

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

	毎月決算型	年2回決算型
商品分類	追加型投信／内外／債券	
信託期間	2017年5月31日から2027年9月13日までです。	
運用方針	「Amundi Funds ストラテジック・インカム」への投資を通じて、主として世界各国の公社債等へ実質的に投資を行い、インカムゲイン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。また、「CAマネーパールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行います。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	Amundi Funds インカムファンド (為替ヘッジなし/毎月決算型) (為替ヘッジなし/年2回決算型)	Amundi Funds ストラテジック・インカム CAマネーパールファンド (適格機関投資家専用)
	Amundi Funds ストラテジック・インカム	世界各国の公社債等
	CAマネーパールファンド (適格機関投資家専用)	本邦通貨表示の短期公社債
組入制限	株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時（年12回、原則毎月12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。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた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、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	毎決算時（年2回、原則毎年3月および9月の各12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。分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた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、委託者が基準価額水準および市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

愛称：ボンドアクセル  
アムンディ・ストラテジック・インカムファンド  
(為替ヘッジなし/毎月決算型) (為替ヘッジなし/年2回決算型)

運用報告書（全体版）

毎月決算型 第15作成期  
第83期（決算日 2024年4月12日）  
第84期（決算日 2024年5月13日）  
第85期（決算日 2024年6月12日）  
第86期（決算日 2024年7月12日）  
第87期（決算日 2024年8月13日）  
第88期（決算日 2024年9月12日）  
年2回決算型 第15期（決算日 2024年9月12日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、よろしく願い申し上げます。

アムンディ・ジャパン株式会社

〒105-0021 東京都港区東新橋1丁目9番2号

お客様サポートライン：050-4561-2500

受付は委託会社の営業日の午前9時から午後5時まで

ホームページアドレス：<https://www.amundi.co.jp/>

# アムディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■最近5作成期の運用実績

	決 算 期	基 準 価 額			投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	純 資 産 総 額
		(分 配 落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率			
		円	円	%	%	%	百万円
第11 作成期	59期（2022年4月12日）	10,332	20	4.9	0.1	97.7	876
	60期（2022年5月12日）	10,420	20	1.0	0.1	98.0	883
	61期（2022年6月13日）	10,690	20	2.8	0.1	98.1	902
	62期（2022年7月12日）	10,678	20	0.1	0.1	98.0	886
	63期（2022年8月12日）	10,607	20	△0.5	0.1	97.4	876
	64期（2022年9月12日）	11,094	20	4.8	0.1	98.2	913
第12 作成期	65期（2022年10月12日）	10,801	20	△2.5	0.1	98.1	884
	66期（2022年11月14日）	10,330	20	△4.2	0.1	98.3	846
	67期（2022年12月12日）	10,415	20	1.0	0.1	98.6	853
	68期（2023年1月12日）	10,149	20	△2.4	0.1	97.8	828
	69期（2023年2月13日）	10,125	20	△0.0	0.1	98.2	826
	70期（2023年3月13日）	10,254	20	1.5	0.1	98.5	837
第13 作成期	71期（2023年4月12日）	10,300	20	0.6	0.1	98.8	841
	72期（2023年5月12日）	10,386	20	1.0	0.1	97.9	844
	73期（2023年6月12日）	10,574	20	2.0	0.1	98.3	849
	74期（2023年7月12日）	10,527	20	△0.3	0.1	97.6	842
	75期（2023年8月14日）	10,853	20	3.3	0.1	97.8	863
	76期（2023年9月12日）	10,906	20	0.7	0.1	98.4	865
第14 作成期	77期（2023年10月12日）	10,854	20	△0.3	0.1	98.6	861
	78期（2023年11月13日）	11,001	20	1.5	0.1	98.2	868
	79期（2023年12月12日）	10,972	20	△0.1	0.1	97.7	832
	80期（2024年1月12日）	11,214	20	2.4	0.1	98.3	849
	81期（2024年2月13日）	11,440	20	2.2	0.1	98.7	865
	82期（2024年3月12日）	11,372	20	△0.4	0.1	98.6	849
第15 作成期	83期（2024年4月12日）	11,580	20	2.0	0.1	98.5	836
	84期（2024年5月13日）	11,878	20	2.7	0.1	98.9	857
	85期（2024年6月12日）	12,055	20	1.7	0.1	98.8	869
	86期（2024年7月12日）	12,391	20	3.0	0.1	98.7	893
	87期（2024年8月13日）	11,701	20	△5.4	0.1	98.7	843
	88期（2024年9月12日）	11,590	20	△0.8	0.1	98.6	834

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■ 当作成期中の基準価額等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
		円	騰 落 率		
第83期	(期 首) 2024年3月12日	11,372	—	0.1	98.6
	3月末	11,707	2.9	0.1	98.2
	(期 末) 2024年4月12日	11,600	2.0	0.1	98.5
第84期	(期 首) 2024年4月12日	11,580	—	0.1	98.5
	4月末	11,834	2.2	0.1	98.7
	(期 末) 2024年5月13日	11,898	2.7	0.1	98.9
第85期	(期 首) 2024年5月13日	11,878	—	0.1	98.9
	5月末	11,931	0.4	0.1	98.6
	(期 末) 2024年6月12日	12,075	1.7	0.1	98.8
第86期	(期 首) 2024年6月12日	12,055	—	0.1	98.8
	6月末	12,432	3.1	0.1	98.5
	(期 末) 2024年7月12日	12,411	3.0	0.1	98.7
第87期	(期 首) 2024年7月12日	12,391	—	0.1	98.7
	7月末	11,936	△3.7	0.1	98.7
	(期 末) 2024年8月13日	11,721	△5.4	0.1	98.7
第88期	(期 首) 2024年8月13日	11,701	—	0.1	98.7
	8月末	11,617	△0.7	0.1	98.7
	(期 末) 2024年9月12日	11,610	△0.8	0.1	98.6

(注) 期末基準価額は当該期の分配金込み、騰落率は各期首比です。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## ■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金			
	円	円	%	%	百万円
11期（2022年9月12日）	12,683	0	13.5	0.2	197
12期（2023年3月13日）	11,861	0	△ 6.5	0.2	158
13期（2023年9月12日）	12,746	0	7.5	0.2	160
14期（2024年3月12日）	13,428	0	5.4	0.2	165
15期（2024年9月12日）	13,814	0	2.9	0.2	168

（注）当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

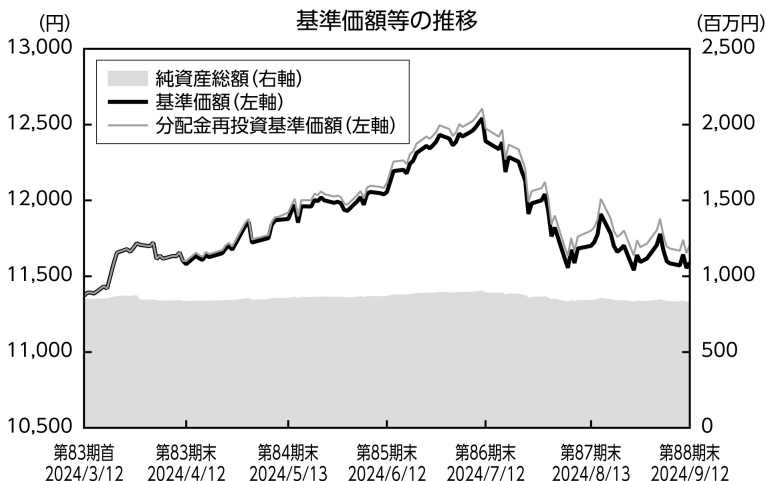
## ■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		
(期 首)	円	%	%	%
2024年3月12日	13,428	—	0.2	98.3
3月末	13,824	2.9	0.2	98.3
4月末	13,997	4.2	0.2	98.1
5月末	14,133	5.3	0.2	98.0
6月末	14,747	9.8	0.2	98.1
7月末	14,181	5.6	0.2	98.7
8月末	13,823	2.9	0.2	98.7
(期 末)				
2024年9月12日	13,814	2.9	0.2	98.4

（注）騰落率は期首比です。

## 【基準価額等の推移】

第83期首	11,372円
第88期末	11,590円
既払分配金 (税込み)	120円
騰落率	3.0% (分配金再投資ベース)



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客様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、2024年3月12日の値を基準価額と同一となるように指数化しています。

## 【基準価額の主な変動要因】

### 上昇要因

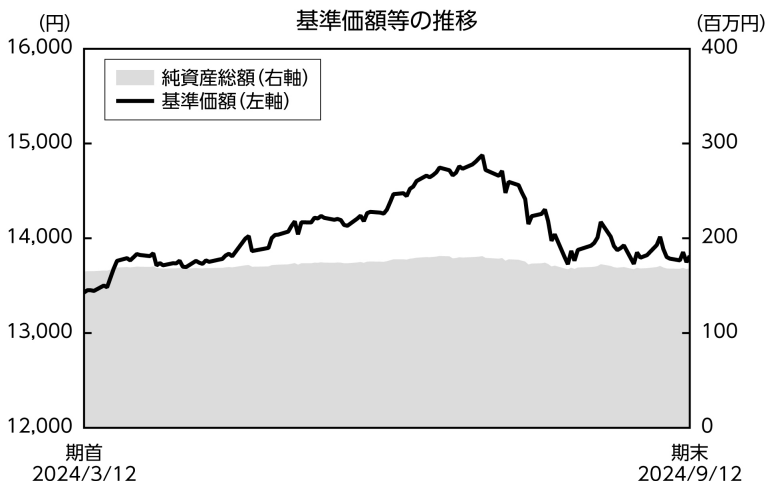
- ① 4月末から作成期末にかけて、金利が低下（債券価格は上昇）傾向にあったこと
- ② 上記期間において、社債を中心にクレジット資産を多めに組入れていたこと
- ③ 作成期初から7月中旬にかけて、為替が円安傾向にあったこと

### 下落要因

- ① 作成期初から4月末にかけて、金利が上昇（債券価格は下落）傾向にあったこと
- ② 7月中旬から作成期末にかけて、為替が円高傾向にあったこと

【基準価額等の推移】

第15期首	13,428円
第15期末	13,814円
既払分配金 (税込み)	0円
騰落率	2.9%



【基準価額の主な変動要因】

上昇要因

- ① 4月末から期末にかけて、金利が低下（債券価格は上昇）傾向にあったこと
- ② 上記期間において、社債を中心にクレジット資産を多めに組入れていたこと
- ③ 期初から7月中旬にかけて、為替が円安傾向にあったこと

下落要因

- ① 期初から4月末にかけて、金利が上昇（債券価格は下落）傾向にあったこと
- ② 7月中旬から期末にかけて、為替が円高傾向にあったこと

## 【投資環境】

### <世界の債券市場>

当（作成）期の世界債券市場は上昇しました。（作成）期初は、強い経済指標の発表がみられたため、FRB（米連邦準備理事会）の利下げが遠のいたとみられ、金利が上昇（債券価格は下落）しました。しかしその後は、インフレ率の低下と経済成長の鈍化を示す指標の発表が続いたため、FRBが今後の金融政策に対してハト派的な姿勢を示したことから、金利は低下（債券価格は上昇）に転じるとともに、クレジット市場を含むリスク資産が強含みました。堅調だった雇用統計が軟化するにより、市場では利下げ期待が膨らみ、投資家の関心はFRBが「いつ」政策金利を引き下げるかから「どこまで」政策金利を引き下げるかに移りました。また、労働市場の悪化を印象づける指標の発表により、景気後退リスクが意識される局面では、リスク資産が軟調に推移する局面もありましたが、景気の底堅さを示す指標が続く、投資家の不安が和らぐことでリスク資産が上昇しました。そのため、（作成）期を通じてみると、金利は（作成）期初と比べると大幅に低下するとともに、クレジット市場を含むリスク資産は、国債を上回るリターンとなりました。

### <為替市場>

（作成）期初、発表された米国のインフレ指標が予想外の伸びを示したことや日銀の金融緩和策の修正が決定されたものの、日銀の引き続き緩和的な政策を維持するとの声明などを受け円安・米ドル高基調となりました。また、米国の利下げ期待がさらに後退したことに加え、4月の日銀金融政策決定会合後の会見で植田総裁の発言が円安容認と受け止められ、円安・米ドル高の動きは加速しました。しかし当局による為替介入とみられる動きにより、円は対米ドルで小幅に反発しましたが、その効果は長続きせず、日米金利差は開いたままという見通しの下、ジリジリと円安・米ドル高が進行しました。その後、当局による為替介入が入ったとみられ急激な円高・米ドル安が進行していたところに、日銀による追加利上げの決定や植田総裁による想定外のタカ派発言、さらには予想以上の米国経済指標の鈍化を受けて、円キャリートレードの巻き戻しとみられる動きが活発化すると円高が加速し、米国での利下げ観測が強まったことも下落要因となった米ドルは当（作成）期末にかけて対円で大きく水準を切り下げました。

### <日本短期国債市場>

当（作成）期の短期国債市場では、TDB（国庫短期証券）3ヵ月物利回りが0%近辺から0.1%近辺に上昇しました。TDB 3ヵ月物利回りは、2024年3月に日銀によりマイナス金利政策が解除されたことで、長く続いたマイナス圏での推移から0%近辺に上昇していましたが、2024年7月には、日銀によりさらに0.25%への利上げが実施され、それにとまって利回りは0.1%近辺に上昇しました。

