

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2023年3月27日>

新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号

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/内外/債券	
信託期間	2015年3月25日から2025年3月25日までです。	
運用方針	投資信託証券を主要投資対象として、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	投資信託証券
	ピムコ・パミュダ・インカム・ファンド AクラスS (JPY)	ピムコ・パミュダ・インカム・ファンド (M)
	D I A M マネー マザー ファンド	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産
運用方法	以下の投資信託証券を通じて、世界の様々な債券(デリバティブを含む)などに市場動向などを踏まえ機動的に投資を行うことで、安定的な収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。 パミュダ籍外国投資信託 ピムコ・パミュダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY) (以下「インカム・ファンド」といいます。) 円建受益証券 内国証券投資信託(親投資信託) D I A M マネー マザー ファンド受益証券 各投資信託証券への投資割合は、資金動向や市況動向等を勘案して決定するものとし、インカム・ファンドの組入比率は、原則として高位とすることを基本とします。 インカム・ファンドへの投資に係る指図権限を、ピムコジャパンリミテッドに委託します。	
組入制限	新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	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。)以外には投資を行いません。
	D I A M マネー マザー ファンド	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。外貨建て資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額は、基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号」は、2023年3月27日に第8期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			投資信託 組入比率	債券 組入比率	純資産 総額
		税金 込み	騰落 率	中期 騰落 率			
4期 (2019年3月25日)	円 10,003	円 40	% 0.4	% 97.5	% -	百万円 8,292	
5期 (2020年3月25日)	9,018	0	△9.8	97.2	0.0	5,851	
6期 (2021年3月25日)	10,001	475	16.2	96.8	-	4,933	
7期 (2022年3月25日)	9,567	0	△4.3	97.0	0.0	4,116	
8期 (2023年3月27日)	8,982	0	△6.1	97.6	0.0	3,659	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

(注4) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		投資信託 組入比率	債券 組入比率
	騰落率	騰落率		
(期首) 2022年3月25日	円 9,567	% -	% 97.0	% 0.0
3月末	9,614	0.5	97.2	0.0
4月末	9,364	△2.1	97.7	0.0
5月末	9,368	△2.1	98.3	0.0
6月末	9,020	△5.7	97.5	0.0
7月末	9,247	△3.3	98.2	0.0
8月末	9,188	△4.0	97.3	0.0
9月末	8,793	△8.1	97.0	0.0
10月末	8,821	△7.8	97.6	0.0
11月末	8,956	△6.4	98.0	0.0
12月末	8,964	△6.3	98.1	0.0
2023年1月末	9,138	△4.5	97.0	0.0
2月末	8,933	△6.6	97.3	0.0
(期末) 2023年3月27日	8,982	△6.1	97.6	0.0

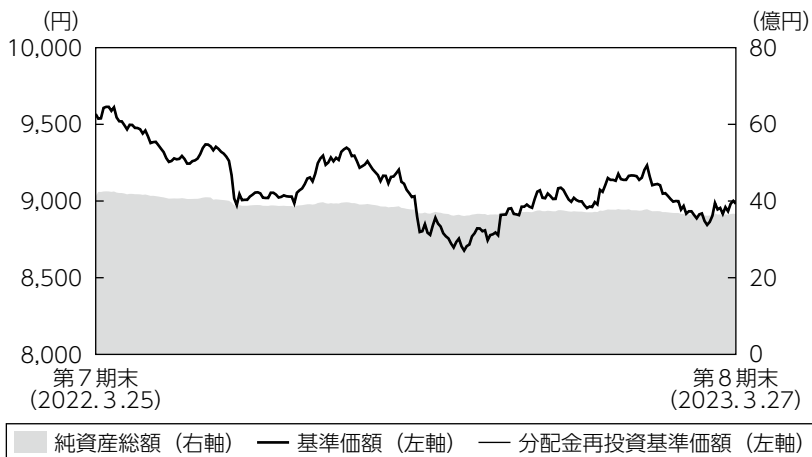
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 「投資信託受益証券組入比率」にはマザーファンドの比率を含みません。

■当期の運用経過（2022年3月26日から2023年3月27日まで）

基準価額等の推移



第8期首： 9,567円
第8期末： 8,982円
(既払分配金0円)
騰落率： △6.1%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

バミューダ籍外国投資信託「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)」(以下「インカム・ファンド」) 円建受益証券への投資を通じて、世界で発行されているさまざまな債券などに実質的に投資を行った結果、基準価額 (税引前分配金再投資ベース) は下落しました。保有する債券の利金収入などが上昇要因となった一方で、金利上昇などが下落要因となり下落しました。

投資環境

米国国債利回りは、インフレ加速に対する懸念が高まるなか、F R B（米連邦準備理事会）による金融引締めが意識されたことなどから、2022年6月中旬にかけて上昇しました。8月以降も利上げ継続姿勢が示されたことなどから上昇基調で推移しましたが、期末にかけては景気減速に対する懸念の高まりなどから上昇幅を一部縮小しました。

ドイツ国債利回りは、米国国債利回りと同様に、域内のインフレ加速などを背景にE C B（欧州中央銀行）による金融政策の早期正常化観測が高まったことなどから、上昇しました。8月以降もE C Bが大幅利上げを決定し、利上げを継続する方針を示したことなどから上昇基調を継続しました。

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

インカム・ファンドを通じて「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M) 」 (以下「インカム・ファンド (M) 」) 米ドル建受益証券を実質的に高位に組み入れました。また、D I A Mマネーマザーファンドの組み入れを継続しました。

●インカム・ファンド

当ファンドは世界で発行されているさまざまな債券などに実質的に投資し、あらゆる市場局面において最適な資産配分を追求することで安定的な収益確保を目指しました。金利戦略では市場環境に応じ機動的に金利リスクを調整しました。セクター (債券種別) 戦略では、モーゲージ証券 (非政府系) など相対的に魅力的な利回りを有する資産へ投資したほか、リスクオフ時にも安定した値動きが期待される債券に投資しました。尚、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行いました。



※基準価額は、当作成期間における分配金を再投資したものとみなして計算しています。

●D I A Mマネーマザーファンド

残存期間の短い国債などで運用を行いました。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2022年3月26日 ～2023年3月27日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	133円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」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。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「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・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

さまざまな債券市場や為替市場および資金動向などを考慮しながら、安定した収益の確保を目指し、インカム・ファンドを通じてインカム・ファンド（M）を実質的に高位に組み入れる方針です。また、国内短期金融市場や資金動向に留意しつつ、D I AMマネーマザーファンドの組み入れを継続します。

●インカム・ファンド

欧州での天然ガス価格の下落や中国のゼロコロナ政策の終了などが景気の下支えとなり、先進国が2023年中に景気後退に入る可能性は低下したものの、その後の景気後退リスクは依然として高いとみており、投資においては引き続き慎重なスタンスで臨む必要があると考えています。

今後の運用戦略についてはマクロ経済見通しをもとにリスクの調整を意識しつつ、高い利回りの資産への投資とポートフォリオを安定化させる低リスク資産への投資とのバランスを市場動向を見据えつつ柔軟に調整していく方針です。

●D I AMマネーマザーファンド

大規模な金融緩和を推進した黒田日銀総裁が本年4月に退任する予定です。しかし新体制発足後も当面の急速な金融引き締めは見込みにくく、金融政策は緩和的な状態を維持するものと見られます。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	(2022年3月26日 ～2023年3月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	159円	1.747%	(a) 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9,099円です。
(投信会社)	(96)	(1.051)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(60)	(0.664)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(3)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.003 (0.003)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	159	1.750	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

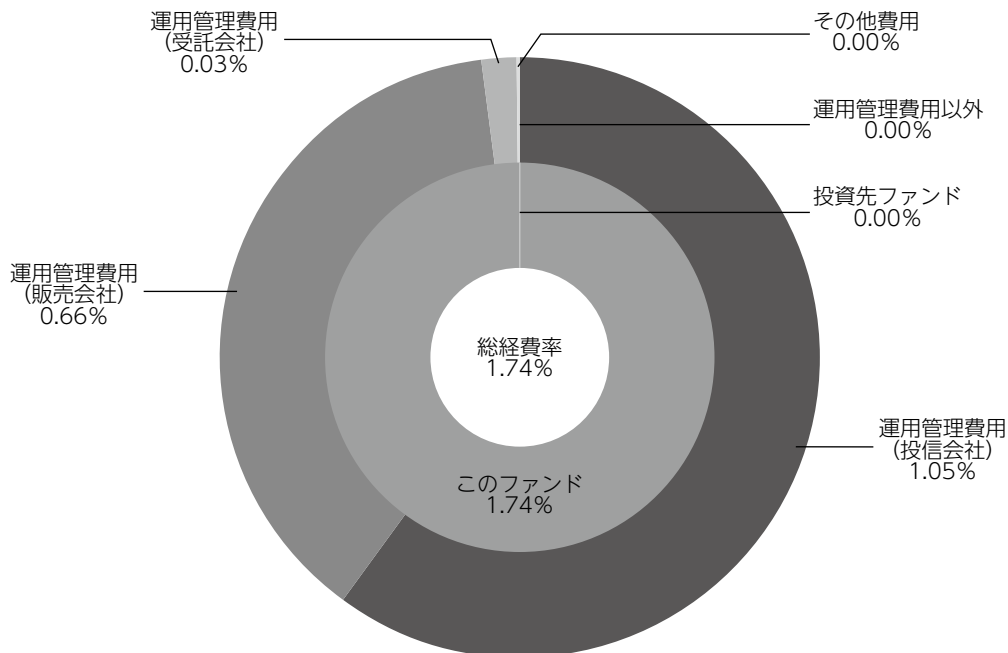
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.74%です。



総経費率 (①+②+③)	1.74%
①このファンドの費用の比率	1.74%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.00%

(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、売買委託手数料およ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、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用および「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS（J P Y）」（以下「インカム・ファンド」という場合があります。）への投資の指図に関する権限の委託を受けた投資顧問会社（ピムコジャパンリミテッド）に対する報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.6%（税抜））が含まれます。

(注6) ②の費用には、直接の投資運用会社報酬などはありません。

(注7) 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8) 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異なります。

■売買及び取引の状況 (2022年3月26日から2023年3月27日まで)

投資信託受益証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 邦 建	千口	千円	千円	千口	千円
ピムコ・バミューダ・インカム・ ファンドA クラスS (JPY)	10.6228437	117,000	27.5051313	291,000	

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況 (2022年3月26日から2023年3月27日まで)

期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■利害関係人との取引状況等 (2022年3月26日から2023年3月27日まで)

【新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.010619	百万円 0.010619	% 100.0	百万円 0.010619	百万円 0.010619	% 100.0

【DIAMマネーマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.028051	百万円 0.028051	% 100.0	百万円 0.028051	百万円 0.028051	% 100.0

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	期首(前期末)	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率
	千□	千□	千円	%
ピムコ・バミューダ・インカム・ ファンドAクラスS(JPY)	361.6199196	344.737632	3,570,792	97.6
合 計	361.6199196	344.737632	3,570,792	97.6

(注) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(2) 親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	
	千□	千□	千円	
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	395	395	397	

■投資信託財産の構成

2023年3月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	3,570,792	96.7
D I A M マ ネ ー マ ザ ー フ ァ ン ド	397	0.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	122,935	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	3,694,125	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年3月27日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,694,125,250円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	122,935,247
投 資 信 託 受 益 証 券(評 価 額)	3,570,792,392
D I A Mマネーマザーファンド(評 価 額)	397,611
(B) 負 債	34,983,192
未 払 解 約 金	2,699,220
未 払 信 託 報 酬	32,229,606
そ の 他 未 払 費 用	54,366
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	3,659,142,058
元 本	4,074,005,433
次 期 繰 越 損 益 金	△414,863,375
(D) 受 益 権 総 口 数	4,074,005,433口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	8,982円

(注) 期首における元本額は4,303,031,692円、当期中における追加設定元本額は142,754,508円、同解約元本額は371,780,767円です。

■損益の状況

当期 自2022年3月26日 至2023年3月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	64,179,192円
受 取 配 当 金	64,218,472
受 取 利 息	823
支 払 利 息	△40,103
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△235,512,083
売 買 損 益	13,947,623
売 買 損 益	△249,459,706
(C) 信 託 報 酬 等	△67,289,960
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△238,622,851
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△127,352,064
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△48,888,460
(配 当 等 相 当 額)	(10,565,616)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△59,454,076)
(G) 合 計(D + E + F)	△414,863,375
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△414,863,375
追 加 信 託 差 損 益 金	△48,888,460
(配 当 等 相 当 額)	(10,565,616)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△59,454,076)
分 配 準 備 積 立 金	43,784,334
繰 越 損 益 金	△409,759,249

(注1) (B)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) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用の指図に係る権限を委託するために要する費用は、当期は25,510,238円で、委託者報酬から支弁しております。

(注5) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	10,565,616
(d) 分 配 準 備 積 立 金	43,784,334
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	54,349,950
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	133.41
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	バミューダ籍外国投資信託／円建受益証券
運 用 方 針	「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)」を通じて、世界のさまざまな債券などに投資を行い、市場環境に合わせて機動的に投資比率を変更することで長期的な収益の獲得およびインカム収益の最大化を目指します。また、原則として、米ドル売り円買いの為替ヘッジを行いますが、為替による収益の獲得を目指して、総資産の10%の範囲で実質的に為替ヘッジを行わない場合があります。
主 な 投 資 制 限	①ポートフォリオの実質的なデュレーションは原則0年～8年の間とします。 ②非投資適格債券への実質投資割合は総資産の50%以内とします。ただし、資産担保証券およびモーゲージ証券についてはこの限りではありません。 ③新興国債券への実質投資割合は総資産の20%以内とします。 ④流動性に欠ける資産への実質投資割合は総資産の15%以内とします。
決 算 日	毎年10月31日
関 係 法 人	受託会社：メイプルズ・トラスティ・サービシーズ (バミューダ) リミテッド 投資顧問会社：パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー 管理事務代行会社兼保管受託銀行：ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・アンド・カンパニー
信 託 報 酬 等	かかりません。
その他の費用・手数料	有価証券の売買手数料などがかかります。
収 益 分 配 方 針	原則として、毎月、分配を行います。

