

ブラックロック・ ワールド・インカム・ストラテジー (愛称) BR Win

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

第36作成期 運用報告書(全体版)

第208期 (決算日:2023年1月20日)
 第209期 (決算日:2023年2月20日)
 第210期 (決算日:2023年3月20日)
 第211期 (決算日:2023年4月20日)
 第212期 (決算日:2023年5月22日)
 第213期 (決算日:2023年6月20日)

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒110-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先
 電話番号: 03-6703-4300
 (受付時間 営業日の9:00~17:00)
 ホームページアドレス
www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

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

◇基準価額の推移

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託証券 組入比率	純資産
		(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率		
第32 作成期		円	円	%	%	百万円
	184期(2021年1月20日)	9,394	20	0.7	99.1	1,574
	185期(2021年2月22日)	9,546	20	1.8	99.1	1,509
	186期(2021年3月22日)	9,766	20	2.5	99.8	1,537
	187期(2021年4月20日)	9,725	20	△ 0.2	98.9	1,504
	188期(2021年5月20日)	9,761	20	0.6	99.7	1,499
	189期(2021年6月21日)	9,869	20	1.3	99.1	1,547
第33 作成期	190期(2021年7月20日)	9,752	20	△ 1.0	99.1	1,487
	191期(2021年8月20日)	9,785	20	0.5	99.2	1,492
	192期(2021年9月21日)	9,750	20	△ 0.2	99.3	1,465
	193期(2021年10月20日)	10,138	20	4.2	98.6	1,619
	194期(2021年11月22日)	10,059	20	△ 0.6	99.4	1,614
	195期(2021年12月20日)	9,935	20	△ 1.0	99.5	1,594
第34 作成期	196期(2022年1月20日)	9,932	20	0.2	99.8	1,592
	197期(2022年2月21日)	9,865	20	△ 0.5	99.2	1,572
	198期(2022年3月22日)	10,134	20	2.9	99.8	1,608
	199期(2022年4月20日)	10,844	20	7.2	98.9	1,744
	200期(2022年5月20日)	10,562	20	△ 2.4	99.2	1,665
	201期(2022年6月20日)	11,024	20	4.6	99.8	1,727
第35 作成期	202期(2022年7月20日)	11,205	20	1.8	99.1	1,764
	203期(2022年8月22日)	11,239	20	0.5	99.4	1,765
	204期(2022年9月20日)	11,509	20	2.6	98.9	1,936
	205期(2022年10月20日)	11,766	20	2.4	99.0	1,883
	206期(2022年11月21日)	11,107	20	△ 5.4	99.5	1,767
	207期(2022年12月20日)	10,766	20	△ 2.9	99.3	1,718
第36 作成期	208期(2023年1月20日)	10,426	20	△ 3.0	99.5	1,589
	209期(2023年2月20日)	10,758	20	3.4	99.4	1,642
	210期(2023年3月20日)	10,576	20	△ 1.5	98.8	1,566
	211期(2023年4月20日)	10,757	20	1.9	98.9	1,589
	212期(2023年5月22日)	10,962	20	2.1	98.9	1,571
	213期(2023年6月20日)	11,351	20	3.7	99.1	1,472

(注1) 基準価額の騰落率は税込分配金込み。基準価額は1万口当り。

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

(注3) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当作成期中の基準価額と市況の推移

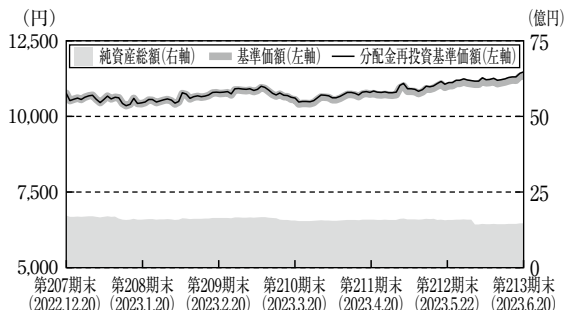
決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託証券 組 入 比 率
			騰 落 率	
第208期	(期 首) 2022年12月20日	円 10,766	% -	% 99.3
	12月末	10,572	△1.8	99.5
	(期 末) 2023年 1 月20日	10,446	△3.0	99.5
第209期	(期 首) 2023年 1 月20日	10,426	-	99.5
	1 月末	10,563	1.3	99.7
	(期 末) 2023年 2 月20日	10,778	3.4	99.4
第210期	(期 首) 2023年 2 月20日	10,758	-	99.4
	2 月末	10,881	1.1	99.3
	(期 末) 2023年 3 月20日	10,596	△1.5	98.8
第211期	(期 首) 2023年 3 月20日	10,576	-	98.8
	3 月末	10,649	0.7	99.4
	(期 末) 2023年 4 月20日	10,777	1.9	98.9
第212期	(期 首) 2023年 4 月20日	10,757	-	98.9
	4 月末	10,724	△0.3	98.9
	(期 末) 2023年 5 月22日	10,982	2.1	98.9
第213期	(期 首) 2023年 5 月22日	10,962	-	98.9
	5 月末	11,084	1.1	89.6
	(期 末) 2023年 6 月20日	11,371	3.7	99.1

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

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

■当作成期中の基準価額等の推移について

(第36作成期：2022年12月21日～2023年6月20日)



第208期首：10,766円

第213期末：11,351円 (既払分配金 120円)

騰落率：6.6% (分配金再投資ベース)

- * 分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- * 分配金再投資基準価額は、前作成期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

米国においては、当作成期を通じて金利は小幅上昇しました。インフレの高止まり、米国経済の底堅さを示す経済指標、米連邦準備制度理事会 (FRB) による継続的な利上げ等が金利上昇要因となった一方、金融システム不安への懸念や債務上限問題に対する懸念等が金利低下要因となりました。12月は、11月の消費者物価指数 (CPI) が市場予想を下回ったことを背景にインフレ鈍化が意識され金利が低下しました。その後、開催された米連邦公開市場委員会 (FOMC) において市場予想通りの50bpsの利上げが決定されたものの、政策金利見通しが上方修正されたことや、パウエル議長が引き締めを継続する意向を示したことで景気減速懸念が強まり、金利低下となりました。その後、日銀が予想外に10年金利の変動許容幅を拡大したこ

とを受け米国金利は上昇し月を終えました。1月、上旬は年始で市場参加者が少ない中、年末に見られた欧州金利の巻き戻しに追随し米金利も低下しました。2月、経済の底堅さを示す指標が発表され、利上げ懸念が再燃し、米金利は先月末比上昇しました。月初のFOMCでは市場予想通りの25bpsの利上げが実施され、ややハト派的なパウエル議長の発言が一時的な金利低下圧力となるも、予想を大幅に上回った1月分米雇用統計などの経済指標やハト派色の後退が示唆されるFOMC議事要旨を受けて金利は大きく上昇しました。3月、米地銀の経営破綻やスイス大手行の買収に絡んだ一連の出来事がグローバルの金融システム不安に繋がりリスクオフとなった中、米金利は大きく低下しました。月後半のFOMCでは、市場予想通りの25bpsの利上げがなされたものの、声明文の一部が修正されたことなどから、利上げ終了間近との見方が広がり、金利がさらに低下したものの、月末にかけては破綻した地銀の買収等がセンチメントの回復に繋がり、それまでの金利低下を一部巻き戻す形で上昇しました。4月、予想を上回る米銀決算やFRB理事のタカ派発言を受け金利が上昇する局面も見られたものの、下旬にかけては金融セクターの信用不安への懸念が再燃し、リスクオフとなり金利が低下しました。5月、FRBによる市場予想通りの25bpsの利上げ後、利上げサイクル終了との見方が強まりました。その後強い経済指標や一部FOMCメンバーからのタカ派発言等を背景に6月のFOMC会合での利上げ期待が高まり、金利は上昇したものの、金融不安の再燃や債務上限問題がセンチメントの重石となり金利上昇を一部抑制しました。6月、FRBは政策金利を据え置きましたが、FOMC参加者のフェデラルファンド (FF) 金利見通し (ドットチャート) で予想外の2回の追加利上げが示唆されたことを受け、金利は上昇し、米10年国債利回りは3.72%台で当作成期を終えました。

欧州においては、当作成期を通じて金利は上昇しま

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

した。インフレの高止まり、各国中央銀行による金融引き締め等が金利上昇要因となりました。12月、月半ばに開催された、欧州中央銀行 (ECB) 会合において50bpsの利上げに加え、2023年3月から毎月150億ユーロずつ行う量的引き締め(QT)の発表や、ECB会合後に相次いだECBメンバーのタカ派発言を受け金利が上昇しました。1月、各国のインフレ指標からインフレの鈍化が確認されたこと等から金利は低下しました。月後半に公表されたECB議事要旨がタカ派と見られたことやラガルド総裁によるタカ派的な発言などを受け、欧州金利は上昇基調となったものの、月間では金利は低下して月を終えました。2月、月初に行われたECB会合においては、50bpsの利上げが行われたものの、ラガルド総裁の発言がハト派と捉えられ金利が一時低下する局面が見られました。その後、ECBメンバーによるタカ派発言やインフレ指標が市場予想を上回ったことによる利上げ継続懸念を受け、欧州金利は前月末対比で上昇しました。3月に入ってから、米地銀の破綻やクレディスイスの問題を受け、金融システム不安が広がり、金利は低下しました。4月、上旬は金融システム不安が後退していることや軟調な米経済指標を受けた米金利の低下に追随し、金利は低下しました。その後、イースター休暇明けからはECBメンバーのタカ派発言や予想を上回る米雇用統計、英国CPIなどの経済指標の発表を受けた米英金利の上昇に追随し金利は上昇しました。月末にかけては、独、スペインのCPIが予想比下振れたことからECBによる過度な利上げ観測が後退したことや、米中堅銀行の軟調な決算が市場センチメントの悪化に繋がり金利が大きく低下、前月末比では小幅上昇で月を終えました。5月、上旬に開催されたECB会合において、市場予想通りの25bpsの利上げが行われ、資産購入プログラム(APP)の償還再投資を7月に終了することが発表されました。ラガルド総裁の記者会見がタカ派であったものの、銀行セクターにおける懸念が議論の中心である

との見方が広がり、金利は低下しました。その後、ECBメンバーのタカ派発言、米債務上限問題に関するヘッドライン、予想を上回る米雇用統計、英国CPIなどの経済指標の発表を受けた米英金利の上昇に追随し金利は上昇しました。月末にかけては、独、スペイン、仏のCPIやユーロ圏の消費者物価指数(HICP)が予想比下振れたことからECBによる利上げ観測が後退したことで金利が低下し、前月末比小幅低下で月を終えました。6月、月半ばに開催されたECB会合において25bpsの利上げが行われました。声明文に特段の変更はなかったものの、インフレ見通しが上方修正されたことがタカ派と捉えられ、金利が上昇しドイツ10年国債利回りは2.40%台で当作成期を終えました。

ポートフォリオについて

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

<BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド>

金利リスクについては、柔軟な投資戦略に基づき、ポートフォリオのデュレーションを2.9年程度に長期化しました。当作成期、米国経済が堅調であることを示す経済指標等を受け、市場で織り込まれていた年後半のFRBによる利下げ織り込みが剥落するとみて、期後半には米国のデュレーションを機動的に調整しました。欧州については、エネルギー価格の鈍化を背景とするインフレの減速を受けECBによる金融引き締めが終盤に近づいていること踏まえ、欧州のデュレーションを積み増しました。クレジット資産においては、選別的にポジションを追加しました。また、新興国においてはインフレにピークアウトが見られており、中央銀行の金融政策が転換期にあることに加え、利回り水準が魅

力的であることを踏まえ、一部現地通貨建て新興国債券への配分を拡大しました。

なお、当作成期におけるパフォーマンスの変動要因は以下のとおりです。

(主なプラス要因)

- ・ 政府系MBSのポジションニング
- ・ 米国ハイ・イールド社債、投資適格社債や欧州クレジットの保有

(主なマイナス要因)

- ・ 欧州等のデュレーション戦略

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額の期中騰落率は+6.6%となりました。当作成期、主要投資対象である「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」が-0.5%と下落した一方、当該ファンドが米ドル

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称：BR Win)

建てのため、米ドルが円に対して上昇したことがプラス要因となりました。

■主要投資対象ファンドの当作成期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	△0.5%

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

収益分配金は基準価額水準、市場動向等を勘案して、208期(1万口あたり20円)、209期(1万口あたり20円)、210期(1万口あたり20円)、211期(1万口あたり20円)、212期(1万口あたり20円)、213期(1万口あたり20円)とさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行っております。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期	第213期
	2022年12月21日 ～2023年1月20日	2023年1月21日 ～2023年2月20日	2023年2月21日 ～2023年3月20日	2023年3月21日 ～2023年4月20日	2023年4月21日 ～2023年5月22日	2023年5月23日 ～2023年6月20日
当期分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.19%	0.19%	0.19%	0.19%	0.18%	0.18%
当期の収益	15円	20円	16円	20円	20円	20円
当期の収益以外	4	-	3	-	-	-
翌期繰越分配対象額	3,465	3,480	3,477	3,506	3,537	3,552

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

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

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

今後の運用方針について

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

投資先ファンドにおける今後の運用方針は以下の通りです。

<BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド>

世界金融危機以降、経済成長等が鈍化した際には、先進国の中央銀行は金融緩和によって経済や市場の支援を行ってきました。しかし、今後の景気サイクルでは、従来と異なり、各国中央銀行はインフレ水準を重要視していることからスピーディーに大規模な支援策を講じる可能性は低いと考えています。

当ファンドでは、魅力的なリターンに加え、流動性と柔軟性の特性を持ち合わせる高格付けかつ短期の資産を選好しています。そのため、短期かつ高格付けの米国と欧州の投資適格債のポジションは魅力的であると考えています。ハイ・イールド債については、厳選して保有する必要があると考えており、ユーロ圏のハイ・イールド債も選好しています。また、ECBの利上げサイクルが長期化し、米国と欧州の金利差が縮小する可能性があり、このことがユーロ通貨を下支えすると考えられることから、ユーロ通貨を選好するポジションを継続します。加えて、メキシコ等の一部のエマージング市場の現地通貨建て債券は高い利回りを提供しており、投資妙味があると考えています。

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第208期～第213期		項目の概要
	(2022.12.21～2023.6.20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 85	% 0.787	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10,757円です。
(投信会社)	(38)	(0.355)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(44)	(0.410)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	8	0.077	その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.022)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(印刷費用・監査費用等)	(6)	(0.054)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	93	0.864	

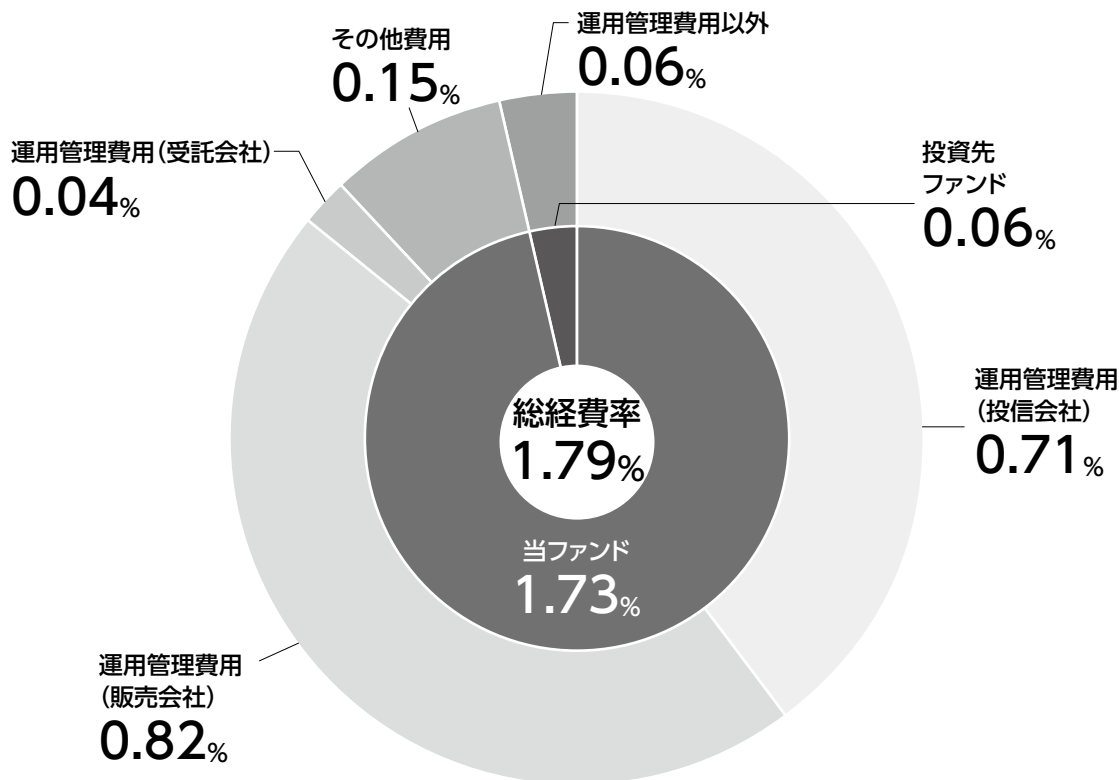
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

■総経費率



※当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.79%です。

総経費率(①+②+③)	1.79%
①当ファンドの費用の比率	1.73%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1)①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5)①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2022年12月21日から2023年6月20日まで)

投資信託証券

			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ	BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 29	千米・ドル 282	千口 270	千米・ドル 2,605
		BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド(ルクセンブルグ)	-	-	2	36

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2022年12月21日から2023年6月20日まで)

投資信託証券

買 付			売 付		
銘 柄	口 数	金 額	銘 柄	口 数	金 額
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 29	千円 37,824	BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 270	千円 354,967
			BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド(ルクセンブルグ)	2	4,953

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は、発行国です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2022年12月21日から2023年6月20日まで)

当作成期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2022年12月21日から2023年6月20日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当 作 成 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	千口 1,053	千米・ドル 10,153	百万円 1,444	% 98.1
BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	6	102	14	1.0
合 計	1,059	10,256	1,458	99.1

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

(注2) 比率欄は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 口数、評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2023年6月20日現在

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 証 券	1,458,829	98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,685	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,477,515	100.0

(注1) 第213期末における外貨建資産(1,458,833千円)の投資信託財産総額(1,477,515千円)に対する比率は、98.7%です。

(注2) 外貨建資産は、作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=142.23円です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	2023年1月20日現在	2023年2月20日現在	2023年3月20日現在
	第 208 期 末	第 209 期 末	第 210 期 末
(A) 資 産	1,595,309,027 円	1,648,181,487 円	1,571,907,251 円
コール・ローン等	13,325,217	15,732,901	24,342,748
投資証券(評価額)	1,581,983,810	1,632,448,586	1,547,564,503
(B) 負 債	5,503,377	5,424,823	5,097,261
未払収益分配金	3,049,578	3,054,086	2,962,887
未払解約金	55,084	50,562	1,392
未払信託報酬	2,242,962	2,169,524	1,994,484
その他未払費用	155,753	150,651	138,498
(C) 純資産総額(A-B)	1,589,805,650	1,642,756,664	1,566,809,990
元 本	1,524,789,226	1,527,043,210	1,481,443,575
次期繰越損益金	65,016,424	115,713,454	85,366,415
(D) 受益権総口数	1,524,789,226 口	1,527,043,210 口	1,481,443,575 口
1万口当り基準価額(C/D)	10,426 円	10,758 円	10,576 円

項 目	2023年4月20日現在	2023年5月22日現在	2023年6月20日現在
	第 211 期 末	第 212 期 末	第 213 期 末
(A) 資 産	1,594,820,416 円	1,577,125,194 円	1,477,515,232 円
コール・ローン等	22,363,323	22,686,368	18,685,975
投資証券(評価額)	1,572,457,093	1,554,438,826	1,458,829,257
(B) 負 債	5,201,646	5,237,938	4,922,492
未払収益分配金	2,955,492	2,867,974	2,594,670
未払解約金	-	-	321,756
未払信託報酬	2,100,310	2,216,080	1,875,810
その他未払費用	145,844	153,884	130,256
(C) 純資産総額(A-B)	1,589,618,770	1,571,887,256	1,472,592,740
元 本	1,477,746,065	1,433,987,381	1,297,335,400
次期繰越損益金	111,872,705	137,899,875	175,257,340
(D) 受益権総口数	1,477,746,065 口	1,433,987,381 口	1,297,335,400 口
1万口当り基準価額(C/D)	10,757 円	10,962 円	11,351 円

(注記事項)

期首元本額	1,595,919,588円
期中追加設定元本額	22,761,962円
期中一部解約元本額	321,346,150円

■損益の状況

第208期 自 2022年12月21日 至 2023年 1月20日

第209期 自 2023年 1月21日 至 2023年 2月20日

第210期 自 2023年 2月21日 至 2023年 3月20日

項 目	第 208 期	第 209 期	第 210 期
(A) 配 当 等 収 益	4,859,729 円	5,543,402 円	4,740,864 円
受 取 配 当 金	4,857,419	5,539,844	4,736,894
受 取 利 息	2,310	3,558	3,970
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 51,148,268	50,323,294	△ 26,451,171
売 買 益	19,452,006	70,409,269	365,794
売 買 損	△ 70,600,274	△ 20,085,975	△ 26,816,965
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,455,983	△ 2,321,827	△ 2,253,536
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 48,744,522	53,544,869	△ 23,963,843
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	159,743,801	107,653,849	152,887,955
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 42,933,277	△ 42,431,178	△ 40,594,810
(配 当 等 相 当 額)	(219,779,034)	(221,423,896)	(215,868,500)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 262,712,311)	(△ 263,855,074)	(△ 256,463,310)
(G) 合 計 (D + E + F)	68,066,002	118,767,540	88,329,302
(H) 収 益 分 配 金	△ 3,049,578	△ 3,054,086	△ 2,962,887
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	65,016,424	115,713,454	85,366,415
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 42,933,277	△ 42,431,178	△ 40,594,810
(配 当 等 相 当 額)	(219,779,034)	(221,423,896)	(215,868,500)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 262,712,311)	(△ 263,855,074)	(△ 256,463,310)
分 配 準 備 積 立 金	308,637,292	310,050,415	299,268,877
繰 越 損 益 金	△ 200,687,591	△ 151,905,783	△ 173,307,652

第211期 自 2023年 3月21日 至 2023年 4月20日

第212期 自 2023年 4月21日 至 2023年 5月22日

第213期 自 2023年 5月23日 至 2023年 6月20日

項 目	第 211 期	第 212 期	第 213 期
(A) 配 当 等 収 益	7,814,777 円	7,897,052 円	4,680,625 円
受 取 配 当 金	7,811,685	7,891,871	4,676,638
受 取 利 息	3,092	5,181	3,987
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	24,091,935	26,741,408	50,475,420
売 買 益	25,832,360	31,591,679	50,975,293
売 買 損	△ 1,740,425	△ 4,850,271	△ 499,873
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,306,293	△ 2,432,732	△ 2,073,307
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	29,600,419	32,205,728	53,082,738
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	125,128,205	147,129,025	159,460,677
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 39,900,427	△ 38,566,904	△ 34,691,405
(配 当 等 相 当 額)	(216,585,056)	(210,471,182)	(190,734,882)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 256,485,483)	(△ 249,038,086)	(△ 225,426,287)
(G) 合 計 (D + E + F)	114,828,197	140,767,849	177,852,010
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,955,492	△ 2,867,974	△ 2,594,670
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	111,872,705	137,899,875	175,257,340
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 39,900,427	△ 38,566,904	△ 34,691,405
(配 当 等 相 当 額)	(216,585,056)	(210,471,182)	(190,734,882)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 256,485,483)	(△ 249,038,086)	(△ 225,426,287)
分 配 準 備 積 立 金	301,584,191	296,830,429	270,134,813
繰 越 損 益 金	△ 149,811,059	△ 120,363,650	△ 60,186,068

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

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

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

■当作成期の分配金

	第208期 2023年1月20日	第209期 2023年2月20日	第210期 2023年3月20日
1万口当り分配金	20円	20円	20円
	第211期 2023年4月20日	第212期 2023年5月22日	第213期 2023年6月20日
1万口当り分配金	20円	20円	20円

- (注1) 分配金は、分配落ち後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、普通分配金と元本払戻金(特別分配金)に分かれます。分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金(特別分配金)、残りの部分が普通分配金となります。
- (注2) 普通分配金は次の税率で課税されます。
2037年12月31日までは、個人の受益者の場合は配当所得として、20.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。原則として、申告は不要です。また、確定申告を行うことにより総合課税(配当控除なし)と申告分離課税20.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税5%)のいずれかを選択することができます。法人の受益者の場合、15.315% (所得税及び復興特別所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。)の税率による源泉徴収が行われます。
※なお、税法が改正された場合には、上記の内容が変更になることがあります。
- (注3) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- (注4) 累積投資コースの税引き後分配金は、販売会社がお客様との累積投資契約に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。なお、第208期末の再投資は2023年1月20日現在の基準価額(1万口当り10,426円)、第209期末の再投資は2023年2月20日現在の基準価額(1万口当り10,758円)、第210期末の再投資は2023年3月20日現在の基準価額(1万口当り10,576円)、第211期末の再投資は2023年4月20日現在の基準価額(1万口当り10,757円)、第212期末の再投資は2023年5月22日現在の基準価額(1万口当り10,962円)、第213期末の再投資は2023年6月20日現在の基準価額(1万口当り11,351円)に基づいて行いました。
- (注5) 第208期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,403,746円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(219,779,034円)、分配準備積立金(309,283,124円)により、分配対象収益は531,465,904円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,049,578円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注6) 第209期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5,313,077円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(221,423,896円)、分配準備積立金(307,791,424円)により、分配対象収益は534,528,397円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、3,054,086円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注7) 第210期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,487,328円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(215,868,500円)、分配準備積立金(299,744,436円)により、分配対象収益は518,100,264円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,962,887円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