## 【ポートフォリオ】

### ■（為替ヘッジなし／毎月決算型）／（為替ヘッジなし／年2回決算型）

#### <当ファンド>

「為替ヘッジなし／毎月決算型」および「為替ヘッジなし／年2回決算型」は、外国投資信託「Amundi Funds ストラテジック・インカム」への投資を通じて、主として米ドル建を中心とする世界各国のさまざまな種類の公社債等に投資し、安定した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した。「Amundi Funds ストラテジック・インカム」の組入比率は、当（作成）期を通して高位を維持しました。なお、国内籍投資信託「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

### <Amundi Funds ストラテジック・インカム>

レバティブ・バリュー（相対価値）、ファンダメンタルズ（基礎的条件）、クレジットリスクに基づいて、社債よりも証券化商品をやや選好しました。証券化商品は、相対的に割安なバリュエーションの他、格付機関の信用基準が厳格になっていること、裏付資産が米国の消費者向けローンであり、グローバル経済の影響を社債よりも受けにくいことなどの優位性があります。また、当（作成）期を通じて社債のスプレッド（利回り格差）は、国債と比べて魅力があるものの、魅力度は低下してきています。ポートフォリオでは引き続き米国国債をアンダーウェイトするとともに、短中期債の金利低下の恩恵を受けやすいポジションとしました。

（アムンディ・アセットマネジメント・US・インク）

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

当（作成）期、主として12ヵ月以内に償還を迎える地方債への投資により、安定した収益の確保を旨指して運用を行いました。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

### 【分配金】

#### ■（為替ヘッジなし／毎月決算型）

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、分配を行いました（各期の分配金額および分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、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。

#### ■（為替ヘッジなし／年2回決算型）

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます（分配原資の内訳につきましては、後記の「分配金のお知らせ」をご覧ください）。なお、収益分配に充てず、信託財産内に留保した収益については、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。

### 【今後の運用方針】

#### ■（為替ヘッジなし／毎月決算型）／（為替ヘッジなし／年2回決算型）

#### <当ファンド>

「為替ヘッジなし／毎月決算型」および「為替ヘッジなし／年2回決算型」は引き続き、外国投資信託「Amundi Funds ストラテジック・インカム」の組入れを高位に保ちます。なお、「CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）」にも投資を行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）

## <Amundi Funds ストラテジック・インカム>

インフレ率が安定的に推移し、将来の労働需要に対する懸念が高まったことにより、FRBが9月に金融緩和に転じる道筋がつかまりました。歴史的にみて、FRBが利下げを開始すると国債利回りは低下する傾向にあります。しかし、市場はすでに過去の緩和サイクル開始前にみられたよりもかなり積極的な利下げ軌道を織り込んでいるため、今後の金利低下幅は抑えられると考えています。今後、国債利回りがさらに大幅に低下するには、景気後退の可能性が著しく高まる必要があると考えますが、現在の景気は軟化していても景気後退に陥っているわけではないとみています。一方で、景気が冷え込めば景気後退に転じやすくなるため、レイオフ・スパイラルの発生や個人・企業支出の急減など、景気転換のシグナルに注意を払っています。また、社債などのリスク資産への投資には引き続き慎重に取り組みます。金利低下余地が小さくなってきたため、ポートフォリオのデュレーションは縮小するものの、短中期債の金利低下の恩恵を受けやすいポジションを維持する方針です。

（アムンディ・アセットマネジメント・US・インク）

## <CAマネープールファンド（適格機関投資家専用）>

安全性重視の観点から、12ヵ月以内に償還を迎える債券への投資により安定的な運用を行います。

（アムンディ・ジャパン株式会社）



# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第83期～第88期 (2024年3月13日 ～2024年9月12日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	74円 (26) (46) ( 2 )	0.621% (0.216) (0.388) (0.017)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 ( 監 査 費 用 ) ( 印 刷 費 用 ) ( そ の 他 )	3 ( 1 ) ( 3 ) ( 0 )	0.028 (0.005) (0.023) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	77	0.649	

期中の平均基準価額は11,909円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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が支払った費用を含みません。

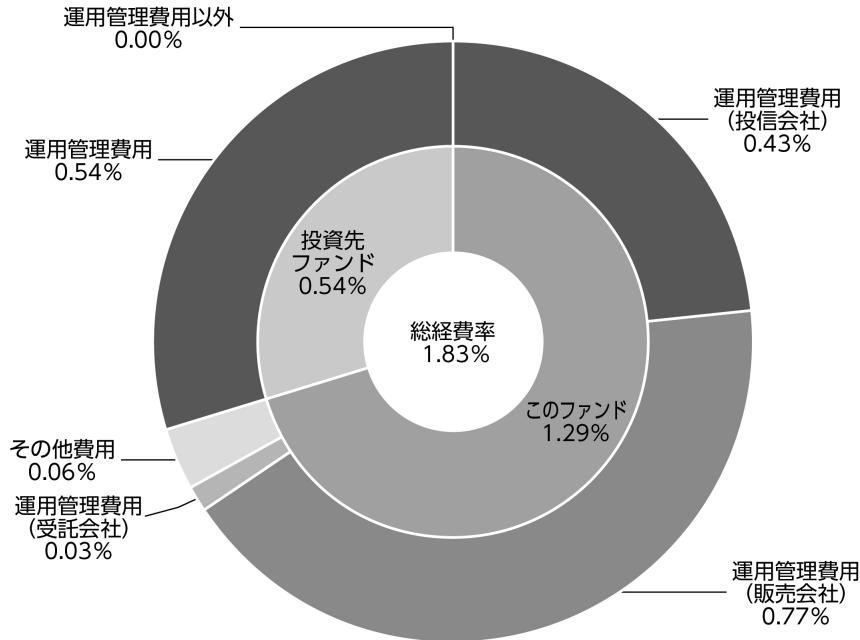
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## （参考情報）

### ●総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）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1.83%です。



総経費率 (①+②+③)	1.83%
①このファンドの費用の比率	1.29%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.54%
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です。

(注5) 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6) 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。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■売買及び取引の状況（2024年3月13日から2024年9月12日まで）

投資信託受益証券、投資証券

決 算 期		第 83 期 ～ 第 88 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) Amundi Funds ストラテジック・インカム	口 125	千米ドル 104	口 355	千米ドル 303

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年3月13日から2024年9月12日まで）

当作成期中における利害関係人との取引等はありません。

(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（2024年9月12日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘 柄		第14作成期末 (第82期末)	第15作成期末（第88期末）	
		口 数	口 数	評 価 額
C Aマネープールファンド(適格機関投資家専用)		口 476,000	口 476,000	千円 476
合 計	口 数・金 額 銘 柄 数 <比 率>	476,000 1	476,000 1	476 <0.1%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

### (2) 外国（外貨建）投資証券

銘 柄		第14作成期末 (第82期末)	第15作成期末（第88期末）		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(ルクセンブルク) Amundi Funds ストラテジック・インカム		口 6,685	口 6,456	千米ドル 5,760	千円 822,943
合 計	口 数・金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,685 1	6,456 1	5,760 -	822,943 <98.6%>

(注) 邦貨換算金額は、当作成期末の時価を日本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。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■投資信託財産の構成（2024年9月12日現在）

項 目	第15作成期末（第88期末）	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 476	% 0.1
投 資 証 券	822,943	98.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,684	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	838,103	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当作成期末における外貨建純資産（823,102千円）の投資信託財産総額（838,103千円）に対する比率は98.2%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を日本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。

なお、2024年9月12日現在における邦貨換算レートは、1米ドル＝142.85円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第83期末 (2024年4月12日)	第84期末 (2024年5月13日)	第85期末 (2024年6月12日)	第86期末 (2024年7月12日)	第87期末 (2024年8月13日)	第88期末 (2024年9月12日)
(A) 資 産	838,777,016円	859,705,952円	871,876,118円	896,352,959円	845,949,885円	838,103,639円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,235,869	11,316,944	12,336,299	13,570,210	13,065,591	14,683,444
投資信託受益証券(評価額)	476,856	476,809	476,856	476,999	476,952	476,952
投資証券(評価額)	824,064,289	847,912,196	859,062,960	882,305,747	832,407,304	822,943,200
未 収 利 息	2	3	3	3	38	43
(B) 負 債	2,376,850	2,408,733	2,438,335	2,504,314	2,590,090	3,892,533
未 払 収 益 分 配 金	1,444,522	1,443,509	1,442,505	1,442,777	1,441,537	1,439,520
未 払 解 約 金	—	—	—	—	11,092	1,359,058
未 払 信 託 報 酬	891,711	884,055	875,252	901,330	935,202	852,464
そ の 他 未 払 費 用	40,617	81,169	120,578	160,207	202,259	241,491
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	836,400,166	857,297,219	869,437,783	893,848,645	843,359,795	834,211,106
元 本	722,261,034	721,754,788	721,252,859	721,388,543	720,768,592	719,760,320
次 期 繰 越 損 益 金	114,139,132	135,542,431	148,184,924	172,460,102	122,591,203	114,450,786
(D) 受 益 権 総 口 数	722,261,034口	721,754,788口	721,252,859口	721,388,543口	720,768,592口	719,760,320口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,580円	11,878円	12,055円	12,391円	11,701円	11,590円

(注記事項)

作成期首元本額 747,039,465円

作成期中追加設定元本額 852,973円

作成期中一部解約元本額 28,132,118円

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■損益の状況

項 目	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期
	自 2024年3月13日 至 2024年4月12日	自 2024年4月13日 至 2024年5月13日	自 2024年5月14日 至 2024年6月12日	自 2024年6月13日 至 2024年7月12日	自 2024年7月13日 至 2024年8月13日	自 2024年8月14日 至 2024年9月12日
(A) 配 当 等 収 益	8,013,428円	49円	682円	8,349,186円	987円	1,535円
受 取 配 当 金	8,023,132	—	—	8,348,470	—	—
受 取 利 息	3,383	49	682	716	987	1,535
支 払 利 息	△ 13,087	—	—	—	—	—
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	9,428,771	23,850,580	15,092,583	18,279,796	△ 47,296,741	△ 5,639,037
売 買 益	34,377,892	23,850,858	15,097,814	18,279,796	17,919,445	19,718,993
売 買 損	△ 24,949,121	△ 278	△ 5,231	—	△ 65,216,186	△ 25,358,030
(C) 信 託 報 酬 等	△ 932,328	△ 924,807	△ 914,661	△ 940,959	△ 977,254	△ 891,696
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	16,509,871	22,925,822	14,178,604	25,688,023	△ 48,273,008	△ 6,529,198
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	104,858,241	119,818,617	141,177,270	153,913,369	177,963,618	128,041,421
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,784,458	△ 5,758,499	△ 5,728,445	△ 5,698,513	△ 5,657,870	△ 5,621,917
(配 当 等 相 当 額)	( 2,467,339)	( 2,486,528)	( 2,510,196)	( 2,539,803)	( 2,579,512)	( 2,614,785)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,251,797)	(△ 8,245,027)	(△ 8,238,641)	(△ 8,238,316)	(△ 8,237,382)	(△ 8,236,702)
(G) 計 (D+E+F)	115,583,654	136,985,940	149,627,429	173,902,879	124,032,740	115,890,306
(H) 収 益 分 配 金	△ 1,444,522	△ 1,443,509	△ 1,442,505	△ 1,442,777	△ 1,441,537	△ 1,439,520
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	114,139,132	135,542,431	148,184,924	172,460,102	122,591,203	114,450,786
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 5,784,458	△ 5,758,499	△ 5,728,445	△ 5,698,513	△ 5,657,870	△ 5,621,917
(配 当 等 相 当 額)	( 2,467,339)	( 2,486,528)	( 2,510,196)	( 2,539,803)	( 2,579,512)	( 2,614,785)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 8,251,797)	(△ 8,245,027)	(△ 8,238,641)	(△ 8,238,316)	(△ 8,237,382)	(△ 8,236,702)
分 配 準 備 積 立 金	119,923,590	141,300,930	153,913,369	178,158,615	176,522,081	174,796,749
繰 越 損 益 金	—	—	—	—	△ 48,273,008	△ 54,724,046

(注1) (B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注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。

### 分配金の計算過程

第83期計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,585,117円）、費用控除後の有価証券等損益額（5,441,880円）、信託約款に規定する収益調整金（2,467,339円）および分配準備積立金（108,341,115円）より分配対象収益は123,835,451円（10,000口当たり1,714円）であり、うち1,444,522円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第84期計算期間末における費用控除後の配当等収益（49円）、費用控除後の有価証券等損益額（22,925,773円）、信託約款に規定する収益調整金（2,486,528円）および分配準備積立金（119,818,617円）より分配対象収益は145,230,967円（10,000口当たり2,012円）であり、うち1,443,509円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第85期計算期間末における費用控除後の配当等収益（682円）、費用控除後の有価証券等損益額（14,177,922円）、信託約款に規定する収益調整金（2,510,196円）および分配準備積立金（141,177,270円）より分配対象収益は157,866,070円（10,000口当たり2,188円）であり、うち1,442,505円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第86期計算期間末における費用控除後の配当等収益（8,054,195円）、費用控除後の有価証券等損益額（17,633,828円）、信託約款に規定する収益調整金（2,539,803円）および分配準備積立金（153,913,369円）より分配対象収益は182,141,195円（10,000口当たり2,524円）であり、うち1,442,777円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第87期計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（2,579,512円）および分配準備積立金（177,963,618円）より分配対象収益は180,543,130円（10,000口当たり2,504円）であり、うち1,441,537円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