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA クラスS (JPY)」は、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」を構成する個別クラスであり、「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)」に投資しております。

「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA」及び「ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)」は、同ファンドの国籍において一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務諸表が作成され、現地監査人による監査を受けております。

なお、以下は入手しうる直近の現地監査済み財務諸表の原文の一部を委託会社が和訳したものでありますが、あくまで参考和訳であり正確性を保証するものではありません。

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドAの内容

(1) 資産・負債計算書

(単位：受益証券数を除き、千米ドル)

	2022年10月31日現在
資産：	
投資－評価額	
有価証券投資	468,029
関連当事者に係る投資	9,497,093
金融デリバティブ商品	
店頭	49,624
現金	643
取引相手方への預託金	149,552
売却済投資に係る未収金	438
関連当事者に係る売却済投資に係る未収金	8,280
売却済ファンド受益証券に係る未収金	28,378
未収利息および未収配当金	335
	10,202,372
負債：	
金融デリバティブ商品	
店頭	246,926
購入済投資に係る未払金	688
関連当事者に係る購入済投資に係る未払金	20,544
未払利息	655
取引相手方からの預託金	1,290
償還済ファンド受益証券に係る未払金	15,523
運用手数料未払金	450
助言手数料未払金	12
管理手数料未払金	7
代理店手数料未払金	4
販売手数料未払金	69
	286,168
純資産	9,916,204
有価証券投資の取得原価	468,031
関連当事者に係る投資の取得原価	9,636,026

0となっている金額は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(2) 損益計算書

(単位：千米ドル)

	2022年10月31日終了年度
投資収益：	
利息－外国税引後純額*	3,963
配当金－外国税引後純額*	0
雑収入	0
収益合計	3,963
費用：	
助言手数料－クラスW (USD)	188
運用手数料－クラスM (JPY 助言)	547
運用手数料－クラスM (USD 助言)	332
運用手数料－クラスP (JPY)	241
運用手数料－クラスR (USD)	93
運用手数料－クラスT (JPY)	5,769
運用手数料－クラスU (USD)	83
運用手数料－クラスU2 (JPY)	214
運用手数料－クラスX (JPY)	30
管理手数料	0
管理手数料－クラスR (USD)	29
管理手数料－クラスW (USD)	58
販売手数料－クラスM (JPY 助言)	474
販売手数料－クラスM (USD 助言)	288
販売手数料－クラスP (JPY)	241
代理店手数料－クラスM (JPY 助言)	37
代理店手数料－クラスM (USD 助言)	22
支払利息	133
雑費用	12
費用合計	8,791
純投資利益 (損失)	(4,828)
実現純利益 (損失)：	
関連当事者に係る投資	440,185
店頭金融デリバティブ商品	(2,074,947)
外国為替	(2,481)
実現純利益 (損失)	(1,637,243)
未実現利益 (損失) 純変動額：	
有価証券投資	(1)
関連当事者に係る投資	(1,752,599)
店頭金融デリバティブ商品	(4,806)
外貨資産および負債	(100)
未実現損失純変動額	(1,757,506)
純損失	(3,394,749)
営業による純資産の純減少額	(3,399,577)
* 外国源泉徴収税	0

0となっている金額は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(3) 投資有価証券明細表

ピムコ・バミューダ・インカム・ファンドA

2022年10月31日現在

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資 4.7%		
短期金融商品 4.7%		
定期預金 4.7%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd. 2.580% due 11/01/2022	USD 72,714	72,714
Bank of Nova Scotia 2.580% due 11/01/2022	5,987	5,987
Brown Brothers Harriman & Co. 2.580% due 11/01/2022	39	39
Citibank N.A. 2.580% due 11/01/2022	60,870	60,870
DBS Bank Ltd. 2.580% due 11/01/2022	37,928	37,928
JPMorgan Chase Bank N.A. 2.580% due 11/01/2022	81,160	81,160
Royal Bank of Canada 2.580% due 11/01/2022	80,362	80,362
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2.580% due 11/01/2022	61,645	61,645
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd. 2.580% due 11/01/2022	62,794	62,794
		<u>463,499</u>
米国短期国債 0.0%		
2.552% due 11/10/2022 (a)	2,825	2,823
米国資金管理国債 0.0%		
3.278% due 01/10/2023 (a)	1,720	1,707
短期金融商品合計 (取得原価 468,031千米ドル)		<u>468,029</u>
有価証券投資合計 (取得原価 468,031千米ドル)		<u>468,029</u>
	受益証券口数 (単位：千)	
関連当事者に係る投資 95.8%		
その他の投資会社 95.8%		
PIMCO Bermuda Income Fund (M) (取得原価 9,636,026千米ドル)	682,263	9,497,093
関連当事者に係る投資合計 (取得原価 9,636,026千米ドル)		<u>9,497,093</u>
投資合計 100.5%		9,965,122
(取得原価 10,104,057千米ドル)		
金融デリバティブ商品(b) (2.0%)		(197,302)
(取得原価またはプレミアム(純額) 0千米ドル)		
その他の資産および負債(純額) 1.5%		<u>148,384</u>
純資産 100.0%		<u>9,916,204</u>

* 額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示している場合があります。

(a)利率は満期までの利回りです。

(b)金融デリバティブ商品：店頭
為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額 (千通貨)	外貨受取額 (千通貨)	未実現利益 (損失)	
				資産 (千米ドル)	負債 (千米ドル)
BPS	11/2022	JPY 106,684	USD 728	10	0
BPS	11/2022	899,743	6,163	109	0
BPS	11/2022	USD 1,379	JPY 201,334	0	(25)
BPS	11/2022	0	0	0	0
BPS	11/2022	933	136,228	0	(16)
MBC	11/2022	JPY 844,346	USD 5,725	44	0
MBC	11/2022	38,092	258	2	0
MYI	11/2022	1,072,662	7,218	0	0
MYI	11/2022	USD 253	JPY 37,641	0	0
				165	(41)

クラスF (J P Y)、クラスJ (J P Y)、クラスM (J P Y助言)、クラスN (J P Y)、クラスP (J P Y)、
クラスQ (J P Y)、クラスR (J P Y)、クラスS (J P Y)、クラスT (J P Y)、クラスU2 (J P Y)、
クラスX (J P Y)、クラスY (J P Y) およびクラスZ (J P Y) 為替予約契約：

取引相手方	決済月	外貨引渡額 (千通貨)	外貨受取額 (千通貨)	未実現利益 (損失)	
				資産 (千米ドル)	負債 (千米ドル)
BOA	11/2022	JPY 874,671	USD 5,984	99	0
BOA	11/2022	USD 2,687	JPY 399,465	1	0
CBK	11/2022	JPY 10,974,574	USD 75,552	1,716	0
CBK	11/2022	USD 11,727	JPY 1,750,671	52	0
JPM	11/2022	JPY 210,644,904	USD 1,435,595	18,400	0
JPM	12/2022	USD 1,435,595	JPY 209,941,463	0	(18,442)
MBC	11/2022	JPY 253,278,894	USD 1,723,284	19,251	0
MBC	11/2022	USD 2,456,288	JPY 354,314,651	0	(72,498)
MBC	12/2022	1,439,739	211,607,321	0	(11,341)
MYI	11/2022	JPY 93,706	USD 630	0	0
MYI	11/2022	USD 1,013,884	JPY 146,309,231	0	(29,532)
RBC	11/2022	398,620	57,546,962	0	(11,450)
RBC	12/2022	JPY 334,137	USD 2,275	20	0
SCX	11/2022	65,277,116	438,841	0	0
SCX	12/2022	USD 438,481	JPY 65,010,795	0	0
SOG	11/2022	JPY 221,942,790	USD 1,496,893	3,686	0
SOG	12/2022	USD 1,496,893	JPY 221,204,896	0	(3,709)
SSB	11/2022	JPY 57,631,197	USD 387,413	0	(323)
SSB	12/2022	USD 387,413	JPY 57,440,745	325	0
TOR	11/2022	JPY 134,818,267	USD 912,952	5,909	0
TOR	12/2022	USD 912,952	JPY 134,369,643	0	(5,926)
UAG	11/2022	2,901,337	417,318,500	0	(93,664)
				49,459	(246,885)
為替予約契約合計				49,624	(246,926)

(4) 投資有価証券明細表－ピムコ・バミューダ・インカム・ファンド (M)

2022年10月31日現在

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
有価証券投資 127.5%					456	442
バンクローン債務証券 6.0%						
A Advantage Loyalty IP Ltd.					2,666	2,572
8.993% due 04/20/2028	USD	10,503	10,419			
Air Canada				EUR	39,600	37,182
6.421% due 08/11/2028		1,435	1,404			
AmSurg LLC				USD	788	680
1.000% due 04/29/2027 (b)		2,415	2,376			
12.119% due 04/29/2027		13,285	13,069		3,000	2,170
15.744% due 04/28/2028		34,672	31,378			
Avolon TLB Borrower 1 (U.S.) LLC					4,900	4,900
4.989% due 02/12/2027		6,984	6,827			
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV					188	20
5.424% due 06/01/2024		391	387			
Azalea TopCo, Inc.				EUR	3,670	3,053
7.254% due 07/24/2026		827	774			
Caesars Resort Collection LLC				USD	15,150	15,311
6.504% due 12/23/2024		13,214	13,089			
7.254% due 07/21/2025		4,578	4,544	USD	42,246	40,493
Carnival Corp.						
3.975% due 06/30/2025	EUR	11,380	10,746		3,362	3,068
5.877% due 06/30/2025	USD	24,287	22,861			
6.127% due 10/18/2028		7,949	7,311		3,247	3,187
Cengage Learning, Inc.					4,021	3,836
7.814% due 07/14/2026		18,276	16,228			
Charter Communications Operating LLC					23,288	20,039
5.510% due 02/01/2027		5,387	5,302			
Coherent Corp.					792	781
5.878% due 07/02/2029		4,777	4,663		2,271	2,223
CommScope, Inc.					26,146	25,576
7.004% due 04/06/2026		3,880	3,710			
DIRECTV Financing LLC					3,750	2,349
8.754% due 08/02/2027		7,881	7,530			
Hilton Worldwide Finance LLC					5,546	5,507
5.336% due 06/22/2026		9,745	9,588		9,843	9,806
iHeartCommunications, Inc.						
6.754% due 05/01/2026		132,910	125,863		6,802	6,658
Instant Brands Holdings, Inc.						
7.076% due 04/12/2028	USD	2,663	1,819		7,074	7,052
Intelsat Jackson Holdings S.A.						
7.445% due 02/01/2029		18,343	17,724		839	598
Iqvia, Inc.						
3.193% due 03/07/2024	EUR	3,900	3,821		40,918	40,899
Lealand Finance Co. BV						
3.000-4.754% due 06/30/2025	USD	594	318		8,104	7,309
6.754% due 06/28/2024		261	170			
LifePoint Health, Inc.					9,264	7,548
8.165% due 11/16/2025		1,038	922			<u>577,183</u>
Lumen Technologies, Inc.						
6.004% due 03/15/2027		1,158	1,081			
Marriott Ownership Resorts, Inc.						
				社債 21.1%		
				銀行および金融 7.4%		