- (注8) 第211期計算期末における、費用控除後の配当等収益(7,249,966円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(216,585,056円)、分配準備積立金(297,289,717円)により、分配対象収益は521,124,739円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,955,492円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注9) 第212期計算期末における、費用控除後の配当等収益(7,342,389円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(210,471,182円)、分配準備積立金(292,356,014円)により、分配対象収益は510,169,585円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,867,974円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。
- (注10) 第213期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,504,601円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(190,734,882円)、分配準備積立金(268,224,882円)により、分配対象収益は463,464,365円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,594,670円(1万口当り20円)を分配に充てる事と決定いたしました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

<参考情報>

**ブラックロック・グローバル・ファンズ
フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンドの運用状況について
(計算期間:2021年9月1日~2022年8月31日)**

ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人)フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(以下「BGF フィクスト・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド」)はブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年8月末日)です。従って、入手可能な直前の計算期間(決算)である2022年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

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

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

■損益及び純資産変動計算書

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

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

BGF フィクスト・インカム・グローバル・ オポチュニティーズ・ファンド	
米ドル	
期首純資産	10,990,274,596
収益	
預金利息	1,917,409
債券利息、源泉徴収税控除後	255,923,595
スワップ利息	66,123,453
短期金融商品預け入れによる利息	57,146
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	252,125
配当金、源泉徴収税控除後	4,469,949
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	104,175
有価証券貸付による収益	1,524,349
投資運用報酬リベート	-
その他の払戻し	14,069
収益合計	330,386,270
費用	
差金決済契約に係る支払利息	3,295
スワップ利息	70,301,644
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	132,374
年間サービス費用	6,465,591
ローン・コミットメント・フィー	70,430
保管および預託報酬	1,852,123
販売報酬	3,030,105
税金	2,081,930
投資運用報酬	36,531,006
費用合計	120,468,498
純利益	209,917,772
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(353,251,329)
事後通告証券契約	(22,934,554)
差金決済取引	30,710
上場先物取引	285,960,242
オプション／スワップシオン契約	(3,792,651)
スワップ取引	89,823,659
先渡為替予約	(351,833,740)
その他の取引に係る外国通貨	(2,462,118)
当期実現純評価損	(358,459,781)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	(1,079,488,219)
事後通告証券契約	14,012,405
差金決済取引	(145,132)
上場先物取引	16,683,269
オプション／スワップシオン契約	(29,448,222)
スワップ取引	(1,452,839)
先渡為替予約	(53,399,964)
その他の取引に係る外国通貨	(8,653,423)
当期末実現評価益／(損)の純変動	(1,141,892,125)
運用成績による純資産の減少	(1,290,434,134)
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	1,997,532,850
投資証券買戻しによる正味支払額	(2,665,511,192)
資本の変動による純資産の減少	(667,978,342)
配当金宣言額	(34,771,614)
期末純資産	8,997,090,506

BGF フィクスド・インカム・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド

投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
	ルクセンブルグ		
955,110	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Bond Fund	18,806,116	0.21
122,600	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund	13,454,124	0.15
ファンド合計		32,260,240	0.36
普通/優先株式およびワラント			
	ベルギー		
32,829	Anheuser-Busch InBev	1,605,045	0.02
	バミューダ		
27,078	Bunge	2,669,349	0.03
11,612	Signet Jewelers	761,631	0.01
		3,430,980	0.04
	英領バージン諸島		
36,400	Capri*	1,767,584	0.02
	カナダ		
140,905	Lions Gate Entertainment*	1,471,048	0.02
99,749	Northern Graphite	47,092	0.00
		1,518,140	0.02
	ケイマン諸島		
13,501	OPAL Fuels (Wts 21/7/2027)	21,061	0.00
115,110	TPB Acquisition I	1,120,020	0.01
38,370	TPB Acquisition I (Wts 19/2/2023)	11,515	0.00
26,880	TPG Pace Beneficial Finance (Wts 9/10/2027)	1,613	0.00
147,094	Vantage Drilling	15	0.00
		1,154,224	0.01
	キュラソー島		
33,382	Schlumberger	1,266,179	0.01
	フランス		
4,388	BNP Paribas	205,052	0.00
151	Hermes International	196,838	0.00
943	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	620,478	0.01
1,054	Pernod Ricard	196,023	0.00
1,500	Schneider Electric	181,278	0.00
4,057	TotalEnergies	205,576	0.01
		1,605,245	0.02
	ドイツ		
27,746	Commerzbank	183,425	0.00
23,082	Covestro	691,835	0.01
10,909	Deutsche Telekom	206,313	0.00
37,574	Evonik Industries	704,064	0.01
181,632	Fresenius	4,497,329	0.05
18,675	KION	754,795	0.01
51,652	Mercedes-Benz	2,931,997	0.03
21,292	Porsche Automobil	1,514,514	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
5,017	RWE	195,245	0.00
2,860	Volkswagen	410,930	0.00
		<hr/>	<hr/>
		12,090,447	0.13
	ガーンジー		
297,095	Genius Sports	1,244,828	0.02
64,379	Genius Sports (Wts 31/12/2028)	50,866	0.00
		<hr/>	<hr/>
		1,295,694	0.02
	アイルランド		
1,388	Eaton	192,418	0.00
3,259	ICON	692,244	0.01
		<hr/>	<hr/>
		884,662	0.01
	イタリア		
255,713	Enel	1,218,742	0.01
	ジャージー		
56,602	Glencore	310,989	0.00
	ルクセンブルグ		
33,760	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	10,132	0.00
	オランダ		
1,485	ASML	734,852	0.01
979	Ferrari	190,644	0.00
2,266	NXP Semiconductors	374,774	0.00
		<hr/>	<hr/>
		1,300,270	0.01
	スウェーデン		
55,962	Telia	198,402	0.00
	スイス		
1,238	Cie Financiere Richemont	140,755	0.00
	台湾		
6,419	Taiwan Semiconductor Manufacturing	541,764	0.01
	英国		
1,563	AstraZeneca	196,101	0.00
22,010	BAE Systems	199,395	0.00
107,824	Barclays	207,227	0.00
23,900	BP	727,994	0.01
2,725,082	Lloyds Banking	1,392,534	0.02
74,791	Shell	1,968,225	0.02
30,039	Standard Chartered	208,667	0.00
		<hr/>	<hr/>
		4,900,143	0.05
	米国		
2,582	2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust	3,161,049	0.04
5,549	Abbott Laboratories	574,155	0.01
19,355	Activision Blizzard	1,527,690	0.02
1,100	Adobe	417,032	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
2,198	Advanced Micro Devices	188,457	0.00
34,763	Alcoa	1,730,502	0.02
1,443	Align Technology	359,249	0.00
9,140	Alphabet	1,015,362	0.01
1,800	Alphabet	198,252	0.00
180,700	Altus Power	1,906,385	0.02
27,502	Altus Power (Wts 12/1/2027)	78,381	0.00
6,874	Applied Materials	646,843	0.01
26,416	Archer-Daniels-Midland	2,306,645	0.03
303,507	Astra Space	273,156	0.00
12,672	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	4,055	0.00
59,157	Blend Labs	182,795	0.00
264	Booking	504,768	0.01
1,577	Broadcom	796,322	0.01
14,455	Caesars Entertainment	634,575	0.01
177,419	California Resources	8,682,886	0.10
106,424	Cano Health (Wts 3/6/2026)	159,636	0.00
1,038	Caterpillar	193,286	0.00
19,919	Century Communities	938,982	0.01
23,824	CF Industries	2,454,587	0.03
1,878	CH Robinson Worldwide	213,998	0.00
32,343	Chesapeake Energy	3,154,736	0.04
1,323	Chesapeake Energy (Wts 9/2/2026)	98,590	0.00
5,066	Chevron	796,324	0.01
5,559	Climate Real Impact Solutions II Acquisition (Wts 31/12/2027)	584	0.00
2,074	Consolidated Edison	204,227	0.00
32,427	Coupang	555,474	0.01
6,847	Crowdstrike	1,312,228	0.01
11,973	Datadog	1,301,525	0.01
23,948	Devon Energy	1,669,894	0.02
228,398	DiamondRock Hospitality	2,028,174	0.02
6,090	Domino's Pizza	2,302,446	0.02
3,838	Dow	194,702	0.00
68,245	Dynatrace	2,645,176	0.03
3,057	Edison International	210,841	0.01
73,253	Element Solutions	1,371,296	0.02
3,597	Eli Lilly	1,106,797	0.01
9,128	Embark Technology (Wts 31/12/2027)	1,044	0.00
40,560	EQT	1,906,320	0.02
60,140	Evgo (Wts 15/9/2025)	129,301	0.01
191,837	Excellerate Energy	4,747,966	0.05
21,461	Exxon Mobil	2,025,489	0.02
48,550	Ford Motor	748,156	0.01
34,018	Forestar	431,348	0.00
45,112	Freeport-McMoRan	1,324,940	0.01
5,572	Generac	1,244,729	0.01
13,401	General Motors	522,505	0.01
20,031	Gores VIII (Wts 31/12/2027)	12,024	0.00
87,166	Green Plains	3,147,564	0.04
62,128	Halliburton	1,852,657	0.02
4,655	HCA Healthcare	935,003	0.01
687	Home Depot	199,450	0.00
888	Humana	433,078	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
84,000	Informatica	1,879,080	0.02
5,359	Intuit	2,341,508	0.03
3,322	IQVIA	723,598	0.01
7,367	Juniper Networks	213,459	0.00
11,486	Kinder Morgan	208,184	0.00
134,037	Latch (4/6/2026)	20,106	0.00
7,134	McDonald's	1,813,819	0.02
5,624	Microchip Technology	364,773	0.00
5,088	Micron Technology	286,353	0.00
171	Morgan Stanley	14,487	0.00
25,880	Mr Cooper	1,096,018	0.01
2,892	NetApp	208,976	0.00
1,521	Nucor	200,437	0.00
5,992	NVIDIA	917,315	0.01
298,087	Offerpad	465,016	0.01
92,223	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	17,716	0.00
5,173	Otis Worldwide	375,922	0.01
107,759	Park Hotels & Resorts	1,528,023	0.02
32,025	Pear Therapeutics (Wts 1/12/2026)	4,810	0.00
77,818	Pivotal Investment III	766,507	0.01
232,160	Planet Labs PBC	1,286,166	0.01
18,445	Raymond James Financial	1,930,823	0.02
180,213	Rocket Lab USA	1,030,818	0.01
14,854	Salesforce	2,382,136	0.03
154,796	Sarcos Technology and Robotics	509,279	0.01
375,884	Sarcos Technology and Robotics (Wts 24/9/2026)	135,356	0.00
614	SBA Communications	201,429	0.00
28,124	Science Strategic Acquisition Alpha (Wts 31/12/2027)	1,969	0.00
1,244	Sempra Energy	206,840	0.00
227,107	Service Properties Trust	1,560,225	0.02
1,255	ServiceNow	557,659	0.01
325,291	Sonder	600,162	0.01
79,119	Starwood Property Trust	1,816,572	0.02
98,314	Sunstone Hotel Investors	1,087,353	0.01
82,145	Symbotic	1,010,384	0.01
6,596	Target Hospitality (15/3/2024)	25,988	0.00
51,669	Taylor Morrison Home	1,330,993	0.01
2,772	Tesla	773,139	0.01
50,007	Tishman Speyer Innovation II	492,569	0.01
10,001	Tishman Speyer Innovation II (Wts 31/12/2027)	1,200	0.00
56,257	Toast	1,073,946	0.01
6,054	United Rentals	1,773,035	0.02
3,053	UnitedHealth	1,604,138	0.02
1,866	Valero Energy	215,486	0.00
61,950	Volta (Wts 26/8/2026)	37,158	0.00
22,214	Western Digital	941,651	0.01
5,700	Weyerhaeuser	195,054	0.00
57,220	WillScot Mobile Mini	2,316,266	0.03
125,921	Xenia Hotels & Resorts	2,039,920	0.03
4,439	XPO Logistics	236,377	0.00
		108,583,834	1.22
		143,823,231	1.60