第88期計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（2,614,785円）および分配準備積立金（176,236,269円）より分配対象収益は178,851,054円（10,000口当たり2,484円）であり、うち1,439,520円（10,000口当たり20円）を分配金額としております。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／毎月決算型）

## ■分配金のお知らせ

決 算 期	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期
1 万口当たりの分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20円

### ◇分配金をお支払いする場合

分配金は各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しています。

### ◇分配金を再投資する場合

お手持り分配金は、各決算日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

### 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超過して支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

## 【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第83期	第84期	第85期	第86期	第87期	第88期
	(2024年3月13日 ～2024年4月12日)	(2024年4月13日 ～2024年5月13日)	(2024年5月14日 ～2024年6月12日)	(2024年6月13日 ～2024年7月12日)	(2024年7月13日 ～2024年8月13日)	(2024年8月14日 ～2024年9月12日)
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	(0.172%)	(0.168%)	(0.166%)	(0.161%)	(0.171%)	(0.172%)
当期の収益	20	—	0	20	—	—
当期の収益以外	—	20	19	—	20	20
翌期繰越分配対象額	1,694	1,992	2,168	2,504	2,484	2,464

（注1）「対基準価額比率」は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

（注2）「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

## 《お知らせ》

2024年3月15日付で、投資先ファンド名称の変更に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 15 期 (2024年3月13日 ～2024年9月12日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	88円 (31) (55) ( 2 )	0.621% (0.216) (0.388) (0.017)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 ( 監 査 費 用 ) ( 印 刷 費 用 ) ( そ の 他 )	7 ( 1 ) ( 7 ) ( 0 )	0.052 (0.005) (0.046) (0.000)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 ファンドの法定開示資料の印刷に係る費用 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	95	0.673	

期中の平均基準価額は14,117円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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が支払った費用を含みません。

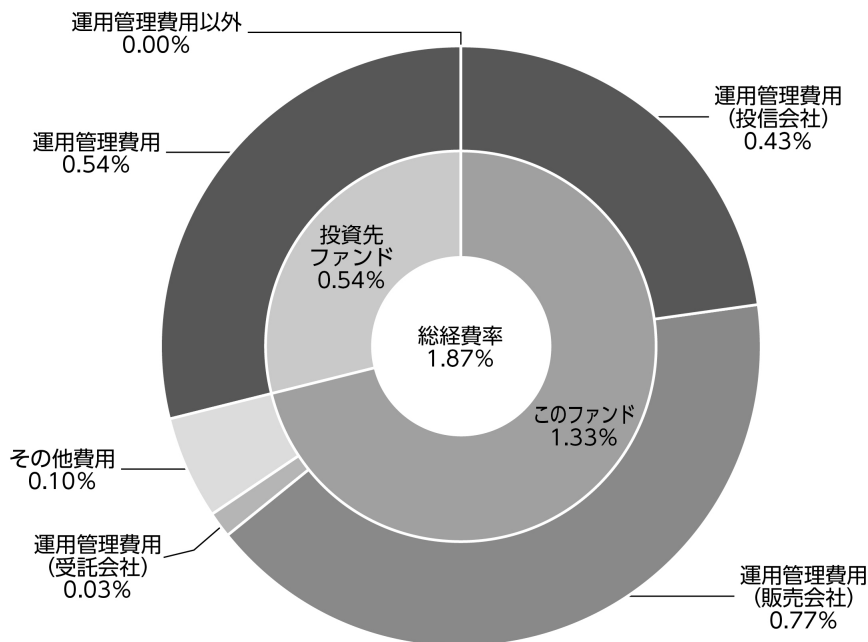
(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## （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（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除く。）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1.87%です。



総経費率 (①+②+③)	1.87%
①このファンドの費用の比率	1.33%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.54%
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です。

(注5) 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6) 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。



# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## ■売買及び取引の状況（2024年3月13日から2024年9月12日まで）

投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外国	(ルクセンブルク) Amundi Funds ストラテジック・インカム	口 25	千米ドル 21	口 20	千米ドル 16

(注1) 金額は受渡し代金です。

(注2) 単位未満は切捨てです。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年3月13日から2024年9月12日まで）

当中における利害関係人との取引等はありません。

(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（2024年9月12日現在）

### (1) 国内（邦貨建）投資信託受益証券

銘	柄	期 首 (前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		口	口	千円
	CAマネープールファンド(適格機関投資家専用)	330,000	330,000	330
合 計	口 数・金 額	330,000	330,000	330
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	<0.2%>

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。以下同じ。

(注2) 単位未満は切捨てです。以下同じ。

### (2) 外国（外貨建）投資証券

銘	柄	期 首 (前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
	(ルクセンブルク) Amundi Funds ストラテジック・インカム	口 1,294	口 1,299	千米ドル 1,159	千円 165,625
合 計	口 数・金 額	1,294	1,299	1,159	165,625
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	-	<98.4%>

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## ■投資信託財産の構成（2024年9月12日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	330	0.2
投 資 証 券	165,625	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,565	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	169,520	100.0

(注1) 金額の単位未満は切捨てです。

(注2) 当期末における外貨建純資産（166,011千円）の投資信託財産総額（169,520千円）に対する比率は97.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を日本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。

なお、2024年9月12日現在における邦貨換算レートは、1米ドル=142.85円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2024年9月12日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	169,520,085円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,563,620
投資信託受益証券(評価額)	330,660
投 資 証 券(評価額)	165,625,796
未 収 利 息	9
(B) 負 債	1,159,735
未 払 信 託 報 酬	1,070,372
そ の 他 未 払 費 用	89,363
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	168,360,350
元 本	121,873,240
次 期 繰 越 損 益 金	46,487,110
(D) 受 益 権 総 口 数	121,873,240口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	13,814円

(注記事項)

期首元本額 122,916,225円

期中追加設定元本額 711,023円

期中一部解約元本額 1,754,008円

## ■損益の状況

当期（自2024年3月13日 至2024年9月12日）

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,996,875円
受 取 配 当 金	2,940,483
受 取 利 息	7,010
支 払 利 息	49,382
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,824,176
売 買 損 益	7,221,258
売 買 損 益	△ 4,397,082
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,159,773
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	4,661,278
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	40,181,504
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,644,328
(配 当 等 相 当 額)	( 2,080,054)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 435,726)
(G) 計 (D+E+F)	46,487,110
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	46,487,110
追 加 信 託 差 損 益 金	1,644,328
(配 当 等 相 当 額)	( 2,080,054)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 435,726)
分 配 準 備 積 立 金	44,842,782

(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。

# アムンディ・ストラテジック・インカムファンド（為替ヘッジなし／年2回決算型）

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準および市況動向等を勘案した結果、見送りとさせていただきます。

### 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。  
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

### 【分配原資の内訳】

（単位：円・1万口当たり・税込み）

項 目	第15期
	(2024年3月13日～2024年9月12日)
当期分配金	—
(対基準価額比率)	(—%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,850

(注1) 「対基準価額比率」は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

(注2) 「当期の収益」「当期の収益以外」は小数点以下切捨てで算出しているため、合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

### 《お知らせ》

2024年3月15日付で、投資先ファンド名称の変更に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

## &lt; 1. 補足情報 &gt;

組入ファンド「Amundi Funds ストラテジック・インカム」の決算日（毎年6月末日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年9月11日現在の情報を掲載しています。

## ■有価証券明細（評価額上位30銘柄）（2024年9月11日現在）

## 債券

	銘柄	通貨	額面金額	評価額（ユーロ）	
アメリカ	UNITED STATES OF AMERICA 0% 08/10/2024	USD	70,000,000	63,350,063.58	
	INTL BK RECON AND DEVELOP 0.75% 11/03/2025	USD	60,000,000	53,452,861.04	
	US TREASURY 2.250% 15/02/2052	USD	61,441,000	39,413,412.84	
	UNITED STATES OF AMERICA 0% 24/09/2024	USD	37,000,000	33,549,019.07	
	UNITED STATES OF AMERICA 3% 15/02/2048	USD	39,323,300	29,867,978.12	
	G2 MA8042 MTGE TF 20/05/2052	USD	40,950,103	27,825,355.34	
	G2 MA7881 TF 20/02/2052	USD	38,198,691	25,359,629.41	
	GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASS GNMA II TF 01/09/2052	USD	28,500,000	24,575,668.77	
	FR SD8433 TF 01/04/2054	USD	26,709,000	23,339,046.09	
	INTL BANK RECON AND DEVELOP 2.5% 29/07/2025	USD	25,000,000	22,433,393.89	
イギリス	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 05/06/2030	USD	16,830,000	16,259,002.89	
	アメリカ	GNMA G2SF MTGE TF 01/09/2050	USD	20,300,000	15,838,442.07
アメリカ	FN FS6691 MTGE TF 01/03/2042	USD	21,502,000	15,679,096.32	
	PEPSICO INC 4.8% 17/07/2034	USD	15,590,000	14,828,341.42	
	LIBERTY M 7.697% 15/10/2097	USD	10,530,000	12,181,857.76	
	GNMA II TF 01/09/2053	USD	13,000,000	12,136,620.78	
	ENERGY TRANSFER LP 5.60% 01/09/2034	USD	11,680,000	11,058,504.71	
	KEYCORP VAR 06/03/2035	USD	11,170,000	11,001,273.42	
	GEN MOTORS FINL CO 6.4% 09/01/2033	USD	10,985,000	10,900,015.63	
	オランダ	LUNDIN ENERGY FI 3.10% 315/07/2031	USD	13,265,000	10,823,953.52
	ABN AMRO VAR 13/03/2037	USD	13,000,000	10,477,401.75	
	アメリカ	FARMERS INS EXCH VAR 01/11/2057	USD	13,855,000	10,457,088.86
アラブ首長国連邦	UAE INTL GOVT BOND 4.875% 02/07/2034	USD	10,865,000	10,379,570.84	
イタリア	UNICREDIT SPA VAR 30/06/2035	USD	11,343,000	10,260,071.74	
オランダ	ING GROEP NV VAR PERPETUAL	USD	13,400,000	9,999,325.71	
スペイン	CAIXABANK SA VAR PERPETUAL	EUR	11,200,000	9,927,310.22	
インドネシア	REPUBLIC OF INDONESIA 6.125% 15/05/2028	IDR	164,149,000,000	9,773,642.90	
アイルランド	AERCAP IRELAND CAP 3.3% 30/01/2032	USD	11,840,000	9,764,272.00	
アメリカ	CAS 2022 R02 B1 MTGE 25/12/2041	USD	9,980,000	9,625,673.59	
	UNILEVER CAPITAL CORP 4.625% 12/08/2034	USD	10,030,000	9,331,960.24	

（注）通貨欄の表記は以下の通りです。

USD（米ドル）、EUR（ユーロ）、IDR（インドネシアルピア）

## < 2. 補足情報 >

組入ファンド「C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）」の決算日（2024年2月15日）と当ファンドの決算日が異なっていますので、2024年9月12日現在の情報を掲載しています。

### ■主要な売買銘柄（2024年2月16日から2024年9月12日まで）

公社債

買		付	売		付
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
第146回共同発行市場公募地方債		千円 100,320	第137回共同発行市場公募地方債		千円 50,029
第148回共同発行市場公募地方債		80,162			

（注1）金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）国内の現先取引によるものは含まれていません。

### ■組入資産の明細（2024年9月12日現在）

公社債

#### A 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区分	2024年9月12日現在						
	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	%	%	%	%	%
地方債証券	330,000	330,384	73.3	—	—	—	73.3
合計	330,000	330,384	73.3	—	—	—	73.3

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

（注4）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

#### B 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種類	銘柄	2024年9月12日現在			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
地方債証券	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,063	2024/10/25
	第146回共同発行市場公募地方債	0.553	100,000	100,171	2025/5/23
	第148回共同発行市場公募地方債	0.553	80,000	80,150	2025/7/25
合計			330,000	330,384	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

**Amundi Funds ストラテジック・インカム\***  
**決算日 2023年6月30日**  
**(計算期間：2022年7月1日～2023年6月30日)**

作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに委託会社が翻訳・抜粋・作成しています。なお、開示情報につきましては各クラス別の情報がないため、全てのシェアクラスを含むファンド全体の情報を開示しています。

※2024年3月15日付で「Amundi Funds パイオニア・ストラテジック・インカム」は「Amundi Funds ストラテジック・インカム」に名称変更されました。

■費用の明細 (2022年7月1日～2023年6月30日)

項目	当期
	ユーロ
(a)運用報酬	23,792,870
(b)成功報酬	76,205
(c)管理費用等	4,034,110
(d)その他の費用	81,625,980
合計	109,529,165

■純資産計算書 (2023年6月30日現在)

項目	当期末
	ユーロ
<b>資産合計</b>	<b>2,241,531,245</b>
有価証券	1,959,081,119
オプション取引評価勘定 (買)	246,644
預金	174,526,783
未収利息	18,918,257
有価証券売却未収入金	77,960,703
未収追加設定金	2,323,768
為替予約取引評価勘定	8,452,629
為替未収入金	21,342
<b>負債合計</b>	<b>118,501,968</b>
オプション取引評価勘定 (売)	328,090
借入金	161,583
有価証券買付未払金	93,316,044
未払解約金	3,449,343
先物取引評価勘定	5,788,897
スワップ取引評価勘定	5,858,070
未払運用報酬	5,894,829
その他の負債	3,705,112
<b>純資産</b>	<b>2,123,029,277</b>