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		
AGFC Capital Trust I			3.500% due 04/15/2023	EUR	39,300	7,244	
5.829% due 01/15/2067	2,200	1,185	Corsair International Ltd.				
AIB Group PLC			5.473% due 01/28/2027		10,000	9,463	
4.263% due 04/10/2025	1,960	1,870	5.823% due 01/28/2029		4,100	3,840	
Armor Holdco, Inc.			Country Garden Holdings Co. Ltd.				
8.500% due 11/15/2029	200	149	2.700% due 07/12/2026	USD	2,100	194	
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates			3.125% due 10/22/2025		3,400	337	
3.812% due 06/15/2050	8,100	5,534	3.875% due 10/22/2030		1,700	134	
Aroundtown S.A.			CPI Property Group S.A.				
5.375% due 03/21/2029	11,300	8,731	2.750% due 05/12/2026	EUR	2,100	1,598	
Avolon Holdings Funding Ltd.			Credit Agricole S.A.				
2.528% due 11/18/2027	47,992	36,669	7.875% due 01/23/2024 (d)(e)	USD	296	295	
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA			Credit Suisse AG				
1.875% due 01/09/2026	EUR	5,000	4.231	6.500% due 08/08/2023 (d)	10,885	10,566	
2.625% due 04/28/2025	1,000	883	Credit Suisse Group AG				
3.625% due 09/24/2024	700	650	0.625% due 01/18/2033	EUR	1,720	1,023	
5.375% due 01/18/2028	800	590	0.650% due 09/10/2029		270	189	
8.000% due 01/22/2030	4,937	3,683	3.091% due 05/14/2032	USD	2,300	1,580	
8.500% due 09/10/2030	100	75	3.869% due 01/12/2029		31,650	25,342	
Banco Bradesco S.A.			4.194% due 04/01/2031		250	193	
2.850% due 01/27/2023	USD	2,100	2.089	6.375% due 08/21/2026 (d)(e)	546	408	
Banco BTG Pactual S.A.			6.442% due 08/11/2028		2,150	1,942	
4.500% due 01/10/2025	1,200	1,148	6.537% due 08/12/2033		20,900	18,219	
Banco de Credito del Peru S.A.			7.250% due 09/12/2025 (d)(e)		1,100	861	
4.650% due 09/17/2024	PEN	16,400	3.833	7.500% due 07/17/2023 (d)(e)	6,700	5,955	
Banco Espirito Santo S.A.			7.500% due 12/11/2023 (d)(e)		700	637	
2.625% due 05/08/2049 (c)	EUR	3,100	444	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl			
Bank of Ireland Group PLC			2.125% due 11/19/2025	EUR	433	316	
7.500% due 05/19/2025 (d)(e)	12,003	11,597	CTP NV				
Bank of Nova Scotia			1.250% due 06/21/2029		7,500	4,481	
4.900% due 06/04/2025 (d)(e)	USD	1,124	1.044	1.500% due 09/27/2031	8,200	4,291	
Barclays Bank PLC			Deutsche Bank AG				
7.625% due 11/21/2022 (d)	USD	5,281	5,274	1.375% due 02/17/2032	8,500	5,854	
Barclays PLC			1.750% due 11/19/2030		6,200	4,620	
4.972% due 05/16/2029	2,600	2,305	3.035% due 05/28/2032	USD	700	493	
5.875% due 09/15/2024 (d)(e)	GBP	4,000	4,042	3.547% due 09/18/2031	7,400	5,515	
6.125% due 12/15/2025 (d)(e)	USD	7,700	6,689	3.961% due 11/26/2025	3,756	3,469	
6.375% due 12/15/2025 (d)(e)	GBP	2,150	2,197	EPR Properties			
7.125% due 06/15/2025 (d)(e)	5,000	5,301	4.750% due 12/15/2026		256	221	
7.250% due 03/15/2023 (d)(e)	16,760	19,193	4.950% due 04/15/2028		1,132	930	
7.750% due 09/15/2023 (d)(e)	USD	14,570	13,750	Fairfax Financial Holdings Ltd.			
8.000% due 06/15/2024 (d)(e)	9,600	9,057	4.625% due 04/29/2030		1,142	1,007	
BGC Partners, Inc.			4.850% due 04/17/2028		1,370	1,262	
3.750% due 10/01/2024	1,464	1,392	First-Citizens Bank & Trust Co.				
4.375% due 12/15/2025	1,400	1,300	2.969% due 09/27/2025		2,800	2,639	
CA Immobilien Anlagen AG			G City Europe Ltd.				
1.000% due 10/27/2025	EUR	3,400	2,841	4.250% due 09/11/2025	EUR	400	335
CIFI Holdings Group Co. Ltd. (c)			Gaci First Investment Co.				
4.375% due 04/12/2027	USD	300	21	5.250% due 10/13/2032	USD	1,900	1,860
4.450% due 08/17/2026	500	37	5.375% due 10/13/2122		1,900	1,588	
5.950% due 10/20/2025	200	15	GLP Capital LP				
6.000% due 07/16/2025	200	15	5.250% due 06/01/2025		650	628	
6.450% due 11/07/2024	600	53	5.300% due 01/15/2029		3,142	2,837	
Corestate Capital Holding S.A.			Goodman U.S. Finance Three LLC				

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.700% due 03/15/2028	2,324	2,073	Preferred Term Securities XVIII Ltd.		
HSBC Holdings PLC			3.673% due 09/23/2035	79	79
2.848% due 06/04/2031	3,300	2,454	Preferred Term Securities XXIV Ltd.		
3.973% due 05/22/2030	14,100	11,636	3.593% due 03/22/2037	770	709
6.000% due 09/29/2023 (d)(e)	EUR 6,600	6,433	3.673% due 03/22/2037	4,830	4,160
6.500% due 03/23/2028 (d)(e)	USD 4,400	3,583	Preferred Term Securities XXV Ltd.		
Huarong Finance 2017 Co. Ltd.			3.583% due 06/22/2037	21,092	19,194
4.750% due 04/27/2027	2,400	1,731	Preferred Term Securities XXVI Ltd.		
4.950% due 11/07/2047	700	357	3.593% due 09/22/2037	USD 27,451	24,982
Huarong Finance 2019 Co. Ltd.			Santander Holdings USA, Inc.		
3.375% due 02/24/2030	700	426	4.500% due 07/17/2025	2,124	2,032
3.625% due 09/30/2030	2,000	1,230	Santander UK Group Holdings PLC		
3.875% due 11/13/2029	1,125	691	3.823% due 11/03/2028	3,400	2,889
4.500% due 05/29/2029	3,300	2,199	6.750% due 06/24/2024 (d)(e)	GBP 16,610	18,371
Huarong Finance II Co. Ltd.			Seazen Group Ltd.		
4.625% due 06/03/2026	517	391	6.000% due 08/12/2024	USD 700	168
InCaps Funding I Ltd.			Societe Generale S.A.		
5.082% due 06/01/2033	10,807	10,213	7.375% due 10/04/2023 (d)(e)	6,800	6,232
ING Groep NV			Sunac China Holdings Ltd.		
5.750% due 11/16/2026 (d)(e)	6,200	5,302	7.000% due 07/09/2025 (c)	800	48
Intesa Sanpaolo SpA (d)(e)			Svenska Handelsbanken AB		
5.500% due 03/01/2028	EUR 500	392	4.750% due 03/01/2031 (d)(e)	6,600	5,107
5.875% due 09/01/2031	500	382	Tesco Property Finance 2 PLC		
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.			6.052% due 10/13/2039	GBP 3,544	3,873
3.250% due 11/12/2025	1,400	1,034	Tesco Property Finance 6 PLC		
Lloyds Banking Group PLC (d)(e)			5.411% due 07/13/2044	2,496	2,530
4.947% due 06/27/2025	2,011	1,850	TP ICAP Finance PLC		
7.500% due 06/27/2024	USD 2,700	2,581	5.250% due 05/29/2026	2,900	2,995
7.500% due 09/27/2025	7,200	6,696	U.S. Capital Funding VI Ltd.		
7.875% due 06/27/2029	GBP 4,000	4,141	4.189% due 07/10/2043	USD 23,533	18,738
MPT Operating Partnership LP			UniCredit SpA		
3.692% due 06/05/2028	2,400	1,939	7.830% due 12/04/2023	72,590	72,327
Nationwide Building Society			Unique Pub Finance Co. PLC		
3.960% due 07/18/2030	USD 5,600	4,701	7.395% due 03/28/2024	GBP 994	1,146
4.302% due 03/08/2029	12,500	10,899	Uniti Group LP		
NatWest Group PLC			6.500% due 02/15/2029	USD 2,280	1,641
4.445% due 05/08/2030	17,600	15,041	7.875% due 02/15/2025	19,582	19,415
4.600% due 06/28/2031 (d)(e)	6,200	4,019	VICI Properties LP		
5.076% due 01/27/2030	16,500	14,713	3.500% due 02/15/2025	4,784	4,454
6.000% due 12/29/2025 (d)(e)	14,000	12,494	3.750% due 02/15/2027	4,300	3,777
8.000% due 08/10/2025 (d)(e)	12,660	11,962	4.125% due 08/15/2030	5,684	4,702
New Metro Global Ltd.			4.250% due 12/01/2026	3,600	3,284
4.500% due 05/02/2026	1,000	141	4.625% due 12/01/2029	3,600	3,139
4.625% due 10/15/2025	200	31	Voyager Aviation Holdings LLC		
4.800% due 12/15/2024	1,400	369	8.500% due 05/09/2026	4,421	3,686
6.800% due 08/05/2023	600	281			<u>705,488</u>
Omega Healthcare Investors, Inc.			工業 5.6%		
3.625% due 10/01/2029	1,682	1,340	AA Bond Co. Ltd.		
OneMain Finance Corp.			5.500% due 07/31/2027	GBP 855	846
5.625% due 03/15/2023	29,772	29,808	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust		
6.125% due 03/15/2024	2,027	1,983	4.800% due 08/15/2027	USD 3,605	3,377
Park Aerospace Holdings Ltd.			Amdocs Ltd.		
4.500% due 03/15/2023	9,522	9,479	2.538% due 06/15/2030	5,300	4,161
5.500% due 02/15/2024	575	562	American Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust		

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.700% due 10/01/2026		2,015	Ford Motor Credit Co. LLC		
American Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust			1.051% due 11/15/2023	EUR	200
3.375% due 05/01/2027	1,497	1,241	1.744% due 07/19/2024		194
American Airlines 2017-2 Class AA Pass-Through Trust			2.330% due 11/25/2025		10,300
3.350% due 10/15/2029	363	308	2.700% due 08/10/2026	USD	2,450
American Airlines, Inc.			3.021% due 03/06/2024	EUR	1,200
5.500% due 04/20/2026	3,982	3,799	3.250% due 09/15/2025		9,400
5.750% due 04/20/2029	1,883	1,717	3.350% due 11/01/2022	USD	26,548
Atlantia SpA			3.375% due 11/13/2025		24,699
1.875% due 02/12/2028	EUR	10,200	4.389% due 01/08/2026		12,100
Boeing Co.			4.535% due 03/06/2025	GBP	5,500
5.150% due 05/01/2030	USD	476	4.687% due 06/09/2025	USD	1,864
5.705% due 05/01/2040	15,535	13,506	5.125% due 06/16/2025		1,724
5.805% due 05/01/2050	12,129	10,453	5.584% due 03/18/2024		18,765
5.930% due 05/01/2060	18,015	15,271	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC		20,001
British Airways 2019-1 Class AA Pass-Through Trust			6.500% due 10/01/2025		1,700
3.300% due 12/15/2032	90	76	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide		1,614
Broadcom, Inc.			1.875% due 03/31/2028	EUR	2,609
2.450% due 02/15/2031	10,500	7,891	Greene King Finance PLC		1,639
3.137% due 11/15/2035	8,450	5,874	3.593% due 03/15/2035	GBP	1,617
3.187% due 11/15/2036	1,183	809	4.035% due 12/15/2034		5,475
3.419% due 04/15/2033	1,667	1,269	4.064% due 03/15/2035		5,266
3.469% due 04/15/2034	8,092	6,068	5.106% due 03/15/2034		8,839
4.150% due 11/15/2030	USD	5,310	IHO Verwaltungs GmbH (f)		6,839
4.300% due 11/15/2032	12,473	10,507	3.625% due 05/15/2025	EUR	2,049
4.926% due 05/15/2037	20,074	16,585	3.875% due 05/15/2027		1,953
Caesars Entertainment, Inc.			6.000% due 05/15/2027	USD	3,933
6.250% due 07/01/2025	3,190	3,117	6.375% due 05/15/2029		560
Carnival Corp.			Imperial Brands Finance PLC		142
4.000% due 08/01/2028	8,210	6,630	3.500% due 07/26/2026		2,600
Carvana Co.			JetBlue 2020-1 Class A Pass-Through Trust		2,331
5.500% due 04/15/2027	21,762	10,400	4.000% due 11/15/2032		711
10.250% due 05/01/2030	35,100	21,124	Market Bidco Finco PLC		3,028
Community Health Systems, Inc.			4.750% due 11/04/2027	EUR	1,122
4.750% due 02/15/2031	22,100	14,837	Marriott International, Inc.		2,157
5.625% due 03/15/2027	37,147	29,677	4.625% due 06/15/2030	USD	5,815
8.000% due 03/15/2026	11,418	9,870	Massachusetts Institute of Technology		14,083
CoStar Group, Inc.			4.678% due 07/01/2114		463
2.800% due 07/15/2030	2,000	1,579	5.600% due 07/01/2111		51
CVS Pass-Through Trust			Melco Resorts Finance Ltd.		98
5.773% due 01/10/2033	139	133	4.875% due 06/06/2025	USD	400
7.507% due 01/10/2032	560	578	5.375% due 12/04/2029		286
8.353% due 07/10/2031	560	597	MGM China Holdings Ltd.		2,915
Delta Air Lines, Inc.			5.250% due 06/18/2025		3,586
7.000% due 05/01/2025	1,290	1,308	Micron Technology, Inc.		
Energy Transfer LP			4.663% due 02/15/2030		3,365
4.950% due 05/15/2028	424	393	5.327% due 02/06/2029		3,007
Exela Intermediate LLC			Mitchells & Butlers Finance PLC		1,237
11.500% due 07/15/2026	639	176	3.743% due 12/15/2030		403
Expedia Group, Inc.			6.013% due 12/15/2028	GBP	403
4.625% due 08/01/2027	1,500	1,405	Nissan Motor Co. Ltd.		933
6.250% due 05/01/2025	2,247	2,244	3.522% due 09/17/2025	USD	8,300
Ford Foundation			4.345% due 09/17/2027		7,368
2.815% due 06/01/2070	2,070	1,132	4.810% due 09/17/2030		7,338
					2,250
					1,799