普通/優先株式およびワラント合計

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
アンゴラ			
USD 2,246,000	Angolan Government International Bond 8.75% 14/4/2032	1,841,720	0.02
アルゼンチン			
USD 2,325,496	Argentine Republic Government International Bond 1.5% 9/7/2035	520,911	0.01
USD 4,449,085	Generacion Mediterranea / Central Termica Roca 9.875% 1/12/2027	2,969,542	0.03
USD 1,012,820	Gennea 8.75% 2/9/2027	951,149	0.01
USD 3,003,000	YPF 7% 15/12/2047	1,636,635	0.02
		6,078,237	0.07
オーストラリア			
USD 78,000	FMG Resources August 2006 Pty 4.5% 15/9/2027	71,094	0.00
USD 3,310,000	FMG Resources August 2006 Pty 6.125% 15/4/2032	3,073,368	0.03
USD 187,500	Linc Energy 0% 10/4/2018	5,625	0.00
USD 282,000	National Australia Bank 3.375% 14/1/2026	274,739	0.00
		3,424,826	0.03
オーストリア			
EUR 2,200,000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	1,755,234	0.02
EUR 2,400,000	ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	1,717,700	0.02
EUR 1,346,000	ams-OSRAM 6% 31/7/2025*	1,260,924	0.01
EUR 2,600,000	BAWAG 2.375% 26/3/2029*	2,506,414	0.03
USD 3,036,000	BRF 4.35% 29/9/2026	2,776,741	0.03
EUR 600,000	Erste Bank 6.5% 15/10/2170	592,005	0.01
USD 1,355,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	1,075,328	0.01
EUR 4,500,000	Lenzing 5.75% 7/12/2170	4,288,547	0.05
EUR 15,091,000	Republic of Austria Government Bond 2.1% 20/9/2117	12,887,229	0.14
USD 2,335,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	1,849,343	0.02
USD 780,000	Suzano Austria 3.75% 15/1/2031	663,002	0.01
USD 1,109,000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	1,039,743	0.01
USD 699,000	Suzano Austria 5.75% 14/7/2026	713,183	0.01
		33,125,393	0.37
ベルギー			
EUR 1,400,000	House of Finance 4.375% 15/7/2026*	1,401,304	0.02
EUR 3,900,000	Solvay 2.5% 2/3/2171*	3,361,493	0.04
EUR 7,700,000	Solvay 4.25% 4/3/2171	7,551,948	0.08
		12,314,745	0.14
バミューダ			
USD 1,486,246	Digicel 8% 1/4/2025	964,856	0.01
USD 900,000	Geopark 5.5% 17/1/2027	788,733	0.01
USD 600,000	Li & Fung 4.375% 4/10/2024	558,492	0.01
HKD 4,062,966	REXLot 4.5% 17/4/2019	64,709	0.00
HKD 348,254	REXLot 6% 28/4/2017	14,792	0.00
USD 655,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038*	555,500	0.01
		2,947,082	0.04
ブラジル			
USD 205,000	Banco Bradesco 3.2% 27/1/2025	197,774	0.00
USD 1,419,000	Banco Votorantim 4% 24/9/2022	1,418,305	0.01
USD 1,326,000	Oi 10% 27/7/2025	609,960	0.01
		2,226,039	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英領バージン諸島			
USD 624,000	Champion Path 4.85% 27/1/2028	419,144	0.00
USD 489,426	Easy Tactic 7.5% 11/7/2028	58,702	0.00
USD 338,000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	173,411	0.00
USD 400,000	Fortune Star BVI 5.95% 19/10/2025	215,884	0.00
USD 200,000	Greenland Global Investment 6.125% 22/4/2023	96,000	0.00
USD 1,853,000	Knight Castle Investments 7.99% 23/1/2023	1,336,013	0.02
USD 282,000	New Metro Global 4.8% 15/12/2024	143,945	0.00
USD 920,000	NWD Finance BVI 4.125% 10/12/2170	712,512	0.01
USD 840,000	NWD MTN 4.125% 18/7/2029	705,587	0.01
USD 242,000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	104,060	0.00
USD 369,000	RKPF Overseas 2019 A 6.7% 30/9/2024	212,092	0.00
USD 164,540	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	160,218	0.00
USD 493,620	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	480,654	0.00
USD 850,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029	459,000	0.01
USD 1,080,000	TSMC Global 4.625% 22/7/2032	1,085,000	0.01
		6,362,222	0.06
カナダ			
USD 98,000	101178 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	87,882	0.00
USD 1,830,395	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust 5% 15/6/2025	1,779,648	0.02
USD 1,378,000	Bausch Health 4.875% 1/6/2028	972,027	0.01
USD 563,000	Bausch Health 5.5% 1/11/2025	469,733	0.01
USD 65,000	Bausch Health 5.75% 15/8/2027	47,782	0.00
USD 3,452,000	Bausch Health 6.125% 1/2/2027	2,645,388	0.03
USD 778,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	619,413	0.01
USD 1,159,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6.25% 15/9/2027	1,036,022	0.01
USD 3,500,000	Canadian National Railway 2.75% 1/3/2026	3,359,797	0.04
USD 1,504,000	Canadian National Railway 4.4% 5/8/2052	1,465,210	0.01
EUR 2,834,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	2,633,212	0.03
USD 1,250,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	1,214,760	0.01
USD 800,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	793,875	0.01
USD 2,310,000	Frontera Energy 7.875% 21/6/2028	1,884,775	0.02
USD 162,000	Masonite International 5.375% 1/2/2028	150,321	0.00
USD 2,099,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,697,202	0.02
USD 1,813,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	1,599,042	0.02
USD 500,000	MEGlobal Canada 5.875% 18/5/2030	524,200	0.00
USD 1,629,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	1,566,404	0.02
USD 2,078,000	Rockpoint Gas Storage Canada 7% 31/3/2023	2,063,194	0.02
USD 5,106,000	Rogers Communications 2.95% 15/3/2025	4,943,308	0.06
USD 317,000	Royal Bank of Canada 0.65% 29/7/2024	297,786	0.00
USD 819,000	Royal Bank of Canada 0.75% 7/10/2024	763,781	0.01
USD 155,000	Royal Bank of Canada 1.2% 27/4/2026	139,703	0.00
USD 1,696,000	Royal Bank of Canada 3.97% 26/7/2024	1,693,437	0.02
USD 175,000	Thomson Reuters 3.35% 15/5/2026	170,012	0.00
USD 3,540,000	Toronto-Dominion Bank/The 1.95% 12/1/2027	3,217,236	0.04
USD 612,000	Toronto-Dominion Bank/The 2% 10/9/2031	499,633	0.01
USD 2,750,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.35% 8/3/2024	2,687,758	0.03
USD 325,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.8% 10/3/2027	305,651	0.00
		41,328,192	0.46
ケイマン諸島			
USD 500,000	522 Funding CLO 2018-3A 4.76% 20/10/2031	471,827	0.01
USD 3,337,525	ACAS CLO 2015-1 3.63% 18/10/2028	3,286,825	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 500,000	ACAS CLO 2015-1 4.34% 18/10/2028	481,493	0.01
USD 3,870,000	ACAS CLO 2015-1 4.94% 18/10/2028	3,673,102	0.04
USD 299,000	Agile 5.75% 2/1/2025	122,590	0.00
USD 322,000	Agile 7.875% 31/1/2171	83,720	0.00
USD 250,000	AGL CLO 11 8.872% 15/4/2034	233,499	0.00
USD 375,000	AGL CLO 3 5.812% 15/1/2033	352,814	0.00
USD 410,000	AGL CLO 5 4.11% 20/7/2034	391,794	0.00
USD 4,700,000	AGL CLO 5 4.41% 20/7/2034	4,517,192	0.05
USD 2,150,000	AGL CLO 5 9.16% 20/7/2034	2,002,268	0.02
USD 1,460,000	AGL CLO 7 5.612% 15/7/2034	1,375,251	0.02
USD 500,000	AGL CLO 7 8.862% 15/7/2034	466,061	0.01
USD 250,000	AGL CLO 9 6.41% 20/1/2034	237,141	0.00
USD 1,030,000	AGL CLO 9 9.97% 20/1/2034	945,350	0.01
USD 700,000	Ahli United Sukuk 3.875% 17/12/2170	642,517	0.01
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2015-A 4.34% 17/10/2034	240,720	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2017-A 5.86% 20/4/2034	233,379	0.00
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S 4.882% 21/10/2028	1,509,117	0.02
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S 5.732% 21/10/2028	2,160,610	0.02
USD 370,000	Allegro CLO IV 4.062% 15/1/2030	361,044	0.00
USD 250,000	Allegro CLO VI 3.87% 17/1/2031	248,357	0.00
USD 500,000	Allegro CLO XI 4.588% 19/1/2033	489,346	0.01
USD 690,000	Allegro CLO XI 5.738% 19/1/2033	664,350	0.01
USD 4,065,000	ALM VII 0% 15/10/2116	2,642	0.00
USD 530,000	AMMC CLO 21 4.038% 2/11/2030	526,452	0.01
USD 2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 3.445% 13/4/2031	2,318,807	0.03
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 3.705% 13/10/2030	834,670	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 4.105% 13/10/2030	1,045,956	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 4.605% 13/10/2030	330,637	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 5.655% 13/10/2030	391,740	0.00
USD 795,223	Anchorage Capital CLO 3-R 3.843% 28/1/2031	786,618	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R 4.293% 28/1/2031	1,611,338	0.02
USD 1,420,000	Anchorage Capital CLO 4-R 3.843% 28/1/2031	1,404,631	0.02
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R 4.643% 28/1/2031	1,421,228	0.02
USD 5,223,000	Anchorage Capital CLO 5-R 3.962% 15/1/2030	5,114,090	0.06
USD 1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R 4.362% 15/1/2030	1,263,015	0.01
USD 700,000	Apidos CLO XII 3.592% 15/4/2031	690,666	0.01
USD 1,040,000	Apidos CLO XV 3.72% 20/4/2031	1,022,580	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 4.062% 15/4/2031	239,448	0.00
USD 250,000	Apidos CLO XXXII 5.11% 20/1/2033	238,257	0.00
USD 300,000	Apidos CLO XXXII 6.21% 20/1/2033	293,274	0.00
USD 375,000	Apidos CLO XXXV 8.46% 20/4/2034	345,114	0.00
USD 1,570,000	Apidos CLO XXXVII 9.059% 22/10/2034	1,463,030	0.02
USD 1,280,000	Apidos CLO XXXVIII 10.482% 21/1/2034	1,208,962	0.01
USD 1,745,000	Arabian Centres Sukuk 5.375% 26/11/2024	1,668,028	0.02
USD 1,036,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	941,615	0.01
USD 375,000	ARES XLV CLO 4.562% 15/10/2030	361,672	0.00
USD 1,500,000	Ares XXXVII CLO 3.682% 15/10/2030	1,486,956	0.02
USD 250,000	ASSURANT CLO 3.75% 20/4/2031	246,203	0.00
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 3.818% 19/7/2031	1,766,170	0.02
USD 2,740,000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 5.883% 24/7/2034	2,547,564	0.03
USD 430,000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 3.88% 20/10/2034	419,134	0.00
USD 250,000	Ballyrock CLO 14 5.01% 20/1/2034	238,787	0.00
USD 1,410,000	Ballyrock CLO 2020-2 8.86% 20/10/2031	1,297,005	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 1,060,000	Bardot CLO 5.759% 22/10/2032	993,416	0.01
USD 1,000,000	Barings Clo 2015-II 3.9% 20/10/2030	990,945	0.01
USD 508,651	Barings CLO 2018-III 3.66% 20/7/2029	503,045	0.01
USD 30,000	Bean Creek CLO 8.46% 20/4/2031	26,505	0.00
USD 750,000	Benefit Street Partners CLO V-B 3.8% 20/4/2031	739,402	0.01
USD 2,010,000	Benefit Street Partners CLO VIII 3.81% 20/1/2031	1,992,473	0.02
USD 2,666,649	BlueMountain CLO 2013-2 3.939% 22/10/2030	2,640,781	0.03
USD 530,000	BlueMountain CLO 2015-3 3.71% 20/4/2031	522,867	0.01
USD 1,000,000	Brookside Mill CLO 2013-1 4.09% 17/1/2028	996,244	0.01
USD 500,000	Brookside Mill CLO 2013-1 5.39% 17/1/2028	484,120	0.01
USD 250,000	Canyon CLO 2018-1 3.582% 15/7/2031	245,748	0.00
USD 370,000	Canyon CLO 2020-3 9.762% 15/1/2034	339,330	0.00
USD 500,000	Carbone Clo 3.85% 20/1/2031	493,125	0.01
USD 2,013,877	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 3.71% 17/4/2031	1,980,145	0.02
USD 10,400	Carlyle Global Market Strategies CLO 2015-4 11.21% 20/7/2032	10,308	0.00
USD 4,500,000	CARLYLE US CLO 2017-4 3.692% 15/1/2030	4,459,041	0.05
USD 750,000	CarVal CLO I 5.63% 16/7/2031	694,059	0.01
USD 790,000	CarVal CLO I 8.51% 16/7/2031	711,343	0.01
USD 350,000	Cayuga Park CLO 4.39% 17/7/2034	330,883	0.00
USD 7,155,000	CBAM 2017-1 3.96% 20/7/2030	7,097,354	0.08
USD 750,000	CBAM 2017-1 5.11% 20/7/2030	728,128	0.01
USD 200,000	Central China Real Estate 7.25% 13/8/2024	69,000	0.00
USD 590,000	China Aoyuan 5.98% 18/8/2025	39,464	0.00
USD 1,027,000	China Aoyuan 6.2% 24/3/2026	69,322	0.00
USD 1,300,000	China Aoyuan 6.35% 8/2/2024	87,750	0.00
USD 2,842,000	China Aoyuan 7.95% 19/2/2023	194,059	0.00
USD 341,000	China Aoyuan 8.5% 23/1/2022	23,018	0.00
USD 1,264,000	China Evergrande 7.5% 28/6/2023	94,114	0.00
USD 800,000	China Evergrande 8.25% 23/3/2022	58,550	0.00
USD 663,000	China SCE 7.375% 9/4/2024	201,855	0.01
USD 750,000	CIFC Funding 2012-II-R 3.96% 20/1/2028	738,669	0.01
USD 850,000	CIFC Funding 2013-III-R 4.633% 24/4/2031	813,637	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014 3.84% 18/1/2031	247,106	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2014-II-R 5.583% 24/4/2030	235,286	0.00
USD 3,530,000	CIFC Funding 2017-I 4.432% 23/4/2029	3,474,366	0.04
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-I 5.182% 23/4/2029	2,671,960	0.03
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-II 3.66% 20/4/2030	989,068	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2017-IV 4.333% 24/10/2030	242,700	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2017-V 3.92% 16/11/2030	247,903	0.00
USD 600,000	CIFC Funding 2017-V 5.59% 16/11/2030	551,271	0.01
USD 5,640,000	CIFC Funding 2018-II 3.75% 20/4/2031	5,567,837	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-II 4.31% 20/4/2031	243,538	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 5.512% 15/1/2032	239,205	0.00
USD 383,000	CIFI 5.95% 20/10/2025	197,245	0.00
USD 300,000	CIFI 6.45% 7/11/2024	169,500	0.00
USD 250,000	Clear Creek CLO 3.91% 20/10/2030	247,108	0.00
USD 1,400,000	Clear Creek CLO 5.66% 20/10/2030	1,314,755	0.01
USD 1,375,000	Clear Creek CLO 9.01% 20/10/2030	1,215,921	0.01
USD 430,000	Country Garden 2.7% 12/7/2026	197,800	0.00
USD 4,500,000	Deer Creek Clo 2017-1 3.89% 20/10/2030	4,456,800	0.05
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 4.36% 20/10/2030	482,658	0.01
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 9.06% 20/10/2030	447,400	0.01
USD 1,105,000	DP World Salaam 6% 1/1/2171	1,102,940	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 10,667,000	Dryden 53 CLO 3.632% 15/1/2031	10,551,378	0.12
USD 482,663	Dryden XXVI Senior Loan Fund 3.412% 15/4/2029	476,564	0.01
USD 6,206,000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 4.105% 15/8/2030	6,147,715	0.07
USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 4.712% 15/10/2030	953,949	0.01
USD 1,577,000	Elevation CLO 2018-10 4.61% 20/10/2031	1,527,761	0.02
USD 1,781,000	Fantasia 0% 5/7/2022	166,390	0.00
USD 925,000	Fantasia 6.95% 17/12/2021	86,894	0.00
USD 794,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	77,415	0.00
USD 2,580,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022	239,566	0.01
USD 411,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	40,073	0.00
USD 250,000	Galaxy XXII CLO 3.94% 16/4/2034	244,129	0.00
USD 441,555	Galaxy XXIII CLO 3.653% 24/4/2029	436,816	0.00
USD 250,000	Generate CLO 2 3.909% 22/1/2031	246,713	0.00
USD 928,021	Generate CLO 3 3.96% 20/10/2029	920,862	0.01
USD 5,995,000	Generate CLO 3 4.46% 20/10/2029	5,759,024	0.06
USD 4,240,000	Generate CLO 3 6.31% 20/10/2029	4,032,517	0.04
USD 1,520,000	Generate CLO 3 9.11% 20/10/2029	1,427,516	0.02
USD 730,000	Generate CLO 3 9.96% 20/10/2029	594,921	0.01
USD 2,090,000	Gilbert Park CLO 4.462% 15/10/2030	2,006,615	0.02
USD 2,717,000	Gilbert Park CLO 5.462% 15/10/2030	2,582,948	0.03
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 3.73% 20/4/2034	484,503	0.01
USD 460,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 4.26% 20/10/2032	441,835	0.01
USD 691,086	GoldenTree Loan Opportunities IX 3.916% 29/10/2029	686,722	0.01
USD 1,166,000	Goldentree Loan Opportunities X 3.83% 20/7/2031	1,151,422	0.01
USD 1,255,000	Goldentree Loan Opportunities XI 3.81% 18/1/2031	1,244,535	0.01
USD 2,510,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 7.46% 20/1/2033	2,158,002	0.02
USD 2,610,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 8.06% 20/10/2034	2,336,305	0.03
USD 1,400,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10.46% 20/10/2034	1,343,821	0.02
USD 500,000	Golub Capital Partners CLO 53B 9.41% 20/7/2034	457,300	0.01
USD 2,900,000	Golub Capital Partners CLO 55B 9.27% 20/7/2034	2,637,527	0.03
USD 3,590,000	Great Lakes CLO 2019-1 4.072% 15/7/2031	3,537,582	0.04
USD 364,391	Grippen Park CLO 3.97% 20/1/2030	361,473	0.00
USD 4,901,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	3,968,352	0.04
USD 1,235,000	Grupo Aval 4.75% 26/9/2022	1,233,277	0.01
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 3.99% 18/7/2031	310,707	0.00
USD 650,000	Highbridge Loan Management 12-2018 7.89% 18/7/2031	584,940	0.01
USD 80,000	Highbridge Loan Management 7-2015 4.605% 15/3/2027	78,241	0.00
USD 997,000	Hilong 9.75% 18/11/2024	418,740	0.01
USD 2,810,790	HPS Loan Management 6-2015 3.832% 5/2/2031	2,786,200	0.03
USD 1,924,000	IHS 5.625% 29/11/2026	1,663,870	0.02
USD 1,210,000	IHS 6.25% 29/11/2028	1,031,525	0.01
USD 424,000	KWG 5.875% 10/11/2024	63,600	0.00
USD 300,000	KWG 7.4% 5/3/2024	46,500	0.00
USD 750,000	LCM XIV 3.75% 20/7/2031	736,189	0.01
USD 418,700	LCM XXI 3.59% 20/4/2028	413,483	0.00
USD 130,391	LoanCore 2018-CREI Issuer 3.521% 15/5/2028	130,469	0.00
USD 2,794,132	Loanpal Solar Loan 2021-1 2.29% 20/1/2048	2,395,671	0.03
USD 600,000	Madison Park Funding XIII 4.638% 19/4/2030	582,982	0.01
USD 618,898	Madison Park Funding XLI 3.589% 22/4/2027	612,113	0.01
USD 1,385,000	Madison Park Funding XLI 4.409% 22/4/2027	1,344,763	0.02
USD 700,000	Madison Park Funding XXX 7.462% 15/4/2029	621,770	0.01
USD 250,000	Marble Point CLO XVII 6.46% 20/4/2033	228,786	0.00
USD 256,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	169,600	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 200,000	Melco Resorts Finance 5.625% 17/7/2027	143,127	0.00
USD 648,000	MGM China 4.75% 1/2/2027	509,684	0.01
USD 1,851,000	Modern Land China 9.8% 11/4/2023	305,415	0.01
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 4.227% 20/1/2035	824,446	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 9.91% 20/1/2032	242,626	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 46 4.36% 20/1/2036	236,734	0.00
USD 250,000	Ocean Trails Clo X 4.312% 15/10/2034	239,321	0.00
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 3.846% 26/4/2031	453,879	0.01
USD 1,320,000	OCP CLO 2014-5 5.666% 26/4/2031	1,183,166	0.01
USD 1,100,000	OCP CLO 2014-7 4.36% 20/7/2029	1,072,193	0.01
USD 1,170,000	OCP CLO 2014-7 5.106% 20/7/2029	1,085,596	0.01
USD 360,000	OCP CLO 2017-14 4.934% 20/11/2030	344,549	0.00
USD 250,000	Octagon Investment Partners 18-R 3.7% 16/4/2031	246,319	0.00
USD 1,144	Odebrecht Offshore Drilling Finance 7.72% 1/12/2026	277	0.00
USD 1,433,000	OHA Loan Funding 2013-2 3.998% 23/5/2031	1,416,355	0.02
USD 290,000	OZLM Funding IV 4.459% 22/10/2030	284,546	0.00
USD 3,200,000	OZLM VI 0% 17/4/2031	460,160	0.01
USD 300,000	OZLM VI 4.49% 17/4/2031	289,731	0.00
USD 500,000	OZLM VII 4.34% 17/7/2029	482,594	0.01
USD 815,000	OZLM VIII 5.89% 17/10/2029	782,665	0.01
USD 250,000	OZLM XII 4.382% 30/4/2027	248,373	0.00
USD 250,000	OZLM XX 4.36% 20/4/2031	240,314	0.00
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 3.87% 17/1/2031	574,600	0.01
USD 1,840,000	Palmer Square CLO 2018-1 3.77% 18/4/2031	1,814,217	0.02
USD 500,000	Palmer Square CLO 2018-2 4.39% 16/7/2031	487,571	0.01
USD 460,000	Palmer Square CLO 2020-3 4.505% 15/11/2031	443,263	0.01
USD 330,000	Parallel 2015-1 4.46% 20/7/2027	324,508	0.00
USD 1,350,000	Park Avenue Institutional Advisers CLO 2016-1 8.808% 23/8/2031	1,210,858	0.01
USD 1,049,714	Pearl II 6% 29/12/2049	40,750	0.00
USD 836,000	Pearl III 9% 22/10/2025	313,868	0.01
USD 500,000	Pikes Peak CLO 1 3.963% 24/7/2031	492,662	0.01
USD 375,000	Pikes Peak Clo 4 5.762% 15/7/2034	351,377	0.00
USD 500,000	Pikes Peak CLO 6 9.391% 18/5/2034	468,807	0.01
USD 1,290,000	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4% 24/8/2049	1,254,665	0.01
USD 565,000	Redsun Properties 7.3% 13/1/2025	37,855	0.00
USD 785,000	Redsun Properties 9.7% 16/4/2023	66,725	0.00
USD 1,000,000	Regatta IX Funding 4.54% 17/4/2030	986,186	0.01
USD 2,180,000	Regatta IX Funding 5.19% 17/4/2030	2,130,127	0.02
USD 500,000	Regatta IX Funding 6.64% 17/4/2030	495,414	0.01
USD 1,230,000	Regatta VIII Funding 4.44% 17/10/2030	1,202,043	0.01
USD 910,000	Regatta VIII Funding 5.94% 17/10/2030	842,407	0.01
USD 250,000	Regatta XVI Funding 4.562% 15/1/2033	245,924	0.00
USD 500,000	Regatta XVI Funding 6.412% 15/1/2033	469,430	0.01
USD 10,872,992	Rockford Tower CLO 2017-3 3.9% 20/10/2030	10,785,342	0.12
USD 1,000,000	Rockford Tower CLO 2018-1 4.084% 20/5/2031	986,858	0.01
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 4.704% 20/5/2031	1,212,781	0.01
USD 341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 3.87% 20/10/2031	335,940	0.00