(注) 各項目の金額の整数未満を四捨五入しているため、資産合計および負債合計並びに純資産が一致しない場合があります。

## ■ 有価証券明細 (2023年6月30日現在)

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ	
<b>株式</b>	<b>19,805,925</b>	1,537,750,000	DEVELOPMENT BANK OF KAZAHKASTAN JSC 10.75% 12/02/2025	2,808,188
<b>銀行</b>	<b>19,437,229</b>	990,000,000	DEVELOPMENT BANK OF KAZAHKASTAN JSC 10.95% REGS 06/05/2026	1,734,704
18,408 WELLS FARGO COMPANY PREFERRED	19,437,229	320,500,000	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION AND DEVELOPMENT EBRD 6.25% 11/04/2028	3,474,017
化学	3,197	25,000,000	EUROPEAN INVESTMENT BANK EIB 0.375% 26/03/2026	20,453,255
38 LYONDELLBASELL	3,197	8,575,000	HSBC HOLDINGS PLC VAR 11/08/2033	7,684,410
一般産業	363,962	1,000,000	ING GROUP NV VAR 28/03/2033	838,909
3,970,830 ASCENT CLASS A	363,962	250,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD FRN 13/03/2024 USD (ISIN XS2127855125)	228,626
家庭用品・住宅建設用品	350	60,000,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 0.75% 11/03/2025	51,171,587
503,703 DESARROLL.HOMEX S.A.B. DE C.V.	350	750,000,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 12.50% 21/02/2025	1,466,477
石油・ガス・石炭	1,187	25,000,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 2.50% 29/07/2025	21,865,262
155 FRONTERA ENERGY CORPORATION	1,187	8,000,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 3.125% 15/06/2027	6,990,577
<b>債券</b>	<b>1,324,516,532</b>	272,800,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 6.50% 17/04/2030	2,978,726
航空宇宙・防衛産業	26,719,401	378,000,000	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT IBRD 6.85% 24/04/2028	4,202,147
12,655,000 BOEING CO 5.805% 01/05/2050	11,547,485	4,030,000	INTESA SANPAOLO PRIVATE BANKING SPA VAR 144A 20/06/2054	3,680,302
14,371,033 GLOBAL AIRCRAFTS LEASING CO LTD 6.50% 144A 15/09/2024	12,075,619	965,000	INTESA SANPAOLO SPA 4.198% 01/06/2032	660,773
1,910,000 SPIRIT AEROSYSTEMS INC 9.375% 144A 30/11/2029	1,877,455	2,090,000	INTESA SANPAOLO SPA 4.95% 01/06/2042	1,262,467
1,300,000 TRIUMPH GROUP INC 9.00% 144A 15/03/2028	1,218,842	6,745,000	INTESA SANPAOLO SPA 8.248% 144A 21/11/2033	6,499,620
代替エネルギー	1,236,995	3,215,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR PERPETUAL USD (ISIN US53944YAV56)	2,684,687
2,056,000 ADANI RENEWABLE ENERGY 4.625% 144A 15/10/2039	1,236,995	6,130,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 11/08/2033	5,264,777
自動車・部品	4,966,211	4,795,000	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 15/11/2033	4,767,091
3,550,000 FORD MOTOR CO 5.291% 08/12/2046	2,680,136	3,775,000	SOCIETE GENERALE SA VAR 144A PERPETUAL USD (ISIN US83370RAA68)	2,573,955
2,570,000 FORD MOTOR CO 6.10% 19/08/2032	2,286,075	500,000	SOCIETE GENERALE SA VAR 144A 10/01/2034	466,632
銀行	260,281,137	5,305,000	SOCIETE GENERALE SA VAR 144A 15/06/2033	4,514,258
13,000,000 ABN AMRO BANK NV VAR 144A 13/03/2037	9,058,533	4,535,000	SOCIETE GENERALE SA VAR 144A 21/01/2043	2,769,925
1,758,000 ANZ BANK NEW ZEALAND LTD 5.548% 144A 11/08/2032	1,584,939	13,370,000	STANDARD CHARTERED PLC VAR 144A 12/01/2033	9,832,648
7,465,000 AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 6.375% 144A 04/05/2028	6,772,212	310,000	STANDARD CHARTERED PLC 6.296% 144A 06/07/2034	285,106
3,000,000 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA VAR PERPETUAL EUR	2,912,160	6,040,000	THE TORONTO DOMINION BANK CANADA 4.456% 08/06/2032	5,261,942
2,465,000 BANCO MERCAN DEL NORTE SA BANORTE VAR 144A PERPETUAL	2,097,103	5,605,000	TRUIST FINANCIAL CORPORATION VAR 26/01/2029	4,939,387
5,600,000 BANCO SANTANDER SA VAR 22/11/2032	4,072,961	7,644,000	UNICREDIT SPA VAR 144A 02/04/2034	6,624,146
5,776,000 BARCLAYS PLC VAR PERPETUAL USD (ISIN US06738EBX22)	4,701,484	11,343,000	UNICREDIT SPA VAR 144A 30/06/2035	8,829,345
3,105,000 BARCLAYS PLC VAR 02/11/2033	3,081,777		<b>化学</b>	<b>16,576,626</b>
3,800,000 BARCLAYS PLC VAR 09/05/2034	3,473,709	3,354,000	ALBEMARLE CORP 5.05% 01/06/2032	2,983,461
7,980,000 BARCLAYS PLC 5.746% 09/08/2033	7,081,939	1,785,000	BRASKEM IDESA SAPI 6.99% 144A 20/02/2032	1,056,340
8,955,000 BPCE SA VAR 144A 14/01/2037	6,532,307	5,310,000	CELANESE US HOLDINGS LLC 6.379% 15/07/2032	4,900,434
9,590,000 BPCE SA VAR 144A 19/10/2032	6,813,383	8,495,000	OCI N V 6.70% 144A 16/03/2033	7,636,391
5,725,000 CITIGROUP INC USA VAR 25/05/2034	5,284,684			





数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
3,680,000	GARDA WORLD SECURITY CORP 4.625% 144A 15/02/2027	3,095,146	
3,012,000	GARDA WORLD SECURITY CORP 6.00% 144A 01/06/2029	2,275,040	
	産業輸送	22,783,247	
14,925,000	AIR LEASE CORP 2.875% 15/01/2032	11,010,026	
1,100,000	BOMBARDIER INC 7.50% 144A 01/02/2029	997,370	
1,085,000	OI EUROPEAN GROUP BV 6.25% 144A 15/05/2028	1,111,138	
3,515,000	PENSKE TRUCK LEASING CO LP 6.20% 144A 15/06/2030	3,244,561	
1,985,000	TRANSOCEAN INC 8.75% 144A 15/02/2030	1,849,652	
5,110,000	VISTAJET MALTA FINANCE PLC 6.375% 144A 01/02/2030	3,776,154	
930,000	VISTAJET MALTA FINANCE PLC 7.875% 144A 01/05/2027	766,922	
5,020,000	WESTERN GLOBAL AIRLINES 10.375% 144A 15/08/2025	27,424	
	投資銀行・仲介サービス	222,560,806	
9,750,157	ABRA GLOBAL FINANCE 11.50% 144A 02/03/2028	7,271,865	
3,309,000	ADANIREN KODSOPAR WARSOM 4.625% REGS 15/10/2039	1,990,865	
2,230,000	ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 7.00% 144A 15/04/2028	2,076,496	
5,615,000	AERCAP IRELAND CAP LTD 3.30% 30/01/2032	4,209,809	
13,265,000	AKER BP ASA 3.10% 144A 15/07/2031	10,071,429	
750,000	ALAMO RE LTD VAR 07/06/2026	675,533	
1,325,000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC 4.625% 144A 01/06/2028 USD (ISIN US019579AA90)	1,028,727	
850,000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC 4.625% 144A 01/06/2028 USD (ISIN US049362AA49)	656,658	
1,925,000	ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 3.625% 144A 01/06/2028	1,545,044	
1,375,000	ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK PLC 7.25% 144A 30/04/2030	1,398,774	
590,000	ALLWYN ENTERTAINMENT FINANCING UK PLC 7.875% 144A 30/04/2029	550,441	
24,551	ALTURAS RE LTD VAR 12/09/2023	279	
21,261	ALTURAS RE LTD 0% 10/03/2023 USD (ISIN XS1917775063)	-	
2,401	ALTURAS RE LTD 0% 10/03/2023 USD (ISIN XS1917798198)	-	
360,465	ALTURAS RE LTD 0% 10/03/2023 USD (ISIN XS2096026104)	-	
225,449	ALTURAS RE LTD 0% 30/09/2024	-	
2,639,535	ALTURAS RE LTD 0% 31/12/2024	-	
2,323,938	ALTURAS RE LTD 0% 31/12/2027	808,799	
5,930,000	AMAGGI LUXEMBOURG INTERNATIONAL 5.25% 144A 28/01/2028	4,965,492	
1,070,000	AMERICAN AIRLINES PASS THROUGH TRUST 3.95% 11/07/2030	826,031	
2,725,000	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.75% 01/10/2030	2,139,537	
3,000,000	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 6.50% 15/04/2040	2,711,797	
1,400,000	ATLAS CAPITAL DAC VAR 05/06/2029	1,295,995	
3,405,000	BANK OF NEW YORK MELLON CORP VAR 01/02/2034	3,006,294	
6,490,000	BANQUE OUEST AFRICAINE D 4.70% 144A 22/10/2031	4,838,946	
250,000	BONANZA RE LTD VAR 08/01/2026	227,314	
250,000	BONANZA RE LTD VAR 16/03/2025	196,861	
1,250,000	BONANZA RE LTD VAR 23/12/2024	992,581	
2,703,000	BPCE CYCLE MERGER SUB II INC 10.625% 144A 15/07/2027	694,133	
6,955,000	B3 SA BRASIL BOLSA BALCAO 4.125% 144A 20/09/2031	5,457,794	
500,000	CAELUS RE V LTD VAR 09/06/2025 USD (ISIN US12765KAF21)	9,773	
3,100,000	CAELUS RE V LTD VAR 144A 05/06/2024	419,111	
3,540,000	CHARLES SCHWAB CORP VAR 19/05/2034	3,296,094	
1,645,000	CIDRON AIDA FINCO SARL 5.00% 144A 01/04/2028	1,492,854	
250,000	COMMONWEALTH RE MIDCO LIMITED VAR 08/07/2025	226,799	
3,650,000	COMMSCOPE TECHNOLOGIES LLC 5.00% 144A 15/03/2027	2,340,517	
750,000	CPAE LOOKOUT REAL ESTATE LTD VAR 28/04/2026	694,266	
7,750,000	CSC HOLDINGS LLC 4.50% 144A 15/11/2031	4,959,432	
1,659,000	DIAMOND SPORTS GROUP LLC 6.625% 144A 15/08/2027	47,459	
1,475,637	DIGICEL HOLDINGS BERMUDA LTD 8.00% REGS 31/12/2026	292,652	
3,000,000	EASTON RE PTE LTD VAR 08/01/2027	2,736,847	
880,000	EDEN RE II LTD VAR 20/03/2026	485,791	
3,000,000	EDEN RE II LTD 0% 19/03/2027	2,749,771	
1,749,922	EDEN RE II LTD 0% 21/03/2025 USD (ISIN US27955HAB69)	903,030	
700,000	EDEN RE II LTD 0% 22/03/2024 USD (ISIN US27954QAH48)	223,923	
4,605,000	ENERGIZER GAMMA ACQUISITION INC 3.50% 144A 30/06/2029	3,720,149	
750,000	FLOODSMART RE LTD VAR 01/03/2024	646,282	
750,000	FLOODSMART RE LTD VAR 11/03/2026	694,231	
5,700,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.625% 17/06/2031	4,292,973	
8,000,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.815% 02/11/2027	6,578,918	
2,380,000	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35% 06/03/2030	2,231,921	
3,335,000	FOUNDRY HOLDCO LLC 5.875% 25/01/2034	3,044,204	
1,750,000	FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2024	1,561,590	
1,900,000	FOUR LAKES RE LTD VAR 05/01/2027	1,691,331	
250,000	FOUR LAKES RE LTD VAR 07/01/2025	215,095	
1,150,000	FREEDOM MORTGAGE CO 6.625% 144A 15/01/2027	918,451	
2,445,000	FREEDOM MORTGAGE CO 8.25% 144A 15/04/2025	2,192,118	
10,985,000	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 6.40% 09/01/2033	10,239,912	
15,031,000	HAT HOLDING I LLC 3.375% 144A 15/06/2026	12,384,110	
250,000	HERBIE RE LTD VAR 08/01/2030	221,878	
417,000	HIGHWOODS REALTY LTD PARTNERSHIP 2.60% 01/02/2031	281,538	
398,000	HIGHWOODS REALTY LTD PARTNERSHIP 3.05% 15/02/2030	288,749	