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
NMG Holding Co., Inc.			5.125% due 12/15/2029	2,800	1,701
7.125% due 04/01/2026	11,900	11,333	5.500% due 01/15/2026	USD 6,500	4,517
Oracle Corp.			5.500% due 10/01/2027	1,000	647
3.850% due 04/01/2060	1,835	1,112	5.625% due 08/26/2028	1,198	734
PeaceHealth Obligated Group					<u>537,719</u>
3.218% due 11/15/2050	3,100	1,918	公益 8.1%		
QVC, Inc.			Altice Financing S.A.		
5.950% due 03/15/2043	5,293	3,240	3.000% due 01/15/2028	EUR 1,200	910
Roadster Finance DAC			4.250% due 08/15/2029	3,510	2,666
2.375% due 12/08/2027	EUR 1,000	843	5.750% due 08/15/2029	USD 12,389	9,755
Rolls-Royce PLC			Altice France S.A.		
4.625% due 02/16/2026	13,860	13,124	8.125% due 02/01/2027	2,744	2,516
5.750% due 10/15/2027	GBP 8,199	8,159	Charter Communications Operating LLC		
Royal Caribbean Cruises Ltd.			3.900% due 06/01/2052	10,000	6,211
11.500% due 06/01/2025	USD 7,300	7,871	3.950% due 06/30/2062	3,500	2,055
Russian Railways Via RZD Capital PLC			4.400% due 12/01/2061	9,500	6,041
7.487% due 03/25/2031	GBP 6,300	2,539	4.800% due 03/01/2050	3,818	2,709
Sands China Ltd.			Constellation Oil Services Holding S.A.		
3.350% due 03/08/2029	USD 2,500	1,679	3.000% due 12/31/2026 (f)	377	282
3.750% due 08/08/2031	2,200	1,445	Directv Financing LLC		
4.300% due 01/08/2026	3,000	2,462	5.875% due 08/15/2027	7,200	6,498
4.875% due 06/18/2030	2,700	1,930	DISH DBS Corp.		
5.625% due 08/08/2025	4,500	3,984	5.250% due 12/01/2026	11,110	9,673
5.900% due 08/08/2028	5,500	4,381	5.750% due 12/01/2028	11,110	8,978
Studio City Co. Ltd.			Enel Finance America LLC		
7.000% due 02/15/2027	2,700	2,148	7.100% due 10/14/2027	6,000	5,986
Syngenta Finance NV			Enel Finance International NV		
3.375% due 04/16/2026	EUR 11,100	10,051	7.500% due 10/14/2032	4,700	4,714
4.441% due 04/24/2023	USD 5,300	5,257	7.750% due 10/14/2052	3,000	2,881
4.892% due 04/24/2025	800	766	Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
Times Square Hotel Trust			2.250% due 11/22/2024	EUR 100	62
8.528% due 08/01/2026	1,070	1,054	2.949% due 01/24/2024	450	278
Triumph Group, Inc.			4.950% due 03/23/2027	USD 1,800	963
6.250% due 09/15/2024	1,541	1,427	4.950% due 02/06/2028	1,000	545
U.S. Renal Care, Inc.			5.150% due 02/11/2026	5,700	3,550
10.625% due 07/15/2027	1,282	519	7.288% due 08/16/2037	500	282
Uber Technologies, Inc.			8.625% due 04/28/2034	2,372	1,340
4.500% due 08/15/2029	2,865	2,461	Gazprom PJSC via Gaz Finance PLC		
7.500% due 05/15/2025	571	572	1.500% due 02/17/2027	EUR 31,800	18,868
United Airlines 2019-2 Class AA Pass-Through Trust			2.950% due 04/15/2025	5,000	2,842
2.700% due 05/01/2032	1,365	1,086	2.950% due 01/27/2029	USD 23,200	13,579
United Airlines 2020-1 Class A Pass-Through Trust			iHeartCommunications, Inc.		
5.875% due 10/15/2027	24,502	23,679	4.750% due 01/15/2028	36,300	31,726
Venture Global Calcasieu Pass LLC			6.375% due 05/01/2026	6,808	6,503
3.875% due 08/15/2029	3,600	3,097	8.375% due 05/01/2027	6,911	6,220
3.875% due 11/01/2033	15,900	12,790	Intelsat Jackson Holdings S.A.		
4.125% due 08/15/2031	3,500	2,993	6.500% due 03/15/2030	70,143	64,550
VOC Escrow Ltd.			Netflix, Inc.		
5.000% due 02/15/2028	1,100	908	3.625% due 05/15/2027	EUR 3,900	3,761
Western Midstream Operating LP			3.625% due 06/15/2030	18,776	16,893
5.041% due 01/13/2023	1,048	1,043	3.875% due 11/15/2029	8,217	7,566
Wynn Las Vegas LLC			4.625% due 05/15/2029	7,600	7,343
5.250% due 05/15/2027	1,800	1,569	4.875% due 04/15/2028	USD 200	190
Wynn Macau Ltd.			4.875% due 06/15/2030	2,900	2,689

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
5.375% due 11/15/2029	1,280	1,219	Petroleos Mexicanos		
5.875% due 11/15/2028	300	298	2.750% due 04/21/2027	EUR	1,200 883
6.375% due 05/15/2029	1,500	1,532	5.950% due 01/28/2031	USD	22,485 16,245
Noble Finance Co.			6.700% due 02/16/2032		79,356 60,145
11.000% due 02/15/2028 (f)	2,086	2,263	6.950% due 01/28/2060		6,116 3,681
NPC Ukrenergo			7.690% due 01/23/2050		1,570 1,026
6.875% due 11/09/2028 (h)	1,200	215	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC		
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.			4.263% due 06/01/2036		3,600 3,245
6.720% due 12/01/2022	20	20	4.377% due 06/01/2039		3,990 3,479
Pacific Gas & Electric Co.			4.451% due 12/01/2047		20,700 17,233
2.100% due 08/01/2027	1,910	1,572	4.674% due 12/01/2051		3,600 3,096
2.500% due 02/01/2031	2,600	1,946	Prosus NV		
2.950% due 03/01/2026	8,630	7,643	1.985% due 07/13/2033	EUR	5,600 3,340
3.000% due 06/15/2028	11,288	9,298	2.085% due 01/19/2030		4,200 2,934
3.150% due 01/01/2026	15,753	14,202	3.061% due 07/13/2031	USD	11,900 8,004
3.250% due 06/15/2023	8,640	8,506	4.193% due 01/19/2032		5,600 3,989
3.250% due 06/01/2031	3,800	2,962	4.987% due 01/19/2052		4,700 2,925
3.300% due 03/15/2027	3,838	3,311	Rio Oil Finance Trust Series 2014-1		
3.300% due 12/01/2027	14,666	12,450	9.250% due 07/06/2024		1,184 1,199
3.300% due 08/01/2040	1,542	1,004	Rio Oil Finance Trust Series 2014-3		
3.400% due 08/15/2024	6,570	6,251	9.750% due 01/06/2027		554 573
3.450% due 07/01/2025	12,102	11,254	Rio Oil Finance Trust Series 2018-1		
3.500% due 06/15/2025	8,068	7,510	8.200% due 04/06/2028		2,383 2,398
3.500% due 08/01/2050	4,660	2,851	Southern California Edison Co.		
3.750% due 02/15/2024	10,188	9,882	4.875% due 03/01/2049		346 279
3.750% due 07/01/2028	13,613	11,630	Sprint Capital Corp.		
3.750% due 08/15/2042	418	266	8.750% due 03/15/2032		2,200 2,585
3.850% due 11/15/2023	1,830	1,789	Sprint Communications LLC		
3.950% due 12/01/2047	2,500	1,617	6.000% due 11/15/2022		3,934 3,940
4.000% due 12/01/2046	3,144	2,005	Sprint Corp.		
4.200% due 03/01/2029	9,900	8,600	7.125% due 06/15/2024	USD	8,766 8,874
4.250% due 08/01/2023	3,735	3,698	7.625% due 02/15/2025		1,100 1,132
4.250% due 03/15/2046	5,219	3,483	7.625% due 03/01/2026		839 877
4.300% due 03/15/2045	3,000	2,026	7.875% due 09/15/2023		46,749 47,578
4.400% due 03/01/2032	7,300	6,119	Sprint Spectrum Co. LLC		
4.450% due 04/15/2042	4,333	3,062	4.738% due 03/20/2025		2,425 2,392
4.500% due 07/01/2040	39,210	29,308	5.152% due 03/20/2028		2,758 2,685
4.500% due 12/15/2041	743	507	System Energy Resources, Inc.		
4.550% due 07/01/2030	50,195	44,022	2.140% due 12/09/2025		6,100 5,475
4.600% due 06/15/2043	1,794	1,289	T-Mobile USA, Inc.		
4.650% due 08/01/2028	100	88	3.375% due 04/15/2029		5,983 5,188
4.750% due 02/15/2044	2,707	1,958	3.500% due 04/15/2031		3,000 2,527
4.950% due 07/01/2050	25,950	19,397	Topaz Solar Farms LLC		
5.250% due 03/01/2052	7,300	5,630	4.875% due 09/30/2039		5,450 4,610
Petrobras Global Finance BV			5.750% due 09/30/2039		7,731 7,363
6.250% due 12/14/2026	6,234	6,833	Transocean Phoenix 2 Ltd.		
6.625% due 01/16/2034	2,900	2,801	7.750% due 10/15/2024		840 836
Petroleos de Venezuela S.A. (c)			Transocean, Inc.		
5.375% due 04/12/2027	11,932	283	7.500% due 01/15/2026		1,228 1,040
5.500% due 04/12/2037	10,372	236	8.000% due 02/01/2027		2,983 2,423
6.000% due 05/16/2024	8,283	217	United Group BV		
6.000% due 11/15/2026	13,183	300	4.875% due 07/01/2024	EUR	565 535
9.000% due 11/17/2022	400	9	Valaris Ltd.		
9.750% due 05/17/2035	4,730	112	8.250% due 04/30/2028 (f)	USD	2,483 2,446

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Viasat, Inc.			3.500% due 09/01/2047	182	165
5.625% due 09/15/2025	3,363	3,109	3.500% due 03/01/2048	56	50
6.500% due 07/15/2028	2,700	2,261	3.500% due 04/01/2051	729	653
Windstream Escrow LLC			4.000% due 07/01/2040	7	6
7.750% due 08/15/2028	11,607	10,076	4.000% due 12/01/2041	55	50
		<u>777,725</u>	4.000% due 07/01/2042	75	67
社債合計		<u>2,020,932</u>	4.000% due 08/01/2042	8	7
(取得原価 2,522,029千米ドル)			4.000% due 09/01/2042	98	89
転換社債 0.4%			4.000% due 11/01/2045	98	92
Multiplan Corp.			4.000% due 03/01/2047	31	29
6.000% due 10/15/2027 (d)	5,700	3,933	4.000% due 04/01/2047	242	227
Nationwide Building Society			4.000% due 08/01/2047	4,110	3,834
10.250% due 06/20/2166	GBP 7,405	9,571	4.000% due 10/01/2047	257	239
Stichting AK Rabobank Certificaten			4.000% due 12/01/2047	82	76
6.500% due 03/29/2170 (e)	EUR 30,963	28,971	4.000% due 01/01/2048	52	48
転換社債合計		<u>42,475</u>	4.000% due 02/01/2048	586	546
(取得原価 67,887千米ドル)			4.000% due 07/01/2048	6,869	6,338
地方債 0.2%			4.000% due 08/01/2048	4,053	3,744
Chicago, Illinois, Build America Bonds, Series 2010			4.000% due 09/01/2048	1,153	1,075
6.630% due 02/01/2035	USD 655	654	4.500% due 05/01/2033	15	14
6.725% due 04/01/2035	310	310	4.500% due 05/01/2035	6	6
7.350% due 07/01/2035	506	519	4.500% due 02/01/2038	1	1
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015			4.500% due 01/01/2041	177	164
7.750% due 01/01/2042	130	131	4.750% due 06/01/2033	172	163
Chicago, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2017			5.000% due 10/01/2035	64	63
7.045% due 01/01/2029	275	274	5.000% due 12/01/2035	148	142
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2021			5.000% due 10/01/2036	6	6
4.000% due 07/01/2037	2,082	1,661	5.000% due 05/01/2038	2	2
Commonwealth of Puerto Rico, General Obligation Bonds, Series 2022			5.000% due 11/01/2039	7	7
0.000% due 11/01/2043	13,426	6,142	5.500% due 07/01/2033	23	23
Golden State, California, Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			5.500% due 06/01/2035	699	682
2.246% due 06/01/2029	1,600	1,305	5.500% due 04/01/2036	1	1
3.000% due 06/01/2046	710	644	5.500% due 11/01/2036	2	2
Puerto Rico Electric Power Authority, Build America Bonds, Series 2010 (c)			5.500% due 03/01/2037	11	11
6.050% due 07/01/2032	800	604	5.500% due 09/01/2037	5	4
6.125% due 07/01/2040	USD 3,000	2,265	5.500% due 02/01/2038	3	3
地方債合計		<u>14,509</u>	5.500% due 04/01/2038	13	13
(取得原価 14,672千米ドル)			6.000% due 08/01/2031	22	21
米国政府関係機関 28.5%			6.000% due 06/01/2032	1	1
Fannie Mae			6.000% due 09/01/2039	373	368
2.614% due 05/25/2048 (g)	USD 2,241	281	6.000% due 10/01/2047	8	8
3.000% due 04/01/2037	667	615	6.500% due 01/01/2037	2	2
3.000% due 09/01/2049	194	167	6.500% due 10/01/2037	3	3
3.000% due 03/01/2050	18,419	15,817	7.000% due 09/01/2031	30	30
3.000% due 10/01/2051	1,378	1,174	7.000% due 05/01/2037	1	1
3.000% due 12/01/2051	210	179	Fannie Mae, TBA (h)		
3.000% due 02/01/2052	10,966	9,361	2.500% due 11/01/2052	USD 47,000	38,482
3.000% due 03/01/2052	25,128	21,428	2.500% due 12/01/2052	99,000	81,061
3.000% due 04/01/2052	27,202	23,152	3.000% due 12/01/2052	243,350	206,886
3.000% due 05/01/2052	3,554	3,030	3.500% due 12/01/2052	862,411	757,936
3.000% due 06/01/2052	9,382	8,001	4.000% due 11/01/2052	55,000	50,006
3.000% due 07/01/2052	7,483	6,393	4.000% due 12/01/2052	107,150	97,375
3.000% due 08/01/2052	3,667	3,126	4.500% due 12/01/2052	36,200	33,940
3.500% due 08/01/2042	20	18	Freddie Mac		