USD 813,000	Rockford Tower CLO 2018-2 4.51% 20/10/2031	788,103	0.01
USD 836,000	Ronshine China 7.1% 25/1/2025	58,520	0.00
USD 200,000	Ronshine China 7.35% 15/12/2023	14,000	0.00
USD 1,500,000	RR 19 9.012% 15/10/2035	1,384,757	0.02
USD 250,000	RR 3 3.602% 15/1/2030	246,982	0.00
USD 2,000,000	RR 4 4.062% 15/4/2030	1,938,717	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 719,000	Sands China 4.875% 18/6/2030*	578,795	0.01
USD 300,000	Seazen 6% 12/8/2024	131,759	0.00
USD 250,000	Seneca Park CLO 2014-1 0% 17/7/2026	388	0.00
USD 3,103,015	Shackleton 2013-III CLO 3.632% 15/7/2030	3,059,413	0.03
USD 220,000	Shelf Drilling 8.875% 15/11/2024	220,000	0.00
USD 787,000	Shimao 3.45% 11/1/2031	108,213	0.00
USD 1,719,000	Shimao 4.6% 13/7/2030	236,362	0.00
USD 200,000	Shui On Development 5.5% 3/3/2025	150,608	0.00
USD 300,000	Shui On Development 5.75% 12/11/2023	271,500	0.01
USD 3,146,358	Silver Creek CLO 3.95% 20/7/2030	3,122,618	0.03
USD 750,000	Silver Creek CLO 6.06% 20/7/2030	710,434	0.01
USD 774,000	Sinic 0% 18/6/2022	22,489	0.00
USD 2,680,000	Sitka 6.75% 6/7/2026	2,551,891	0.03
USD 58,539	SPARC EM SPC Panama Metro Line 2 SP 0% 5/12/2022	57,606	0.00
USD 330,000	Steele Creek Clo 2017-1 3.762% 15/10/2030	324,967	0.00
USD 2,213,000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	1,201,438	0.01
USD 410,000	Strata CLO I 9.592% 15/1/2031	386,860	0.00
USD 624,000	Sunac China 6.5% 10/1/2025	90,480	0.00
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 4.512% 15/1/2034	468,600	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 8.662% 15/1/2034	459,045	0.01
USD 263,000	Tiaa Clo III 3.89% 16/1/2031	260,662	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III 4.24% 16/1/2031	719,475	0.01
USD 2,750,000	TICP CLO IX 3.85% 20/1/2031	2,725,714	0.03
USD 500,000	TICP CLO XI 3.89% 20/10/2031	491,571	0.01
USD 334,000	Times China 5.75% 14/1/2027*	50,100	0.00
USD 200,000	Times China 6.75% 16/7/2023	47,000	0.00
GBP 800,000	Trafford Centre Finance 2.561% 28/7/2035	752,231	0.01
USD 4,470,300	Transocean Phoenix 2 7.75% 15/10/2024	4,342,494	0.05
USD 398,700	Transocean Proteus 6.25% 1/12/2024	384,062	0.00
USD 351,000	TRESTLES CLO II 4.453% 25/7/2031	339,823	0.00
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 2.061% 3/3/2039	78,046	0.00
USD 950,000	TRINITAS CLO IV 4.14% 18/10/2031	925,565	0.01
USD 590,000	Trinitas CLO XIV 4.783% 25/1/2034	570,477	0.01
USD 625,000	Trinitas CLO XIV 5.783% 25/1/2034	613,297	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 3.773% 25/4/2031	1,830,641	0.02
USD 1,040,000	Voya CLO 2016-1 5.389% 20/1/2031	928,536	0.01
USD 3,500,000	Voya Clo 2017-4 3.642% 15/10/2030	3,452,932	0.04
USD 234,000	Wynn Macau 5.125% 15/12/2029	164,385	0.00
USD 280,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026*	219,100	0.00
USD 200,000	Wynn Macau 5.5% 1/10/2027	146,500	0.00
USD 1,000,000	York CLO 1 4.409% 22/10/2029	965,825	0.01
USD 250,000	York CLO 1 5.769% 22/10/2029	236,691	0.00
USD 760,000	Yuzhou 6% 25/10/2023	57,000	0.00
USD 810,000	Yuzhou 8.375% 30/10/2024	60,750	0.00
USD 720,000	Yuzhou 8.5% 4/2/2023	54,000	0.00
USD 1,955,000	Yuzhou 8.5% 26/2/2024	146,625	0.00
USD 517,000	Zhenro Properties 6.63% 7/1/2026	25,850	0.00
USD 3,429,000	ZTO Express Cayman 1.5% 1/9/2027	3,514,725	0.04
		268,765,164	2.97
チリ			
USD 2,630,000	VTR Comunicaciones 4.375% 15/4/2029	1,591,150	0.02
USD 1,326,000	VTR Comunicaciones 5.125% 15/1/2028	902,794	0.01
		2,493,944	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
中国			
CNY 48,000,000	China Development Bank 3.3% 1/2/2024	7,082,098	0.08
USD 2,018,000	Prime Bloom 0% 5/7/2022	338,015	0.00
USD 529,000	ZhongAn Online P&C Insurance 3.5% 8/3/2026	433,515	0.01
		7,853,628	0.09
コロンビア			
USD 1,261,000	Colombia Government International Bond 4.125% 22/2/2042	796,952	0.01
USD 2,031,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051	1,206,262	0.01
USD 8,237,000	Colombia Government International Bond 4.5% 15/3/2029	7,228,235	0.08
USD 1,303,000	Colombia Telecomunicaciones 4.95% 17/7/2030	1,091,566	0.01
COP 18,146,000,000	Colombian TES 7% 26/3/2031	3,027,350	0.03
COP 15,809,000,000	Colombian TES 7.25% 18/10/2034	2,520,214	0.03
USD 8,547,000	Ecopetrol 6.875% 29/4/2030	7,927,342	0.09
USD 1,818,000	Empresas Publicas de Medellin 4.25% 18/7/2029	1,503,613	0.02
USD 1,428,000	Empresas Publicas de Medellin 4.375% 15/2/2031	1,148,362	0.01
USD 1,303,000	Oleoducto Central 4% 14/7/2027	1,130,353	0.01
USD 1,590,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029	1,363,027	0.02
USD 1,499,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029*	1,285,018	0.01
USD 1,951,000	Transportadora de Gas Internacional 5.55% 1/11/2028	1,879,764	0.02
		32,108,058	0.35
コートジボワール			
EUR 2,003,000	Ivory Coast Government International Bond 6.625% 22/3/2048	1,386,708	0.02
キプロス			
EUR 725,000	Bank of Cyprus 2.5% 24/6/2027	574,368	0.01
デンマーク			
EUR 3,842,000	Danske Bank 1.5% 2/9/2030	3,469,860	0.04
EUR 400,000	Nykredit Realkredit 4.125% 15/4/2171	366,738	0.00
		3,836,598	0.04
エクアドル			
USD 95,484	Ecuador Government International Bond 0% 31/7/2030	33,369	0.00
USD 534,131	Ecuador Government International Bond 1.5% 31/7/2040	188,674	0.00
USD 1,165,440	Ecuador Government International Bond 2.5% 31/7/2035	459,005	0.01
USD 444,717	Ecuador Government International Bond 5.5% 31/7/2030	238,455	0.00
		919,503	0.01
フィンランド			
EUR 231,000	Citycon 4.496% 22/2/2171	174,573	0.00
EUR 1,525,000	Finnair 4.25% 19/5/2025	1,234,302	0.02
EUR 200,000	SBB Treasury 0.75% 14/12/2028	128,834	0.00
EUR 1,200,000	SBB Treasury 1.125% 26/11/2029	771,019	0.01
		2,308,728	0.03
フランス			
EUR 7,771	Accor 0.7% 7/12/2027	330,728	0.00
EUR 1,500,000	Air France-KLM 3.875% 1/7/2026*	1,294,382	0.01
EUR 1,468,000	Altice France 2.125% 15/2/2025	1,329,112	0.01
EUR 2,739,000	Altice France 2.5% 15/1/2025*	2,497,756	0.03
EUR 592,000	Altice France 4.125% 15/1/2029	471,361	0.01
EUR 952,000	Altice France 4.25% 15/10/2029*	757,080	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	フランス(続き)		
EUR 6,484,000	Altice France 5.875% 1/2/2027*	5,901,945	0.07
EUR 700,000	Arkema 1.5% 21/1/2171	612,414	0.01
EUR 3,300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.875% 16/6/2032	3,194,225	0.03
USD 800,000	BNP Paribas 6.625% 25/9/2170	774,247	0.01
USD 800,000	BNP Paribas 7.375% 19/2/2171*	805,871	0.01
USD 1,600,000	BNP Paribas 7.75% 16/2/2171	1,598,000	0.02
EUR 825,000	Burger King France 5.017% 1/11/2026	790,472	0.01
EUR 879,000	CAB SELAS 3.375% 1/2/2028	736,418	0.01
USD 800,000	Carrefour 0% 14/6/2023	774,820	0.01
EUR 1,300,000	Casino Guichard Perrachon 3.992% 31/1/2171	487,788	0.01
EUR 1,358,000	Casino Guichard Perrachon 5.25% 15/4/2027	770,216	0.01
EUR 700,000	Casino Guichard Perrachon 6.625% 15/1/2026	432,919	0.01
EUR 1,399,000	CGG 7.75% 1/4/2027*	1,240,461	0.01
EUR 1,344,000	Chrome Bidco 3.5% 31/5/2028	1,182,342	0.01
EUR 1,715,000	CMA CGM 7.5% 15/1/2026	1,777,042	0.02
USD 300,000	Credit Agricole 4.75% 23/3/2171	235,636	0.00
USD 2,000,000	Danone 2.589% 2/11/2023	1,968,838	0.02
EUR 8,202,000	d' Infrastructures des Metiers de l' Environnement 0.625% 16/9/2028	6,631,426	0.07
EUR 800,000	Electricite de France 2.625% 1/6/2171	593,043	0.01
EUR 1,600,000	Electricite de France 2.875% 15/3/2171	1,278,551	0.02
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/12/2170	149,664	0.00
EUR 4,600,000	Electricite de France 3.375% 15/9/2170	3,423,875	0.04
EUR 2,100,000	Electricite de France 4% 4/10/2170	1,944,387	0.02
EUR 400,000	Electricite de France 5% 22/1/2171	359,255	0.00
EUR 3,000,000	Electricite de France 5.375% 29/1/2171*	2,830,219	0.03
GBP 2,600,000	Electricite de France 6% 29/7/2171	2,664,325	0.03
EUR 3,364,000	Faurecia 2.75% 15/2/2027*	2,778,414	0.03
EUR 600,000	Faurecia 3.125% 15/6/2026	534,176	0.01
EUR 783,000	Faurecia 3.75% 15/6/2028	648,110	0.01
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 1.259% 25/9/2035	157,765	0.00
EUR 96,328	FCT Autonoria 2019 1.659% 25/9/2035	94,177	0.00
EUR 192,079	FCT Autonoria 2019 2.759% 25/9/2035	187,542	0.00
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 3.759% 25/9/2035	156,226	0.00
EUR 46,916	FCT E-Carat 10 1.503% 20/12/2028	46,679	0.00
EUR 70,374	FCT E-Carat 10 2.353% 20/12/2028	69,257	0.00
EUR 263,344	FCT Noria 2018-1 1.559% 25/6/2038	258,078	0.00
EUR 263,344	FCT Noria 2018-1 2.709% 25/6/2038	256,779	0.00
EUR 278,173	FCT Noria 2021 0.759% 25/10/2049	270,955	0.01
EUR 278,173	FCT Noria 2021 1.159% 25/10/2049	268,185	0.00
EUR 834,519	FCT Noria 2021 1.559% 25/10/2049	796,717	0.01
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 2.218% 25/2/2038	287,212	0.01
EUR 1,338,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026	1,181,106	0.01
EUR 675,000	Goldstory 6.12% 1/3/2026*	627,798	0.01
EUR 300,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 1.468% 27/5/2061	286,901	0.00
EUR 400,000	iliad 1.5% 14/10/2024	381,602	0.00
EUR 800,000	iliad 1.875% 11/2/2028	669,877	0.01
EUR 300,000	iliad 2.375% 17/6/2026	279,044	0.00
EUR 920,000	Iliad 5.125% 15/10/2026	873,811	0.01
EUR 300,000	Iliad 5.625% 15/10/2028	277,174	0.00
EUR 12,306	Korian 0.875% 6/3/2027	545,625	0.01
GBP 1,800,000	Korian 4.125% 15/6/2171	1,640,009	0.02
EUR 1,100,000	La Financiere Atalian 4% 15/5/2024	1,047,943	0.01
EUR 1,436,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	1,371,748	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
GBP 2,570,000	La Financiere Atalian 6.625% 15/5/2025	2,856,322	0.03
EUR 1,900,000	La Poste 3.125% 29/1/2171	1,768,332	0.02
EUR 528,000	Loxam 3.25% 14/1/2025	492,102	0.01
EUR 2,157,000	Loxam 3.75% 15/7/2026*	1,962,335	0.02
EUR 400,000	Loxam 4.25% 15/4/2024*	390,700	0.00
EUR 1,306,000	Loxam 4.5% 15/2/2027*	1,195,329	0.01
EUR 200,000	Loxam 5.75% 15/7/2027*	168,635	0.00
EUR 575,000	Midco GB 7.75% 1/11/2027	554,562	0.01
EUR 400,000	Novafives 5% 15/6/2025*	267,995	0.00
EUR 1,800,000	Orano 2.75% 8/3/2028	1,623,570	0.02
EUR 100,000	Orano 3.375% 23/4/2026	96,549	0.00
EUR 1,712,000	Paprec 3.5% 1/7/2028	1,422,146	0.02
EUR 1,635,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026*	1,454,468	0.02
EUR 300,000	Quatrim 5.875% 15/1/2024	274,099	0.00
EUR 5,400,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	4,756,074	0.05
EUR 500,000	Renault 2.375% 25/5/2026	438,979	0.00
EUR 900,000	Societe Generale 1% 24/11/2030	792,634	0.01
EUR 11,900,000	Societe Generale 1.125% 30/6/2031	10,245,196	0.11
USD 1,600,000	Societe Generale 7.375% 4/4/2171*	1,559,512	0.02
USD 1,800,000	Societe Generale 7.875% 18/6/2171	1,787,798	0.02
USD 1,600,000	Societe Generale 8% 29/3/2171	1,616,696	0.02
USD 200,000	Societe Generale 8% 29/3/2171	202,087	0.00
EUR 1,300,000	Solvay Finance 5.425% 12/11/2170	1,295,293	0.01
EUR 3,889,000	Solvay Finance 5.869% 3/6/2171*	3,913,242	0.04
EUR 2,700,000	Suez 2.875% 19/4/2171*	2,627,557	0.03
EUR 5,900,000	Teleperformance 3.75% 24/6/2029*	5,967,205	0.07
EUR 176,000	Tereos Finance Groupe I 7.5% 30/10/2025	178,601	0.00
EUR 1,190,000	TotalEnergies 1.625% 25/1/2171	984,256	0.01
EUR 700,000	TotalEnergies 1.75% 4/4/2171	663,545	0.01
EUR 2,700,000	TotalEnergies 2.625% 26/2/2171	2,554,533	0.03
EUR 1,264,000	Vallourec 8.5% 30/6/2026*	1,210,625	0.01
		121,152,705	1.34
ドイツ			
USD 2,600,000	Allianz 3.2% 30/4/2171*	1,986,356	0.02
EUR 9,300,000	Bayer 2.375% 12/11/2079	8,411,344	0.09
EUR 2,343,000	Bayer 3.75% 1/7/2074	2,267,230	0.02
EUR 8,000,000	Bertelsmann 3% 23/4/2075	7,879,794	0.09
EUR 17,920,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	18,254,544	0.20
EUR 1,259,000	Cheplapharm Arzneimittel 3.5% 11/2/2027	1,135,011	0.01
EUR 5,032,000	Cheplapharm Arzneimittel 4.375% 15/1/2028	4,551,744	0.05
EUR 2,600,000	Commerzbank 6.125% 9/4/2171	2,371,962	0.03
EUR 2,800,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024	2,335,394	0.03
EUR 2,100,000	Deutsche Bahn Finance 0.95% 22/4/2171*	1,913,130	0.02
EUR 2,995,000	Deutsche Bahn Finance 1.125% 29/5/2051	1,948,777	0.02
EUR 2,700,000	Deutsche Bank 3.25% 24/5/2028	2,524,413	0.03
EUR 2,300,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	2,085,503	0.02
EUR 2,200,000	Deutsche Bank 4.5% 30/4/2171	1,732,476	0.02
EUR 200,000	Deutsche Bank 6.75% 30/4/2171	178,927	0.00
EUR 11,900,641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	14,947,451	0.17
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 1.625% 16/11/2023	484,719	0.01
EUR 1,300,000	Deutsche Lufthansa 2% 14/7/2024	1,239,948	0.01
EUR 1,800,000	Deutsche Lufthansa 2.875% 16/5/2027	1,459,655	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ(続き)		
EUR 2,000,000	Deutsche Lufthansa 3.5% 14/7/2029	1,560,122	0.02
EUR 1,200,000	Deutsche Lufthansa 3.75% 11/2/2028	995,781	0.01
EUR 900,000	DIC Asset 2.25% 22/9/2026	694,424	0.01
EUR 700,000	Douglas 6% 8/4/2026*	576,569	0.01
EUR 700,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.125% 5/11/2079	630,825	0.01
EUR 200,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.625% 5/8/2079*	160,797	0.00
EUR 8,900,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 2.125% 31/8/2081	6,206,886	0.07
EUR 1,270,000	Fraport Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31/3/2028	1,115,687	0.01
EUR 660,000	Gruenthal 3.625% 15/11/2026*	612,734	0.01
EUR 1,638,000	Gruenthal 4.125% 15/5/2028*	1,506,814	0.02
EUR 284,000	HT Troplast 9.25% 15/7/2025	249,758	0.00
EUR 779,000	IHO Verwaltungs 3.75% 15/9/2026	689,985	0.01
EUR 969,715	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027	804,681	0.01
USD 200,000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	178,104	0.00
EUR 10,908,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.375% 7/6/2032*	10,141,281	0.11
EUR 2,568,000	LANXESS 4.5% 6/12/2076	2,533,525	0.03
EUR 10,394,000	Nidda Healthcare 3.5% 30/9/2024*	9,601,695	0.11
EUR 642,000	Nidda Healthcare 3.5% 30/9/2024	595,442	0.01
EUR 401,000	Novelis Sheet Ingot 3.375% 15/4/2029	340,417	0.01
EUR 1,781,000	PCF 4.75% 15/4/2026*	1,535,883	0.02
EUR 1,144,000	PCF 4.75% 15/4/2026	949,969	0.01
EUR 2,200,000	ProGroup 3% 31/3/2026*	1,882,119	0.02
EUR 200,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.723% 15/9/2030	195,073	0.00
EUR 400,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.923% 15/9/2030	384,911	0.01
EUR 100,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 1.323% 15/9/2030	95,266	0.00
EUR 1,539,000	Renk 5.75% 15/7/2025	1,446,575	0.02
EUR 2,550,000	RWE 2.75% 24/5/2030	2,418,378	0.02
EUR 467,000	Schenck Process 5.375% 15/6/2023	454,201	0.00
EUR 565,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2% 15/7/2025	523,088	0.01
EUR 1,281,871	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 6% 30/7/2026*	1,205,388	0.01
EUR 766,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025	654,499	0.00
EUR 952,000	thyssenkrupp 1.875% 6/3/2023	934,576	0.01
EUR 95,000	thyssenkrupp 2.5% 25/2/2025*	89,143	0.00
EUR 3,017,000	thyssenkrupp 2.875% 22/2/2024*	2,922,137	0.03
EUR 1,260,000	TK Elevator Holdco 6.625% 15/7/2028	1,086,197	0.01
EUR 2,719,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	2,416,628	0.03
EUR 1,652,000	TK Elevator Midco 4.75% 15/7/2027	1,580,464	0.02
EUR 5,200,000	Volkswagen Leasing 0.625% 19/7/2029	4,175,604	0.05
EUR 1,600,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	1,284,169	0.01
EUR 400,000	ZF Finance 2.25% 3/5/2028	305,830	0.00
EUR 800,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	660,669	0.01
EUR 2,200,000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	2,003,754	0.02
EUR 5,900,000	ZF Finance 3.75% 21/9/2028*	4,841,560	0.05
		150,949,986	1.68
	ガーナ		
USD 1,489,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/5/2029	597,461	0.01
	ギリシャ		
EUR 2,820,000	Hellenic Republic Government Bond 0% 12/2/2026	2,541,605	0.03
EUR 5,548,000	Hellenic Republic Government Bond 1.875% 24/1/2052*	3,283,722	0.03
EUR 1,549,000	Public Power 3.375% 31/7/2028	1,239,633	0.01
EUR 480,000	Public Power 3.875% 30/3/2026	427,015	0.01
		7,491,975	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ガーンジー		
USD 111,822	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust 5.25% 30/5/2025	110,199	0.00
	香港		
USD 847,000	Bank of East Asia 5.825% 21/4/2171	808,004	0.01
USD 402,000	Bank of East Asia 5.875% 19/3/2171	392,374	0.00
USD 941,000	Yango Justice International 7.5% 15/4/2024	61,165	0.00
USD 680,000	Yango Justice International 7.5% 17/2/2025	44,200	0.00
USD 490,000	Yango Justice International 7.875% 4/9/2024	31,850	0.00
		1,337,593	0.01
	インド		
USD 699,000	Adani Green Energy 4.375% 8/9/2024	632,595	0.01
USD 500,000	Adani Transmission Step-One 4% 3/8/2026	470,505	0.00
USD 400,000	Bharti Airtel 3.25% 3/6/2031*	346,818	0.00
USD 375,000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 2/2/2026	348,281	0.01
USD 400,000	Oil India 5.125% 4/2/2029*	394,260	0.00
USD 400,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	379,583	0.01
USD 285,000	Shriram Transport Finance 5.1% 16/7/2023*	280,012	0.00
USD 445,000	Summit Digitel Infrastructure 2.875% 12/8/2031	346,370	0.00
		3,198,424	0.03
	インドネシア		
USD 690,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026	646,875	0.01
USD 1,360,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027	1,326,000	0.01
USD 600,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.8% 23/6/2050	496,500	0.01
		2,469,375	0.03
	国際機関(International)		
EUR 5,490,000	European Union 0.7% 6/7/2051	3,531,394	0.04
	アイルランド		
GBP 999,626	Agora UK 2021 2.787% 22/7/2031	1,109,329	0.01
EUR 2,900,000	AIB 1.875% 19/11/2029	2,682,292	0.03
EUR 4,675,000	AIB 2.875% 30/5/2031	4,278,954	0.05
EUR 1,000,000	AIB 5.25% 9/4/2171	920,897	0.01
EUR 5,149,000	AIB 6.25% 23/12/2170	4,909,111	0.05
EUR 800,000	AlbaCore EURO CLO I 5.962% 18/10/2034	675,685	0.01
EUR 2,680,000	Alme Loan Funding V 5.41% 15/7/2031	2,339,999	0.03
EUR 838,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 1.6% 15/4/2034	795,669	0.01
EUR 180,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 6.45% 15/4/2034	160,596	0.00
EUR 200,000	Anchorage Capital Europe CLO 2021-4 5.855% 25/4/2034	171,432	0.00
EUR 1,000,000	Aqueduct European CLO 5-2020 2.047% 20/4/2034	919,071	0.01
EUR 400,000	ARBOUR CLO VIII 6.11% 15/10/2034	342,832	0.00
EUR 1,200,000	Ares European CLO VII 1.5% 15/10/2030	1,151,076	0.01
EUR 250,000	Ares European CLO VII 5.26% 15/10/2030	218,299	0.00
EUR 405,000	Ares European CLO VIII 3.802% 17/4/2032	382,095	0.00
EUR 2,150,000	Ares European CLO X 2.8% 15/10/2031	1,945,035	0.02
EUR 858,000	Ares European CLO XII 1.747% 20/4/2032	816,587	0.01
EUR 875,000	Ares European CLO XII 3.047% 20/4/2032	799,097	0.01
EUR 2,100,000	Armada Euro CLO III 3.3% 15/7/2031	1,962,718	0.02
USD 3,778,000	ASG Finance Designated Activity 7.875% 3/12/2024	3,485,205	0.04
GBP 1,906,199	Atom Mortgage 3.487% 22/7/2031	2,112,128	0.02
GBP 2,158,089	Atom Mortgage 4.387% 22/7/2031	2,293,402	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 300,000	Aurium CLO II 6.08% 22/6/2034	255,401	0.00
EUR 550,000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	239,010	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 4.7% 12/1/2031	126,298	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 6.35% 12/1/2031	111,726	0.00
EUR 380,000	Avoca CLO XV 4.13% 15/4/2031	321,013	0.00
EUR 350,000	Avoca CLO XVIII 1.75% 15/4/2031	331,329	0.00
EUR 270,000	Avoca CLO XX 5.75% 15/7/2032	235,535	0.00
EUR 290,000	Avoca CLO XXII 1.3% 15/4/2035	267,285	0.00
EUR 280,000	Avoca CLO XXII 2.9% 15/4/2035	248,204	0.00
EUR 280,000	Avoca CLO XXII 5.23% 15/4/2035	232,138	0.00
EUR 400,000	Avoca CLO XXII 5.23% 15/4/2035	331,626	0.00
EUR 1,000,000	Avoca CLO XXIII 3.05% 15/4/2034	913,707	0.01
EUR 1,020,000	Avoca CLO XXV 6.14% 15/10/2034	891,476	0.01
EUR 2,850,000	Bank of Ireland 1.375% 11/8/2031*	2,435,191	0.03
GBP 2,000,000	Bank of Ireland 3.125% 19/9/2027	2,323,151	0.02
EUR 300,000	BBAM European CLO I 6.035% 22/7/2034	255,836	0.00