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
2,425,000	HILTON GRAND ACA LLC IN 5.00% 144A 01/06/2029	1,975,942	
4,120,000	HIRDROVIAS INTERNATIONAL FINANCE SARL 4.95% 144A 08/02/2031	3,028,068	
1,000,000	INTEGRITY RE LTD VAR 06/06/2025	908,089	
935,000	JBS USA LUX SA 3.00% 144A 15/05/2032	664,039	
7,260,000	JBS USA LUX SA 5.75% 144A 01/04/2033	6,281,131	
2,270,000	JBS USA LUX SA 6.50% 144A 01/12/2052	1,976,461	
500,000	KILIMANJARO III RE LTD VAR 25/06/2025	454,331	
1,116,000	LIMESTONE RE LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN XS2096788026)	15,037	
384,000	LIMESTONE RE LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN XS2096788455)	5,174	
167,000	LIMESTONE RE LTD 0% 01/10/2023	-	
7,000,000	MACQUARIE GROUP LTD VAR 144A 14/01/2033	5,127,516	
250,000	MATTERHORN RE LTD VAR 08/01/2024	191,533	
250,000	MATTERHORN RE LTD VAR 08/12/2025	205,236	
1,000,000	MATTERHORN RE LTD VAR 24/03/2025 USD (ISIN US577092AP49)	862,273	
500,000	MATTERHORN RE LTD VAR 24/03/2025 USD (ISIN US577092AQ22)	440,101	
3,990,000	MINERVA MERGER 6.50% 144A 15/02/2030	3,078,883	
1,310,000	MORGAN STANLEY VAR 19/01/2038	1,185,220	
6,685,000	MORGAN STANLEY VAR 20/04/2037	5,797,445	
1,250,000	MYSTIC RE IV LTD VAR 08/01/2026	1,135,856	
500,000	MYSTIC RE IV LTD VAR 10/01/2028	451,879	
3,135,000	NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 4.55% 144A 28/01/2033	2,773,024	
1,000,000	NORTHSHORE RE II LTD VAR 08/01/2027	907,264	
500,000	NORTHSHORE RE II LTD VAR 08/07/2025	460,014	
3,450,000	ONEMAIN FINANCE CORP 3.50% 15/01/2027	2,727,239	
250,000	PHOENICIAN RE LTD VAR 14/12/2024	225,103	
8,818,000	PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC 6.25% 144A 15/01/2028	7,587,601	
2,000,000	QUEEN STREET 2023 RE DAC VAR 08/12/2025	1,840,926	
500,000	RESIDENTAL RE 19 LTD VAR 06/12/2026	438,451	
750,000	RESIDENTAL REINS 2022 LIMITED VAR 06/12/2029	685,346	
500,000	SAKURA RE LTD VAR 06/01/2030	489,746	
1,250,000	SANDERS RE III LTD VAR 07/04/2025	1,092,461	
750,000	SANDERS RE III LTD VAR 05/06/2026	687,151	
250,000	SANDERS RE III LTD VAR 07/04/2027	226,289	
500,000	SANDERS RE III LTD VAR 08/04/2030	469,833	
1,483	SECTOR RE V LTD VAR 01/03/2026 USD (ISIN US81369ADS87)	95,212	
8,207	SECTOR RE V LTD VAR 01/03/2026 USD (ISIN US81369ADU34)	99,630	
76,879	SECTOR RE V LTD VAR 01/12/2026 USD (ISIN US81369ADW99)	65,900	
400,000	SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN US81369ACT79)	184,724	
5,318	SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2024 USD (ISIN US81369ACW09)	117,709	
9,693	SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2025	127,706	
1,650	SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2027 USD (ISIN US81369AEC27)	144,147	
26,483	SECTOR RE V LTD 0% 01/03/2027 USD (ISIN US81369AE82)	101,730	
100,000	SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2024 USD (ISIN US81369ADB52)	157,766	
215,995	SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2024 USD (ISIN US81369ADC36)	340,768	
2,217	SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADK51)	52,099	
6,305	SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2025 USD (ISIN US81369ADL35)	148,165	
3,767,078	SECTOR RE V LTD 0% 01/12/2027	3,654,549	
2,190,000	SHERWOOD FINANCING PLC 4.50% 144A 15/11/2026	1,882,349	
1,670,000	SIMPAR EUROPE 5.20% 144A 26/01/2031	1,219,452	
3,335,000	SOVCOM CAPITAL DESIGNATED ACTIVITY COMPANY VAR 144A PERPETUAL USD (ISIN US84605LAD82)	-	
1,000,000	SUSSEX CAP UK PPC LTD VAR 08/01/2025	880,133	
1,590,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 4.375% 09/05/2030	1,360,929	
5,461,000	UBS GROUP INC 4.988% 144A 05/08/2033	4,643,702	
3,130,000	UNITED GROUP B V 5.25% 144A 01/02/2030	2,489,696	
5,943,000	UNITED WHOLESAME MTGE LLC 5.50% 144A 15/04/2029	4,678,900	
1,340,000	UNITI GROUP LP 10.50% 144A 15/02/2028	1,220,984	
2,580,000	UNITI GROUP LP 6.50% 144A 15/02/2029	1,680,429	
3,500,000	URSA RE II LTD VAR 07/12/2023	3,195,474	
1,050,000	VITALITY RE VIII LTED VAR 06/01/2026	943,653	
2,685,000	VZ SECURED FINANCING BV 5.00% 144A 15/01/2032	1,989,927	
3,360,000	WINDSTREAM ESCROW LLC 7.75% 144A 15/08/2028	2,557,912	
1,085,000	ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 6.875% 144A 14/04/2028	1,009,368	
1,500,000	ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 7.125% 144A 14/04/2030	1,403,868	
	生命保険		10,353,222
11,345,000	FARMERS INSURANCE EXCHANGE VAR 144A 01/11/2057	8,166,944	
350,000	LOCKE TAVERN RE LTD VAR 09/04/2026	322,804	
1,500,000	VITALITY RE XI LTD VAR 05/01/2027	1,410,495	
500,000	VITALITY RE XI LTD VAR 09/01/2025 USD (ISIN US92851AAB08)	452,979	
	保険（生命保険以外）		18,955,097
400,000	AXA SA VAR 17/01/2047	356,689	
250,000	FIRST COAST RE LTD VAR 07/04/2026	224,255	
2,020,000	LIBERTY MUTUAL GROUP INC VAR 144A 23/05/2059	1,922,576	
750,000	LIBERTY MUTUAL GROUP INC 5.50% 144A 15/06/2052	649,977	
10,530,000	LIBERTY MUTUAL INSURANCE COMPANY 7.697% 144A 15/10/2097	10,618,893	
800,000	LIGHTNING RE LIMITED VAR 31/03/2026	755,325	
750,000	MONA LISA RE LTD VAR 08/01/2026	727,314	
1,250,000	RESIDENTIAL REINS VAR 06/12/2024 USD (ISIN US76120AAB89)	1,093,293	

数量		評価額 ユーロ	数量		評価額 ユーロ
1,000,000	RESIDENTIAL REINS VAR 06/12/2024 USD (ISIN US76120AAC62)	877,406	1,750,000	LONG POINT REAL ESTATE IV LTD VAR 01/06/2026	1,595,492
1,000,000	TORREY PINES RE PTE LTD VAR 07/06/2029	898,625	650,000	PURPLE REAL ESTATE LIMITED VAR 24/04/2026	597,660
650,000	URSA RE LTD VAR 06/12/2025	601,339	250,000	VERAISON REAL ESTATE LIMITED VAR 09/03/2026	241,974
250,000	VITALITY RE XIV LIMITED VAR 05/01/2027	229,405		<b>不動産投資信託</b>	<b>7,041,321</b>
	<b>石油・ガス・石炭</b>	<b>58,529,684</b>	2,750,000	GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS LIMITED 3.00% 29/03/2025	2,272,188
405,000	AKER BP ASA 6.00% 144A 13/06/2033	371,609	7,500,000	MPT OPERATING PARTNERSHIP LP / MPT FINANCE CORP 3.50% 15/03/2031	4,769,133
3,330,000	CRESTWOOD MIDSTREAM PARTNERS LP / CRESTWOOD MIDSTREAM FINANCE CORP 7.375% 144A 01/02/2031	3,022,242		<b>テクノロジーハードウェア・機器</b>	<b>20,275,346</b>
3,185,000	ENERFLEX LTD 9.00% 144A 15/10/2027	2,847,962	5,380,000	BELDEN INC 3.375% 144A 15/07/2027	5,033,635
11,195,000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.45% 01/06/2047	8,452,584	3,370,000	BELDEN INC 3.375% 144A 15/07/2031	2,938,741
4,448,000	ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.60% 01/04/2044	3,420,435	597,000	BELDEN INC 3.875% 144A 15/03/2028	561,246
4,790,000	HARBOUR ENERGY PLC 5.50% 144A 15/10/2026	4,046,518	4,100,000	BROADCOM INC 4.15% 144A 15/04/2032	3,404,766
2,960,000	INTERNATIONAL PETROLEUM CORPORATION 7.25% 01/02/2027	2,551,352	4,750,000	BROADCOM INC 4.926% 144A 15/05/2037	3,938,538
5,066,000	LIGHT SERVICES DE ELECTRICIDADE SA 4.375% 144A 18/06/2026	1,882,964	6,200,000	SK HYNIX INC 2.375% 144A 19/01/2031	4,398,420
5,935,000	MC BRAZIL DOWNSTREAM TRADING SARL 7.25% 144A 30/06/2031	3,558,565		<b>通信機器</b>	<b>2,114,911</b>
9,995,000	MPLX LP 5.00% 01/03/2033	8,794,408	2,910,000	COMMSCOPE INC 4.75% 144A 01/09/2029	2,114,911
3,705,000	NAKILAT INC 6.267% 144A 31/12/2033	2,233,680		<b>通信サービスプロバイダー</b>	<b>17,874,805</b>
850,000	NOBLE FINANCE II LIMITED LIABILITY COMPANY 8.00% 144A 15/04/2030	792,339	455,000	ALTICE FRANCE SA 5.125% 144A 15/01/2029	299,595
2,810,000	PETROLEOS MEXICANOS PEMEX 6.70% 16/02/2032	1,964,038	2,690,000	ALTICE FRANCE SA 5.125% 144A 15/07/2029	1,753,850
4,245,000	TULLOW OIL PLC 10.25% 144A 15/05/2026	2,999,203	7,606,000	ALTICE FRANCE SA 5.50% 144A 15/01/2028	5,320,087
1,535,000	VENTURE GLOBAL LNG INC 8.125% 144A 01/06/2028	1,431,574	1,135,000	CCO HOLDINGS LLC/CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 7.375% 144A 01/03/2031	1,015,248
3,590,000	VENTURE GLOBAL LNG INC 8.375% 144A 01/06/2031	3,324,452	950,000	IHS HOLDING LIMITED 6.25% 144A 29/11/2028	717,298
2,970,000	VERMILION ENERGY INC 6.875% 144A 01/05/2030	2,524,418	2,013,000	LEVEL 3 FINANCING INC 10.50% 144A 15/05/2030	1,874,968
5,750,000	YPF SOCIEDAD ANONIMA 6.95% 144A 21/07/2027	4,311,341	4,655,000	LORCA TELECOM BOND CO 4.00% 144A 18/09/2027	4,258,022
	<b>パーソナルケア・薬品・食料品店</b>	<b>3,380,911</b>	4,830,000	TOTAL PLAY TELECOMUNICATIONS 6.375% 144A 20/09/2028	2,635,737
3,680,000	ALBERTSONS COMPANIES LLC 6.50% 144A 15/02/2028	3,380,911		<b>旅行・レジャー</b>	<b>6,738,253</b>
	<b>医薬・バイオテクノロジー</b>	<b>4,618,346</b>	7,225,000	GRUPO AEROMEXICO SAB DE CV 8.50% 144A 17/03/2027	5,951,055
2,714,000	PAR PHARMACEUTICAL COS INC 0% 144A 01/04/2027	1,856,465	845,000	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.25% 144A 15/01/2030	787,198
1,310,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV 4.75% 09/05/2027	1,112,708		<b>転換社債</b>	<b>17,618,731</b>
925,000	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV 5.125% 09/05/2029	769,878		<b>メディア</b>	<b>1,284,826</b>
970,000	TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD 3.75% 09/05/2027	879,295	1,524,000	IMAX CORP 0.50% 01/04/2026 CV	1,284,826
	<b>貴金属・鉱業</b>	<b>11,811,994</b>		<b>医薬・バイオテクノロジー</b>	<b>2,778,081</b>
8,263,000	COEUR MINING INC 5.125% 144A 15/02/2029	6,254,204	3,175,000	INSMED INC 1.75% 15/01/2025 CV	2,778,081
8,028,000	IAMGOLD CORP 5.75% 144A 15/10/2028	5,557,790	6,130,000	TRICIDA INC 0% 15/05/2027 CV	-
	<b>不動産投資・サービス</b>	<b>3,681,968</b>		<b>ソフトウェア・コンピューターサービス</b>	<b>4,008,100</b>
850,000	GATEWAY REAL ESTATE II LTD VAR 27/04/2026	772,518	1,555,000	BENTLEY SYSTEMS INC 0.375% 01/07/2027 CV	1,290,921
500,000	GATEWAY REAL ESTATE LTD VAR 24/02/2026	474,324	3,358,000	VERINT SYSTEMS INC 0.25% 15/04/2026 CV	2,717,179
				<b>旅行・レジャー</b>	<b>9,547,724</b>
			9,493,000	DAIMOND EAGLE ACQUISITION CORP 0% 15/03/2028 CV	6,537,379