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.000% due 05/01/2037	1,902	1,753	5.500% due 07/20/2038	35	34
3.000% due 11/01/2046	63	54	5.500% due 08/20/2038	279	280
3.000% due 12/01/2047	1,956	1,692	5.500% due 09/20/2038	75	75
3.000% due 03/01/2048	111	96	5.500% due 10/20/2038	15	15
3.000% due 04/01/2052	154	132	5.500% due 01/20/2039	11	10
3.000% due 07/01/2052	164	140	5.500% due 02/20/2039	43	43
3.138% due 06/15/2042 (g)	33	4	5.500% due 09/20/2039	54	54
3.500% due 10/01/2039	122	110	5.500% due 10/20/2039	9	9
3.500% due 10/01/2047	2,126	1,914	5.500% due 11/20/2039	220	220
3.500% due 12/01/2047	724	651	5.500% due 12/20/2039	25	24
3.500% due 03/01/2048	2,588	2,325	5.500% due 01/20/2040	194	190
3.500% due 04/01/2048	933	840	5.500% due 06/20/2040	245	252
3.500% due 10/01/2048	1,039	931	5.500% due 07/20/2040	486	478
3.500% due 12/01/2048	2,503	2,251	Ginnie Mae, TBA (h)		
3.500% due 03/01/2049	1,595	1,427	2.000% due 11/01/2052	19,000	15,613
3.500% due 05/01/2051	82	73	2.500% due 11/01/2052	46,200	39,162
4.000% due 09/01/2033	1	1	3.000% due 11/01/2052	133,720	116,451
4.000% due 04/01/2047	328	307	3.000% due 12/01/2052	366,280	318,878
4.000% due 05/01/2047	319	298	3.500% due 11/01/2052	85,700	76,721
4.000% due 08/01/2047	570	532	4.000% due 11/01/2052	646,158	595,566
4.000% due 08/01/2048	673	624	4.500% due 11/01/2052	4,000	3,792
4.000% due 09/01/2048	276	255	米国政府関係機関合計		<u>2,732,876</u>
4.000% due 12/01/2048	10,622	9,840	(取得原価 2,778,773千米ドル)		
4.000% due 02/01/2049	4,039	3,742	米国長期国債 9.9%		
4.000% due 03/01/2049	315	292	Treasury Inflation Protected Securities (i)		
5.000% due 06/01/2034	75	75	0.125% due 07/15/2024	64,736	63,127
5.000% due 08/01/2035	42	41	0.125% due 10/15/2024	37,979	36,871
5.000% due 01/01/2037	3	3	0.125% due 07/15/2030	52,802	47,150
5.000% due 01/01/2038	1	1	0.125% due 01/15/2031	1,934	1,714
5.500% due 01/01/2035	273	271	0.125% due 07/15/2031	7,337	6,471
5.500% due 05/01/2037	2	2	0.250% due 07/15/2029	142,835	130,385
5.500% due 06/01/2037	205	203	0.250% due 02/15/2050	21,151	14,090
5.750% due 05/01/2037	186	186	0.375% due 07/15/2023	77,060	76,440
6.000% due 07/01/2037	44	44	0.375% due 01/15/2027	5,694	5,383
Ginnie Mae			0.375% due 07/15/2027	1,526	1,441
4.000% due 06/20/2041	2	1	0.500% due 04/15/2024	26,903	26,344
4.000% due 04/20/2047	1,622	1,520	0.625% due 01/15/2024	20,195	19,866
4.000% due 05/20/2047	30,018	28,145	0.625% due 07/15/2032	87,868	80,541
4.000% due 06/20/2047	14,337	13,442	0.625% due 02/15/2043	2,834	2,238
4.000% due 07/20/2047	12,474	11,696	0.750% due 07/15/2028	33,456	31,853
4.000% due 02/20/2048	8,496	7,981	0.750% due 02/15/2042	6,685	5,498
4.000% due 05/20/2049	29,604	27,562	0.750% due 02/15/2045	18,237	14,515
4.000% due 02/20/2050	360	337	0.875% due 01/15/2029	61,077	58,186
4.000% due 07/20/2050	179	166	0.875% due 02/15/2047	21,349	17,173
4.000% due 08/20/2050	27	25	1.000% due 02/15/2046	11,500	9,605
4.000% due 09/20/2050	2,159	2,009	1.000% due 02/15/2048	24,981	20,566
4.000% due 10/20/2050	67,643	62,916	1.000% due 02/15/2049	63,333	52,238
4.500% due 01/20/2040	79	76	1.375% due 02/15/2044	3,304	3,014
4.500% due 03/20/2040	8	7	2.125% due 02/15/2040	3,426	3,586
5.000% due 08/20/2030	191	188	2.125% due 02/15/2041	1,893	1,978
5.000% due 05/20/2040	276	270	U.S. Treasury Bonds		
5.000% due 04/20/2041	7	7	2.250% due 08/15/2046	100	68
5.500% due 05/20/2038	7	7	2.750% due 08/15/2047	2,830	2,124
5.500% due 06/20/2038	40	40	3.000% due 08/15/2048	155	123

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
3.000% due 02/15/2049	77	62	4.066% due 05/25/2035	20,545	18,224
3.125% due 05/15/2048	180	146	Argent Securities Trust		
U.S. Treasury Notes			3.946% due 04/25/2036	7,821	2,564
1.625% due 02/15/2026	2,200	2,013	Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates		
2.000% due 02/15/2025	11,021	10,430	4.258% due 09/25/2033	3,275	3,148
2.000% due 08/15/2025	1,400	1,310	4.351% due 10/25/2035	36,400	31,894
2.000% due 11/15/2026	800	731	Asset-Backed Funding Certificates Trust		
2.250% due 11/15/2024	12,300	11,766	3.806% due 10/25/2036	10,129	8,287
2.250% due 02/15/2027	28,000	25,740	4.246% due 03/25/2035	13,129	12,529
2.375% due 05/15/2029	32,200	28,832	4.321% due 06/25/2035	7,965	7,605
2.625% due 02/15/2029	5,000	4,555	Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
2.750% due 08/15/2032	150,100	134,340	4.051% due 05/25/2036 (c)	37,847	34,858
2.875% due 05/15/2032	290	263	Atrium Hotel Portfolio Trust		
米国長期国債合計		952,776	4.842% due 06/15/2035	18,395	17,329
(取得原価 1,070,454千米ドル)			Austin Fairmont Hotel Trust		
モーゲージバック証券 37.3%			5.212% due 09/15/2032	3,000	2,839
Accredited Mortgage Loan Trust			Banc of America Alternative Loan Trust		
4.531% due 07/25/2035	USD 9,806	9,553	3.921% due 01/25/2023	58	48
5.281% due 07/25/2035 (c)	715	600	6.000% due 07/25/2046 (c)	1,531	1,265
ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust			Banc of America Funding Trust		
3.741% due 08/25/2036	3,949	3,723	2.765% due 06/20/2036	4,196	3,366
4.381% due 01/25/2035	927	834	3.104% due 02/20/2035	1,345	1,158
4.411% due 02/25/2034	3,077	3,003	3.547% due 01/20/2047 (c)	86	79
4.486% due 08/25/2035	4,857	4,707	BCAP LLC Trust		
Adjustable Rate Mortgage Trust			4.578% due 04/26/2037	2,854	1,551
4.536% due 08/25/2035	3,475	3,179	5.468% due 04/26/2036	USD 4,966	2,780
AFC Home Equity Loan Trust			Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust		
4.396% due 06/25/2029	1,685	1,065	3.889% due 11/25/2034	194	186
Alternative Loan Trust			Bear Stearns Alternative-A Trust		
2.721% due 08/25/2035 (c)	417	345	3.926% due 04/25/2037	6,239	5,395
3.623% due 08/25/2035 (c)	466	418	4.006% due 11/25/2046	7,446	5,656
3.679% due 09/20/2046	711	677	Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
3.757% due 09/25/2034	992	896	3.014% due 05/25/2036 (g)	8,798	274
3.909% due 03/20/2046	5,629	4,413	3.826% due 02/25/2037	2,728	5,322
3.926% due 07/25/2046	59	276	3.886% due 06/25/2047	6,300	5,936
3.946% due 07/25/2036	5,013	4,830	3.986% due 05/25/2036 (c)	8,798	3,108
3.966% due 08/25/2046 (c)	9,125	7,337	4.126% due 04/25/2036	5,026	4,994
3.986% due 05/25/2036	13,102	11,058	4.186% due 02/25/2036 (c)	2,543	2,532
4.086% due 12/25/2046	14,983	12,123	4.231% due 12/25/2035	713	711
4.126% due 07/25/2036	20,327	17,524	4.606% due 06/25/2034	4,740	4,599
4.129% due 12/20/2035	5,472	4,796	4.636% due 11/25/2035 (c)	3,116	2,770
4.186% due 01/25/2036	3,183	2,709	4.636% due 08/25/2037	16,968	15,068
5.500% due 06/25/2035	4,775	3,851	4.666% due 12/25/2035	9,270	7,617
5.500% due 08/25/2035 (c)	54	46	Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust		
5.500% due 02/25/2036 (c)	15	10	5.500% due 11/25/2033	4,076	3,645
6.000% due 07/25/2037 (c)	24,656	13,144	Bear Stearns Mortgage Funding Trust		
7.000% due 10/25/2037	29,569	11,237	3.986% due 02/25/2037 (c)	5,216	4,574
Amerquest Mortgage Securities Trust			Benchmark Mortgage Trust		
4.096% due 04/25/2036	2,220	2,200	3.509% due 09/15/2048	47,290	42,964
4.201% due 03/25/2036	27,500	24,984	3.899% due 03/15/2062	9,775	7,396
Amerquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			BHP Trust		
4.058% due 09/25/2032	167	174	5.183% due 08/15/2036	10,500	9,864
5.341% due 10/25/2034	9,913	9,213	BHP Trust 2019-BXHP		
Argent Mortgage Loan Trust			5.980% due 08/15/2036	33,656	31,477

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
BSSST Mortgage Trust			3.638% due 11/25/2034	8	7
6.226% due 02/15/2037	11,000	10,209	3.638% due 11/25/2037	4,696	4,243
6.876% due 02/15/2037	24,700	22,811	5.500% due 11/25/2035 (c)	6,050	3,437
7.876% due 02/15/2037	7,500	6,886	6.000% due 07/25/2036	17,730	10,084
BX Trust			6.000% due 11/25/2037	3,719	2,127
5.058% due 10/15/2036	16,400	15,169	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.		
5.299% due 10/15/2036	7,150	6,647	6.036% due 01/25/2033	1,206	1,094
5.307% due 10/15/2036	25,610	23,263	Credit Suisse Mortgage Capital		
7.787% due 07/15/2034	6,800	6,551	3.000% due 01/29/2036	544	527
Canterbury Finance No.1 PLC			3.000% due 06/27/2037	1,462	1,441
2.465% due 05/16/2056	GBP 16,366	18,809	3.254% due 11/27/2036	11,043	12,537
Capitalsource Real Estate Loan Trust			8.810% due 10/26/2036	142	119
4.559% due 01/20/2037	USD 11,122	10,055	Credit Suisse Mortgage Capital Trust		
4.659% due 01/20/2037	4,800	4,026	0.000% due 01/25/2058	22	22
4.759% due 01/20/2037	2,700	1,781	0.000% due 04/25/2058 (g)	1	1
CBA Commercial Small Balance Commercial Mortgage			3.562% due 06/25/2050	45,723	38,011
6.040% due 01/25/2039 (c)	657	600	3.592% due 01/25/2058	19,089	15,473
Centex Home Equity Loan Trust			3.687% due 06/01/2050	43,560	43,645
4.231% due 03/25/2035	3,661	3,593	3.951% due 04/25/2058	30,646	28,823
Chase Mortgage Finance Trust			4.162% due 07/15/2032	5,200	4,902
3.067% due 12/25/2035 (c)	4,087	3,494	4.412% due 07/15/2032	4,000	3,735
ChaseFlex Trust			4.612% due 07/15/2032	2,400	2,217
3.886% due 07/25/2037	906	849	Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			7.480% due 03/25/2046	4,266	3,425
3.946% due 03/25/2035	275	261	CWABS Asset-Backed Certificates Trust		
CIT Mortgage Loan Trust			3.726% due 06/25/2035 (c)	1,577	1,411
4.936% due 10/25/2037	3,488	3,464	3.726% due 06/25/2037	13,597	12,372
5.086% due 10/25/2037	28,585	26,870	3.726% due 07/25/2037 (c)	5,642	5,521
Citigroup Commercial Mortgage Trust			3.736% due 04/25/2047 (c)	591	590
0.283% due 03/10/2047 (g)	25,400	85	3.766% due 11/25/2047	3,747	4,091
Citigroup Mortgage Loan Trust			3.806% due 08/25/2037	25,800	21,540
3.244% due 08/25/2036	15,928	6,599	3.816% due 05/25/2037 (c)	12,639	11,777
3.291% due 08/25/2036	4,085	3,865	3.816% due 10/25/2047	8,007	7,871
3.643% due 07/25/2037 (c)	2,752	2,387	3.836% due 02/25/2036	1,176	1,118
3.746% due 12/25/2036	10,148	5,769	3.846% due 09/25/2046	5,600	5,278
3.866% due 12/25/2036	2,870	2,792	4.006% due 01/25/2045	1,494	1,481
4.406% due 09/25/2037	13,629	11,184	4.066% due 05/25/2036	9,800	8,062
7.250% due 05/25/2036 (c)	9,326	4,866	4.066% due 03/25/2037	29,856	27,748
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			4.066% due 03/25/2047 (c)	26,535	22,676
4.621% due 05/25/2035	10,698	10,013	4.090% due 12/25/2034	4	4
Commercial Mortgage Trust			4.111% due 08/25/2036	2,400	2,275
0.177% due 04/10/2047 (g)	USD 33,000	71	4.186% due 06/25/2036	1,830	1,811
3.633% due 02/10/2037	10,000	8,866	4.246% due 04/25/2036	134	134
6.563% due 12/15/2038	8,575	8,021	4.286% due 03/25/2036 (c)	1,655	1,471
Conseco Finance Corp.			4.666% due 05/25/2036 (c)	2,182	1,598
6.920% due 12/01/2030	1,202	1,209	4.681% due 06/25/2035	8,400	7,850
7.500% due 03/01/2030	47,279	20,106	5.161% due 11/25/2034	6,720	6,632
7.600% due 04/15/2026	4,963	1,468	5.536% due 08/25/2035	3,000	2,806
Countrywide Asset-Backed Certificates			5.633% due 06/25/2035	8,644	7,015
4.076% due 08/26/2033	219	210	CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust		
5.461% due 05/25/2035 (c)	4,282	4,166	5.161% due 03/25/2035	5,500	5,295
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust		
3.160% due 06/25/2034	1	1	3.662% due 03/15/2030	319	321
3.411% due 03/25/2037 (c)	3,708	3,175	DBGS Mortgage Trust		
3.573% due 10/20/2035 (c)	4,532	4,091	6.063% due 10/15/2036	USD 15,000	13,494

