	T-Mobile USA 2.25% 15/2/2026	3,273,240	0.20
USD 2,181,000	T-Mobile USA 2.625% 15/4/2026	2,064,672	0.13
USD 2,455,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	2,355,975	0.15
USD 1,895,000	T-Mobile USA 4.85% 15/1/2029	1,874,647	0.12
USD 1,015,000	Truist Financial 5.435% 24/1/2030	1,005,664	0.06
USD 4,392,000	Truist Financial 6.047% 8/6/2027	4,437,613	0.28
USD 40,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	41,154	0.00
USD 86,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	76,544	0.01
USD 32,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	29,908	0.00
USD 227,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	227,565	0.01
USD 3,189,404	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3.225% 15/8/2050	2,982,170	0.18
USD 4,151,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3.212% 15/11/2050	3,886,414	0.24
USD 310,000	UKG 6.875% 1/2/2031	313,322	0.02
USD 93,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	85,685	0.01
USD 730,744	United Airlines 2020-I Class A Pass Through Trust 5.875% 15/10/2027	738,128	0.05
USD 122,320	United Airlines 2020-I Class B Pass Through Trust 4.875% 15/1/2026	120,599	0.01
USD 7,000	United Natural Foods 6.75% 15/10/2028	5,839	0.00
USD 61,330,000	United States Treasury Note/Bond 3.5% 15/4/2026*	60,297,452	3.73
USD 7,060,000	United States Treasury Note/Bond 3.625% 15/5/2026	6,922,109	0.43
USD 80,465,000	United States Treasury Note/Bond 3.875% 15/1/2026*	79,336,604	4.91
USD 36,645,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025*	36,206,978	2.24
USD 29,680,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/2/2026*	29,332,187	1.81
USD 32,190,000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/6/2026	31,899,535	1.97
USD 41,020,000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/1/2027	40,550,513	2.51
USD 13,285,000	United States Treasury Note/Bond 4.125% 15/2/2027	13,178,097	0.81
USD 20,955,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/10/2025	20,791,289	1.29
USD 36,010,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/12/2026	35,946,701	2.22
USD 19,295,000	United States Treasury Note/Bond 4.5% 15/8/2026	19,235,457	1.19
USD 34,125,000	United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/3/2026	34,135,664	2.11
USD 46,620,000	United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/9/2026	46,762,046	2.89
USD 22,340,000	United States Treasury Note/Bond 4.625% 15/11/2026	22,429,884	1.39
USD 51,100,000	United States Treasury Note/Bond 4.75% 15/7/2026*	51,078,043	3.16
USD 47,492,000	United States Treasury Note/Bond 4.75% 15/10/2026	47,661,747	2.95
USD 126,000	Uniti Group / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	130,851	0.01
USD 59,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	57,216	0.00
USD 15,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030	14,497	0.00
USD 102,000	Univision Communications 8% 15/8/2028	102,027	0.01
USD 1,105,000	US Bancorp 5.384% 23/1/2030	1,099,856	0.07
USD 19,000	US Foods 6.875% 15/9/2028	19,315	0.00
USD 170,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	169,648	0.01
USD 3,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/9/2027	2,984	0.00
USD 46,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	46,033	0.00
USD 464,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	415,031	0.03
USD 154,000	Venture Global LNG 8.125% 1/6/2028	156,537	0.01
USD 290,000	Venture Global LNG 9.5% 1/2/2029	309,358	0.02
USD 536,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	478,220	0.03
USD 150,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	141,563	0.01
USD 1,329,000	Verizon Communications 4.329% 21/9/2028	1,292,644	0.08
USD 93,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	85,710	0.01
USD 12,000	Viasat 5.625% 15/9/2025	11,619	0.00
USD 90,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	84,680	0.01
USD 2,611,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	2,564,302	0.16
USD 6,065,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 15/6/2025	5,967,657	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 1,696,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,576,554	0.10
USD 5,425,000	Viper Energy 7.375% 1/11/2031	5,590,925	0.35
USD 1,487,000	Virginia Electric and Power 3.75% 15/5/2027	1,431,290	0.09
USD 90,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	88,288	0.01
USD 33,000	Vital Energy 9.75% 15/10/2030	35,351	0.00
USD 30,000	Vital Energy 10.125% 15/1/2028	31,414	0.00
USD 2,566,000	VMware 1.4% 15/8/2026	2,335,681	0.14
USD 52,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	47,623	0.00
USD 8,000	Walgreens Boots Alliance 3.2% 15/4/2030	6,930	0.00
USD 2,000	Waste Pro USA 5.5% 15/2/2026	1,961	0.00
USD 317,000	WEC Energy 5.6% 12/9/2026	320,290	0.02
USD 2,030,000	Wells Fargo 5.198% 23/1/2030	2,015,450	0.13
USD 5,000,000	Wells Fargo 5.574% 25/7/2029	5,037,922	0.31
USD 1,275,000	Wells Fargo 6.303% 23/10/2029	1,326,007	0.08
USD 5	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014- LC16 3.477% 15/8/2050	5	0.00
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015- NXS1 3.148% 15/5/2048	1,530,030	0.10
USD 563,000	Welltower 4% 1/6/2025	553,046	0.04
USD 21,000	WESCO Distribution 6.375% 15/3/2029	21,020	0.00
USD 19,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	19,407	0.00
USD 760,000	Western Midstream Operating 6.35% 15/1/2029	784,549	0.05
USD 22,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	21,689	0.00
USD 310,000	Williams 4.3% 4/3/2024	310,000	0.02
USD 7,302,000	Williams 5.4% 2/3/2026	7,323,144	0.45
USD 73,000	Williams Scotsman 6.125% 15/6/2025	72,714	0.01
USD 10,000	Windstream Escrow / Windstream Escrow Finance 7.75% 15/8/2028	9,334	0.00
USD 1,244,000	Workday 3.5% 1/4/2027	1,186,897	0.07
USD 154,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	146,451	0.01
USD 14,000	WR Grace 7.375% 1/3/2031	14,134	0.00
USD 62,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	58,552	0.00
USD 34,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.125% 15/2/2031	35,131	0.00
USD 14,000	Yum! Brands 4.75% 15/1/2030	13,225	0.00
USD 338,000	Zayo 4% 1/3/2027	281,551	0.02
USD 77,000	ZoomInfo Technologies/ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	69,031	0.00
		1,253,616,489	77.55
債券合計		1,538,815,148	95.21
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 2,250,000	HSBC USA 0% 24/6/2024	2,210,267	0.14
USD 5,000,000	HSBC USA 0% 22/8/2024	4,864,993	0.30
USD 5,000,000	HSBC USA 0% 11/10/2024	4,826,549	0.30
コマーシャル・ペーパー合計		11,901,809	0.74
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,550,716,957	95.95