数量		評価額 ユーロ	数量		評価額 ユーロ
4,042,000	SPIRIT AIRLINES INC 1.00% 15/05/2026 CV	3,010,345	2,300,000	COMM 2015 DC 1 MORTGAGE TRUST VAR 10/02/2048	1,820,375
	<b>モーゲージ・資産担保証券</b>	<b>597,139,931</b>	3,200,000	COMMERCIAL MORTGAGE TRUST BACKED SECURITIES VAR 10/10/2049	2,507,639
	<b>金融・クレジットサービス</b>	<b>585,172,286</b>	3,310,000	CSAIL 2015-C1 COMMERCIAL MORTGAGE TRUST VAR 01/11/2048 USD (ISIN US12635RBE71)	2,408,398
2,000,000	522 FUNDING CLO 2018 2A LTD FRN 20/04/2031	1,486,238	5,317,000	CSAIL 2015-C1 COMMERCIAL MORTGAGE TRUST VAR 15/04/2050	3,661,055
4,150,000	522 FUNDING CLO 2018 2A LTD VAR 23/04/2034	3,179,954	3,503,000	CSMC TRUST 2015 WIN1 VAR 25/07/2043	442,082
1,900,000	522 FUNDING CLO 2018 2A LTD VAR 23/10/2034	1,460,954	3,120,000	FANNIE MAE FRN 25/02/2040	2,952,548
3,500,000	ABPCI DIRECT LENDING FUND CO LLC VAR 20/01/2032 USD (ISIN US000848AQ48)	3,114,394	6,850,000	FANNIE MAE FRN 25/11/2039	1,963,037
1,600,000	ACCELERATED PROCESSORS INC 4.51% 02/12/2033	383,652	10,521,000	FANNIE MAE VAR 25/06/2048	115,063
2,000,000	ACCELERATED PROCESSORS INC 6.65% 02/12/2033	483,799	10,565,000	FANNIE MAE VAR 25/07/2049	84,692
1,690,000	AGATE BAY MORTGAGE TRUST 2015 7 VAR 25/09/2045	1,055,811	26,514,600	FANNIE MAE VAR 25/08/2041	111,101
2,000,000	AGL CLO 1 LTD VAR 20/01/2034	1,707,505	7,000,000	FANNIE MAE VAR 25/08/2049 USD (ISIN US3136B5SU01)	124,004
3,000,000	AGL CLO 1 LTD VAR 20/10/2034	2,322,456	6,975,000	FANNIE MAE VAR 25/08/2049 USD (ISIN US3136B5TL92)	120,819
1,000,000	AGL CLO 1 LTD VAR 21/01/2035	850,126	9,980,000	FANNIE MAE VAR 25/12/2041 USD (ISIN US20754BAF85)	9,201,845
1,500,000	AGL CLO 17 LIMITED VAR 21/01/2035	1,258,319	4,000,000	FANNIE MAE 1.50% 01/01/2042 USD (ISIN US3140XFK779)	2,702,714
2,000,000	AIMCO CLO LTD VAR 17/01/2032	1,668,299	2,000,000	FANNIE MAE 1.50% 01/01/2042 USD (ISIN US31418EAV20)	1,351,731
3,250,000	ARBOR REALTY COLLATERALIZED LOAN FRN 15/08/2034	2,761,457	3,000,000	FANNIE MAE 1.50% 01/02/2042	2,065,859
4,500,000	ARBOR REALTY COLLATERALIZED LOAN OBLIGATION FRN 15/11/2036	3,804,084	1,000,000	FANNIE MAE 1.50% 01/03/2042	679,015
5,800,000	ARBOR REALTY COLLATERALIZED LOAN VAR 15/01/2037	5,033,821	118,000	FANNIE MAE 2.00% 01/01/2051	76,443
2,500,000	AREIT 2021-CRE5 LIMITED VAR 17/12/2024	2,087,492	63,000	FANNIE MAE 2.00% 01/02/2042 USD (ISIN US3140MFKW28)	46,016
4,500,000	BARCLAYS COMMERCIAL MORTGAGE SECURITIES VAR 15/12/2051	3,343,284	178,000	FANNIE MAE 2.00% 01/02/2042 USD (ISIN US3140M2NG30)	130,028
4,000,000	BATTALION CLO X LTD FRN 15/07/2031	2,894,442	3,100,000	FANNIE MAE 2.00% 01/03/2052	2,164,796
50,000,000	BAYVIEW COMMERCIAL ASSET TRUST 2007-2 VAR 25/07/2037	5	243,000	FANNIE MAE 2.00% 01/11/2050	141,733
2,000,000	BDS 2018 FL2 A FRN 16/02/2037	1,800,379	1,871,000	FANNIE MAE 2.00% 01/11/2051	1,274,348
775,000	BELLEMADE RE LT FRN 25/06/2030 USD (ISIN US07876UAC36)	729,700	3,633,000	FANNIE MAE 2.00% 01/12/2041	2,508,405
670,000	BELLEMADE RE LT FRN 25/10/2030	638,418	900,000	FANNIE MAE 2.50% 01/02/2052	633,130
3,630,000	BELLEMADE RE 2018 3 LTD FRN 25/10/2028	3,019,984	6,400,000	FANNIE MAE 2.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3140MJ6G58)	4,791,130
2,350,000	BSPRT 2018-FL4 ISSUER LTD / LLC VAR 01/02/2037	2,035,063	200,000	FANNIE MAE 2.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3140XGXS33)	142,827
600,000	B2R MORTGAGE TRUST VAR 15/05/2048	533,200	14,000,000	FANNIE MAE 2.50% 01/05/2051	9,241,434
4,730,000	CASCADE FUNDING MORTGAGE TRUST 2018 VAR 25/10/2068 USD (ISIN US14727QAD79)	4,850,265	200,000	FANNIE MAE 2.50% 01/09/2050 USD (ISIN US3140KLYE69)	108,865
2,000,000	CERBERUS LOAN FUNDING VAR 15/10/2031 USD (ISIN US15673EAC75)	1,800,715	500,000	FANNIE MAE 2.50% 01/09/2050 USD (ISIN US3140KLYF35)	278,267
2,375,000	CG-CORE COML MTG TR 2014-FL1 FRN 15/06/2031 USD (ISIN US12528MAE93)	1,992,880	1,400,000	FANNIE MAE 2.50% 01/09/2050 USD (ISIN US3140X7QE23)	848,573
3,781,950	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST 2018 RP3 VAR 25/03/2061 USD (ISIN US17327DAE13)	2,777,850	100,000	FANNIE MAE 2.50% 01/10/2050	49,179
3,250,000	CITIGROUP MORTGAGE LOAN TRUST 2018 RP3 VAR 25/03/2061 USD (ISIN US17327DAF87)	1,985,972	3,600,000	FANNIE MAE 2.50% 01/11/2051	2,540,143
9,500,000	CITIGROUP MOSTGAGE LOAN TRUST 2018-RP1 VAR 25/09/2064	7,323,173	4,000,000	FANNIE MAE 2.50% 01/12/2051	2,818,907
4,540,000	COLOGIX CANADIAN ISSUER LIMITED PARTNERSHIP 4.94% 25/01/2052	2,850,983	170,000	FANNIE MAE 3.00% 01/01/2027	6,888
800,000	COLONY AMERICAN FINANCE LTD VAR 15/10/2049	281,160	6,133,000	FANNIE MAE 3.00% 01/01/2052	4,460,646
1,630,000	COMM 2013-CCRE9 MORTGAGE TRUST VAR 10/10/2049	38,197	4,200,000	FANNIE MAE 3.00% 01/02/2057	1,517,858
			400,000	FANNIE MAE 3.00% 01/03/2047	278,221
			8,096,000	FANNIE MAE 3.00% 01/03/2052	6,032,999
			1,500,000	FANNIE MAE 3.00% 01/04/2047	523,085
			101,000	FANNIE MAE 3.00% 01/04/2050	26,366

数量		評価額 ユーロ	数量		評価額 ユーロ
10,936,076	FANNIE MAE 3.00% 01/05/2030	1,226,267	2,410,000	FANNIE MAE 4.00% 25/11/2050	222,946
3,658,457	FANNIE MAE 3.00% 01/10/2030	848,449	300,000	FANNIE MAE 4.00% 31/07/2047*	258,060
3,933,000	FANNIE MAE 3.50% 01/02/2043	672,487	2,800,000	FANNIE MAE 4.50% 01/01/2044	850,951
550,000	FANNIE MAE 3.50% 01/02/2045 USD (ISIN US3138EPDY76)	117,072	5,904,321	FANNIE MAE 4.50% 01/02/2044	315,581
92,000	FANNIE MAE 3.50% 01/03/2052	75,314	2,575,073	FANNIE MAE 4.50% 01/03/2040	68,382
370,000	FANNIE MAE 3.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3140MJF837)	276,970	28,892,563	FANNIE MAE 4.50% 01/03/2042	1,931,791
1,352,000	FANNIE MAE 3.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3140XGR843)	1,028,583	500,000	FANNIE MAE 4.50% 01/03/2044	362,570
1,990,000	FANNIE MAE 3.50% 01/05/2052	1,523,972	800,000	FANNIE MAE 4.50% 01/05/2041 USD (ISIN US3138AFXA35)	30,038
1,060,000	FANNIE MAE 3.50% 01/06/2046	351,588	3,677,375	FANNIE MAE 4.50% 01/05/2041 USD (ISIN US3138AGA734)	110,747
3,307,000	FANNIE MAE 3.50% 01/07/2047	2,706,937	8,450,000	FANNIE MAE 4.50% 01/05/2041 USD (ISIN US31416X4209)	833,632
80,000	FANNIE MAE 3.50% 01/12/2051	59,884	8,146,974	FANNIE MAE 4.50% 01/06/2044	801,765
14,755,000	FANNIE MAE 4.00% 01/01/2042 USD (ISIN US3138AWN16)	1,297,258	6,000,000	FANNIE MAE 4.50% 01/07/2044	4,610,962
9,050,000	FANNIE MAE 4.00% 01/01/2042 USD (ISIN US3138AWN03)	627,738	3,313,115	FANNIE MAE 4.50% 01/08/2040 USD (ISIN US3128M74W34)	92,235
29,000	FANNIE MAE 4.00% 01/01/2051 USD (ISIN US3140QGTB37)	12,888	3,070,237	FANNIE MAE 4.50% 01/08/2040 USD (ISIN US31410LA365)	239,339
158,000	FANNIE MAE 4.00% 01/01/2051 USD (ISIN US31418DXE74)	63,062	1,800,000	FANNIE MAE 4.50% 01/08/2047	485,831
106,000	FANNIE MAE 4.00% 01/02/2051 USD (ISIN US3140CG7J02)	34,035	3,900,000	FANNIE MAE 4.50% 01/09/2043	1,241,696
314,000	FANNIE MAE 4.00% 01/02/2051 USD (ISIN US3140QHLM56)	90,485	1,500,000	FANNIE MAE 4.50% 01/11/2041	170,226
14,720,743	FANNIE MAE 4.00% 01/04/2039	458,449	22,637,681	FANNIE MAE 4.50% 01/11/2043	1,765,543
5,216,159	FANNIE MAE 4.00% 01/04/2041	469,275	4,000,000	FANNIE MAE 4.50% 20/06/2042*	3,595,755
5,979,118	FANNIE MAE 4.00% 01/04/2042	725,234	2,350,000	FANNIE MAE 4.50% 25/06/2029	65,378
345,000	FANNIE MAE 4.00% 01/04/2051	115,330	150,000	FANNIE MAE 4.50% 31/07/2047*	132,241
58,000	FANNIE MAE 4.00% 01/05/2050	8,932	1,426,179	FANNIE MAE 5.00% 01/01/2041	80,653
42,000	FANNIE MAE 4.00% 01/05/2051	10,201	26,000,000	FANNIE MAE 5.00% 01/01/2045 USD (ISIN US3138EPAL82)	2,934,885
131,127	FANNIE MAE 4.00% 01/06/2045	16,932	35,338,858	FANNIE MAE 5.00% 01/02/2041	1,339,586
646,000	FANNIE MAE 4.00% 01/06/2051	229,972	727,557	FANNIE MAE 5.00% 01/02/2045	111,469
221,834	FANNIE MAE 4.00% 01/07/2045	92,651	268,000	FANNIE MAE 5.00% 01/02/2053	237,040
133,000	FANNIE MAE 4.00% 01/07/2050	60,132	619,893	FANNIE MAE 5.00% 01/03/2044	65,517
114,000	FANNIE MAE 4.00% 01/07/2051 USD (ISIN US3140LSWZ50)	54,795	56,000	FANNIE MAE 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US31330T789)	50,226
1,226,000	FANNIE MAE 4.00% 01/07/2051 USD (ISIN US3140XCHD34)	652,220	548,000	FANNIE MAE 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NDGZ48)	491,830
51,000	FANNIE MAE 4.00% 01/08/2051	33,877	400,000	FANNIE MAE 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NGX966)	358,475
40,000	FANNIE MAE 4.00% 01/09/2051	22,919	19,339,774	FANNIE MAE 5.00% 01/06/2035	198,863
14,600,000	FANNIE MAE 4.00% 01/10/2040	2,031,320	1,100,000	FANNIE MAE 5.00% 01/06/2040	48,526
3,125,000	FANNIE MAE 4.00% 01/10/2042	323,017	1,000,000	FANNIE MAE 5.00% 01/06/2052	852,001
43,000	FANNIE MAE 4.00% 01/10/2050	10,707	1,066,902	FANNIE MAE 5.00% 01/07/2040	31,334
6,493,748	FANNIE MAE 4.00% 01/11/2043	1,567,656	3,000,000	FANNIE MAE 5.00% 01/08/2052	2,562,214
111,000	FANNIE MAE 4.00% 01/11/2050 USD (ISIN US3140QFRH42)	37,086	218,000	FANNIE MAE 5.00% 01/09/2049 USD (ISIN US3140QBUP17)	62,504
1,209,000	FANNIE MAE 4.00% 01/11/2050 USD (ISIN US3140QFUB35)	304,923	721,000	FANNIE MAE 5.00% 01/09/2049 USD (ISIN US3140QBUB84)	317,521
13,354,329	FANNIE MAE 4.00% 01/12/2040 USD (ISIN US3138A4QJ72)	1,272,147	7,312,433	FANNIE MAE 5.00% 01/10/2043	309,367
5,360,000	FANNIE MAE 4.00% 01/12/2040 USD (ISIN US31419AVT14)	721,838	1,217,000	FANNIE MAE 5.00% 01/10/2050	1,027,011
3,075,846	FANNIE MAE 4.00% 01/12/2042	233,638	7,000,000	FANNIE MAE 5.00% 20/06/2042*	6,377,284
477,704	FANNIE MAE 4.00% 01/12/2044	32,334	1,168,000	FANNIE MAE 5.50% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRZ51)	1,070,333
522,000	FANNIE MAE 4.00% 01/12/2050	151,771	1,005,000	FANNIE MAE 5.50% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRB442)	917,862
			535,000	FANNIE MAE 5.50% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRCB74)	488,168