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust			4.591% due 10/10/2032	8,215	7,807
3.906% due 03/25/2037	9,717	5,282	G5AA Home Equity Trust		
3.916% due 08/25/2037 (c)	20,298	17,099	6.500% due 11/25/2037 (c)	20	9
4.086% due 09/25/2047	12,504	10,505	GSAMP Trust		
Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			3.726% due 03/25/2047	3,737	3,381
3.344% due 10/25/2035 (c)	9,297	8,166	3.746% due 01/25/2037	17,397	10,437
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			3.906% due 05/25/2046	27	27
3.687% due 11/27/2036	1,560	1,538	4.106% due 06/25/2036	12,650	12,077
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			4.231% due 11/25/2035 (c)	6,223	5,394
3.670% due 10/19/2036 (c)	7,566	6,370	GSMSC Resecuritization Trust		
4.080% due 10/19/2045 (c)	524	540	3.264% due 09/26/2036	3,896	2,571
4.140% due 09/19/2045	5,029	3,210	5.270% due 04/26/2037	44,351	12,702
Dragon Finance BV			GSR Mortgage Loan Trust		
3.425% due 07/13/2023	GBP 42	47	3.114% due 03/25/2037 (g)	USD 7,645	850
Ellington Loan Acquisition Trust			3.886% due 03/25/2037	7,645	1,066
4.686% due 05/25/2037	USD 1,199	1,148	HarborView Mortgage Loan Trust		
EMC Mortgage Loan Trust			3.720% due 12/19/2036 (c)	852	773
4.636% due 04/25/2042 (c)	6,336	6,234	4.040% due 02/19/2036	10,220	6,832
Encore Credit Receivables Trust			4.120% due 08/19/2045	7,922	6,040
4.516% due 11/25/2035	6,510	6,069	Hawaii Hotel Trust		
Eurosail-UK PLC			5.062% due 05/15/2038	2,000	1,885
2.994% due 09/13/2045	GBP 4,277	4,522	5.572% due 05/15/2038	12,500	11,663
3.174% due 06/13/2045	7,502	8,576	Home Equity Asset Trust		
Extended Stay America Trust			4.066% due 10/25/2036	23,475	14,259
6.263% due 07/15/2038	USD 15,619	14,772	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust		
FBR Securitization Trust			3.726% due 11/25/2036	12,718	11,271
4.261% due 10/25/2035	20,476	16,975	3.826% due 04/25/2037	13,304	8,939
4.351% due 09/25/2035	7,500	7,210	3.946% due 06/25/2036	2,268	2,173
First Franklin Mortgage Loan Trust			4.576% due 08/25/2035	5,221	5,105
3.896% due 11/25/2036	59,328	48,481	HPLY Trust		
3.906% due 04/25/2036	4,548	4,382	5.412% due 11/15/2036	4,675	4,393
4.276% due 01/25/2036	USD 24,773	22,503	5.762% due 11/15/2036	26,212	24,505
4.291% due 05/25/2036	991	987	HSI Asset Securitization Corp. Trust		
4.441% due 04/25/2035	3,265	3,094	3.961% due 05/25/2037	7,197	6,783
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (c)			Impac CMB Trust		
1.414% due 05/25/2035 (g)	1,263	45	4.266% due 01/25/2035	8,673	8,121
4.086% due 05/25/2035	1,263	778	Impac Secured Assets Corp.		
Fontainebleau Miami Beach Trust			4.146% due 03/25/2036 (c)	9,496	7,723
3.963% due 12/10/2036	33,098	30,218	Impac Secured Assets Trust		
Fremont Home Loan Trust			3.966% due 01/25/2037	2,319	1,979
3.866% due 02/25/2037	7,291	5,564	IndyMac iMJA Mortgage Loan Trust		
4.606% due 01/25/2035	6,493	5,493	6.500% due 10/25/2037	8,443	4,701
Glen Securities Finance DAC			IndyMac iMSC Mortgage Loan Trust		
2.312% due 10/28/2038	EUR 5,104	4,888	3.233% due 06/25/2037 (c)	8,451	5,879
3.312% due 10/28/2038	3,828	3,609	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
4.112% due 10/28/2038	1,871	1,768	3.028% due 07/25/2037	19,688	16,877
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.			3.067% due 03/25/2036 (c)	4,133	3,166
5.456% due 03/10/2051	USD 11,955	10,197	3.119% due 04/25/2037 (c)	6,885	5,810
GreenPoint Mortgage Funding Trust			3.244% due 04/25/2037	13,614	11,244
4.146% due 11/25/2045	52	39	3.694% due 11/25/2036 (c)	11,119	7,774
Grifonas Finance No.1 PLC			3.946% due 02/25/2037 (c)	22,247	20,193
1.264% due 08/28/2039	EUR 629	577	3.966% due 10/25/2036	5,035	2,338
GS Mortgage Securities Corporation Trust			INTOWN Mortgage Trust		
3.419% due 10/10/2032	USD 3,300	3,294	7.061% due 08/15/2039	11,495	11,212

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
IXIS Real Estate Capital Trust			2.691% due 04/25/2034	1	1
4.351% due 12/25/2035	1,930	1,924	Mastr Asset-Backed Securities Trust		
Jefferies Resecuritization Trust			3.806% due 11/25/2036	26	15
7.981% due 06/25/2047 (c)	481	390	4.141% due 01/25/2036	7,500	6,672
JPMorgan Alternative Loan Trust			4.736% due 08/25/2037	15,101	12,413
2.905% due 03/25/2036 (c)	307	256	Mastr Specialized Loan Trust		
4.146% due 04/25/2047	1,683	1,595	4.306% due 02/25/2036	5,342	4,147
5.730% due 03/25/2036 (c)	72	69	MBRT		
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			5.062% due 11/15/2036	6,435	6,167
4.262% due 12/15/2036	3,700	3,576	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust		
5.337% due 05/15/2047	197	182	6.586% due 10/25/2037	13,033	12,145
5.512% due 09/15/2029	1,740	1,621	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
5.928% due 11/15/2038	16,193	14,801	2.845% due 02/25/2033	8	8
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			3.866% due 05/25/2037	20,107	11,076
3.856% due 08/25/2036	8,600	7,760	4.306% due 07/25/2034	4,854	4,221
3.856% due 06/25/2037	34,606	32,426	4.381% due 09/25/2035	1,385	1,346
3.866% due 06/25/2037 (c)	22,826	19,350	4.666% due 10/25/2035	830	812
3.991% due 05/25/2036	9,836	9,490	Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust		
4.021% due 05/25/2036	17,725	16,685	3.836% due 07/25/2036	5,076	4,282
JPMorgan Mortgage Trust (c)			3.846% due 02/25/2037	7,620	3,644
3.295% due 01/25/2037	438	357	3.886% due 07/25/2036	45,517	18,409
3.886% due 10/25/2035	4,004	2,929	4.066% due 06/25/2036	20,749	18,302
JPMorgan Resecuritization Trust			4.086% due 07/25/2036	45,294	18,369
3.225% due 02/26/2037	2,174	1,987	4.126% due 03/25/2036	4,555	4,367
Kentmere No.2 PLC			4.321% due 07/25/2035	5,965	5,751
0.000% due 01/28/2042	GBP 9,500	3,409	4.586% due 03/25/2033	75	73
0.870% due 01/28/2042	2,439	2,276	4.586% due 07/25/2037	345	334
2.985% due 01/28/2042	GBP 54,421	59,356	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust		
3.585% due 01/28/2042	5,693	6,121	0.774% due 11/15/2052 (g)	132,167	3,646
3.935% due 01/28/2042	4,066	4,360	Morgan Stanley Capital I Trust		
4.385% due 01/28/2042	2,439	2,609	2.428% due 04/05/2042	13,500	10,198
5.185% due 01/28/2042	1,626	1,741	5.062% due 08/15/2033	2,619	2,556
7.185% due 01/28/2042	3,252	3,345	5.790% due 12/15/2023	21,942	20,312
Lansdowne Mortgage Securities No.1 PLC			6.489% due 12/15/2023	40,574	37,162
1.300% due 06/15/2045	EUR 3,120	2,944	Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust		
Legacy Mortgage Asset Trust			4.126% due 02/25/2036 (c)	18,209	17,982
0.000% due 09/25/2059 (g)	USD 621,026	3,092	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust		
0.000% due 09/25/2059	18,314	5,964	4.096% due 02/25/2036	14,415	13,278
3.000% due 09/25/2059	107,358	100,159	Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust		
4.040% due 09/25/2059	129,610	94,743	4.046% due 07/25/2036	10,169	4,363
5.382% due 01/28/2070	33,490	33,407	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
Lehman XS Trust			2.982% due 11/25/2037	1,247	923
3.786% due 02/25/2037 (c)	13,119	11,256	6.000% due 12/25/2035 (c)	USD 481	199
3.966% due 09/25/2036	5,858	4,627	Morgan Stanley Reremic Trust		
3.966% due 12/25/2036	11,465	8,775	3.404% due 11/26/2036	6,042	5,270
4.106% due 02/25/2047	22,721	20,159	Mortgage Loan Trust		
5.286% due 10/25/2037	13,965	12,686	5.370% due 03/25/2034	3,310	2,983
6.500% due 06/25/2046	4,809	3,783	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust		
Long Beach Mortgage Loan Trust			3.790% due 11/15/2032	1,400	1,262
3.966% due 02/25/2036	5,414	4,396	3.821% due 02/15/2039	2,900	2,542
3.966% due 03/25/2046	33,650	12,211	5.471% due 02/15/2033	3,204	3,189
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust			New York Mortgage Trust		
6.836% due 03/25/2032	861	862	4.126% due 04/25/2035	623	590
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			Newgate Funding PLC		

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)			額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
2.903% due 12/15/2050	GBP	18,103	19,644	5.161% due 04/25/2034	USD	1,204	1,078
Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust				Residential Asset Mortgage Products Trust			
5.034% due 05/25/2035 (c)	USD	2,890	1,462	3.936% due 10/25/2036		16,691	15,347
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				4.186% due 02/25/2036		1,793	1,767
4.351% due 05/25/2035		7,329	7,116	4.261% due 11/25/2035		10,786	10,472
5.745% due 10/25/2036 (c)		21,971	5,648	4.266% due 12/25/2035		10,537	9,485
Nomura Resecuritization Trust				4.336% due 09/25/2035		8,801	8,560
1.931% due 03/26/2037		5,987	5,348	RESIMAC Bastille Trust			
NovaStar Mortgage Funding Trust				4.073% due 09/05/2057		1,612	1,612
3.786% due 09/25/2037		18,680	17,949	Saxon Asset Securities Trust			
3.906% due 05/25/2036		5,904	5,727	2.472% due 03/25/2035 (c)		506	490
3.906% due 10/25/2036		5,502	3,076	5.336% due 12/25/2037		3,000	2,779
4.306% due 10/25/2035		1,341	1,319	Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
NYO Commercial Mortgage Trust				4.126% due 03/25/2036		5,085	4,500
5.408% due 11/15/2038		30,000	27,559	4.411% due 10/25/2035		10,136	8,950
5.958% due 11/15/2038		14,400	12,906	4.636% due 03/25/2035		6,663	6,391
Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates				Sequoia Mortgage Trust			
4.336% due 07/25/2035		7,965	7,845	3.889% due 05/20/2035		1,334	1,144
Option One Mortgage Loan Trust				4.009% due 06/20/2034		26	23
3.686% due 02/25/2037		15,375	7,894	Sestante Finance Srl			
3.706% due 03/25/2037		8,563	8,044	1.722% due 07/23/2046	EUR	9,116	8,373
3.726% due 03/25/2037		36,689	31,460	SFO Commercial Mortgage Trust			
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				5.812% due 05/15/2038	USD	885	792
4.321% due 09/25/2035		3,107	2,974	6.312% due 05/15/2038		22,000	19,666
4.366% due 09/25/2035 (c)		25,075	21,044	SG Mortgage Securities Trust			
P People's Financial Realty Mortgage Securities Trust				3.946% due 02/25/2036		4,822	2,792
3.746% due 09/25/2036		26,527	5,363	4.046% due 07/25/2036		8,218	1,900
Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust (c)				Shamrock Residential DAC			
3.622% due 07/25/2035		9,601	6,963	1.793% due 12/24/2059	EUR	12,335	11,838
3.896% due 11/25/2036		15,163	12,154	Soundview Home Loan Trust			
Precise Mortgage Funding PLC				4.006% due 06/25/2036 (c)	USD	7,737	6,348
0.000% due 12/12/2055	GBP	0	1,130	4.051% due 06/25/2036 (c)		46,197	38,888
PRET LLC				4.066% due 07/25/2036		24,020	20,998
1.843% due 09/25/2051	USD	42,432	38,399	4.561% due 03/25/2036		8,102	6,960
Quest Trust				Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
5.011% due 03/25/2035		2,667	2,644	4.561% due 12/25/2035		830	804
RAAC Trust				SREIT Trust			
4.291% due 02/25/2036 (c)		9,049	8,328	4.857% due 10/15/2038		24,605	23,162
4.336% due 06/25/2047		21,346	16,791	5.205% due 10/15/2038		20,425	18,843
RBSGC Mortgage Loan Trust				Stratton Mortgage Funding PLC			
6.000% due 01/25/2037 (c)		2	2	3.546% due 09/25/2051	GBP	2,000	2,231
Real Estate Asset Liquidity Trust				Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
2.419% due 06/12/2054	CAD	5,647	4,040	2.771% due 05/25/2035 (c)	USD	56	43
Renaissance Home Equity Loan Trust				3.133% due 06/25/2037		2,004	1,830
4.306% due 11/25/2034	USD	53	45	3.810% due 07/25/2035 (c)		2,194	1,162
4.586% due 09/25/2037		37	31	3.906% due 10/25/2035		4,271	3,912
5.612% due 04/25/2037		10,124	3,114	4.561% due 08/25/2035		9,770	8,747
5.675% due 06/25/2037 (c)		3,910	1,207	Structured Asset Investment Loan Trust			
Residential Accredit Securities Corporation Trust				3.736% due 06/25/2036		6,701	6,423
3.806% due 02/25/2037		22,285	21,082	4.306% due 04/25/2035		4,464	4,381
3.886% due 01/25/2037		35,930	26,406	4.386% due 02/25/2034		14,796	14,296
4.081% due 04/25/2036		7,681	7,540	4.786% due 12/25/2034		2,867	2,823
4.201% due 03/25/2036		5,500	5,037	Structured Asset Mortgage Investments II Trust			
4.561% due 09/25/2035		6,582	6,382	4.006% due 09/25/2047 (c)		21,264	22,853