EUR 800,000	BBAM European CLO II 6.11% 15/10/2034	683,295	0.01
EUR 701,299	Bilbao CLO I 4.777% 20/7/2031	592,145	0.01
EUR 800,000	Bilbao CLO II 6.361% 20/8/2035	680,637	0.01
EUR 300,000	BlueMountain 2021-1 CLO 5.41% 15/4/2034	249,732	0.00
EUR 250,000	Bluemountain Euro 2021-2 CLO 1.75% 15/10/2035	237,359	0.00
EUR 900,000	BlueMountain Fuji CLO III 2.9% 15/1/2031	830,960	0.01
EUR 800,000	BlueMountain Fuji CLO IV 6.678% 25/2/2034	697,277	0.01
EUR 500,000	BlueMountain Fuji CLO V 2.45% 15/1/2033	470,258	0.01
EUR 800,000	Cairn CLO XIV 6.348% 29/10/2034	685,037	0.01
EUR 300,000	Capital Four CLO II 5.91% 15/1/2034	257,755	0.00
EUR 582,000	Capital Four CLO III 6.06% 15/10/2034	495,261	0.01
EUR 650,000	CIFC European Funding CLO I 5.86% 15/7/2032	565,643	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO II 1.6% 15/4/2033	379,145	0.00
EUR 500,000	CIFC European Funding CLO III 2.5% 15/1/2034	476,276	0.01
EUR 200,000	CIFC European Funding CLO III 5.61% 15/1/2034	170,672	0.00
EUR 1,580,000	Clontarf Park CLO 3.302% 5/8/2030	1,498,940	0.02
EUR 539,000	Contego CLO IX 6.155% 24/1/2034	460,494	0.01
EUR 800,000	Contego CLO VIII 6.205% 25/1/2034	691,273	0.01
EUR 330,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 1.691% 22/2/2034	306,982	0.00
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund V 1.542% 21/7/2030	384,207	0.00
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund XIX 3.8% 23/12/2033	372,744	0.00
EUR 930,000	CVC Cordatus Loan Fund XVII 6.453% 18/11/2033	805,243	0.01
EUR 522,000	CVC Cordatus Loan Fund XVIII 6.298% 29/7/2034	444,988	0.01
EUR 1,550,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 3% 22/6/2034	1,396,462	0.02
EUR 158,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 5.61% 22/6/2034	132,123	0.00
EUR 840,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 5.61% 22/6/2034	702,425	0.01
EUR 480,000	CVC Cordatus Loan Fund XXI 5.93% 22/9/2034	404,729	0.01
EUR 250,000	Dartry Park CLO 3.562% 28/1/2034	231,271	0.00
EUR 200,000	eircom Finance 1.75% 1/11/2024	192,740	0.00
EUR 250,000	Euro-Galaxy III CLO 2.495% 24/4/2034	237,457	0.00
EUR 510,000	Euro-Galaxy III CLO 3.395% 24/4/2034	477,001	0.01
EUR 1,210,000	Euro-Galaxy V CLO 6.141% 15/2/2034	1,042,718	0.01
EUR 593,000	Fair Oaks Loan Funding III 6.11% 15/10/2034	503,663	0.01
EUR 1,510,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 3.6% 15/10/2034	1,407,319	0.02
GBP 460,221	Frost CMBS 2021-1 3.043% 20/11/2033	522,513	0.01
EUR 800,000	Glencore Capital Finance 1.25% 1/3/2033	583,135	0.01
EUR 260,000	Harvest CLO XIX 2.55% 14/4/2031	239,174	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 700,000	Harvest CLO XVIII 1.2% 15/10/2030	666,158	0.01
EUR 390,000	Harvest CLO XXIII 3.047% 20/10/2032	359,370	0.00
EUR 714,793	Haus European Loan Conduit No 39 0.917% 28/7/2051	689,607	0.01
EUR 210,939	Haus European Loan Conduit No 39 1.367% 28/7/2051	199,065	0.00
EUR 840,757	Haus European Loan Conduit No 39 1.667% 28/7/2051	771,130	0.01
EUR 1,977,429	Haus European Loan Conduit No 39 2.267% 28/7/2051	1,811,472	0.02
EUR 130,000	Henley CLO IV 1.495% 25/4/2034	120,651	0.00
EUR 250,000	Henley CLO IV 3.145% 25/4/2034	225,385	0.00
EUR 300,000	Henley CLO IV 5.395% 25/4/2034	246,472	0.00
EUR 385,000	Invesco Euro CLO 5.99% 15/7/2034	331,164	0.00
EUR 450,000	Invesco Euro Clo III 1.75% 15/7/2032	430,552	0.01
EUR 229,414	Invesco Euro Clo III 8.07% 15/7/2032	199,840	0.00
EUR 625,000	Invesco Euro CLO IV 1.7% 15/4/2033	590,853	0.01
EUR 450,000	Invesco Euro CLO V 3.8% 15/1/2034	426,330	0.01
EUR 200,000	Invesco Euro CLO V 5.81% 15/1/2034	173,379	0.00
EUR 573,428	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.089% 17/8/2033	547,379	0.01
EUR 349,434	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.389% 17/8/2033	331,375	0.00
EUR 1,349,951	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.739% 17/8/2033	1,270,041	0.01
EUR 1,045,316	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 2.239% 17/8/2033	1,020,406	0.01
EUR 938,803	Last Mile PE 2021 1.539% 17/8/2031	895,440	0.01
EUR 1,060,777	Last Mile PE 2021 1.939% 17/8/2031	981,642	0.01
EUR 1,160,000	Madison Park Euro Funding XIV 3.6% 15/7/2032	1,108,457	0.01
EUR 1,250,000	Madison Park Euro Funding XVI 3.2% 25/5/2034	1,137,294	0.01
EUR 1,050,000	Man GLG Euro CLO 3.5% 15/10/2032	992,605	0.01
EUR 150,000	Marino Park CLO 5.672% 16/1/2034	130,884	0.00
EUR 188,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 5.522% 17/4/2034	158,310	0.00
EUR 699,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 6.06% 15/4/2034	599,360	0.01
EUR 120,000	North Westerly VII ESG CLO 5.981% 15/5/2034	100,406	0.00
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 2.5% 25/11/2033	240,596	0.00
EUR 300,000	Northwoods Capital 21 Euro 6.185% 22/7/2034	257,596	0.00
EUR 200,000	Northwoods Capital 23 Euro 6.21% 15/3/2034	175,905	0.00
EUR 425,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 1.942% 21/1/2035	407,273	0.01
EUR 450,000	OAK Hill European Credit Partners VI 1.247% 20/1/2032	427,639	0.01
EUR 800,000	OCP Euro CLO 2017-2 1.35% 15/1/2032	765,267	0.01
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 2.347% 20/4/2033	235,154	0.00
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 3.347% 20/4/2033	235,648	0.00
EUR 200,000	OCP Euro CLO 2019-3 6.067% 20/4/2033	172,674	0.00
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 2.239% 17/11/2032	1,133,449	0.01
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 2.839% 17/11/2032	1,338,359	0.02
EUR 650,000	Penta CLO 11 2.45% 15/11/2034	633,131	0.01
EUR 470,000	Penta CLO 11 4.8% 15/11/2034	450,443	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 1.845% 25/7/2034	468,077	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 2.445% 25/7/2034	468,625	0.01
EUR 930,000	Penta CLO 8 5.93% 15/1/2034	895,561	0.01
EUR 1,750,000	Penta Clo 9 3.245% 25/7/2036	1,567,714	0.02
USD 2,232,800	Prodigy Finance CM2021-1 3.694% 25/7/2051	2,182,836	0.02
USD 1,210,000	Prodigy Finance CM2021-1 4.944% 25/7/2051	1,215,860	0.01
USD 710,000	Prodigy Finance CM2021-1 6.194% 25/7/2051	702,181	0.01
USD 480,000	Prodigy Finance CM2021-1 8.344% 25/7/2051	482,516	0.01
EUR 400,000	Providus Clo III 6.262% 18/7/2034	353,070	0.00
EUR 171,000	Providus CLO V 5.611% 15/2/2035	139,497	0.00
EUR 800,000	Providus Clo VI 6.501% 20/5/2034	683,237	0.01
EUR 443,625	River Green Finance 2020 1.122% 22/1/2032	434,916	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
EUR 321,750	River Green Finance 2020 1.472% 22/1/2032	309,243	0.00
EUR 1,339,000	Rockfield Park CLO 5.952% 16/7/2034	1,148,458	0.01
EUR 2,657,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 1.85% 20/12/2031	2,549,394	0.03
EUR 710,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 2.47% 20/12/2031	669,031	0.01
EUR 1,300,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 5.36% 20/12/2031	1,124,994	0.01
EUR 2,480,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 1.647% 20/1/2033	2,346,591	0.03
EUR 300,000	Rockford Tower Europe CLO 2021-1 6.007% 20/4/2034	259,527	0.00
EUR 976,000	RRE 5 Loan Management 1.75% 15/1/2037	927,897	0.01
EUR 700,000	RRE 6 Loan Management 6.25% 15/4/2035	619,010	0.01
EUR 430,000	RRE 9 Loan Management 1.7% 15/10/2036	401,673	0.00
GBP 2,751,882	Scorpio European Loan Conduit No. 34 3.913% 17/5/2029	3,180,457	0.04
EUR 700,000	Sound Point Euro CLO II Funding 6.382% 26/1/2036	612,970	0.01
EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 2.3% 15/4/2033	232,633	0.00
EUR 300,000	Sound Point Euro CLO V Funding 5.985% 25/7/2035	251,049	0.00
EUR 500,000	St Paul' s CLO X 3.875% 22/4/2035	470,273	0.01
EUR 1,350,000	St Paul' s CLO XII 1.6% 15/4/2033	1,275,735	0.01
EUR 2,020,000	St Paul' s CLO XII 3.2% 15/4/2033	1,881,077	0.02
EUR 650,000	Sutton Park CLO 2.021% 15/11/2031	626,454	0.01
EUR 750,000	Sutton Park CLO 2.671% 15/11/2031	712,029	0.01
EUR 357,825	Taurus 2019-1 FR 1.717% 2/2/2031	348,643	0.00
EUR 382,717	Taurus 2019-1 FR 2.217% 2/2/2031	369,527	0.00
GBP 3,206,283	Taurus 2019-2 UK 3.613% 17/11/2029	3,662,525	0.04
GBP 1,887,447	Taurus 2019-2 UK 3.913% 17/11/2029	2,147,894	0.02
GBP 879,540	Taurus 2021-1 UK 2.993% 17/5/2031	971,062	0.01
GBP 536,063	Taurus 2021-1 UK 3.343% 17/5/2031	581,753	0.01
GBP 546,983	Taurus 2021-1 UK 4.293% 17/5/2031	587,939	0.01
GBP 553,888	Taurus 2021-4 UK 2.643% 17/8/2031	620,456	0.01
GBP 5,295,359	Taurus 2021-4 UK 3.443% 17/8/2031	5,734,523	0.06
GBP 1,756,595	Taurus 2021-4 UK 3.793% 17/8/2031	1,866,142	0.02
GBP 2,057,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028	2,034,010	0.03
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 1.67% 15/7/2035	237,713	0.00
EUR 500,000	Voya Euro CLO II 2.15% 15/7/2035	460,198	0.01
EUR 446,000	Voya Euro CLO II 6.02% 15/7/2035	380,238	0.00
EUR 439,000	Voya Euro CLO III 1.65% 15/4/2033	413,358	0.01
EUR 840,000	Voya Euro CLO V 3.1% 15/4/2035	760,571	0.01
		137,856,786	1.54
マン島			
USD 1,085,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	929,807	0.01
イタリア			
EUR 675,000	ASTM 1.5% 25/1/2030*	535,151	0.01
EUR 500,000	ASTM 2.375% 25/11/2033	376,717	0.00
EUR 321,000	Autoflorence 2 0.796% 24/12/2044	307,602	0.00
EUR 414,000	Autoflorence 2 1.196% 24/12/2044	388,437	0.01
EUR 222,000	Autoflorence 2 2.396% 24/12/2044	210,045	0.00
EUR 1,781,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 1.875% 9/1/2026*	1,456,844	0.02
EUR 1,100,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 2.625% 28/4/2025	946,430	0.01
EUR 200,000	Banca Monte dei Paschi di Siena 3.625% 24/9/2024	181,080	0.00
EUR 1,600,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	1,327,572	0.02
EUR 400,000	Banco BPM 3.25% 14/1/2031	353,652	0.00
EUR 1,350,000	Banco BPM 3.375% 19/1/2032*	1,117,931	0.01
EUR 294,000	Banco BPM 5% 14/9/2030*	282,037	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
イタリア(続き)			
EUR 137,000	Brignole 2021 0.846% 24/7/2036	132,194	0.00
EUR 100,000	Brignole 2021 1.646% 24/7/2036	95,376	0.00
EUR 5,978,852	Cassia 2022-1 2.891% 22/5/2034	5,809,462	0.07
EUR 2,857,839	Cassia 2022-1 3.891% 22/5/2034	2,860,314	0.03
EUR 1,698,000	Cedacri Mergeco 4.946% 15/5/2028*	1,645,392	0.02
EUR 2,212,000	Centurion Bidco 5.875% 30/9/2026*	2,052,957	0.02
EUR 406,155	Diocle 3.875% 30/6/2026	404,390	0.00
EUR 1,719,000	doValue 3.375% 31/7/2026*	1,492,340	0.02
EUR 400,000	doValue 5% 4/8/2025	385,470	0.00
EUR 5,554,000	Enel 1.375% 8/9/2170	4,400,557	0.05
EUR 849,000	Enel 3.375% 24/11/2170*	761,684	0.01
EUR 2,023,000	Eni 2% 11/5/2171	1,666,658	0.02
EUR 6,200,000	Eni 2.625% 13/1/2171	5,622,422	0.06
EUR 500,000	Fabric BC 4.707% 31/8/2026	497,099	0.01
EUR 300,000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5.625% 1/8/2027	263,000	0.00
EUR 700,000	Gamma Bidco 5.125% 15/7/2025*	660,171	0.01
EUR 2,070,000	Hera 2.5% 25/5/2029	1,935,394	0.02
EUR 454,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	376,035	0.01
EUR 531,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	489,201	0.00
GBP 350,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030	345,544	0.00
EUR 500,000	Intesa Sanpaolo 5.5% 1/3/2171	411,052	0.01
EUR 400,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 4/3/2029*	405,675	0.00
EUR 2,550,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 1/3/2171*	2,020,151	0.02
EUR 1,773,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 20/6/2171	1,652,926	0.02
EUR 800,000	Intesa Sanpaolo 6.375% 30/9/2170*	683,294	0.01
EUR 2,527,000	Intesa Sanpaolo 7.75% 11/7/2171*	2,450,666	0.03
EUR 185,000	Leather 2 4.5% 30/9/2028	144,326	0.00
EUR 1,800,000	Nexi 0% 24/2/2028	1,340,263	0.01
EUR 1,625,000	Poste Italiane 2.625% 24/6/2171	1,180,665	0.01
EUR 312,030	Progetto Quinto 0.469% 27/10/2036	308,775	0.00
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 2.935% 28/12/2031	575,490	0.01
EUR 2,681,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026	2,418,057	0.03
EUR 1,132,000	TeamSystem 3.75% 15/2/2028*	1,057,245	0.01
EUR 1,843,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029*	1,378,549	0.02
EUR 699,000	Telecom Italia 2.75% 15/4/2025	664,854	0.01
EUR 400,000	Telecom Italia 2.875% 28/1/2026	369,619	0.01
EUR 200,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	189,583	0.00
EUR 200,000	Telecom Italia 3.25% 16/1/2023	199,464	0.00
EUR 1,254,000	Telecom Italia 4% 11/4/2024*	1,241,305	0.01
EUR 1,000,000	UniCredit 2% 23/9/2029	910,692	0.01
EUR 4,000,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032	3,371,452	0.04
EUR 300,000	UniCredit 4.875% 20/2/2029	297,203	0.00
EUR 1,200,000	UniCredit 5.375% 3/6/2171*	1,030,944	0.01
EUR 2,200,000	UniCredit 6.625% 3/12/2170	2,121,164	0.02
EUR 1,600,000	UniCredit 7.5% 3/6/2171	1,537,462	0.02
EUR 475,000	Unipol Gruppo 3.25% 23/9/2030	431,153	0.01
EUR 215,000	Verde Bidco 4.625% 1/10/2026	181,390	0.00
		67,952,577	0.75
ジャマイカ			
USD 553,557	Digicel International Finance/Digicel international 8% 31/12/2026	361,196	0.00
USD 1,386,646	Digicel International Finance/Digicel international 8.75% 25/5/2024	1,316,239	0.02
USD 815,040	Digicel International Finance/Digicel international 13% 31/12/2025	679,540	0.01
		2,356,975	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本			
JPY 200,000,000	Medipal 0% 7/10/2022	1,445,013	0.02
USD 2,256,000	Mitsubishi UFJ Financial 2.341% 19/1/2028	2,031,335	0.02
USD 3,000,000	Mizuho Financial 3.261% 22/5/2030	2,675,363	0.03
USD 2,205,000	Nomura 5.099% 3/7/2025	2,223,352	0.03
EUR 1,634,000	Rakuten 4.25% 22/4/2171	1,082,665	0.01
EUR 2,288,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	2,096,459	0.02
EUR 1,700,000	SoftBank 2.875% 6/1/2027	1,358,060	0.02
EUR 1,950,000	SoftBank 3.125% 19/9/2025*	1,717,013	0.02
EUR 2,947,000	SoftBank 4% 19/9/2029	2,209,492	0.03
EUR 400,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025	370,726	0.00
USD 300,000	SoftBank 4.75% 19/9/2024	282,750	0.00
EUR 1,281,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025*	1,174,632	0.01
EUR 3,200,000	SoftBank 5% 15/4/2028	2,667,197	0.03
USD 300,000	SoftBank 6% 30/7/2025	285,750	0.00
USD 3,791,000	SoftBank 6% 19/1/2171*	3,514,560	0.04
USD 2,487,000	Sumitomo Mitsui Financial 2.472% 14/1/2029	2,152,027	0.02
EUR 174,000	Takeda Pharmaceutical 2% 9/7/2040	134,697	0.00
USD 1,718,000	Takeda Pharmaceutical 2.05% 31/3/2030	1,445,530	0.02
USD 1,139,000	Takeda Pharmaceutical 3.175% 9/7/2050	846,863	0.01
USD 3,600,000	Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028	3,662,098	0.04
		33,375,582	0.37
ジャージー			
USD 1,508,000	Aptiv 3.1% 1/12/2051	956,682	0.01
USD 2,835,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	2,704,685	0.03
EUR 500,000	Avis Budget Finance 4.125% 15/11/2024*	490,801	0.01
EUR 600,000	Avis Budget Finance 4.75% 30/1/2026	566,194	0.01
GBP 392,000	CPUK Finance 4.5% 28/8/2027	410,244	0.00
GBP 457,000	CPUK Finance 4.875% 28/2/2047	500,381	0.01
GBP 400,000	CPUK Finance 6.5% 28/8/2026	438,068	0.01
GBP 4,051,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	4,095,196	0.05
USD 800,000	Galaxy Pipeline Assets Bidco 2.625% 31/3/2036	674,778	0.01
GBP 3,105,000	Heathrow Funding 2.625% 16/3/2028	3,067,896	0.03
GBP 1,300,000	Heathrow Funding 2.75% 13/10/2031	1,306,922	0.01
GBP 1,600,000	Intu Jersey 2 2.875% 1/11/2022	376,115	0.00
GBP 1,769,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027	1,829,636	0.02
		17,417,598	0.20
ルクセンブルグ			
EUR 400,000	ADLER 2.25% 14/1/2029*	211,727	0.00
EUR 2,100,000	ADLER 2.75% 13/11/2026	1,171,927	0.01
EUR 4,800,000	ADLER 3.25% 5/8/2025*	2,881,481	0.03
EUR 1,877,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	1,524,227	0.02
GBP 883,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028	839,269	0.01
EUR 1,922,000	Altice Financing 2.25% 15/1/2025	1,742,025	0.02
EUR 300,000	Altice Financing 3% 15/1/2028	240,058	0.00
EUR 2,156,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029	1,752,289	0.02
EUR 438,000	Altice France 8% 15/5/2027	360,095	0.00
EUR 400,000	Aroundtown 3.375% 23/12/2170	316,636	0.01
GBP 1,381,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2171*	1,292,527	0.02
USD 1,897,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	908,725	0.01
EUR 3,927,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.336% 13/8/2041	2,526,974	0.03
EUR 452,000	BK LC Lux Finco1 5.25% 30/4/2029	389,195	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 1.159% 25/9/2038	512,905	0.01
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 1.709% 25/9/2038	645,475	0.01
EUR 356,000	BL Consumer Credit 2021 2.909% 25/9/2038	334,864	0.00
EUR 1,070,000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028	944,671	0.01
GBP 2,134,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028	2,124,406	0.02
EUR 1,489,000	Cirsa Finance International 4.5% 15/3/2027	1,258,017	0.01
EUR 1,965,000	Cirsa Finance International 4.75% 22/5/2025	1,823,421	0.02
EUR 1,403,679	Cirsa Finance International 6.25% 20/12/2023	1,383,374	0.02
USD 1,197,000	CSN Resources 5.875% 8/4/2032	993,510	0.01
EUR 1,097,000	Cullinan Holdco 4.625% 15/10/2026	925,191	0.01
EUR 650,000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	496,362	0.01
USD 548,796	Dragon Aviation Finance Luxembourg 4% 28/11/2022	549,822	0.01
USD 7,193,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	5,844,313	0.06
EUR 1,400,000	Eliott Capital 0% 30/12/2022	1,394,259	0.02
EUR 2,300,000	European TopSoho 4% 18/10/2021	1,769,724	0.02
EUR 400,000	FACT Master 0.953% 20/7/2028	385,847	0.01
EUR 500,000	FACT SA/LU 0.873% 20/11/2025	497,384	0.01
EUR 3,949,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025*	3,507,532	0.04
GBP 1,814,000	Garfunkelux Holdco 3 7.75% 1/11/2025	1,871,724	0.02
EUR 2,873,298	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.723% 14/11/2034	2,851,623	0.03
EUR 1,044,835	Germany Compartment Consumer 2020-1 2.473% 14/11/2034	1,021,355	0.01
USD 765,000	GOL Equity Finance 3.75% 15/7/2024	484,614	0.00
USD 1,788,000	Gol Finance 7% 31/1/2025	1,095,731	0.01
EUR 200,000	Hanesbrands Finance Luxembourg 3.5% 15/6/2024	190,932	0.00
EUR 2,111,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029	1,548,273	0.02
USD 1,280,000	Kenbourne Invest 4.7% 22/1/2028	1,041,126	0.01
USD 4,039,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	3,921,263	0.04
EUR 1,015,702	LHMC Finco 2 7.25% 2/10/2025	874,266	0.01
EUR 2,800,000	Lincoln Financing 3.625% 1/4/2024	2,739,580	0.03
EUR 200,000	Lincoln Financing 3.875% 1/4/2024	198,980	0.00
EUR 395,000	Lion/Polaris Lux 4 4% 1/7/2026*	368,661	0.00
EUR 500,000	Lune 5.625% 15/11/2028	423,722	0.00
EUR 1,235,000	Matterhorn Telecom 4% 15/11/2027	1,094,126	0.01
USD 2,909,000	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	2,443,560	0.03
USD 1,620,000	Millicom International Cellular 6.625% 15/10/2026	1,592,201	0.02
EUR 2,048,000	Monitchem HoldCo 3 5.25% 15/3/2025*	1,934,637	0.02
USD 699,000	Movida Europe 5.25% 8/2/2031	572,238	0.01
USD 917,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	817,354	0.01
USD 2,064,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024*	1,950,480	0.02
EUR 400,000	Rossini 4.142% 30/10/2025	391,613	0.00
EUR 4,230,000	Rossini 6.75% 30/10/2025	4,231,823	0.05
EUR 11,678,000	SES 2.875% 27/8/2171	9,619,224	0.11
EUR 5,140,000	SES 3.5% 14/1/2029	4,819,258	0.05
EUR 1,700,000	SES 5.625% 29/1/2171*	1,663,657	0.02
EUR 300,000	Silver Arrow Compartment 10 1.323% 15/3/2027	299,512	0.00
EUR 300,000	Silver Arrow Compartment 10 2.573% 15/3/2027	299,793	0.00
USD 1,903,000	Simpar Europe 5.2% 26/1/2031	1,553,338	0.02
EUR 1,079,461	Summer BC Holdco A 9.25% 31/10/2027	934,892	0.01
EUR 5,814,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026	5,373,258	0.06
USD 973,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	814,236	0.01
EUR 673,000	Telecom Italia Finance 7.75% 24/1/2033*	703,622	0.01
EUR 2,700,000	Traton Finance Luxembourg 1.25% 24/3/2033*	1,965,164	0.02
		103,254,068	1.15