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 (%)
債券			
	米国		
USD 52,807	Level 3 11% 15/11/2029	52,807	0.00
債券合計		52,807	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		52,807	0.00
投資有価証券合計		1,550,769,764	95.94
その他の純資産		65,667,454	4.06
純資産合計(米ドル)		1,616,437,218	100.00

* 当該有価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 2024年2月29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	102,461	USD	95,000	BNY Mellon	20/3/2024	676
EUR	5,067,330	USD	4,678,000	Morgan Stanley	20/3/2024	11,313
USD	35,525,000	GBP	45,025,344	State Street	20/3/2024	1,665
USD	73,676,000	EUR	80,833,399	UBS	20/3/2024	847,486
USD	6,212,000	GBP	7,891,265	Deutsche Bank	20/3/2024	18,298
USD	13,252,000	EUR	14,409,948	Deutsche Bank	20/3/2024	22,992
USD	2,290,000	EUR	2,454,987	BNY Mellon	20/3/2024	(31,138)
USD	137,000	EUR	147,613	Nomura	20/3/2024	(1,120)
USD	1,360,000	GBP	1,717,257	UBS	20/3/2024	(6,380)
未実現純評価益						863,792
オンショア中国人民元ヘッジ投資証券クラス						
CNY	253,330	USD	1,823,887	BNY Mellon	15/3/2024	-
未実現純評価損						(0)
ユーロ・ヘッジ投資証券クラス						
EUR	212,836,714	USD	197,602,956	BNY Mellon	15/3/2024	1,644,789
USD	22,648,007	EUR	24,555,702	BNY Mellon	15/3/2024	(26,891)
未実現純評価益						1,617,898
シンガポール・ドル・ヘッジ投資証券クラス						
SGD	6,214,434	USD	8,350,077	BNY Mellon	15/3/2024	5,184
USD	542,478	SGD	403,979	BNY Mellon	15/3/2024	(89)
未実現純評価益						5,095
未実現純評価益合計						2,486,785

2024年10月21日

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 2024年2月29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)
(184)	EUR	Euro BOBL	2024年3月	295,610
4	EUR	Euro Bund	2024年3月	868
(12)	EUR	Euro Schatz	2024年3月	10,150
(56)	USD	US Long Bond (CBT)	2024年6月	(86,624)
(218)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2024年6月	(77,433)
(315)	USD	US Ultra 10 Year Note	2024年6月	(106,609)
(11)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2024年6月	(22,349)
2,318	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2024年6月	(571,922)
(1,713)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2024年6月	(78,797)
合計				(637,106)

スワップ 2024年2月29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 25,250,000	ファンドはCDX.NA.IG.41.V1に係る デフォルト・プロテクションを受け取り、 1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2028	(146,875)	(520,964)
IRS	JPY 5,695,109,060	ファンドは1日JPY-TONA-OIS Compoundに係る 変動金利を受け取り、0.229%の固定金利を支払う	Bank of America	24/11/2025	3,909	3,909
合計					(142,966)	(517,055)

CDS：クレジット・デフォルト・スワップ

IRS：金利スワップ

事後通告証券契約 2024年2月29日現在

保有高	摘要	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
TBA	米国		
USD 16,335,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	15,476,124	0.95
TBA合計		15,476,124	0.95