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
4.026% due 05/25/2036	9,948	7,658	4.006% due 03/25/2037		
4.155% due 04/19/2035	1,655	1,548	Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates	794	769
Structured Asset Mortgage Investments Trust			4.186% due 04/25/2034	3,873	3,657
4.140% due 09/19/2032	20	19	Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust		
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust			4.464% due 10/25/2036 (c)	174	159
3.716% due 05/25/2036	6,031	5,827	WFRBS Commercial Mortgage Trust		
3.836% due 05/25/2036	3,750	3,064	0.423% due 03/15/2047 (g)	8,800	50
3.846% due 04/25/2036	51	51	モーゲージバック証券合計		<u>3,574,196</u>
3.896% due 07/25/2036	17,559	17,049	(取得原価 3,974,104千米ドル)		
3.906% due 10/25/2036	2,804	1,925	アセットバック証券 4.1%		
4.086% due 04/25/2031	8,945	8,768	AASET Trust		
4.516% due 11/25/2035	9,825	9,781	3.967% due 05/16/2042	153	118
Summerhill Residential			ALESCO Preferred Funding XI Ltd.		
0.000% due 03/24/2059	EUR 5	4	4.054% due 12/23/2036	5,000	4,306
1.793% due 03/24/2059	147,216	144,290	American Homes 4 Rent Trust		
2.193% due 03/24/2059	EUR 22,011	21,535	6.231% due 10/17/2036	1,150	1,131
2.743% due 03/24/2059	17,746	17,350	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.		
3.343% due 03/24/2059	14,202	13,785	5.226% due 05/15/2037	3,146	3,061
4.593% due 03/24/2059	8,521	8,256	Auto Asset-Backed Securities Spanish Loans Fondo Titulizacion		
5.943% due 03/24/2059	4,256	4,123	2.909% due 02/28/2032	EUR 2,000	1,928
6.500% due 03/24/2059	6,568	5,512	BlueMountain CLO XXII Ltd.		
6.943% due 03/24/2059	4,256	4,125	5.159% due 07/15/2031	USD 3,900	3,779
7.000% due 03/24/2059	35,506	27,651	BPCRE Ltd.		
Sutherland Commercial Mortgage Loans			5.816% due 01/16/2037	13,800	13,672
3.192% due 05/25/2037	USD 50	50	6.516% due 01/16/2037	3,468	3,441
Taurus UK DAC			7.216% due 01/16/2037	13,516	13,133
2.637% due 06/22/2029	GBP 5,417	6,119	Cairn CLO III DAC		
Terwin Mortgage Trust			2.688% due 10/20/2028	EUR 2,270	2,216
4.966% due 03/25/2035	USD 2,943	2,712	Cairn CLO VI DAC		
Tharaldson Hotel Portfolio Trust			0.935% due 07/25/2029	1,584	1,548
5.499% due 11/11/2034	4,718	4,428	Castlelake Aircraft Securitization Trust		
Towd Point Mortgage Trust			4.125% due 06/15/2043	USD 1,461	1,281
3.750% due 09/25/2062	104,988	97,533	Cologix Canadian Issuer LP		
Trinidad Mortgage Securities PLC			4.940% due 01/25/2052	CAD 1,800	1,217
3.110% due 01/24/2059	GBP 5,042	5,746	FAB CBO BV		
Truman Capital Mortgage Loan Trust			1.826% due 08/20/2080 (c)	EUR 80	78
3.846% due 03/25/2036	USD 849	838	Gateway Casinos & Entertainment Ltd.		
Verus Securitization Trust			5.000% due 03/12/2038	CAD 8,464	5,402
4.474% due 04/25/2067	32,656	30,704	Goodgreen		
Wachovia Mortgage Loan Trust			3.930% due 10/15/2053	USD 4,635	4,212
4.276% due 10/25/2035	3,180	2,781	Harley Marine Financing LLC		
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			6.682% due 05/15/2043	4,913	4,318
4.306% due 01/25/2045	412	370	Humboldt Americas LLC		
Warwick Finance Residential Mortgages Number Three PLC			0.000% due 11/30/2022	COP 62,570,000	12,281
0.000% due 12/21/2049	GBP 0	272	Jubilee CLO DAC		
3.040% due 12/21/2049	27,586	31,734	2.128% due 07/12/2028	EUR 87	86
3.798% due 12/21/2049	4,921	5,658	KKR CLO 18 Ltd.		
4.240% due 12/21/2049	2,460	2,827	5.134% due 07/18/2030	USD 1,792	1,755
4.740% due 12/21/2049	1,406	1,615	LoanCore Issuer Ltd.		
5.240% due 12/21/2049	1,406	1,614	4.712% due 07/15/2036	2,350	2,253
6.670% due 12/21/2049	0	3,395	4.712% due 11/15/2038	19,100	18,319
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (c)			METAL LLC		
2.221% due 10/25/2046	USD 10,743	8,696	4.581% due 10/15/2042	11,855	5,958
5.500% due 11/25/2035	62	54	MF1 LLC		
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
5.617% due 06/19/2037	22,100	21,693	3.875% due 04/16/2050	2,600	2,021
6.102% due 09/17/2037	9,600	9,503	Argentina Government International Bond		
6.117% due 06/19/2037	8,236	8,034	0.500% due 07/09/2030	78,827	16,176
MMcapS Funding XVII Ltd.			1.000% due 07/09/2029	4,943	1,023
3.432% due 12/01/2035	544	535	1.500% due 07/09/2035	51,459	10,237
National Collegiate Student Loan Trust			1.500% due 07/09/2046	1,035	212
2.824% due 10/25/2033	4,462	4,290	3.500% due 07/09/2041	44,349	10,644
Navient Private Education Loan Trust			3.875% due 01/09/2038	25,740	6,696
4.312% due 11/15/2068	1,550	1,487	Argentina Treasury Bond BONCER (i)		
5.562% due 12/15/2045	3,003	3,027	1.400% due 03/25/2023	ARS 591,348	6,042
Nelnet Student Loan Trust			1.450% due 08/13/2023	289,924	2,603
4.386% due 09/25/2065	2,798	2,760	Argentine Bonos del Tesoro		
Rockford Tower Europe CLO DAC			15.500% due 10/17/2026	49,200	36
2.060% due 12/20/2031	EUR 12,800	12,324	Asian Development Bank		
Sapphire Aviation Finance I Ltd.			4.700% due 03/12/2024	MXN 18,100	834
4.250% due 03/15/2040	USD 17,848	13,603	Australia Government Bond		
Saranac CLO III Ltd.			1.750% due 06/21/2051	AUD 38,100	14,846
5.202% due 06/22/2030	26,301	25,876	Autonomous City of Buenos Aires Argentina		
SMB Private Education Loan Trust			69.966% due 02/22/2028	ARS 76,810	261
0.000% due 02/16/2055	3	6,208	72.219% due 03/29/2024	62,559	211
3.940% due 02/16/2055	25,092	23,095	Colombia Government International Bond		
4.241% due 02/16/2055	25,092	24,319	4.000% due 02/26/2024	USD 1,600	1,535
4.550% due 02/16/2055	8,414	7,696	International Finance Corp.		
4.950% due 02/16/2055	2,185	1,977	8.000% due 10/09/2023	IDR 12,600,000	816
5.950% due 02/16/2055	3,907	3,591	Israel Government International Bond		
Sound Point CLO XV Ltd.			3.800% due 05/13/2060	USD 17,000	12,219
5.225% due 01/23/2029	1,568	1,546	4.500% due 04/03/2120	3,800	2,906
Taberna Preferred Funding I Ltd.			Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER		
4.218% due 07/05/2035	3,362	3,064	0.000% due 05/19/2023	ARS 2,281,600	10,433
Theorem Funding Trust			Peru Government International Bond		
6.060% due 12/15/2028	8,372	8,224	5.350% due 08/12/2040	PEN 749	134
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			5.400% due 08/12/2034	862	168
4.212% due 05/17/2032	472	399	5.940% due 02/12/2029	38,611	8,704
TICP CLO III-2 Ltd.			6.150% due 08/12/2032	32,985	7,080
5.083% due 04/20/2028	10,405	10,302	6.350% due 08/12/2028	32,430	7,582
Tropic CDO V Ltd.			6.950% due 08/12/2031	327	76
4.399% due 07/15/2036	10,258	9,745	8.200% due 08/12/2026	80,750	20,935
TRTX Issuer Ltd.			Provincia de Buenos Aires		
4.441% due 02/15/2039	4,500	4,351	72.723% due 04/12/2025	ARS 399,853	1,197
TruPS Financials Note Securitization Ltd.			Romania Government International Bond		
4.844% due 03/30/2039	19,698	18,960	1.750% due 07/13/2030	EUR 21,200	14,151
5.097% due 09/20/2039	3,631	3,440	2.125% due 03/07/2028	9,200	7,165
Upstart Pass-Through Trust			2.875% due 04/13/2042	15,000	7,852
3.800% due 04/20/2030	USD 27,081	25,314	Russia Government International Bond		
Upstart Securitization Trust			4.250% due 06/23/2027	USD 28,400	14,200
5.500% due 06/20/2032	11,653	11,549	4.375% due 03/21/2029	200	90
Venture XVII CLO Ltd.			4.750% due 05/27/2026	23,800	11,900
4.959% due 04/15/2027	25,095	24,656	4.875% due 09/16/2023	2,200	1,606
Venture XXI CLO Ltd.			5.100% due 03/28/2035	3,200	1,408
4.959% due 07/15/2027	212	212	5.250% due 06/23/2047	82,400	39,552
アセットバック証券合計		397,273	5.625% due 04/04/2042	37,000	18,500
(取得原価 427,456千米ドル)			5.875% due 09/16/2043	13,200	6,864
ソブリン発行体 6.2%			7.150% due 11/12/2025	RUB 4,002,466	32,435
Abu Dhabi Government International Bond			7.500% due 03/31/2030	USD 4,748	3,466