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
マレーシア			
USD 2,350,000	Cindai Capital 0% 8/2/2023	2,313,575	0.03
USD 500,000	TNB Global Ventures Capital 3.244% 19/10/2026	475,470	0.01
		2,789,045	0.04
マーシャル諸島			
USD 530,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	532,316	0.00
モーリシャス			
USD 1,016,663	Azure Power Energy 3.575% 19/8/2026	655,748	0.01
USD 303,000	Azure Power Solar Energy Pvt 5.65% 24/12/2024	202,380	0.00
USD 333,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	301,365	0.00
USD 200,000	Greenko Solar Mauritius 5.55% 29/1/2025*	183,000	0.00
USD 2,110,000	HTA 7% 18/12/2025	1,991,882	0.02
USD 292,000	India Green Power 4% 22/2/2027	234,330	0.01
USD 481,000	Network i2i 5.65% 15/4/2171	463,332	0.01
USD 257,000	UPL 5.25% 27/11/2170*	191,736	0.00
		4,223,773	0.05
メキシコ			
USD 2,986,000	Axtel 6.375% 14/11/2024	2,306,028	0.03
USD 1,735,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2171	1,507,281	0.02
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2171*	1,192,794	0.01
USD 1,580,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2171	1,350,687	0.02
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2171	1,173,730	0.01
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 6.75% 27/9/2170*	1,328,103	0.02
USD 909,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	718,110	0.01
USD 913,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032*	715,889	0.00
EUR 998,000	Cemex 3.125% 19/3/2026*	961,084	0.01
USD 623,000	Grupo Televisa SAB 6.625% 15/1/2040	674,002	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 4.75% 6/8/2050*	746,009	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 5.65% 12/9/2049	845,401	0.01
USD1,207,000	Metalsa S A P I De 3.75% 4/5/2031	917,030	0.01
MXN 184,000,000	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	8,856,022	0.10
MXN 233,600,000	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	11,036,156	0.12
MXV 65,903	Mexican Udibonos 4.5% 22/11/2035	2,527,397	0.03
USD 1,303,000	Minera Mexico de 4.5% 26/1/2050	1,024,614	0.01
USD 1,207,000	Nemak 3.625% 28/6/2031	922,751	0.01
USD 2,856,000	Operadora de Servicios Mega de Sofom ER 8.25% 11/2/2025	1,696,500	0.02
USD 926,000	Orbia Advance 5.5% 15/1/2048	796,344	0.01
USD 926,000	Orbia Advance 5.875% 17/9/2044	842,079	0.01
USD 1,303,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 27/6/2044	778,543	0.01
USD 19,301,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	15,023,898	0.17
USD 1,776,000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	1,114,262	0.01
USD 1,383,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16/10/2025*	1,345,521	0.01
MXN 62,256,000	Petroleos Mexicanos 7.19% 12/9/2024	2,810,690	0.03
USD 7,694,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	7,088,117	0.08
USD 244,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026*	232,877	0.00
USD 551,000	Trust Fibra Uno 6.39% 15/1/2050	449,884	0.01
		70,981,803	0.80
モンゴル			
USD 837,000	Mongolia Government International Bond 5.125% 7/4/2026*	773,179	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ			
EUR 1,100,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/2/2171	948,609	0.01
EUR 900,000	Ashland Services 2% 30/1/2028	768,389	0.01
EUR 4,200,000	ATF Netherlands 3.75% 20/1/2171*	3,913,776	0.04
EUR 500,000	Axalta Coating Systems Dutch B 3.75% 15/1/2025*	475,065	0.01
USD 854,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	867,134	0.01
USD 978,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	993,042	0.01
EUR 800,000	Cooperatieve Rabobank 4.625% 29/12/2170	745,921	0.01
EUR 683,936	Domi 2021-1 0.349% 15/6/2053	673,326	0.01
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 1.562% 28/1/2058	281,263	0.00
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 1.312% 28/7/2058	706,797	0.01
EUR 724,820	Dutch Property Finance 2021-2 0.912% 28/4/2059	714,297	0.01
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.012% 28/4/2059	768,661	0.01
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.262% 28/4/2059	458,058	0.00
USD 1,215,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	1,216,005	0.01
EUR 1,311,000	Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30/6/2029	1,042,694	0.01
EUR 800,000	Ferrovial Netherlands 2.124% 14/5/2171	670,769	0.01
EUR 3,000,000	IMCD 2.125% 31/3/2027*	2,716,230	0.03
EUR 4,400,000	ING Groep 1% 13/11/2030	3,906,443	0.05
EUR 2,000,000	ING Groep 1.25% 16/2/2027	1,850,797	0.02
USD 296,000	ING Groep 1.4% 1/7/2026	267,880	0.00
USD 1,968,000	ING Groep 3.869% 28/3/2026	1,917,922	0.02
USD 676,000	ING Groep 4.625% 6/1/2026	673,358	0.01
EUR 1,043,000	Intertrust 3.375% 15/11/2025*	1,044,076	0.01
EUR 413,000	IPD 3 5.5% 1/12/2025	375,583	0.01
EUR 202,000	Jubilee Place 1.602% 17/1/2059	180,262	0.00
EUR 1,300,000	Koninklijke KPN 2% 8/2/2171	1,214,788	0.01
EUR 527,000	Louis Dreyfus Finance 1.625% 28/4/2028	444,464	0.01
USD 4,013,000	LyondellBasell Industries 5.75% 15/4/2024	4,105,186	0.05
EUR 74,812	Magoi 2019 1.385% 27/7/2039	72,670	0.00
EUR 37,497	Magoi 2019 1.785% 27/7/2039	37,159	0.00
EUR 37,498	Magoi 2019 2.585% 27/7/2039	37,351	0.00
USD 200,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	88,970	0.00
USD 207,000	Metinvest 7.75% 17/10/2029	90,002	0.00
USD 606,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	270,382	0.00
USD 485,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	216,395	0.00
USD 227,000	Mondelez International Netherlands 1.25% 24/9/2026	202,096	0.00
USD 450,000	Mong Duong Finance 5.125% 7/5/2029	373,665	0.00
EUR 1,500,000	Naturgy Finance 2.374% 23/2/2171	1,177,632	0.01
EUR 200,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2171	187,331	0.00
EUR 400,000	Naturgy Finance 4.125% 18/11/2170	397,271	0.01
EUR 133,000	Nobel Bidco 3.125% 15/6/2028	93,210	0.00
USD 946,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.25% 30/11/2051	644,114	0.01
USD 3,862,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.875% 18/6/2026	3,747,347	0.04
USD 1,300,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	1,234,188	0.01
EUR 601,200	OCI 3.625% 15/10/2025	602,860	0.01
EUR 858,000	OI European 2.875% 15/2/2025	792,769	0.01
EUR 220,000	OI European 3.125% 15/11/2024	209,786	0.00
EUR 900,000	Phoenix PIB Dutch Finance 2.375% 5/8/2025	848,111	0.01
EUR 664,000	Q-Park I 1.5% 1/3/2025*	605,836	0.01
EUR 447,000	Q-Park I 2% 1/3/2027	371,608	0.00
EUR 652,000	Q-Park I 2.62% 1/3/2026*	590,999	0.01
EUR 5,943,000	Repsol International Finance 2.5% 22/3/2171	4,979,407	0.05
EUR 658,000	Repsol International Finance 3.75% 11/6/2171	608,089	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 600,000	Repsol International Finance 4.247% 11/12/2170*	526,877	0.00
EUR 1,170,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	1,179,698	0.01
EUR 272,769	Summer BidCo 9% 15/11/2025	222,565	0.00
EUR 581,510	Summer BidCo 9% 15/11/2025	473,960	0.01
EUR 6,300,000	Telefonica Europe 2.376% 12/5/2171	4,719,851	0.05
EUR 1,800,000	Telefonica Europe 2.625% 7/6/2171	1,766,961	0.02
EUR 2,900,000	Telefonica Europe 3% 4/12/2170	2,794,048	0.03
EUR 1,400,000	Telefonica Europe 3.875% 22/9/2170	1,265,445	0.02
EUR 2,800,000	Telefonica Europe 4.375% 14/3/2171	2,689,158	0.03
EUR 800,000	Telefonica Europe 5.875% 31/3/2171*	803,386	0.01
EUR 1,200,000	TenneT 2.374% 22/10/2170	1,132,988	0.01
EUR 308,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.25% 31/3/2023	301,417	0.00
EUR 300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.625% 15/10/2028	223,611	0.00
EUR 1,100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	895,912	0.01
EUR 2,420,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027*	2,129,428	0.02
EUR 887,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.375% 9/5/2030	735,720	0.01
EUR 4,037,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.5% 1/3/2025	3,888,226	0.04
EUR 660,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 6% 31/1/2025	654,893	0.01
EUR 854,000	Titan II 5.125% 15/7/2029	728,447	0.01
EUR 1,000,000	Trivium Packaging Finance 3.75% 15/8/2026	948,478	0.01
USD 977,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	939,571	0.01
EUR 1,400,000	United 3.625% 15/2/2028	1,107,177	0.01
EUR 3,279,000	United 4% 15/11/2027	2,652,739	0.03
EUR 1,431,000	United 4.625% 15/8/2028	1,173,668	0.01
EUR 4,457,000	United 4.875% 1/7/2024	4,218,139	0.05
EUR 596,000	United 5.142% 1/2/2029	538,229	0.01
EUR 3,100,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025*	2,731,967	0.03
EUR 9,640,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	7,441,719	0.08
USD 252,000	Vivo Energy Investments 5.125% 24/9/2027	236,628	0.00
EUR 1,400,000	Volkswagen International Finance 2.7% 14/12/2170*	1,384,847	0.02
EUR 7,900,000	Volkswagen International Finance 3.375% 27/6/2171	7,582,058	0.09
EUR 1,900,000	Volkswagen International Finance 3.5% 17/6/2171	1,789,507	0.02
EUR 900,000	Volkswagen International Finance 3.748% 28/12/2170*	783,873	0.01
EUR 200,000	Volkswagen International Finance 4.375% 28/3/2171	168,701	0.00
EUR 849,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032	668,629	0.01
USD 350,000	VZ Secured Financing 5% 15/1/2032	285,805	0.00
EUR 4,600,000	Wintershall Dea Finance 0.84% 25/9/2025	4,231,922	0.05
EUR 3,000,000	Wintershall Dea Finance 1.332% 25/9/2028	2,546,853	0.03
EUR 9,900,000	Wintershall Dea Finance 2 2.499% 20/7/2171	7,881,320	0.09
EUR 400,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	339,732	0.00
EUR 500,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027	398,642	0.01
EUR 200,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030	160,429	0.00
		129,763,267	1.44
ノルウェー			
EUR 359,000	Adevinta 2.625% 15/11/2025	341,019	0.01
EUR 228,000	Adevinta 3% 15/11/2027*	206,223	0.00
EUR 3,800,000	Aker BP 1.125% 12/5/2029	3,176,724	0.04
EUR 1,300,000	Nassa Topco 2.875% 6/4/2024	1,236,078	0.01
		4,960,044	0.06
オマーン			
USD 3,515,000	Oman Government International Bond 4.75% 15/6/2026	3,431,519	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	オマーン(続き)		
USD 3,402,000	Oman Government International Bond 6.75% 28/10/2027	3,555,090	0.04
USD 1,257,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	1,220,993	0.01
		8,207,602	0.09
	パナマ		
EUR 434,000	Carnival 7.625% 1/3/2026*	369,719	0.00
EUR 6,186,000	Carnival 10.125% 1/2/2026*	6,438,193	0.07
		6,807,912	0.07
	パラグアイ		
USD 1,565,000	Frigorifico Concepcion 7.7% 21/7/2028	1,264,903	0.01
	ペルー		
USD 2,015,000	InRetail Consumer 3.25% 22/3/2028	1,738,643	0.02
	フィリピン		
USD 695,000	Globe Telecom 3% 23/7/2035	514,135	0.00
USD 675,000	Globe Telecom 4.2% 2/5/2171	633,398	0.01
USD 400,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	287,000	0.00
		1,434,533	0.01
	ポルトガル		
EUR 236,350	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 2.309% 25/1/2035	226,474	0.00
EUR 1,024,185	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.309% 25/1/2035	959,712	0.01
EUR 200,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017	35,015	0.00
EUR 20,500,000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019	3,589,046	0.04
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018	350,151	0.00
EUR 1,900,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	1,710,737	0.02
EUR 1,000,000	EDP - Energias de Portugal 1.875% 2/8/2081	853,868	0.01
EUR 1,000,000	EDP - Energias de Portugal 4.496% 30/4/2079	988,425	0.01
EUR 500,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.1 1.603% 20/3/2033	499,176	0.01
EUR 900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.1 3.753% 20/3/2033	891,954	0.01
EUR 900,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No.2 2.876% 23/9/2038	867,556	0.01
EUR 200,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 1.035% 28/10/2040	191,812	0.00
EUR 700,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 1.635% 28/10/2040	659,233	0.01
EUR 2,613,907	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII 0.7% 12/2/2024	2,572,170	0.03
		14,395,329	0.16
	プエルトリコ		
USD 590,000	Puerto Rico Sales Tax Financing Sales Tax Revenue 4.75% 1/7/2053	566,897	0.01
	カタール		
USD 675,000	Qatar Energy 3.125% 12/7/2041	551,097	0.01
	ロシア連邦		
RUB 881,274,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.1% 18/7/2035	4,662,783	0.05
	サウジアラビア		
USD 129,000	Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	127,452	0.00
	シンガポール		
USD 343,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028*	339,570	0.00
USD 1,117,463	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	933,081	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
シンガポール(続き)			
USD 203,175	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	169,651	0.00
USD 600,000	DBS 3.3% 27/8/2171*	571,035	0.01
USD 511,920	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039	494,798	0.01
USD 788,000	Theta Capital 8.125% 22/1/2025	672,877	0.01
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	175,650	0.00
		3,356,662	0.04
南アフリカ			
USD 1,040,000	Eskom SOC 7.125% 11/2/2025	981,113	0.01
韓国			
USD 1,300,000	Heungkuk Life Insurance 4.475% 9/5/2171	1,256,044	0.02
USD 1,310,000	KDB Life Insurance 7.5% 21/11/2170	1,211,750	0.01
USD 1,000,000	Kookmin Bank 4.35% 2/1/2171	979,837	0.01
USD 360,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031	302,197	0.00
USD 1,124,000	Tongyang Life Insurance 5.25% 22/3/2171	1,005,047	0.01
		4,754,875	0.05
スペイン			
EUR 376,070	Autonoria Spain 2021 FT 0.859% 31/1/2039	367,458	0.00
EUR 1,910,302	Autonoria Spain 2021 FT 1.109% 31/1/2039	1,834,066	0.02
EUR 818,701	Autonoria Spain 2021 FT 1.609% 31/1/2039	776,968	0.01
EUR 470,088	Autonoria Spain 2021 FT 2.709% 31/1/2039	443,528	0.01
EUR 188,035	Autonoria Spain 2021 FT 3.959% 31/1/2039	177,558	0.00
EUR 200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/10/2170	189,344	0.00
EUR 800,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/6/2171	776,302	0.01
EUR 700,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	618,699	0.01
EUR 3,600,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031*	3,080,039	0.03
EUR 3,400,000	Banco Santander 4.375% 14/4/2171*	2,899,103	0.03
EUR 2,200,000	CaixaBank 6.375% 19/12/2170	2,186,862	0.03
EUR 600,000	CaixaBank 6.75% 13/9/2170	579,751	0.01
EUR 3,300,000	Cellnex Finance 0.75% 15/11/2026	2,848,582	0.03
EUR 3,400,000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	2,477,270	0.03
EUR 900,000	Cellnex Finance 2% 15/2/2033	649,082	0.00
EUR 2,800,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	2,618,218	0.03
EUR 11,000,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	8,361,621	0.09
EUR 2,100,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030*	1,601,436	0.02
EUR 1,357,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027*	1,188,966	0.01
EUR 577,089	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.778% 20/3/2033	566,401	0.01
EUR 173,127	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 1.778% 20/3/2033	167,375	0.00
EUR 346,253	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 20/3/2033	327,610	0.00
EUR 1,672,000	Grupo Antolin-Irausa 3.375% 30/4/2026*	1,375,712	0.02
EUR 729,000	Grupo Antolin-Irausa 3.5% 30/4/2028	534,996	0.01
EUR 1,200,000	International Consolidated Airlines 0.625% 17/11/2022	1,193,722	0.01
EUR 6,000,000	International Consolidated Airlines 1.125% 18/5/2028	3,951,442	0.05
EUR 3,200,000	International Consolidated Airlines 2.75% 25/3/2025	2,809,114	0.03
EUR 2,000,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029*	1,482,298	0.02
EUR 1,253,000	Kaixo Bondco Telecom 5.125% 30/9/2029*	1,028,617	0.01
EUR 3,672,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	3,307,069	0.04
EUR 8,423,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	8,517,004	0.09
EUR 2,173,000	Tendam Brands 5% 15/9/2024*	2,070,511	0.02
EUR 250,000	Tendam Brands 5.517% 15/9/2024	239,961	0.00
		61,246,685	0.68