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
890,000 FANNIE MAE 5.50% 01/02/2053 USD (ISIN US3140NDD284)	746,421	100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLJ40)	92,648
124,000 FANNIE MAE 5.50% 01/02/2053 USD (ISIN US3140N7UL29)	113,981	200,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLN51)	186,024
192,000 FANNIE MAE 5.50% 01/03/2053	175,263	200,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLP00)	188,303
2,750,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2034 USD (ISIN US3140ZC4H21)	24,097	100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMRB59)	93,801
1,000,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2034 USD (ISIN US31404KSR40)	15,981	1,280,000 FANNIE MAE 6.00% 01/07/2038	8,065
1,028,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2050 USD (ISIN US3140XHXV45)	779,109	4,500,000 FANNIE MAE 6.00% 01/09/2035	29,422
2,279,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2050 USD (ISIN US3140XJE746)	1,831,636	22,793,956 FANNIE MAE 6.00% 01/11/2038	114,383
114,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NBYU92)	104,786	750,000 FANNIE MAE 6.00% 01/12/2033	8,281
157,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NBYW58)	143,914	17,800,000 FANNIE MAE 6.00% 14/07/2038*	16,465,712
674,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NDHF74)	615,099	92,000 FANNIE MAE 6.50% 01/02/2053	78,615
308,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NDHG57)	280,971	667,000 FANNIE MAE 6.50% 01/03/2053	615,717
615,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NDYR20)	546,297	70,000 FANNIE MAE 6.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C05Q15)	66,272
146,000 FANNIE MAE 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NGC325)	133,546	78,000 FANNIE MAE 6.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NBYV75)	73,523
930,000 FANNIE MAE 5.50% 01/05/2049	242,491	74,000 FANNIE MAE 6.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NGYG95)	70,540
1,000,000 FANNIE MAE 6.00% 01/01/2034	9,892	83,000 FANNIE MAE 6.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3140NGYH78)	78,140
123,000 FANNIE MAE 6.00% 01/01/2053 USD (ISIN US3140M9AK32)	114,655	3,940,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION FRN 25/02/2040	3,751,914
900,000 FANNIE MAE 6.00% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRCL56)	827,109	21,000,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 1.50% 01/11/2041	13,872,976
1,005,000 FANNIE MAE 6.00% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRCQ44)	923,965	7,756,676 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 2.00% 01/04/2042	5,463,020
280,000 FANNIE MAE 6.00% 01/01/2053 USD (ISIN US3140QRCW12)	260,735	7,000,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 2.50% 01/01/2052	4,983,791
288,000 FANNIE MAE 6.00% 01/02/2053 USD (ISIN US3140M9AZ01)	266,428	125,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/02/2053 USD (ISIN US3140N7T913)	112,139
104,000 FANNIE MAE 6.00% 01/02/2053 USD (ISIN US3140M9BE62)	88,107	208,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/02/2053 USD (ISIN US3140N7UC20)	183,599
187,000 FANNIE MAE 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NBXL03)	172,728	539,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NC3N71)	482,329
128,000 FANNIE MAE 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NDHU42)	118,524	126,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NDJF56)	113,211
98,000 FANNIE MAE 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NDU886)	67,119	68,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3140N4F935)	61,161
124,000 FANNIE MAE 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3140NEAF21)	115,099	81,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3140N4GL53)	72,713
8,391,400 FANNIE MAE 6.00% 01/04/2037	101,964	288,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 5.50% 01/02/2053	263,702
3,679,000 FANNIE MAE 6.00% 01/04/2038	37,528	906,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 6.00% 01/05/2053	847,684
175,000 FANNIE MAE 6.00% 01/04/2053	161,874	129,000 FEDERAL NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION 6.50% 01/03/2053	121,930
1,400,000 FANNIE MAE 6.00% 01/05/2053	1,318,028	3,500,000 FIRST EAGLE COMMERCIAL LOAN FUNDING 2016 LLC VAR 25/01/2032	3,215,858
100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMGL50)	93,351	2,335,000 FLAGSTAR MORTGAGE TRUST 2018 VAR 25/07/2048	1,413,519
100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLD79)	93,801	2,670,000 FREDDIE MAC FRN 25/02/2047 USD (ISIN US35564ACB52)	2,619,793
100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLF28)	92,648	2,000,000 FREDDIE MAC FRN 25/02/2049	1,882,917
100,000 FANNIE MAE 6.00% 01/06/2053 USD (ISIN US3140NMLG01)	92,648	3,275,000 FREDDIE MAC FRN 25/03/2050	1,155,815
		3,690,000 FREDDIE MAC FRN 25/06/2050	2,686,156
		2,150,000 FREDDIE MAC FRN 25/07/2050	2,463,631

数量		評価額 ユーロ	数量		評価額 ユーロ
5,380,000	FREDDIE MAC FRN 25/08/2050 USD (ISIN US35565XBD12)	4,953,652	3,400,000	FREDDIE MAC 4.00% 25/05/2050	243,712
3,340,000	FREDDIE MAC FRN 25/08/2050 USD (ISIN US35565XBE94)	3,901,536	2,900,000	FREDDIE MAC 4.00% 25/12/2050	290,118
6,005,000	FREDDIE MAC FRN 25/09/2048	5,810,748	2,004,808	FREDDIE MAC 4.50% 01/03/2044	127,742
4,150,000	FREDDIE MAC FRN 25/10/2048	4,539,516	5,345,000	FREDDIE MAC 4.50% 01/11/2040	274,336
49,894,608	FREDDIE MAC VAR 15/07/2042	531,436	5,465,144	FREDDIE MAC 4.50% 01/11/2043	336,080
20,010,000	FREDDIE MAC VAR 15/08/2042	373,893	50,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/03/2053	44,872
6,385,000	FREDDIE MAC VAR 25/02/2042 USD (ISIN US35564KSJ96)	5,838,975	1,848,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C0ZN50)	1,637,602
1,590,000	FREDDIE MAC VAR 25/03/2042 USD (ISIN US35564KTJ87)	1,511,412	134,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1AA87)	120,268
3,482,000	FREDDIE MAC VAR 25/09/2050 USD (ISIN US35565RBD44)	3,201,174	116,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1AJ96)	104,195
2,160,000	FREDDIE MAC VAR 25/09/2050 USD (ISIN US35565RBE27)	2,388,484	348,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1C575)	312,764
2,875,000	FREDDIE MAC VAR 25/10/2050 USD (ISIN US35566ABD00)	2,841,972	221,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/08/2050	195,938
3,345,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2050 USD (ISIN US35565TBD00)	3,133,047	1,800,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/09/2038	17,359
5,100,000	FREDDIE MAC VAR 25/11/2050 USD (ISIN US35565TBE82)	5,019,636	620,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/09/2052	544,611
1,745,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2041	1,527,898	2,200,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/10/2038	21,796
2,440,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBD65)	2,208,146	720,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/10/2052	630,835
2,180,000	FREDDIE MAC VAR 25/12/2050 USD (ISIN US35566CBE49)	1,977,332	500,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/11/2034	5,708
1,000,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/01/2042 USD (ISIN US3133D4M916)	689,852	10,700,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/11/2039	402,470
3,000,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/01/2042 USD (ISIN US3133KYV972)	2,034,439	2,515,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/12/2039 USD (ISIN US312938H9Q0)	207,188
1,200,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/02/2042 USD (ISIN US3132D9G991)	812,618	1,100,000	FREDDIE MAC 5.00% 01/12/2050	834,836
2,000,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/02/2042 USD (ISIN US3133KYWD74)	1,355,598	154,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/03/2053 USD (ISIN US3133BWX575)	141,066
300,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/03/2042	208,178	127,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C06U18)	115,840
3,000,000	FREDDIE MAC 1.50% 01/12/2041	2,013,111	156,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1AG57)	142,400
59,000	FREDDIE MAC 2.00% 01/02/2042	41,995	114,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1AS95)	104,032
1,100,000	FREDDIE MAC 2.00% 01/03/2052	786,481	304,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1AT78)	258,772
639,000	FREDDIE MAC 2.50% 01/04/2052	465,150	391,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C1DN71)	336,991
13,554,000	FREDDIE MAC 2.50% 01/05/2051	8,649,627	3,162,658	FREDDIE MAC 5.50% 01/06/2041	440,189
21,000	FREDDIE MAC 3.50% 01/01/2052	14,289	1,204,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/07/2049	967,030
1,490,000	FREDDIE MAC 3.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3133B9MF82)	1,127,489	1,250,000	FREDDIE MAC 5.50% 01/11/2034	6,233
89,000	FREDDIE MAC 3.50% 01/04/2052 USD (ISIN US3133B9W676)	73,052	3,000,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/01/2034	52,426
6,616,982	FREDDIE MAC 3.50% 01/07/2046	1,781,285	1,127,715	FREDDIE MAC 6.00% 01/03/2033	3,256
4,100,000	FREDDIE MAC 3.50% 01/10/2040	586,991	173,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3133BWL55)	162,909
165,275,000	FREDDIE MAC 3.50% 15/12/2042	3,872,565	124,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/03/2053 USD (ISIN US3133XCAT73)	115,470
108,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/02/2051	63,521	2,238,093	FREDDIE MAC 6.00% 01/04/2035	9,601
2,040,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/04/2047	352,237	96,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C04U36)	90,656
160,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/04/2051	35,239	135,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C06X56)	124,956
242,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/06/2050	64,802	85,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C06Y30)	78,613
226,589	FREDDIE MAC 4.00% 01/08/2025	3,936	94,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/04/2053 USD (ISIN US3133C06Z05)	87,174
61,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/09/2051 USD (ISIN US3133ASLK78)	31,709	5,151,962	FREDDIE MAC 6.00% 01/06/2039	45,128
242,000	FREDDIE MAC 4.00% 01/09/2051 USD (ISIN US3133ATKQ31)	185,893	319,086	FREDDIE MAC 6.00% 01/07/2053	296,476
			360,000	FREDDIE MAC 6.00% 01/10/2052	334,405
			1,151,218	FREDDIE MAC 6.00% 01/11/2033	3,975