		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
7.950% due 10/07/2026	RUB	1,564,954	12,682	Neiman Marcus Group Ltd. LLC	151,112	27,423
12.750% due 06/24/2028	USD	4,012	2,739	Noble Corp. PLC	768,399	27,693
14.730% due 04/24/2024	RUB	5,057,901	40,988	Stearns Holdings LLC	110,747	0
Serbia Government International Bond				Voyager Aviation Holdings LLC	616	0
1.650% due 03/03/2033	EUR	4,900	2,877		証券数	時価 (千米ドル)
3.125% due 05/15/2027		4,434	3,744	Westmoreland Mining Holdings LLC	8,912	98
South Africa Government International Bond				普通株式合計		120,350
8.000% due 01/31/2030	ZAR	61,300	2,865	(取得原価 176,368千米ドル)		
8.250% due 03/31/2032		73,300	3,285	商業不動産証券 0.3%		
8.750% due 02/28/2048		34,700	1,427	CBL & Associates Properties, Inc.	6	172
8.875% due 02/28/2035		52,400	2,328	Uniti Group, Inc.	110	850
10.500% due 12/21/2026		2,153,900	122,824	VICI Properties, Inc.	760	24,350
State Agency of Roads of Ukraine				商業不動産証券合計		25,372
6.250% due 06/24/2030 (h)	USD	1,200	181	(取得原価 6.351千米ドル)		
Turkey Government International Bond				エクイティリンク証券 0.0%		
4.250% due 03/13/2025		34,000	30,894	Intelsat Jackson Holdings S.A.		
5.250% due 03/13/2030		29,000	21,743	12/31/2049	210	1,040
6.125% due 10/24/2028		10,100	8,445	エクイティリンク証券合計		1,040
7.625% due 04/26/2029		30,900	27,407	(取得原価 0千米ドル)		
Turkiye Ithracat Kredi Bankasi A/S				ワラント 0.0%		
8.250% due 01/24/2024		3,000	2,959	Intelsat S.A.		
Ukraine Government International Bond				02/17/2027	26	91
4.375% due 01/27/2032 (h)	EUR	1,658	262	Sequa Corp.		
7.750% due 09/01/2025	USD	4,390	951	12/31/2049	10	8
United Kingdom Gilt				Stearns Holdings LLC		
1.250% due 07/31/2051	GBP	180	120	12/31/2049	1	0
1.500% due 07/22/2047		80	59	Windstream Services LLC		
1.750% due 01/22/2049		160	125	09/21/2055	226	3,732
3.250% due 01/22/2044		150	158	ワラント合計		3,831
3.500% due 01/22/2045		140	153	(取得原価 22.629千米ドル)		
Venezuela Government International Bond (c)				優先証券 0.0%		
6.000% due 12/09/2049	USD	3,367	219	Cayenne Aviation LLC		
7.000% due 03/31/2038		1,883	141	9.500%	3,693	1,057
7.650% due 04/21/2025		5,349	401	Sequa Corp.		
7.750% due 04/13/2024		1,200	78	15.000%	1,418	1,828
8.250% due 10/13/2024		5,991	434	優先証券合計		2,885
9.000% due 05/07/2023		3,161	205	(取得原価 2,292千米ドル)		
9.250% due 09/15/2027		4,274	321			
9.250% due 05/07/2028		6,512	488		額面 (千通貨)	
11.750% due 10/21/2026		680	51	短期金融商品 11.0%		
11.950% due 08/05/2031		6,000	450	コマーシャルペーパー 4.0%		
ソブリン発行体合計			596,820	Federal Home Loan Bank		
(取得原価 860,427千米ドル)				3.060% due 01/03/2023	USD	104,700
				3.060% due 01/04/2023		77,700
				3.070% due 01/06/2023		98,700
				3.070% due 01/10/2023		98,600
				買戻契約 6.2%		379,713
						597,100
普通株式 1.3%				定期預金 0.6%		
Cairo Mezz PLC		847,444	96	10.323		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		5,292,182	7,568	Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
Constellation Oil Services Holding S.A.		421,249	46	1.410% due 11/01/2022	GBP	276
Credit Suisse Group AG		601,156	2,492	1.620% due 11/01/2022	AUD	1,199
Eurobank Ergasias Services & Holdings S.A.		10,169,333	10,040	2.580% due 11/01/2022	USD	5,180
iHeartMedia, Inc. Class A		1,246,745	7,209			
iHeartMedia, Inc. Class B		967,427	7,209			
Intelsat S.A.		963,915	26,990			
National Bank of Greece S.A.		102,570	372			

	額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)		額面 (千通貨)	時価 (千米ドル)
Bank of Nova Scotia			1.410% due 11/01/2022	GBP	1,469
2.580% due 11/01/2022	427	427	2.580% due 11/01/2022	USD	4,474
2.810% due 11/01/2022	CAD	164			<u>53,185</u>
BNP Paribas Bank			米国短期国債 0.3%		
(0.240%) due 11/01/2022	CHF	1	2.759% due 11/25/2022 (k)		13,900
0.310% due 11/01/2022	EUR	1,602	2.901% due 12/01/2022 (j)		13,300
0.420% due 11/01/2022	DKK	3			<u>27,132</u>
1.290% due 11/01/2022	NOK	562	短期金融商品合計		<u>1,057,130</u>
1.620% due 11/01/2022	AUD	81	(取得原価 1,057,127千米ドル)		
2.050% due 11/01/2022	NZD	509	有価証券投資合計(a) 126.3%		12,119,648
5.150% due 11/01/2022	ZAR	8,091	(取得原価 13,587,614千米ドル)		
Brown Brothers Harriman & Co.			金融デリバティブ商品 (1.5%)		(148,626)
(0.270%) due 11/01/2022	JPY	132	(取得原価またはプレミアム (純額) (32,050千米ドル)		
0.310% due 11/01/2022	EUR	1	その他の資産および負債 (純額) (24.8%)		<u>(2,376,583)</u>
0.850% due 11/01/2022	SEK	1	純資産 100.0%		<u>9,594,439</u>
2.580% due 11/01/2022	USD	3			
Citibank N.A.					
2.580% due 11/01/2022		4,337	4,337	投資有価証券明細表に対する注記:	
DBS Bank Ltd.					
2.580% due 11/01/2022		2,702	2,702	*額面及び時価が0となっている証券は、千単位未満で四捨五入した数値を表示して	
HSBC Bank PLC					
0.310% due 11/01/2022	EUR	558	551	いる場合があります。	
JPMorgan Chase Bank N.A.				(a)2022年10月31日現在の純資産に対する地域別投資割合は、米国99.6%、英国	
2.580% due 11/01/2022	USD	5,782	5,782	5.2%、その他21.5%です。	
MUFG Bank Ltd.				(b)この金額の全部または一部は、未実行のローン・コミットメントです。未実行部	
(0.270%) due 11/01/2022	JPY	251,387	1,691	分の利率は、実行時に決定されます。	
Royal Bank of Canada				(c)当該証券は、デフォルト状態にあります。	
2.580% due 11/01/2022	USD	5,725	5,725	(d)偶発転換社債です。	
2.810% due 11/01/2022	CAD	129	94	(e)永久債の償還日は、コール日を記載しています。	
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				(f)ペイメント・イン・カインド債券です。当該債券は、利息支払いに現金ではなく	
(0.270%) due 11/01/2022	JPY	2	0	現物債を充当できる債券です。	
0.310% due 11/01/2022	EUR	12,088	11,947	(g)当該証券は、インタレスト・オンリー(「IO」)またはIOストリップです。	
1.410% due 11/01/2022	GBP	222	256	(h)発行時決済証券です。	
2.580% due 11/01/2022	USD	4,392	4,392	(i)当該証券の額面金額は、インフレ調整後のものです。	
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				(j)利率は満期までの利回りです。	
(0.270%) due 11/01/2022	JPY	44,520	300	(k)利率は満期までの利回り(加重平均)です。	

D I A Mマネーマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2022年4月5日）

（計算期間 2021年4月6日～2022年4月5日）

D I A Mマネーマザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2009年10月29日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保をめざします。
主要投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 外貨建て資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券 組入比率	新株予約権 付社債 (転換社債)	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率				
9期(2018年4月5日)	10,099	△0.0	71.1	—	—	百万円 1,030
10期(2019年4月5日)	10,098	△0.0	79.4	—	—	16,167
11期(2020年4月6日)	10,089	△0.1	69.3	—	—	1,139
12期(2021年4月5日)	10,080	△0.1	62.4	—	—	1,064
13期(2022年4月5日)	10,071	△0.1	76.3	—	—	1,192

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

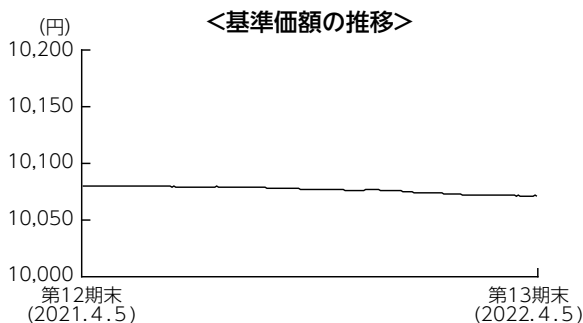
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債 組 入 比	券 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 組 入 比 率	債 先 物 比	券 率
	円	騰 落 率					
(期 首) 2021年 4 月 5 日	10,080	% -		% 62.4		% -	% -
4 月 末	10,080	0.0		61.9		-	-
5 月 末	10,080	0.0		63.1		-	-
6 月 末	10,079	△0.0		82.8		-	-
7 月 末	10,079	△0.0		63.7		-	-
8 月 末	10,078	△0.0		68.1		-	-
9 月 末	10,077	△0.0		68.1		-	-
10 月 末	10,077	△0.0		74.2		-	-
11 月 末	10,076	△0.0		74.2		-	-
12 月 末	10,074	△0.1		76.4		-	-
2022年 1 月 末	10,073	△0.1		76.4		-	-
2 月 末	10,072	△0.1		76.4		-	-
3 月 末	10,071	△0.1		76.4		-	-
(期 末) 2022年 4 月 5 日	10,071	△0.1		76.3		-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月6日から2022年4月5日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は10,071円となり、前期末比で0.1%下落しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主としてわが国の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざした運用を行いました。日銀のマイナス金利政策の影響が大きく基準価額は前期末比で下落して期末を迎えました。

投資環境

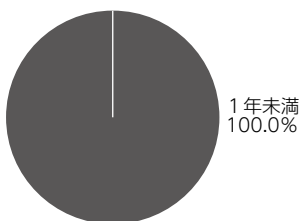
国内短期金融市場では、3ヵ月物国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。

ポートフォリオについて

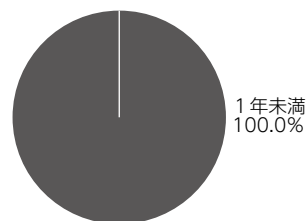
残存期間の短い国債などで運用を行いました。

【運用状況】 ※比率は組入債券の時価評価額に対する割合です。

○残存年限別構成比 期首（前期末）



当期末



今後の運用方針

日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成に向け、引き続き緩和的な金融政策を継続していくと予想しています。そのため、今後も公社債などへの投資を通じて、安定的な運用をめざします。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2021年4月6日から2022年4月5日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	911,871	(400,000)
	特 殊 債 券	—	(263,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2021年4月6日から2022年4月5日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 911	百万円 400	% 44.0	百万円 —	百万円 —	% —

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	910,000	910,671	76.3	—	—	—	76.3
合 計	910,000	910,671	76.3	—	—	—	76.3

(注) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期		末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 1 3 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	210,000	210,060	2022/06/01
4 1 5 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,120	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,154	2022/09/01
4 1 8 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	200,000	200,216	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	100,000	100,121	2022/12/01
合 計	—	910,000	910,671	—

■投資信託財産の構成

2022年4月5日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
	910,671	76.3	910,671	76.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	282,092	23.7	282,092	23.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,192,764	100.0	1,192,764	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月5日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,192,764,024円
コ ー ル ・ 口 ン 等	281,847,683
公 社 債(評価額)	910,671,900
未 収 利 息	221,428
前 払 費 用	23,013
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,192,764,024
元 本	1,184,299,773
次 期 繰 越 損 益 金	8,464,251
(D) 受 益 権 総 口 数	1,184,299,773口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,071円

(注1) 期首元本額	1,056,034,563円	みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) ブラジルリアルコース	9,925円
追加設定元本額	148,321,314円	USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジあり	9,924円
一部解約元本額	20,056,104円	USストラテジック・インカム・ファンド (年1回決算型) ヘッジなし	9,924円
(注2) 期末における元本の内訳		マッシュューズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
短期ハイイールド債券ファンド (ヘッジあり)	990,775円	One世界分散セレクト (Aコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし)	15,843,407円	One世界分散セレクト (Bコース)	99,040円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり)	13,867,169円	One世界分散セレクト (Cコース)	99,040円
新光バンクローン・ファンド・ネオ (円ヘッジ型)	5,049,059円	世界8資産リスク分散バランスファンド (目標払出し型)	99,109円
バンクローン・ファンド (ヘッジなし/年1回決算型)	1,088,285円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジあり)	188,380円
バンクローン・ファンド (ヘッジあり/年1回決算型)	98,095円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (毎月決算型) (為替ヘッジなし)	109,063円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド10月号	3,959,763円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジあり)	297,442円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド11月号	989,197円	モルガン・スタンレーUSハイイールド債券ファンド (年1回決算型) (為替ヘッジなし)	118,977円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド12月号	494,102円	ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド1月号	494,102円	期末元本合計	1,184,299,773円
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド2月号	48,517円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド3月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド4月号	11,377円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド5月号	98,027円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド6月号	989,197円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド7月号	395,083円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド8月号	494,102円		
新光ビムコ・ストラテジック・インカム・ファンド9月号	494,102円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジあり>	791,316円		
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス<為替ヘッジなし>	2,474,972円		
クルーズコントロール	990,000,991円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円		
DIAM新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<米ドルコース>	5,972円		
USストラテジック・インカム・ファンドAコース (為替ヘッジあり)	993,740円		
USストラテジック・インカム・ファンドBコース (為替ヘッジなし)	1,987,479円		
DIAM・ジャナス グローバル債券コアプラス・ファンド<D/C年金>	9,935円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 円コース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 米ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) 豪ドルコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) メキシコペソコース	9,925円		
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー (通貨選択型) トルコリラコース	9,925円		

■損益の状況

当期 自2021年4月6日 至2022年4月5日

項	目	当	期
(A)	配当等収益		1,715,799円
	受取利息		1,785,127
	支払利息		△69,328
(B)	有価証券売買損益		△2,682,620
	売却		△2,682,620
	買入		
(C)	当期損益金(A+B)		△966,821
(D)	前期繰越損益金		8,469,295
(E)	解約差損益金		△160,435
(F)	追加信託差損益金		1,122,212
(G)	合計(C+D+E+F)		8,464,251
	次期繰越損益金(G)		8,464,251

(注1) (B)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) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。