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スリランカ			
USD 306,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/4/2023	104,130	0.00
USD 821,000	Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	276,180	0.01
USD 677,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	228,575	0.00
		608,885	0.01
スウェーデン			
EUR 1,850,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	1,309,069	0.01
EUR 3,076,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/5/2171	2,229,522	0.03
EUR 634,000	Intrum 3.5% 15/7/2026	568,747	0.01
EUR 3,062,000	Intrum 4.875% 15/8/2025	2,929,146	0.03
USD 1,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken 5.125% 13/5/2171	955,000	0.01
USD 200,000	Svenska Handelsbanken 4.375% 1/3/2171	173,521	0.00
USD 200,000	Svenska Handelsbanken 4.75% 1/3/2171	165,322	0.00
EUR 1,524,000	Verisure 3.25% 15/2/2027	1,314,361	0.01
EUR 2,237,000	Verisure 3.5% 15/5/2023*	2,216,278	0.03
EUR 1,498,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,345,769	0.02
EUR 1,993,000	Verisure 5% 15/4/2025*	1,979,393	0.02
EUR 305,000	Verisure Midholding 5.25% 15/2/2029	248,035	0.00
EUR 874,000	Volvo Car 2.5% 7/10/2027	780,468	0.01
		16,214,631	0.18
スイス			
EUR 2,000,000	Credit Suisse 2.125% 13/10/2026	1,835,721	0.02
USD 200,000	Credit Suisse 5.25% 11/2/2171	150,745	0.00
USD 3,554,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2170	3,202,054	0.04
USD 3,200,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2170	2,883,110	0.03
USD 600,000	Credit Suisse 7.25% 12/3/2171	495,365	0.01
USD 900,000	Credit Suisse 7.25% 12/3/2171	743,048	0.01
USD 200,000	Credit Suisse 7.5% 17/1/2171	176,705	0.00
USD 200,000	Credit Suisse 7.5% 11/6/2171	190,442	0.00
USD 4,513,000	UBS 1.375% 13/1/2025	4,227,475	0.05
USD 614,000	UBS 2.095% 11/2/2032	482,563	0.00
USD 1,836,000	UBS 4.488% 12/5/2026	1,818,795	0.02
USD 2,496,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,455,581	0.03
USD 600,000	UBS 5.125% 29/7/2171	554,730	0.01
USD 800,000	UBS 7% 19/2/2171	806,800	0.01
USD 3,000,000	UBS 7% 31/7/2171	2,937,462	0.03
		22,960,596	0.26
タイ			
USD 429,000	Bangkok Bank Hong Kong 3.733% 25/9/2034	374,399	0.00
USD 690,000	Bangkok Bank Hong Kong 5% 23/3/2171	648,483	0.01
USD 1,090,000	GC Treasury Center 2.98% 18/3/2031	911,344	0.01
USD 524,000	Kasikornbank Hong Kong 3.343% 2/10/2031	469,904	0.01
USD 690,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/9/2170	593,400	0.01
USD 700,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050	465,150	0.00
USD 790,000	TMBThanachart Bank 4.9% 2/6/2171	733,712	0.01
		4,196,392	0.05
トルコ			
USD 5,428,000	Turkey Government International Bond 4.875% 16/4/2043	3,087,175	0.03
USD 1,259,533	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4.2% 15/9/2028	1,046,324	0.01
		4,133,499	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ウクライナ			
USD 1,990,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	393,025	0.01
USD 1,582,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2034	312,445	0.00
		705,470	0.01
アラブ首長国連邦			
USD 2,853,000	Emirates NBD Bank 6.125% 20/9/2170*	2,838,913	0.03
USD 2,563,000	NBK Tier 1 3.625% 24/8/2171	2,247,431	0.03
		5,086,344	0.06
英国			
USD 612,000	AstraZeneca 1.375% 6/8/2030	504,737	0.01
USD 946,000	AstraZeneca 2.125% 6/8/2050	624,709	0.01
USD 500,000	AstraZeneca 3.375% 16/11/2025	490,852	0.01
GBP 125,000	Atlas Funding 2021-1 3.301% 25/7/2058	141,358	0.00
GBP 110,000	Atlas Funding 2021-1 3.851% 25/7/2058	123,778	0.00
USD 4,093,231	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	3,458,780	0.04
GBP 1,699,000	Azure Finance NO 2 4.691% 20/7/2030	1,964,651	0.02
EUR 5,800,000	Barclays 0.577% 9/8/2029	4,669,962	0.05
EUR 3,100,000	Barclays 0.877% 28/1/2028	2,685,943	0.03
USD 1,590,000	Barclays 5.304% 9/8/2026	1,585,270	0.02
USD 1,100,000	Barclays 6.125% 15/12/2170	1,017,452	0.01
GBP 800,000	Barclays 6.375% 15/3/2171	848,581	0.01
GBP 400,000	Barclays 7.125% 15/9/2170	442,723	0.00
GBP 400,000	Barclays 7.25% 15/6/2171	460,277	0.00
USD 600,000	Barclays 8% 15/9/2170	591,545	0.01
USD 1,600,000	Barclays 8% 15/12/2170	1,558,954	0.02
GBP 520,000	Barley Hill NO 2 3.391% 27/8/2058	574,872	0.01
EUR 1,300,000	BCP V Modular Services Finance II 4.75% 30/11/2028	1,084,375	0.01
GBP 400,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028*	378,254	0.00
GBP 3,858,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	3,549,505	0.04
GBP 2,628,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	2,453,887	0.03
EUR 5,140,000	British American Tobacco 3% 27/12/2170	3,979,303	0.04
EUR 7,675,000	British Telecommunications 1.874% 18/8/2080	6,626,763	0.07
USD 1,000,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	877,539	0.01
USD 2,200,000	British Telecommunications 4.875% 23/11/2081	1,870,241	0.02
GBP 225,000	Canada Square Funding 2021-2 2.584% 17/6/2058	252,794	0.00
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 2.984% 17/6/2058	112,960	0.00
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 3.011% 17/1/2059	342,147	0.00
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 3.411% 17/1/2059	186,092	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II 3.081% 22/10/2037	950,736	0.01
GBP 4,190,000	Canary Wharf Finance II 3.806% 22/10/2037	3,893,828	0.04
EUR 1,071,000	Chanel Ceres 0.5% 31/7/2026	967,578	0.01
EUR 2,404,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	2,256,513	0.02
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance 3.043% 30/6/2050	1,898,927	0.02
GBP 220,000	CMF 2020-1 2.691% 16/1/2057	251,932	0.00
GBP 105,000	CMF 2020-1 2.941% 16/1/2057	118,914	0.00
GBP 2,097,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027*	1,933,530	0.02
GBP 1,102,412	Dignity Finance 3.546% 31/12/2034	1,222,403	0.01
GBP 350,000	Dignity Finance 4.696% 31/12/2049	365,566	0.00
GBP 394,209	Dowson 2021-2 2.371% 20/10/2028	456,041	0.01
GBP 400,000	Dowson 2021-2 2.891% 20/10/2028	455,076	0.00
GBP 1,300,000	Dowson 2021-2 3.291% 20/10/2028	1,452,287	0.02
GBP 1,143,000	Dowson 2022-1 3.941% 20/1/2029	1,294,781	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 725,000	Dowson 2022-1 4.391% 20/1/2029	805,223	0.01
EUR 3,498,000	EC Finance 3% 15/10/2026	3,233,422	0.04
EUR 2,259,000	eG Global Finance 3.625% 7/2/2024	2,123,482	0.02
EUR 1,163,000	eG Global Finance 4.375% 7/2/2025	1,078,950	0.01
EUR 1,871,000	eG Global Finance 6.25% 30/10/2025	1,757,574	0.02
GBP 549,335	Finsbury Square 2.019% 16/12/2067	622,573	0.01
GBP 544,000	Finsbury Square 2.369% 16/12/2067	612,229	0.01
GBP 1,045,000	Finsbury Square 2.619% 16/12/2067	1,172,189	0.01
GBP 235,000	Finsbury Square 2019-2 3.419% 16/9/2069	272,843	0.00
GBP 215,000	Finsbury Square 2019-2 3.719% 16/9/2069	249,593	0.00
GBP 927,908	Finsbury Square 2021-2 2.169% 16/12/2071	1,053,499	0.01
GBP 435,000	Finsbury Square 2021-2 2.619% 16/12/2071	471,995	0.01
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 2.769% 16/12/2071	389,287	0.01
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 3.069% 16/12/2071	219,063	0.00
USD 2,202,000	Fresnillo 4.25% 2/10/2050*	1,700,296	0.02
GBP 537,000	Funding IV 3.891% 15/9/2024	623,252	0.01
GBP 116,000	Funding V 3.391% 15/10/2025	130,204	0.00
GBP 736,000	Funding VI 4.791% 15/7/2026	843,364	0.01
GBP 884,793	Gemgarto 2018-1 2.722% 16/9/2065	1,026,307	0.01
GBP 205,952	Gemgarto 2018-1 3.022% 16/9/2065	238,725	0.00
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 2.669% 16/12/2067	240,570	0.00
GBP 858,049	Gemgarto 2021-1 6.369% 16/12/2067	996,303	0.01
GBP 1,880,000	Great Hall Mortgages No 1 1.925% 18/6/2039	2,011,399	0.02
GBP 300,000	Greene King Finance 3.28% 15/12/2034	284,987	0.00
GBP 300,000	Greene King Finance 3.56% 15/3/2036	285,569	0.00
GBP 2,565,066	Greene King Finance 3.593% 15/3/2035	2,720,596	0.03
GBP 7,873,034	Greene King Finance 3.98% 15/12/2033	8,543,065	0.09
GBP 1,053,425	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	1,127,631	0.01
USD 80,000	GSK Consumer Healthcare Capital UK 3.125% 24/3/2025	77,162	0.00
GBP 741,000	Harben Finance 2.604% 28/9/2055	786,386	0.01
GBP 441,000	Harben Finance 2.954% 28/9/2055	456,441	0.01
GBP 200,000	Heathrow Finance 3.875% 1/3/2027	202,322	0.00
GBP 517,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	508,089	0.01
GBP 500,000	Heathrow Finance 4.75% 1/3/2024	572,897	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 3.541% 27/5/2054	225,068	0.00
GBP 99,997	Hops Hill No 1 4.041% 27/5/2054	112,629	0.00
USD 3,393,000	HSBC 0.976% 24/5/2025	3,166,904	0.04
GBP 3,760,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	3,787,744	0.04
EUR 1,800,000	HSBC 3.019% 15/6/2027	1,751,362	0.02
USD 3,000,000	HSBC 3.033% 22/11/2023	2,990,567	0.03
USD 840,000	HSBC Bank 3.127% 19/12/2170	644,406	0.01
GBP 660,000	Iceland Bondco 4.375% 15/5/2028	496,212	0.01
GBP 1,200,000	Iceland Bondco 4.625% 15/3/2025*	1,017,253	0.01
EUR 5,470,000	Informa 2.125% 6/10/2025	5,264,161	0.06
USD 404,000	International Game Technology 6.25% 15/1/2027	394,389	0.00
USD 365,000	International Game Technology 6.5% 15/2/2025	363,633	0.00
GBP 790,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025	837,176	0.01
EUR 1,582,000	Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15/7/2028*	1,140,441	0.01
EUR 300,000	Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15/11/2026	261,638	0.00
USD 1,400,000	Jaguar Land Rover Automotive 7.75% 15/10/2025	1,288,171	0.01
GBP 1,205,000	Jerrold Finco 4.875% 15/1/2026*	1,197,981	0.01
GBP 1,794,000	Jerrold Finco 5.25% 15/1/2027	1,821,359	0.02
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.591% 12/6/2057	418,817	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 320,946	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.224% 20/7/2058	364,429	0.00
GBP 173,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.524% 20/7/2058	192,292	0.00
GBP 158,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.824% 20/7/2058	168,558	0.00
GBP 102,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 3.224% 20/7/2058	108,999	0.00
USD 2,016,000	Liquid Telecommunications Financing 5.5% 4/9/2026	1,727,309	0.02
USD 729,000	Lloyds Bank 3.5% 14/5/2025	713,584	0.01
USD 1,400,000	Lloyds Banking 7.5% 27/6/2171	1,386,182	0.02
GBP 503,454	London Wall Mortgage Capital 2.443% 15/5/2051	571,501	0.01
GBP 280,256	London Wall Mortgage Capital 2.493% 15/5/2052	318,677	0.00
GBP 4,575,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	4,394,760	0.05
USD 250,000	Mclaren Finance 7.5% 1/8/2026	211,921	0.00
GBP 1,483,000	Mitchells & Butlers Finance 3.724% 15/6/2036	1,392,836	0.02
GBP 757,481	Mortimer BTL 2021-1 2.11% 23/6/2053	859,296	0.01
GBP 198,000	Mortimer BTL 2021-1 2.51% 23/6/2053	218,600	0.00
GBP 111,000	Mortimer BTL 2021-1 2.86% 23/6/2053	120,945	0.00
GBP 266,625	Motor 2016-1 5.25% 25/11/2025	308,693	0.00
GBP 550,000	National Express 4.25% 26/2/2171	575,642	0.01
GBP 800,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/12/2170*	822,787	0.01
GBP 400,000	Nationwide Building Society 5.875% 20/12/2170	438,086	0.00
EUR 3,900,000	NatWest 1.043% 14/9/2032*	3,186,541	0.04
USD 4,797,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	4,645,573	0.05
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 3.241% 15/3/2029	881,321	0.01
GBP 595,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 2.591% 15/11/2029	675,673	0.01
GBP 677,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 3.041% 15/11/2029	756,294	0.01
GBP 1,212,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 0% 15/7/2030	1,407,302	0.02
EUR 639,443	Newgate Funding 0.9% 1/12/2050	627,102	0.01
EUR 6,000,000	NGG Finance 1.625% 5/12/2079	5,538,970	0.06
GBP 1,300,000	NGG Finance 5.625% 18/6/2073	1,448,741	0.02
GBP 1,524,000	Ocado 3.875% 8/10/2026	1,405,967	0.02
EUR 305,289	Paragon Mortgages No 12 0.801% 15/11/2038	280,506	0.00
GBP 2,405,000	Paragon Mortgages No 25 2.763% 15/5/2050	2,771,556	0.03
GBP 2,100,000	Paragon Mortgages No 25 3.113% 15/5/2050	2,392,574	0.03
GBP 565,034	Pierpont BTL 2021-1 2.21% 22/12/2053	640,735	0.01
GBP 802,000	Pierpont BTL 2021-1 2.66% 22/12/2053	899,580	0.01
GBP 3,748,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025*	3,930,572	0.04
GBP 421,000	Polaris 2022-1 3.191% 23/10/2059	463,109	0.01
GBP 307,000	Polaris 2022-1 3.691% 23/10/2059	336,866	0.00
GBP 538,000	Polaris 2022-1 5.091% 23/10/2059	582,347	0.01
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.141% 16/10/2056	130,929	0.00
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.641% 16/10/2056	111,592	0.00
GBP 1,464,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	1,507,732	0.02
GBP 1,197,000	Residential Mortgage 32 3.602% 20/6/2070	1,368,931	0.02
EUR 44,555	RMAC No 1 0% 12/6/2044	41,414	0.00
EUR 638,156	RMAC No 1 0% 12/6/2044	573,242	0.01
GBP 334,794	RMAC No 1 1.61% 12/6/2044	367,305	0.00
GBP 420,000	RMAC NO 2 3.31% 12/6/2046	484,961	0.01
EUR 400,000	Rolls-Royce 1.625% 9/5/2028	311,284	0.00
EUR 442,000	Rolls-Royce 4.625% 16/2/2026	425,241	0.01
USD 200,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	182,228	0.00
GBP 176,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	192,260	0.00
USD 880,000	Royalty Pharma 1.2% 2/9/2025	800,079	0.01
USD 600,000	Royalty Pharma 1.75% 2/9/2027	522,548	0.01
USD 612,000	Royalty Pharma 2.15% 2/9/2031	487,206	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
USD 842,000	Royalty Pharma 3.55% 2/9/2050	597,309	0.01
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 3.843% 17/11/2030	601,740	0.01
GBP 369,000	Satus 2021-1 2.891% 17/8/2028	419,130	0.00
GBP 453,000	Satus 2021-1 3.291% 17/8/2028	503,918	0.01
GBP 122,000	Satus 2021-1 3.591% 17/8/2028	131,689	0.00
GBP 247,000	Satus 2021-1 4.891% 17/8/2028	263,129	0.00
USD 3,458,440	SCC Power 4% 17/5/2032	354,490	0.00
USD 6,384,812	SCC Power 8% 31/12/2028	2,617,773	0.04
EUR 1,432,000	Sherwood Financing 4.5% 15/11/2026*	1,208,198	0.01
EUR 458,000	Sherwood Financing 4.946% 15/11/2027	426,708	0.00
GBP 624,000	Sherwood Financing 6% 15/11/2026	587,432	0.01
USD 477,000	Sky 3.75% 16/9/2024	474,467	0.00
GBP 453,000	Spirit Issuer 5.472% 28/12/2034	544,513	0.01
EUR 1,659,000	SSE 4% 21/4/2171	1,531,824	0.02
EUR 9,750,000	Standard Chartered 1.2% 23/9/2031	8,431,522	0.09
GBP 535,000	Stanlington No 2 3.091% 12/6/2056	591,078	0.01
GBP 329,000	Stanlington No 2 3.541% 12/6/2056	359,028	0.00
GBP 450,000	Stanlington No 2 4.641% 12/6/2056	502,117	0.01
GBP 3,930,000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025	4,194,523	0.05
GBP 2,321,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025	2,478,005	0.03
EUR 801,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025*	743,240	0.01
GBP 844,882	Tesco Property Finance 1 7.623% 13/7/2039	1,128,686	0.01
GBP 2,055,061	Tesco Property Finance 3 5.744% 13/4/2040	2,387,715	0.03
GBP 937,382	Tesco Property Finance 4 5.801% 13/10/2040	1,087,950	0.01
GBP 2,024,000	Thames Water Kemble Finance 4.625% 19/5/2026*	2,078,832	0.02
GBP 378,506	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.23% 12/7/2063	432,644	0.01
GBP 157,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.48% 12/7/2063	172,111	0.00
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.78% 12/7/2063	114,727	0.00
GBP 145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.852% 20/9/2063	167,670	0.00
GBP 115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 4.852% 20/9/2063	133,122	0.00
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.429% 21/7/2064	415,888	0.01
GBP 252,000	Tower Bridge Funding 2021-1 3.729% 21/7/2064	282,650	0.00
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.652% 20/12/2063	280,170	0.00
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 3.341% 20/8/2028	1,825,812	0.02
GBP 488,000	Twin Bridges 2018-1 3.51% 12/9/2050	557,802	0.01
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 3.591% 12/12/2054	445,627	0.01
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 4.341% 12/12/2054	256,971	0.00
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 2.941% 12/3/2055	475,173	0.01
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 3.441% 12/3/2055	234,382	0.00
GBP 670,099	Twin Bridges 2021-2 2.001% 12/9/2055	753,435	0.01
GBP 274,000	Twin Bridges 2021-2 2.241% 12/9/2055	294,639	0.00
GBP 435,000	Twin Bridges 2021-2 2.491% 12/9/2055	464,528	0.01
GBP 187,000	Twin Bridges 2021-2 2.841% 12/9/2055	194,075	0.00
GBP 192,841	Twin Bridges 2021-2 4.241% 12/9/2055	223,347	0.00
GBP 830,000	Twin Bridges 2022-1 2.641% 1/12/2055	848,367	0.01
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 3.041% 1/12/2055	359,899	0.00
GBP 2,791,000	Twin Bridges 2022-2 0% 12/6/2055	3,176,596	0.04
GBP 1,884,626	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	2,229,497	0.02
GBP 1,997,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	2,749,742	0.03
GBP 599,846	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	706,825	0.01
GBP 4,506,336	United Kingdom Gilt 1.25% 31/7/2051	3,419,073	0.04
USD 1,316,000	Vedanta Resources 6.125% 9/8/2024	913,870	0.01
USD 3,693,000	Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	2,880,540	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
USD 557,000	Vedanta Resources Finance II 13.875% 21/1/2024	482,654	0.01
GBP 1,577,000	Very Funding 6.5% 1/8/2026*	1,367,156	0.02
EUR 1,075,000	Virgin Media Finance 3.75% 15/7/2030	844,217	0.01
GBP 200,000	Virgin Media Secured Finance 4.125% 15/8/2030	195,977	0.00
GBP 1,625,000	Virgin Media Secured Finance 4.25% 15/1/2030*	1,591,464	0.02
USD 443,000	Virgin Media Secured Finance 4.5% 15/8/2030	368,037	0.00
GBP 500,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029	516,921	0.01
USD 1,600,000	Virgin Media Secured Finance 5.5% 15/5/2029	1,428,210	0.02
EUR 4,484,000	Vmed O2 UK Financing I 3.25% 31/1/2031	3,795,368	0.04
GBP 438,000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	432,281	0.00
GBP 2,408,000	Vmed O2 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	2,324,678	0.03
EUR 975,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	876,561	0.01
EUR 2,150,000	Vodafone 3% 27/8/2080*	1,727,302	0.02
EUR 8,200,000	Vodafone 3.1% 3/1/2079	7,966,861	0.09
EUR 800,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078*	731,355	0.01
USD 735,000	Vodafone 4.25% 17/9/2050	608,037	0.01
USD 2,200,000	Vodafone 6.25% 3/10/2078	2,142,250	0.02
		267,520,719	2.98
米国			
USD 460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	432,664	0.01
USD 1,500,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	1,305,597	0.01
USD 300,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.28% 10/8/2035	277,514	0.00
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 0.271% 5/6/2037	55,860	0.00
USD 320,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	269,790	0.00
USD 1,708,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.779% 5/6/2037	1,402,517	0.02
USD 1,070,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 3.906% 15/9/2034	1,020,660	0.01
USD 4,871,133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 4.489% 15/9/2034	4,621,324	0.05
USD 1,500,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,417,952	0.02
USD 365,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	350,704	0.00
USD 1,750,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	1,607,099	0.02
USD 182,000	AbbVie 3.8% 15/3/2025	179,823	0.00
USD 3,162,000	AbbVie 4.25% 21/11/2049	2,820,803	0.03
USD 828,200	AccessLex Institute 3.297% 25/5/2036	800,737	0.01
USD 2,119,612	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 2.704% 25/5/2037	449,140	0.01
USD 107,624	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 3.044% 25/5/2037	23,270	0.00
USD 1,151,000	Aetna 3.5% 15/11/2024	1,137,222	0.01
USD 1,297,000	Affinity Gaming 6.875% 15/12/2027	1,130,877	0.01
USD 340,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-1 3.693% 25/1/2045	318,896	0.00
USD 391,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-3 3.544% 25/4/2045	362,515	0.00
USD 273,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-4 3.522% 25/6/2045	248,957	0.00
USD 2,811,000	AIG Global Funding 0.65% 17/6/2024	2,644,352	0.03
USD 36,231	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 0% 25/12/2057	13,770	0.00
USD 59,280	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 0% 25/4/2058	60,889	0.00
USD 38,133	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B 0% 26/2/2057	27,598	0.00
USD 11,540,633	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-G 3% 25/9/2059	11,375,408	0.13
USD 3,076,768	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-H 3% 25/11/2059	3,033,822	0.03
USD 14,255,051	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-A 2.375% 25/12/2059	13,939,370	0.16
USD 1,291,352	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2.25% 27/9/2060	1,272,405	0.01
USD 5,013,348	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2.25% 25/6/2060	4,863,369	0.05
USD 16,903,227	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2.115% 25/1/2061	15,986,354	0.18
USD 31,188,837	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-F 1.875% 25/6/2061	29,013,082	0.32
USD 2,589,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	2,139,161	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 176,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	161,220	0.00
USD 130,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	113,653	0.00
USD 489,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	465,862	0.01
USD 78,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 7.5% 15/3/2026	79,592	0.00
USD 612,000	Alexandria Real Estate Equities 1.875% 1/2/2033	466,526	0.01
USD 1,327,000	Alexandria Real Estate Equities 2.95% 15/3/2034	1,123,799	0.01
USD 900,000	Alexandria Real Estate Equities 4.5% 30/7/2029	879,209	0.01
USD 1,830,000	Allegheny County Airport Authority 4% 1/1/2046	1,705,493	0.02
USD 1,043,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,037,121	0.01
USD 9,893,000	Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	10,041,494	0.11
USD 612,000	Allstate 1.45% 15/12/2030	493,672	0.01
USD 500,000	Ally Financial 1.45% 2/10/2023	485,199	0.01
USD 621,000	Alphabet 1.1% 15/8/2030	510,368	0.01
USD 961,000	Alphabet 2.25% 15/8/2060	624,786	0.01
USD 3,700,074	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6.25% 25/10/2034	3,595,628	0.04
USD 2,099,302	Alternative Loan Trust 2005-22T1 2.794% 25/6/2035	1,805,362	0.02
USD 586,012	Alternative Loan Trust 2005-76 1.859% 25/2/2036	528,770	0.01
USD 2,827,470	Alternative Loan Trust 2005-J4 4.469% 25/7/2035	2,864,348	0.03
USD 3,564,917	Alternative Loan Trust 2006-11CB 6.5% 25/5/2036	2,093,841	0.02
USD 948,677	Alternative Loan Trust 2006-15CB 6.5% 25/6/2036	531,639	0.01
USD 1,518,120	Alternative Loan Trust 2006-23CB 2.844% 25/8/2036	334,681	0.00
USD 677,120	Alternative Loan Trust 2006-J7 3.873% 20/11/2046	497,968	0.01
USD 2,838,913	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.25% 25/11/2036	1,652,694	0.02
USD 413,859	Alternative Loan Trust 2006-OA11 2.824% 25/9/2046	369,953	0.00
USD 2,954,181	Alternative Loan Trust 2006-OA14 2.589% 25/11/2046	2,383,423	0.03
USD 3,248,655	Alternative Loan Trust 2006-OA16 3.124% 25/10/2046	2,573,919	0.03
USD 343,333	Alternative Loan Trust 2006-OA8 2.824% 25/7/2046	298,909	0.00
USD 1,419,786	Alternative Loan Trust 2006-OC10 2.904% 25/11/2036	1,314,555	0.02
USD 2,854,947	Alternative Loan Trust 2006-OC7 2.944% 25/7/2046	2,639,887	0.03
USD 3,192,973	Alternative Loan Trust 2007-25 6.5% 25/11/2037	1,722,470	0.02
USD 4,689,856	Alternative Loan Trust 2007-3T1 6% 25/4/2037	2,527,091	0.03
USD 2,771,978	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	1,565,104	0.02
USD 10,719	Alternative Loan Trust 2007-OA3 2.804% 25/4/2047	1,323	0.00
USD 181,931	Alternative Loan Trust 2007-OA8 2.804% 25/6/2047	138,845	0.00
USD 236,995	Alternative Loan Trust 2007-OH2 2.924% 25/8/2047	203,288	0.00
USD 568,000	Altria 3.7% 4/2/2051	373,065	0.00
USD 1,371,000	Amazon.com 2.5% 3/6/2050	970,571	0.01
USD 946,000	Amazon.com 2.7% 3/6/2060	645,973	0.01
USD 3,500,000	Amazon.com 3% 13/4/2025	3,444,694	0.04
USD 938,000	Amazon.com 3.1% 12/5/2051	743,424	0.01
USD 1,750,000	Amazon.com 3.45% 13/4/2029	1,702,719	0.02
USD 671,973	Ambac Assurance 5.1% 7/6/2171	677,853	0.01
USD 104,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	96,707	0.00
USD 1,748,000	American Express 2.25% 4/3/2025	1,670,121	0.02
USD 2,570,000	American Express 3.95% 1/8/2025	2,546,542	0.03
USD 3,171,000	American Express 4.05% 3/5/2029	3,095,130	0.03
USD 781,621	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 1.799% 25/10/2046	574,040	0.01
USD 1,618,905	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 2.654% 25/10/2046	924,808	0.01
USD 572,597	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 1.559% 25/2/2047	249,446	0.00
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 6.231% 17/10/2036	1,902,934	0.02
USD 4,749,572	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	48	0.00
USD 3,580,000	American Honda Finance 2.25% 12/1/2029	3,160,853	0.04
USD 1,285,000	American Municipal Power 7.834% 15/2/2041	1,687,174	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	1,817,321	0.02
USD 4,137,000	American Tower 1.875% 15/10/2030	3,281,036	0.04
USD 2,755,000	American Tower 2.7% 15/4/2031	2,309,623	0.03
USD 1,000,000	American Tower 2.75% 15/1/2027	918,702	0.01
USD 905,000	American Tower 2.95% 15/1/2051	624,034	0.01
USD 2,701,000	American Tower 3.1% 15/6/2050	1,906,188	0.02
USD 1,710,000	American Tower 5% 15/2/2024	1,724,088	0.02
USD 2,739,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	2,325,022	0.03
USD 2,000,000	Amgen 1.65% 15/8/2028	1,734,787	0.02
USD 303,000	Amgen 1.9% 21/2/2025	288,708	0.00
USD 3,382,000	Amgen 2% 15/1/2032	2,765,202	0.03
USD 800,000	Amgen 2.6% 19/8/2026	758,873	0.01
USD 946,000	Amgen 2.77% 1/9/2053	636,162	0.01
USD 562,000	Amgen 3% 15/1/2052	402,194	0.00
USD 1,755,000	Amgen 3.125% 1/5/2025	1,721,654	0.02
USD 3,260,000	Amgen 4.05% 18/8/2029	3,190,129	0.04
USD 1,550,000	Amgen 4.875% 1/3/2053	1,524,800	0.02
USD 750,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	741,382	0.01
USD 959,000	AMN Healthcare 4.625% 1/10/2027	888,963	0.01
USD 612,000	Amphenol 2.2% 15/9/2031	509,593	0.01
USD 164,000	Amphenol 4.35% 1/6/2029	163,491	0.00
USD 8,500,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.5% 1/6/2030	8,050,061	0.09
USD 1,097,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.5% 1/6/2050	1,013,100	0.01
USD 377,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.6% 15/4/2048	348,763	0.00
USD 1,160,000	Apple 1.65% 11/5/2030	991,778	0.01
USD 3,941,000	Apple 2.4% 20/8/2050	2,777,673	0.03
USD 466,000	Apple 2.65% 11/5/2050	345,666	0.00
USD 876,000	Apple 2.65% 8/2/2051	649,484	0.01
USD 2,075,000	Apple 3% 13/11/2027	2,002,302	0.02
USD 2,680,000	Applied Materials 1.75% 1/6/2030	2,274,375	0.02
USD 7,086,521	APS Resecuritization Trust 2016-1 3.188% 31/7/2057	2,736,435	0.03
USD 1,245,995	APS Resecuritization Trust 2016-3 5.294% 27/9/2046	1,261,387	0.01
USD 150,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	138,423	0.00
EUR 541,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	448,596	0.00
EUR 416,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	329,200	0.00
USD 2,271,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	1,943,179	0.02
USD 225,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	183,781	0.00
USD 918,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	905,676	0.01
EUR 1,200,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	976,675	0.01
GBP 1,320,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	1,196,284	0.01
USD 2,848,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 30/4/2025	2,705,637	0.03
USD 10,110,000	AREIT 2022-CRE7 4.538% 17/6/2039	10,050,829	0.11
USD 3,251,403	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 2.924% 25/5/2035	2,878,982	0.03
USD 1,820,000	Arizona Health Facilities Authority 2.336% 1/1/2037	1,719,533	0.02
USD 935,000	Arizona State University 5% 1/7/2041	1,014,403	0.01
USD 2,200,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 4.491% 15/4/2035	2,088,445	0.02
USD 6,712,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 5.491% 15/4/2035	6,229,429	0.07
USD 578,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	466,961	0.01
USD 1,520,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,201,135	0.01
USD 3,604,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6.625% 15/1/2028	3,227,874	0.04
USD 2,000,000	Astrazeneca Finance 1.75% 28/5/2028	1,770,994	0.02
USD 1,935,000	AT&T 0.9% 25/3/2024	1,847,632	0.02
USD 2,652,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	2,428,902	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,780,000	AT&T 2.25% 1/2/2032	1,444,648	0.02
USD 2,965,000	AT&T 2.3% 1/6/2027	2,712,301	0.03
USD 563,000	AT&T 3.5% 15/9/2053	422,992	0.00
USD 562,000	AT&T 3.65% 15/9/2059	416,550	0.00
USD 8,115,000	AT&T 4.1% 15/2/2028	7,952,863	0.09
USD 1,615,000	AT&T 4.3% 15/2/2030	1,571,993	0.02
USD 1,700,000	AT&T 4.35% 1/3/2029	1,665,498	0.02
USD 4,207,972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 4.341% 15/12/2036	3,931,193	0.04
USD 514,447	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 5.441% 15/12/2036	478,536	0.01
EUR 1,100,000	Avantor Funding 2.625% 1/11/2025	1,048,058	0.01
USD 1,111,000	Avaya 6.125% 15/9/2028	610,283	0.01
USD 1,265,000	Azul Investments 5.875% 26/10/2024	983,538	0.01
USD 1,451,000	Azul Investments 7.25% 15/6/2026	1,036,068	0.01
USD 1,867,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.716% 14/4/2033	1,675,412	0.02
USD 5,860,000	Bamll Commercial Mortgage Trust 2016-SS1 0.702% 15/12/2035	93,174	0.00
USD 100,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.392% 15/11/2033	94,653	0.00
USD 3,273,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.792% 15/11/2033	3,132,097	0.04
USD 3,645,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 3.892% 15/11/2032	3,481,417	0.04
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 4.392% 15/11/2032	1,702,496	0.02
USD 160,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 3.742% 15/9/2034	153,784	0.00
USD 2,553,409	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 4.092% 15/9/2034	2,444,348	0.03
USD 246,603	Banc of America Funding 2006-A Trust 3.176% 20/2/2036	232,097	0.00
USD 13,421,525	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 0% 26/11/2036	4,625,939	0.05
USD 1,180,000	BANK 2017-BNK5 4.331% 15/6/2060	1,074,653	0.01
EUR 1,800,000	Bank of America 0.583% 24/8/2028	1,568,908	0.02
USD 3,750,000	Bank of America 1.486% 19/5/2024	3,674,699	0.04
USD 698,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	652,012	0.01
USD 341,000	Bank of America 1.658% 11/3/2027	306,285	0.00
USD 2,658,000	Bank of America 1.843% 4/2/2025	2,555,365	0.03
USD 612,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	487,418	0.01
USD 1,127,000	Bank of America 2.456% 22/10/2025	1,079,625	0.01
USD 1,905,000	Bank of America 2.651% 11/3/2032	1,595,639	0.02
USD 2,072,000	Bank of America 2.972% 21/7/2052	1,471,457	0.02
USD 5,500,000	Bank of America 3.004% 20/12/2023	5,480,200	0.06
USD 4,009,000	Bank of America 3.384% 2/4/2026	3,878,293	0.04
USD 466,000	Bank of America 3.458% 15/3/2025	458,818	0.00
USD 1,650,000	Bank of America 3.483% 13/3/2052	1,300,321	0.01
USD 361,000	Bank of America 3.5% 19/4/2026	352,244	0.00
USD 1,881,000	Bank of America 3.705% 24/4/2028	1,792,262	0.02
USD 775,000	Bank of America 3.824% 20/1/2028	744,207	0.01
USD 5,735,000	Bank of America 3.841% 25/4/2025	5,681,424	0.06
USD 811,000	Bank of America 4.083% 20/3/2051	702,749	0.01
USD 3,742,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	3,663,633	0.04
USD 4,720,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,735,535	0.05
USD 3,415,995	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 5.005% 15/7/2049	3,258,179	0.04
USD 9,780,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0.736% 15/2/2050	231,780	0.00
USD 4,000,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1.393% 15/2/2050	192,040	0.00
USD 612,000	Bank of New York Mellon 1.65% 28/1/2031	497,691	0.01
USD 1,700,000	Bank of New York Mellon 2.05% 26/1/2027	1,564,871	0.02
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.35% 25/4/2025	5,678,228	0.06
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.85% 26/4/2029	5,554,078	0.06
USD 3,047,000	Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026	3,066,151	0.03
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.07% 10/2/2022	512,598	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.366% 10/12/2025	670,213	0.01
USD 1,690,000	Bay Area Toll Authority 2.425% 1/4/2026	1,611,291	0.02
USD 3,375,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	4,128,002	0.05
USD 1,058,434	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 2.924% 25/11/2035	969,604	0.01
USD 1,894,404	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 2.894% 25/1/2036	1,731,120	0.02
USD 46,005	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 3.029% 25/1/2036	42,228	0.00
USD 121,584	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 3.119% 25/1/2036	110,871	0.00
USD 160,824	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 2.984% 25/4/2036	153,728	0.00
USD 462,370	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.044% 25/4/2036	411,515	0.01
USD 111,260	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.074% 25/4/2036	98,793	0.00
USD 608,163	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 3.224% 25/4/2036	541,362	0.01
USD 313,083	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 2.864% 25/7/2036	288,491	0.00
USD 532,377	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 2.819% 25/10/2036	499,081	0.01
USD 2,784,752	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 2.789% 25/12/2036	2,587,861	0.03
USD 2,169,990	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 2.714% 25/3/2037	1,999,781	0.02
USD 3,044,767	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 2.714% 25/7/2037	2,712,367	0.03
USD 4,956,387	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 2.894% 25/9/2037	4,537,536	0.05
USD 1,789,662	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 3.944% 25/12/2037	1,659,960	0.02
USD 2,057,969	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 4.944% 25/4/2038	2,020,415	0.02
USD 5,418,028	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 3.493% 28/5/2039	4,645,959	0.05
USD 1,382,593	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 3.793% 28/5/2039	1,049,188	0.01
USD 4,561,224	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 3.493% 28/2/2040	4,379,161	0.05
USD 425,466	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 3.493% 28/12/2040	417,578	0.01
USD 371,582	Bayview Opportunity Master Fund IVa Trust 2017-RT5 3.5% 28/5/2069	361,812	0.00
USD 8,312,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 5.016% 15/8/2036	8,003,698	0.09
USD 3,451,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 6.016% 15/8/2036	3,287,277	0.04
USD 840,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4.409% 5/8/2038	632,956	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 3.113% 15/3/2037	837,342	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0.295% 10/8/2035	111,128	0.00
USD 19,674,351	BBCMS Trust 2015-SRCH 1.083% 10/8/2035	673,453	0.01
USD 1,268,970	BCAP 2011-RR5-I Trust 2.559% 28/5/2036	1,213,220	0.01
USD 2,093,435	BCAP Trust 2007-AA4 3.89% 25/6/2047	1,144,313	0.01
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 7.575% 15/6/2030	255,870	0.00
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 7.83% 15/6/2030	245,279	0.00
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A 8.29% 15/6/2030	186,958	0.00