数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
1,135,350	FREDDIE MAC 6.00% 01/12/2036	10,312	
472,239	FREDDIE MAC 6.50% 01/01/2053	427,869	
2,700,000	FREDDIE MAC 6.50% 01/02/2053	2,517,914	
85,000	FREDDIE MAC 6.50% 01/04/2053	80,060	
2,250,000	FREMF MORTGAGE TRUST VAR 25/04/2033	1,807,958	
4,000,000	FREMF MORTGAGE TRUST VAR 25/08/2033	3,217,075	
3,000,000	FREMF MORTGAGE TRUST VAR 25/11/2032	2,376,361	
8,250,000	FREMF MORTGAGE TRUST VAR 25/12/2027	6,898,940	
3,000,000	FREMF MORTGAGE VAR 25/07/2027	2,570,836	
5,000,000	FREMF MORTGAGE VAR 25/12/2026	4,181,404	
3,565,976	FREMF 2017-K727 MORTGAGE TRUST VAR 25/07/2024	3,158,750	
3,928,000	FREMF 2017-K727 MORTGAGE TRUST VAR 25/11/2033	3,146,174	
4,000,000	FREMF 2018 KBX1 MORTGAGE TRUST VAR 25/01/2026	3,091,443	
3,526,000	FREMF 2018 KBX1 MORTGAGE TRUST VAR 25/07/2036	2,765,951	
2,500,000	FREMF 2018 KSW4 MORTGAGE TRUST FRN 25/10/2028 USD (ISIN US302960AH25)	1,123,340	
1,000,000	FREMF 2018 K730 MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2031	761,683	
3,713,000	FREMF 2018 K74 MORTGAGE TRUST VAR 25/09/2028	2,916,721	
33,310,000	GINNIE MAE VAR 20/09/2049	148,015	
6,266,000	GINNIE MAE 3.50% 20/01/2050	582,256	
3,100,000	GINNIE MAE 3.50% 20/11/2052	2,497,523	
4,000,000	GINNIE MAE 5.00% 01/07/2048*	3,605,923	
1,650,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 3.50% 20/03/2046	444,959	
1,975,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 3.50% 20/04/2045 USD (ISIN US36184JAM27)	273,318	
1,859,804	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 3.50% 20/04/2045 USD (ISIN US36184NEC11)	423,083	
775,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 3.50% 20/04/2045 USD (ISIN US36184XM221)	199,850	
377,179	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/01/2041	9,452	
653,254	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/01/2045	165,520	
2,098,115	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/02/2045	248,539	
11,388,005	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/03/2044 USD (ISIN US36178GJ620)	608,751	
14,379,064	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/03/2044 USD (ISIN US36178GJ703)	751,800	
892,132	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/03/2044 USD (ISIN US36181CEE49)	13,406	
526,726	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/03/2044 USD (ISIN US36198KYQ83)	12,249	
6,395,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/04/2045	562,249	
501,374	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/07/2042	13,313	
12,871,455	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/07/2044	1,254,910	
5,137,530	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/07/2045 USD (ISIN US36185SAK50)	157,653	
526,119	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/08/2044 USD (ISIN US36182R5H39)	15,252	
6,447,281	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/08/2044 USD (ISIN US36182UNQ66)	305,884	
2,879,799	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/08/2045 USD (ISIN US3617A6HP19)	274,194	
906,406	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2041	29,008	
17,823,862	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2044 USD (ISIN US36182UN526)	1,663,960	
400,616	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2044 USD (ISIN US36183B6T02)	9,798	
4,707,498	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2044 USD (ISIN US36183B6U74)	657,762	
10,000,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2044 USD (ISIN US36198VMG94)	694,324	
505,801	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2044 USD (ISIN US36198XBF96)	70,951	
315,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2045 USD (ISIN US3617A3V982)	20,794	
407,518	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/09/2045 USD (ISIN US3617A6YA56)	53,428	
216,403	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/11/2040	43,903	
58,722	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.00% 15/11/2044	5,731	
1,687,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/01/2040	136,335	
30	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/03/2036	2	
5,886,770	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/03/2041	163,809	
34,416,749	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/04/2039	526,553	
4,784,203	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/06/2040	160,074	
82,096	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/07/2034	6,655	
6,581,138	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/07/2039	174,105	
5,262,066	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/07/2041 USD (ISIN US36206C6H78)	72,243	
10,904,318	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/08/2039	236,724	
1,675,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/08/2041	20,589	
1,240,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/09/2040	73,007	
33,382	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 4.50% 15/12/2039	865	
1,315,560	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 15/09/2033	33,609	
1,743,588	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 15/01/2034	23,744	
2,500,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 15/07/2033	44,414	
1,750,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 15/10/2034	44,903	
2,000,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 20/09/2038	1,826,091	
2,773,075	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.00% 20/10/2037	89,352	
2,769,616	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 5.75% 15/11/2038	296,417	
500,000	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.00% 15/03/2033	22,276	
1,153,666	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.00% 15/06/2033	16,189	
8,245,808	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.00% 15/09/2034	261,528	
919,010	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.50% 15/08/2032	2,103	
116,188	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.50% 15/08/2036	528	
312,876	GNMA I AND II SINGLE ISSUER 6.50% 15/10/2032	7,492	
9,410,000	GNMA PLATINUM POOLS USING GNMA I COLLATERAL 4.00% 15/06/2045	828,105	
5,500,000	GNMA PLATINUM POOLS USING GNMA I COLLATERAL 6.00% 15/08/2032	28,874	
1,016,420	GNMA PLATINUM POOLS USING GNMA I COLLATERAL 6.50% 15/11/2032	6,289	
2,000,000	GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION GNMA II 3.00% 20/06/2043*	1,638,262	
2,573,000	GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION GNMA II 3.50% 20/02/2050	191,431	
3,000,000	GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION GNMA II 3.50% 20/09/2052	2,460,092	
48,748,280	GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION GNMA II 3.50% 20/10/2049 USD (ISIN US38382AFF75)	2,717,476	



数量	評価額 ユーロ	数量	評価額 ユーロ
105,064,505	2,144,363	6,015,000	1,130,735
19,131,160	1,184,173	4,300,000	47,793
1,000,000	32,166	5,400,000	559,033
1,500,000	37,113	2,300,000	1,686,021
		970,000	909,478
1,780,000	100,774	1,398,000	1,017,017
		2,055,500	1,437,142
4,920,000	369,235	3,710,000	2,102,908
		2,293,300	1,389,901
11,060,000	730,033	2,441,000	1,787,160
1,500,000	22,987	19,700,000	177,790
4,880,000	87,233	3,300,000	2,490,964
4,000,000	3,692,140	2,800,000	2,365,717
		4,400,000	-
2,471,432	15,325	4,525,000	3,873,172
2,531,043	47,254	6,500,000	5,504,851
561,329	3,393	5,850,000	4,123,950
		4,315,000	2,516,101
1,001,228	318	2,475,000	1,529,711
1,056,739	9,488	1,250,000	975,139
23,565,000	186,978	6,450,000	4,588,992
3,147,000	100,309	2,725,000	1,758,382
3,130,000	235,003	5,000,000	3,752,529
		3,500,000	1,986,031
43,134,880	1,089,181	1,250,000	568,720
28,000,000	1,344,298	1,750,000	1,454,322
2,962,389	21,918	4,350,000	3,634,441
959,139	1,675	2,500,000	2,176,354
265,928	34,341	3,250,000	2,724,009
1,880,000	641,337	3,981,450	1,988,317
1,880,000	876,196	2,100,000	1,575,856
		2,500,000	2,221,787
2,900,841	181,204	1,965,000	1,035,632
1,962,000	133,522	1,000,000	823,997
760,800	75,481		

数量		評価額 ユーロ	数量		評価額 ユーロ
1,605,000	PROGRESS RESIDENTIAL TRUST 4.053% 17/11/2040	1,214,282			
950,000	RADNOR RE LTD VAR 25/11/2031	876,597			
3,875,000	RBCSF 2010 MB-1 VAR 11/03/2031	2,674,653			
1,350,000	READYCAP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN 25/07/2036 USD (ISIN US75575TAJ25)	1,150,039			
3,625,000	READYCAP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN 25/11/2036 USD (ISIN US75575WAJ53)	2,995,469			
6,650,000	SCF EQUIPMENT TRUST 2016-1 LLC 3.56% 20/08/2032	5,554,167			
2,662,000	SEQUOIA MORTGAGE TRUST VAR 25/08/2047	1,508,705			
1,927,000	SEQUOIA MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2047	1,082,801			
120,000	SEQUOIA MORTGAGE TRUST VAR 25/12/2042	19,971			
1,899,000	SEQUOIA MORTGAGE TRUST 2017 3 VAR 25/04/2047	1,079,003			
3,000,000	SOUND POINT CLO LTD FRN 26/10/2031	2,338,856			
3,575,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/03/2058	2,533,987			
4,050,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/06/2057	2,891,063			
12,035,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/07/2057	9,341,877			
3,000,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/07/2058	1,769,757			
1,921,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2056 USD (ISIN US89173CAG24)	1,417,365			
3,630,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2056 USD (ISIN US89173FAF71)	2,798,564			
7,826,468	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2056 USD (ISIN US89173FAG54)	5,644,868			
8,617,814	TOWD POINT MORTGAGE TRUST VAR 25/10/2057	6,044,148			
5,265,000	TOWD POINT MORTGAGE TRUST 2018 3 VAR 25/05/2058	3,713,638			
3,000,000	TOWD POINT MTGE TRUST 18 2 VAR 25/03/2058	2,224,174			
4,500,000	TOWD POINT MTGE 2017-3 A4 VAR 25/07/2057	3,370,408			
1,260,000	TRICON AMERN HOMES 2017-SFR1 TRUST 3.544% 17/07/2038	1,053,363			
3,200,000	TRICON AMERN HOMES 2017-SFR2 TRUST 4.882% 17/07/2038	2,732,730			
3,650,000	TRINITAS CLO I LTD VAR 25/01/2034	2,890,041			
500,000	UBS COMMERCIAL MORTGAGE TRUST VAR 15/10/2050	385,370			
60,000,000	UBS COMMERCIAL MTGE TRUST VAR 15/03/2051	872,761			
4,251,000	WELLS FARGO COMMERCIAL MORTGAGE TRUST 2016-LC25 VAR 15/12/2059	3,500,535			
	投資銀行・仲介サービス	2,713,609			
2,000,000	ABCA REVERSION CLASS A SHARE SERIES JANUARY 2022 VAR 15/01/2035 USD (ISIN US00038JAE47)	1,556,695			
1,600,000	JG WENTWORTH INC 4.70% 15/10/2074	1,156,914			
	生命保険	7,552,716			
9,250,000	GENWORTH MORTGAGE INSURANCE CORP FRN 25/08/2033 USD (ISIN US89600FAD50)	5,947,440			
1,500,000	GENWORTH MORTGAGE INSURANCE CORP FRN 25/08/2033 USD (ISIN US89600FAE34)	1,394,222			
1,820,000	GENWORTH MORTGAGE INSURANCE CORP FRN 25/10/2030	211,054			
	不動産投資・サービス	1,701,320	2,050,000	READYCAP COMMERCIAL MORTGAGE TRUST FRN 25/11/2036 USD (ISIN US75575WAL00)	1,701,320

## C A マネープールファンド（適格機関投資家専用）

## 運用報告書

《第17期》

決算日：2024年2月15日

（計算期間：2023年2月16日～2024年2月15日）

当ファンドはこの度、上記の決算を行いました。ここに期中の運用状況についてご報告申し上げます。

## ■投資対象ファンドの概要

運用方針	主として本邦通貨表示の短期公社債に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行うとともに、あわせてコール・ローンなどで運用を行うことで流動性の確保を図ります。
主要運用対象	本邦通貨表示の短期公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建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			債券組入率	純資産総額
		税込み 分配金	期中 騰落率		
	円	円	%	%	百万円
13期（2020年2月17日）	10,048	0	△0.1	61.1	788
14期（2021年2月15日）	10,042	0	△0.1	64.6	773
15期（2022年2月15日）	10,035	0	△0.1	70.8	552
16期（2023年2月15日）	10,027	0	△0.1	74.3	473
17期（2024年2月15日）	10,020	0	△0.1	70.8	495

（注）当ファンドは運用成果の目標基準となるベンチマークを設けておりません。また、当ファンドと適切に対比できる参考指数はありません。以下同じ。

## ■当期中の基準価額等の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率
		騰 落 率	
(期 首) 2023年2月15日	円	%	%
	10,027	—	74.3
2月末	10,027	0.0	74.3
3月末	10,027	0.0	71.0
4月末	10,027	0.0	72.1
5月末	10,027	0.0	73.6
6月末	10,027	0.0	73.9
7月末	10,026	△0.0	75.4
8月末	10,026	△0.0	65.4
9月末	10,025	△0.0	67.0
10月末	10,024	△0.0	65.9
11月末	10,020	△0.1	69.2
12月末	10,020	△0.1	71.6
2024年1月末	10,020	△0.1	74.6
(期 末) 2024年2月15日	10,020	△0.1	70.8

(注) 騰落率は期首比です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	第 17 期 (2023年2月16日 ～2024年2月15日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 会 社 )	1円 (1) (0) (0)	0.011% (0.009) (0.001) (0.002)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 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、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	1 (1)	0.012 (0.012)	その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	2	0.023	

期中の平均基準価額は10,024円です。

(注1) 費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ■ 売買及び取引の状況（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	地 方 債 証 券	351,475	— (350,000)

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■ 主要な売買銘柄（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

## 公社債

銘 柄	買 付	銘 柄	売 付
	金 額		金 額
	千円		千円
第139回共同発行市場公募地方債	150,810		
第134回共同発行市場公募地方債	100,353	—	—
第137回共同発行市場公募地方債	50,289		
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	50,023		

(注1) 金額は受渡し代金です。経過利子分は含まれていません。

(注2) 単位未満は切捨てです。

(注3) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

（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（2024年2月15日現在）

公社債

## (A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2024 年 2 月 15 日 現 在						
	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	%	%	%	%	%
地 方 債 証 券	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8
合 計	350,000	350,832	70.8	—	—	—	70.8

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

（注2）単位未満は切捨てです。

（注3）—印は組入れなしです。

（注4）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債

種 類	銘 柄	2024 年 2 月 15 日 現 在			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,178	2024/5/24
	第137回共同発行市場公募地方債	0.566	50,000	50,143	2024/8/23
	第139回共同発行市場公募地方債	0.544	150,000	150,511	2024/10/25
	第11回政府保証地方公共団体金融機構債券（4年）	0.001	50,000	50,000	2024/8/28
合 計			350,000	350,832	

（注）額面・評価額の単位未満は切捨てです。

## ■投資信託財産の構成（2024年2月15日現在）

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	350,832	70.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	144,454	29.2
投 資 信 託 財 産 総 額	495,286	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨てです。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年2月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	495,286,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	143,608,953
公 社 債(評価額)	350,832,500
未 収 利 息	452,737
前 払 費 用	392,459
(B) 負 債	59,852
未 払 信 託 報 酬	53,488
未 払 利 息	424
そ の 他 未 払 費 用	5,940
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	495,226,797
元 本	494,224,101
次 期 繰 越 損 益 金	1,002,696
(D) 受 益 権 総 口 数	494,224,101口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	10,020円

(注記事項)

期首元本額	472,090,843円
期中追加設定元本額	134,248,238円
期中一部解約元本額	112,114,980円

## ■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,811,835円
受 取 利 息	1,905,211
支 払 利 息	△ 93,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 2,019,533
売 買 益	146,041
売 買 損	△ 2,165,574
(C) 信 託 報 酬 等	△ 113,341
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 321,039
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 683,574
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	( 17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
(G) 計 (D + E + F)	1,002,696
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	1,002,696
追 加 信 託 差 損 益 金	2,007,309
(配 当 等 相 当 額)	( 17,080,817)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△15,073,508)
分 配 準 備 積 立 金	6,793,356
繰 越 損 益 金	△ 7,797,969

(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。