USD 456,104	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 2.764% 25/11/2036	382,739	0.00
USD 1,820,361	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 2.764% 25/1/2047	1,620,294	0.02
USD 53,566	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 3.175% 25/7/2034	50,446	0.00
USD 40,950	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2004-HE7 4.169% 25/8/2034	40,215	0.00
USD 1,864,657	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6.25% 25/12/2035	1,371,605	0.02
USD 2,007,121	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-HE8 4.394% 25/8/2035	1,960,733	0.02
USD 2,867,903	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6.25% 25/2/2036	2,122,432	0.02
USD 1,350,964	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 3.464% 25/12/2035	1,954,082	0.02
USD 1,951,335	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 2.784% 25/9/2036	1,891,036	0.02
USD 720,000	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE8 2.704% 25/10/2036	631,322	0.01
USD 479,164	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.584% 25/3/2037	449,544	0.01
USD 965,335	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.584% 25/3/2037	903,937	0.01
USD 932,242	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 2.764% 25/3/2037	853,656	0.01
USD 428,234	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 2.694% 25/4/2037	570,199	0.01
USD 5,208,289	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 2.794% 25/4/2037	5,110,250	0.06
USD 133,671	Bear Stearns Commercial Mortgage Trust 2005-PWR7 5.214% 11/2/2041	132,020	0.00
USD 251,082	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 2.724% 25/8/2036	244,793	0.00
USD 262,774	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 2.614% 25/3/2037	243,669	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 472,002	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 2.584% 25/3/2037	411,268	0.01
USD 315,370	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 2.654% 25/6/2037	297,548	0.00
USD 3,142,000	Beazer Homes USA 7.25% 15/10/2029	2,704,693	0.03
USD 612,000	Becton Dickinson 1.957% 11/2/2031	502,921	0.01
USD 1,750,000	Becton Dickinson 3.7% 6/6/2027	1,704,111	0.02
EUR 1,061,000	Belden 3.375% 15/7/2031*	851,363	0.01
EUR 300,000	Belden 3.875% 15/3/2028	278,292	0.00
USD 2,000,000	Belton Independent School District 4% 15/2/2047	1,935,663	0.02
USD 200,000	Benchmark 2018-B3 Mortgage Trust 3.188% 10/4/2051	159,893	0.00
USD 719,000	Berry Global 4.875% 15/7/2026	701,535	0.01
USD 5,012,995	BHMS 2018-ATLS 3.641% 15/7/2035	4,870,848	0.05
USD 4,161,000	BHMS 2018-ATLS 4.291% 15/7/2035	3,992,698	0.04
USD 612,000	Blackstone Finance 2% 30/1/2032	484,242	0.01
USD 464,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	462,508	0.01
USD 2,710,000	Boston Properties 2.55% 1/4/2032	2,167,324	0.02
USD 830,000	Boston Properties 2.75% 1/10/2026	775,029	0.01
EUR 5,244,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	5,090,603	0.06
USD 4,109,000	Boyd Gaming 4.75% 1/12/2027	3,840,764	0.04
USD 568,000	BP Capital Markets America 3.001% 17/3/2052	417,602	0.01
USD 612,000	Bristol-Myers Squibb 1.45% 13/11/2030	502,481	0.01
USD 946,000	Bristol-Myers Squibb 2.55% 13/11/2050	662,120	0.01
USD 599,000	Bristol-Myers Squibb 3.25% 27/2/2027	588,021	0.01
USD 1,000,000	Bristol-Myers Squibb 3.9% 20/2/2028	995,631	0.01
USD 752,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	647,428	0.01
USD 5,412,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	4,359,206	0.05
USD 2,077,000	Broadcom 3.75% 15/2/2051	1,549,991	0.02
USD 82,000	Buckeye Partners 3.95% 1/12/2026	73,377	0.00
USD 1,477,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	1,384,289	0.02
USD 1,500,000	Buckeye Partners 4.35% 15/10/2024	1,445,571	0.02
USD 1,584,492	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.454% 10/3/2033	1,527,176	0.02
USD 2,604,935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,398,268	0.03
USD 13,358,641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.717% 10/3/2033	12,088,897	0.13
USD 573,000	BCP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	493,193	0.01
USD 2,156,000	BCP Trust 2017-CC 3.67% 13/8/2037	1,742,589	0.02
USD 470,000	BCP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	409,748	0.01
USD 945,000	BCP Trust 2017-GM 3.539% 13/6/2039	803,650	0.01
USD 1,864,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	1,823,847	0.02
USD 3,368,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027	3,319,055	0.04
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority 5% 21/11/2045	1,972,899	0.02
USD 847,000	California Resources 7.125% 1/2/2026	834,638	0.01
USD 1,655,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,180,612	0.02
USD 3,130,000	California State University 2.975% 1/11/2051	2,417,855	0.03
USD 250,000	Callon Petroleum 7.5% 15/6/2030	231,844	0.00
USD 9,175,000	Calpine 4.5% 15/2/2028	8,372,064	0.09
USD 1,299,000	Calpine 5.125% 15/3/2028	1,157,460	0.01
USD 1,980,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 4.541% 15/12/2037	1,926,095	0.02
USD 1,208,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 5.641% 15/12/2037	1,168,718	0.01
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 3.074% 25/1/2036	421,003	0.01
USD 1,042,223	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 2.594% 25/8/2036	994,596	0.01
USD 378,867	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 2.604% 25/10/2036	365,948	0.00
USD 2,720,607	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 2.704% 25/2/2037	2,603,043	0.03
USD 425,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029	319,481	0.00
EUR 1,768,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	1,494,577	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 572,000	CCO / CCO Capital 5% 1/2/2028	526,915	0.01
USD 425,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	414,056	0.00
USD 1,270,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,176,782	0.01
USD 65,000	Cedar Fair 5.25% 15/7/2029	59,367	0.00
USD 65,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.375% 15/4/2027	61,326	0.00
USD 3,265,000	Celanese US 5.9% 5/7/2024	3,294,307	0.04
USD 3,590,000	Centene 2.45% 15/7/2028	3,032,324	0.03
USD 2,405,000	Centene 2.625% 1/8/2031	1,928,968	0.02
USD 2,444,000	Centene 4.25% 15/12/2027	2,319,782	0.03
USD 10,347,000	Centennial Resource Production 5.375% 15/1/2026	9,534,398	0.11
USD 1,448,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	1,399,275	0.02
USD 500,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	478,100	0.01
USD 2,210,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 4% 1/11/2046	2,188,807	0.02
USD 1,155,000	Central Puget Sound Regional Transit Authority 5% 1/11/2033	1,346,263	0.02
USD 9,849,000	Century Communities 6.75% 1/6/2027	9,662,632	0.11
USD 5,181,244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1.86% 10/1/2048	251,207	0.00
USD 5,189,832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.854% 10/5/2058	121,494	0.00
USD 1,710,609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 5.001% 10/5/2058	1,607,358	0.02
USD 1,462,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4.199% 15/6/2050	1,375,505	0.02
USD 940,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 4.236% 15/2/2033	930,857	0.01
USD 1,140,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 4.69% 15/2/2033	1,119,322	0.01
USD 1,080,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 5.295% 15/2/2033	1,057,379	0.01
USD 350,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2018-TAN 6.661% 15/2/2033	339,066	0.00
USD 1,634,000	Change Healthcare / Change Healthcare Finance 5.75% 1/3/2025	1,603,224	0.02
USD 326,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	299,345	0.00
USD 612,000	Charles Schwab 1.65% 11/3/2031	496,730	0.01
USD 583,000	Charles Schwab 3.45% 13/2/2026	576,947	0.01
USD 297,000	Charles Schwab 4.2% 24/3/2025	299,338	0.00
USD 1,000,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	825,945	0.01
USD 4,576,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.8% 1/4/2031	3,728,640	0.04
USD 838,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.5% 1/6/2041	587,418	0.01
USD 710,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.7% 1/4/2051	482,326	0.00
USD 1,789,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.85% 1/4/2061	1,171,322	0.01
USD 844,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.9% 1/6/2052	588,082	0.01
USD 1,784,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	1,687,445	0.02
USD 1,250,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	1,248,714	0.01
USD 9,792,481	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	4,916,017	0.06
USD 1,142,000	Cheever Escrow Issuer 7.125% 1/10/2027	1,114,798	0.01
EUR 100,000	Chemours 4% 15/5/2026	93,521	0.00
USD 1,450,000	Cheniere Energy 4.625% 15/10/2028	1,397,713	0.02
USD 219,000	Cheniere Energy Partners 3.25% 31/1/2032	176,567	0.00
USD 905,000	Cheniere Energy Partners 4.5% 1/10/2029	831,582	0.01
USD 1,309,000	Chesapeake Energy 5.5% 1/2/2026	1,270,901	0.01
USD 179,000	Chesapeake Energy 5.875% 1/2/2029	171,215	0.00
USD 2,100,306	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 1.819% 25/4/2046	705,750	0.01
USD 371,326	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 2.844% 25/4/2046	351,968	0.00
USD 5,438,578	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6.5% 25/9/2037	2,596,072	0.03
USD 68,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	61,477	0.00
USD 82,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	78,749	0.00
USD 490,000	Cigna 1.25% 15/3/2026	442,771	0.00
USD 435,000	Cigna 3.4% 15/3/2051	334,741	0.00
USD 1,087,496	Citicorp Mortgage Trust Series 2007-9 6.25% 25/12/2037	951,692	0.01
USD 1,094,104	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6.5% 25/6/2038	883,332	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 1,427,000	Citigroup 0.981% 1/5/2025	1,345,993	0.01
USD 4,297,000	Citigroup 2.014% 25/1/2026	4,043,132	0.04
USD 6,950,000	Citigroup 3.07% 24/2/2028	6,453,678	0.07
USD 1,933,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,868,948	0.02
USD 1,867,000	Citigroup 3.352% 24/4/2025	1,831,080	0.02
USD 124,000	Citigroup 3.4% 1/5/2026	120,003	0.00
USD 1,560,000	Citigroup 3.52% 27/10/2028	1,456,360	0.02
USD 1,503,000	Citigroup 4.14% 24/5/2025	1,494,875	0.02
USD 1,734,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	1,663,453	0.02
USD 851,000	Citigroup 5.316% 26/3/2041	859,901	0.01
USD 1,622,121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5.258% 10/3/2047	1,599,264	0.02
USD 821,302	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 4.57% 10/2/2048	784,545	0.01
USD 20,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P3 5.051% 15/4/2049	18,521	0.00
USD 3,881,357	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 2.644% 25/5/2037	2,887,187	0.03
USD 2,521,975	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 2.614% 25/7/2045	1,854,214	0.02
USD 2,149,550	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 2.604% 25/12/2036	1,231,178	0.01
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 3.149% 25/3/2037	2,607,681	0.03
USD 597,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4.25% 25/2/2054	551,221	0.01
USD 276,908	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	249,050	0.00
USD 4,405,000	City of Boston MA 5% 1/11/2037	5,154,538	0.06
USD 1,735,000	City of Charleston Waterworks & Sewer System Revenue 5% 1/1/2052	1,950,329	0.02
USD 2,955,000	City of Charlotte NC Airport Revenue 3% 1/7/2046	2,314,329	0.03
USD 1,440,000	City of Charlotte NC Airport Revenue 4% 1/7/2051	1,325,137	0.01
USD 2,150,000	City of Los Angeles Department of Airports 5% 15/5/2048	2,233,495	0.03
USD 475,000	City of Philadelphia PA Airport Revenue 5% 1/7/2042	487,792	0.01
USD 1,055,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,392,793	0.02
USD 1,885,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2037	2,010,849	0.02
USD 3,015,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2046	3,134,282	0.04
USD 9,965,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2047	10,194,127	0.11
USD 1,560,000	City of Salt Lake City UT Public Utilities Revenue 5% 1/2/2052	1,734,788	0.02
USD 1,375,000	City of Tampa FL Water & Wastewater System Revenue 5% 1/10/2052	1,527,079	0.02
USD 177,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	168,620	0.00
USD 206,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	184,584	0.00
USD 612,000	Clorox 1.8% 15/5/2030	502,426	0.01
USD 2,000,000	Clorox 3.9% 15/5/2028	1,973,199	0.02
USD 612,000	Coca-Cola 1.375% 15/3/2031	502,189	0.01
USD 946,000	Coca-Cola 2.5% 15/3/2051	682,882	0.01
USD 329,000	Coca-Cola 3% 5/3/2051	262,245	0.00
USD 677,000	Colgate Energy Partners III 5.875% 1/7/2029	628,398	0.01
USD 379,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	378,748	0.00
USD 2,490,000	Colorado Health Facilities Authority 4% 15/11/2046	2,359,379	0.03
USD 612,000	Comcast 1.5% 15/2/2031	493,364	0.00
USD 1,500,000	Comcast 2.35% 15/1/2027	1,401,810	0.02
USD 7,001,000	Comcast 2.45% 15/8/2052	4,627,639	0.05
USD 563,000	Comcast 2.937% 1/11/2056	389,198	0.00
USD 1,126,000	Comcast 2.987% 1/11/2063	763,839	0.01
USD 1,380,000	Comcast 3.15% 1/3/2026	1,344,492	0.01
USD 1,750,000	Comcast 3.3% 1/2/2027	1,695,313	0.02
USD 156,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	151,166	0.00
USD 980,000	Comcast 3.95% 15/10/2025	978,438	0.01
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 4.54% 10/8/2030	94,441	0.00
USD 520,573	COMM 2013-GAM 3.367% 10/2/2028	513,771	0.01
USD 1,740,000	COMM 2013-WWP Mortgage Trust 3.898% 10/3/2031	1,740,684	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 711,283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4.82% 10/2/2047	697,005	0.01
USD 1,265,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4.514% 10/9/2047	1,214,808	0.01
USD 2,691,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 4.487% 10/8/2048	2,586,141	0.03
USD 4,115,626	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0.966% 10/8/2048	80,668	0.00
USD 1,024,500	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4.678% 10/8/2048	943,345	0.01
USD 1,316,780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3.774% 10/10/2048	1,289,258	0.01
USD 111,320,422	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0.145% 10/10/2036	312,810	0.00
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3.285% 10/10/2036	902,092	0.01
USD 2,910,275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1.75% 10/5/2051	224,766	0.00
USD 5,105,000	Commercial Metals 4.125% 15/1/2030	4,469,735	0.05
USD 1,857,000	Commercial Metals 4.375% 15/3/2032	1,576,370	0.02
USD 425,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	409,698	0.00
USD 295,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	223,053	0.00
USD 1,880,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	2,070,839	0.02
USD 235,000	Commonwealth of Massachusetts 5.456% 1/12/2039	259,458	0.00
USD 4,513,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	4,140,626	0.05
USD 4,489,000	Connecticut Avenue Trust 2022-R01 5.333% 25/12/2041	4,143,674	0.05
USD 1,980,000	Connecticut State Health & Educational Facilities Authority 5% 1/7/2045	2,018,548	0.02
USD 147,721	Conseco Finance 6.28% 1/9/2030	148,339	0.00
USD 522,516	Conseco Finance 6.63% 1/6/2030	500,107	0.01
USD 238,920	Conseco Finance 6.83% 1/4/2030	232,855	0.00
USD 2,023,276	Conseco Finance 6.98% 1/9/2030	1,926,348	0.02
USD 460,356	Conseco Finance 7.21% 15/1/2029	438,529	0.01
USD 819,777	Conseco Finance 7.5% 1/3/2030	366,135	0.00
USD 802,188	Conseco Finance 7.53% 15/3/2028	801,885	0.01
USD 764,360	Conseco Finance 7.86% 1/3/2030	354,549	0.00
USD 1,781,141	Conseco Finance Securitizations 7.96% 1/5/2031	623,771	0.01
USD 1,191,186	Conseco Finance Securitizations 8.06% 1/9/2029	297,297	0.00
USD 3,241,702	Conseco Finance Securitizations 8.2% 1/5/2031	1,168,513	0.01
USD 1,472,272	Conseco Finance Securitizations 8.31% 1/5/2032	352,925	0.00
USD 415,000	Conservation Fund A Nonprofit 3.474% 15/12/2029	379,613	0.00
USD 850,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	980,486	0.01
USD 612,000	Costco Wholesale 1.75% 20/4/2032	506,692	0.01
USD 291,000	Cottage Health Obligated 3.304% 1/11/2049	231,445	0.00
EUR 2,269,000	Coty 3.875% 15/4/2026*	2,116,391	0.02
EUR 300,000	Coty 4.75% 15/4/2026*	272,655	0.00
USD 1,679,115	Countrywide Asset-Backed Certificates 2.759% 25/5/2037	1,299,867	0.02
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 2.879% 25/11/2036	4,427,712	0.05
USD 650,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/4/2029	750,476	0.01
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2030	423,470	0.00
USD 295,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2031	350,185	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2032	428,300	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2033	424,460	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2034	421,373	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2035	419,184	0.00
USD 360,000	County of Anne Arundel MD 5% 1/10/2036	417,807	0.00
USD 850,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	745,493	0.01
USD 5,000,000	County of Fairfax VA Sewer Revenue 4% 15/7/2051	5,057,188	0.06
USD 360,000	County of Guilford NC 5% 1/3/2030	419,977	0.00
USD 2,090,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	1,816,400	0.02
USD 795,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.454% 1/10/2030	739,788	0.01
USD 1,475,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 4.062% 1/10/2031	1,425,692	0.02
USD 1,725,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 5% 1/10/2038	1,787,959	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,475,000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 4% 1/10/2051	2,342,080	0.03
USD 9,160,000	County of Montgomery MD 4% 1/12/2044	8,538,568	0.10
USD 769,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	650,189	0.01
USD 3,000,000	Cox Communications 1.8% 1/10/2030	2,392,671	0.03
USD 504,482	Credit Suisse ABS Repackaging Trust 2013-A 2.5% 25/1/2030	488,533	0.01
USD 3,418	Credit Suisse First Boston Mortgage 4.877% 15/4/2037	3,318	0.00
USD 7,508,474	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6.5% 27/10/2037	3,341,956	0.04
USD 1,504,008	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 1.964% 25/7/2037	1,057,466	0.01
USD 303,734	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3.022% 25/12/2036	259,791	0.00
USD 3,420,338	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.056% 25/9/2036	226,301	0.00
USD 648,861	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.25% 25/10/2036	624,145	0.01
USD 612,000	Crown Castle 2.5% 15/7/2031	506,418	0.01
USD 473,000	Crown Castle 3.25% 15/1/2051	342,558	0.00
USD 1,000,000	Crown Castle 3.3% 1/7/2030	893,887	0.01
USD 1,503,000	Crown Castle 4.3% 15/2/2029	1,454,448	0.02
USD 1,298,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	1,280,412	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0.26% 15/11/2050	219,192	0.00
USD 887,395	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust 5.087% 15/11/2051	803,494	0.01
USD 2,494,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.898% 15/8/2051	2,313,033	0.03
USD 563,000	CSC 5.25% 1/6/2024	550,616	0.01
USD 497,000	CSC 5.5% 15/4/2027	470,218	0.00
USD 271,000	CSC 6.5% 1/2/2029	252,962	0.00
USD 116,659,107	CSMC 2014-USA OA 0.186% 15/9/2037	257,817	0.00
USD 770,000	CSMC 2017-TIME 3.646% 13/11/2039	689,796	0.01
USD 527,909	CSMC Series 2014-4R 2.459% 27/2/2036	551,280	0.01
USD 1,312,054	CSMC Series 2015-4R 2.409% 27/10/2036	964,354	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 3.341% 15/12/2030	786,166	0.01
USD 946,000	CSX 2.5% 15/5/2051	643,802	0.01
USD 2,367,000	CVS Health 1.75% 21/8/2030	1,924,109	0.02
USD 4,609,000	CVS Health 2.7% 21/8/2040	3,375,514	0.04
USD 500,000	CVS Health 2.875% 1/6/2026	478,435	0.01
USD 2,150,000	CVS Health 3.75% 1/4/2030	2,027,230	0.02
USD 713,000	CVS Health 5.05% 25/3/2048	694,329	0.01
USD 4,259,221	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 4.504% 25/4/2036	3,777,691	0.04
USD 2,958,237	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 6.547% 25/5/2036	2,445,136	0.03
USD 27,377	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 2.604% 25/9/2046	27,266	0.00
USD 863,451	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 2.704% 25/12/2036	803,505	0.01
USD 6,137,834	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 2.894% 25/3/2037	4,931,034	0.06
USD 260,112	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 2.661% 15/3/2034	250,051	0.00
USD 196,729	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 6.019% 25/1/2029	295,878	0.00
USD 87,778	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6.155% 25/6/2035	108,133	0.00
USD 1,072,499	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 2.581% 15/5/2035	1,053,944	0.01
USD 58,184	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 2.581% 15/5/2035	56,035	0.00
USD 189,379	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 2.571% 15/5/2035	186,025	0.00
USD 967,084	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 2.571% 15/5/2036	924,694	0.01
USD 449,055	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 2.541% 15/11/2036	431,194	0.01
USD 650,000	Dallas Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	526,750	0.00
USD 417,000	Dana 4.25% 1/9/2030	338,501	0.01
USD 946,000	Danaher 2.8% 10/12/2051	686,901	0.01
USD 162,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	158,713	0.00
USD 3,655,051	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 3.669% 15/5/2035	3,573,159	0.04
USD 3,207,307	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 4.369% 15/5/2035	3,076,296	0.03
USD 4,389,268	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	166,573	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 6,941,235	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	6,408,742	0.07
USD 3,439,265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	3,132,821	0.04
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.648% 10/10/2034	1,004,338	0.01
USD 2,072,000	Dell International / EMC 3.45% 15/12/2051	1,394,921	0.02
USD 1,412,000	Dell International / EMC 5.3% 1/10/2029	1,407,810	0.02
USD 2,747,000	Dell International / EMC 6.02% 15/6/2026	2,861,757	0.03
USD 3,505	Deutsche ALT-A 5.674% 27/1/2037	3,532	0.00
USD 4,749,724	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE 2.784% 25/8/2047	4,964,899	0.06
USD 174,252	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.364% 25/7/2036	151,046	0.00
USD 272,988	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.51% 25/7/2036	236,602	0.00
USD 562,000	Discovery Communications 4% 15/9/2055	378,430	0.00
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	937,486	0.01
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	936,297	0.01
USD 1,545,000	DocuSign 0% 15/1/2024	1,454,739	0.02
EUR 1,600,000	Dow Chemical 1.875% 15/3/2040	1,110,632	0.01
USD 612,000	Duke Realty 2.25% 15/1/2032	510,674	0.01
USD 3,989,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	3,914,446	0.04
USD 326,000	eBay 1.9% 11/3/2025	308,122	0.00
USD 524,000	Elanco Animal Health 6.4% 28/8/2028	491,250	0.01
USD 3,426,000	Elevance Health 1.5% 15/3/2026	3,133,866	0.03
USD 217,000	Elevance Health 2.375% 15/1/2025	208,397	0.00
USD 1,750,000	Elevance Health 2.875% 15/9/2029	1,581,326	0.02
USD 690,000	Elevance Health 3.125% 15/5/2050	524,015	0.01
USD 715,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	694,411	0.01
EUR 3,840,000	Eli Lilly 1.375% 14/9/2061	2,137,574	0.02
USD 946,000	Eli Lilly 2.25% 15/5/2050	664,162	0.01
USD 300,000	Eli Lilly 3.1% 15/5/2027	293,218	0.00
USD 2,745,000	Eli Lilly 3.375% 15/3/2029	2,671,735	0.03
USD 1,260,000	Elmwood CLO 15 1.981% 22/4/2035	1,226,705	0.01
USD 2,750,000	Elmwood CLO 15 4.311% 22/4/2035	2,531,735	0.03
GBP 791,000	Encore Capital 4.25% 1/6/2028	749,851	0.01
EUR 1,725,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025	1,673,859	0.02
GBP 600,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026	654,465	0.01
USD 415,000	Endeavor Energy Resources / EER Finance 5.75% 30/1/2028	411,140	0.00
USD 1,000,000	Enterprise Products Operating 3.9% 15/2/2024	997,811	0.01
USD 2,750,000	Equinix 1% 15/9/2025	2,483,945	0.03
USD 2,102,000	Equinix 2.5% 15/5/2031	1,741,339	0.02
USD 690,000	Equinix 2.625% 18/11/2024	666,737	0.01
USD 2,515,000	Equinix 2.95% 15/9/2051	1,719,161	0.02
USD 473,000	Equinix 3% 15/7/2050	326,134	0.00
USD 1,599,000	Equinix 3.2% 18/11/2029	1,441,334	0.02
USD 1,118,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	1,048,406	0.01
USD 612,000	Expedia 2.95% 15/3/2031	514,394	0.01
USD 834,876	Fannie Mae Pool 2% 1/9/2050	724,016	0.01
USD 371,282	Fannie Mae Pool 2% 1/10/2050	322,049	0.00
USD 10,068,891	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2051	9,083,104	0.10
USD 5,874,814	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2050	5,509,155	0.06
USD 3,758,080	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	3,512,442	0.04
USD 1,082,547	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	1,014,390	0.01
USD 1,589,587	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	1,482,616	0.02
USD 1,583,568	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2051	1,477,166	0.02
USD 3,563,687	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2051	3,335,997	0.04
USD 1,364,225	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2052	1,277,130	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 20,246,861	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2052	18,955,053	0.21
USD 2,260,246	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2052	2,108,346	0.02
USD 3,930,888	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	3,834,710	0.04
USD 1,864,044	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	1,799,447	0.02
USD 81,764	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	79,114	0.00
USD 1,406,636	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	1,358,304	0.02
USD 3,538,074	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	3,418,287	0.04
USD 11,335,149	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2050	10,953,136	0.12
USD 65,179	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2051	62,768	0.00
USD 51,380	Fannie Mae Pool 3.5% 1/6/2051	49,479	0.00
USD 55,272	Fannie Mae Pool 3.5% 1/7/2051	53,234	0.00
USD 54,990	Fannie Mae Pool 3.5% 1/8/2051	52,956	0.00
USD 13,867,102	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	13,401,766	0.15
USD 7,111,367	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	6,842,461	0.08
USD 3,906,530	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	3,748,839	0.04
USD 11,357,223	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	10,966,443	0.12
USD 7,213,403	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	6,947,347	0.08
USD 6,188,490	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	5,980,823	0.07
USD 387,291	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2047	385,575	0.00
USD 697,328	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	694,802	0.01
USD 801,250	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	798,267	0.01
USD 572,884	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	571,828	0.01
USD 575,161	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	571,740	0.01
USD 1,654,967	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	1,649,758	0.02
USD 4,605,476	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2049	4,576,053	0.05
USD 15,520,008	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	15,473,052	0.17
USD 4,799,071	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2050	4,728,898	0.05
USD 269,544	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	267,138	0.00
USD 1,809,612	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	1,792,213	0.02
USD 6,389,097	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	6,365,145	0.07
USD 1,950,191	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	1,928,161	0.02
USD 2,514,810	Fannie Mae Pool 4% 1/8/2050	2,493,807	0.03
USD 379,067	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	375,201	0.00
USD 39,662,483	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	39,362,602	0.44
USD 44,974,070	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	44,572,703	0.50
USD 5,779,390	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2051	5,709,043	0.06
USD 118,279,830	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2051	116,881,546	1.30
USD 43,299,351	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	42,788,358	0.48
USD 555,297	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2052	555,194	0.01
USD 780,239	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	779,919	0.01
USD 1,497,100	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2052	1,477,518	0.02
USD 542,269	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2047	549,435	0.01
USD 52,396	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	52,777	0.00
USD 677,493	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2048	680,160	0.01
USD 8,105,734	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2049	8,171,958	0.09
USD 902,047	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2049	910,483	0.01
USD 381,857	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2049	384,807	0.00
USD 1,500,411	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2049	1,516,274	0.02
USD 526,213	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2049	524,395	0.01
USD 334,928	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2049	337,988	0.00
USD 1,706,412	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2049	1,713,760	0.02
USD 759,130	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2050	757,979	0.01
USD 927,185	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2050	933,554	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,037,600	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2050	2,049,662	0.02
USD 2,827,728	Fannie Mae Pool 4.5% 1/9/2050	2,857,571	0.03
USD 1,244,431	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2050	1,246,957	0.01
USD 19,195,574	Fannie Mae Pool 4.5% 1/12/2050	19,257,578	0.21
USD 3,778,030	Fannie Mae Pool 4.5% 1/1/2051	3,774,678	0.04
USD 2,276,045	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2052	2,322,005	0.03
USD 1,243,531	Fannie Mae REMICS 3% 25/2/2052	147,367	0.00
USD 3,460,454	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	673,548	0.01
USD 11,853,995	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	2,286,070	0.03
USD 2,079,182	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	399,709	0.00
USD 3,429,169	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	666,111	0.01
USD 4,651,821	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	873,867	0.01
USD 1,610,000	FedEx 3.25% 1/4/2026	1,575,085	0.02
USD 242,000	Fidelity National Information Services 1.15% 1/3/2026	215,131	0.00
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 3.494% 25/10/2034	750,977	0.01
USD 1,477,450	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 2.684% 25/10/2036	1,062,443	0.01
USD 866,415	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 2.764% 25/10/2036	625,491	0.01
USD 5,485,604	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 2.584% 25/3/2037	3,164,228	0.04
USD 2,552,000	Fiserv 3.2% 1/7/2026	2,433,872	0.03
USD 369,000	Fiserv 4.4% 1/7/2049	322,659	0.00
USD 7,341,000	Five Point Operating / Five Point Capital 7.875% 15/11/2025	6,417,852	0.07
USD 3,228,266	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4.916% 25/10/2048	2,983,781	0.03
USD 135,000	Ford Foundation/The 2.415% 1/6/2050	96,204	0.00
USD 1,144,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032	898,223	0.01
USD 3,642,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	3,579,321	0.04
USD 4,381,000	Ford Motor Credit 3.35% 1/11/2022	4,385,359	0.05
USD 1,837,000	Ford Motor Credit 5.584% 18/3/2024	1,830,985	0.02
USD 739,000	Forestar 3.85% 15/5/2026	624,990	0.01
USD 5,361,000	Forestar 5% 1/3/2028	4,449,546	0.05
USD 18,670,061	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.943% 25/5/2029	784,423	0.01
USD 13,124,339	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.015% 25/6/2029	641,535	0.01
USD 30,127,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.024% 25/6/2029	1,591,618	0.02
USD 6,939,170	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.12% 25/10/2030	446,570	0.01
USD 3,380,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.467% 25/12/2029	239,636	0.00
USD 350,978	Freddie Mac Pool 2% 1/8/2050	304,468	0.00
USD 5,028,375	Freddie Mac Pool 3% 1/6/2051	4,690,376	0.05
USD 7,541,399	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	7,080,964	0.08
USD 1,100,596	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2051	1,029,622	0.01
USD 10,532,609	Freddie Mac Pool 3% 1/9/2051	9,859,672	0.11
USD 4,736,813	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	4,423,056	0.05
USD 2,996,547	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	2,811,701	0.03
USD 4,126,681	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	3,851,715	0.04
USD 13,674,690	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	12,823,206	0.14
USD 6,250,523	Freddie Mac Pool 3% 1/12/2051	5,856,980	0.07
USD 13,837,091	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	12,934,290	0.14
USD 19,287,418	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	18,056,642	0.20
USD 5,133,291	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	4,832,396	0.05
USD 27,387,795	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	25,699,868	0.29
USD 6,786,581	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	6,330,213	0.07
USD 56,188,093	Freddie Mac Pool 3% 1/3/2052	52,640,493	0.59
USD 68,086	Freddie Mac Pool 3.5% 1/6/2051	65,568	0.00
USD 46,590	Freddie Mac Pool 3.5% 1/8/2051	44,866	0.00
USD 1,112,149	Freddie Mac Pool 4% 1/6/2049	1,106,144	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 15,225,259	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	15,169,304	0.17
USD 8,704,668	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	8,590,672	0.10
USD 1,910,658	Freddie Mac Pool 4% 1/4/2052	1,885,668	0.02
USD 164,512	Freddie Mac Pool 4.5% 1/9/2048	165,324	0.00
USD 3,945,916	Freddie Mac Pool 4.5% 1/1/2051	3,984,795	0.04
USD 1,127,906	Freddie Mac Pool 4.5% 1/2/2051	1,132,243	0.01
USD 1,409,208	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,412,000	0.02
USD 880,387	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	883,501	0.01
USD 1,525,971	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,537,016	0.02
USD 1,499,006	Freddie Mac Pool 4.5% 1/4/2052	1,515,405	0.02
USD 1,419,781	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	203,354	0.00
USD 1,544,723	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	229,197	0.00
USD 1,967,444	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	341,640	0.00
USD 3,569,518	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	540,623	0.01
USD 1,406,273	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	192,564	0.00
USD 2,960,216	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	490,001	0.01
USD 3,848,813	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	547,061	0.01
USD 1,876,604	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	292,507	0.00
USD 4,095,799	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	623,518	0.01
USD 6,392,021	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	972,527	0.01
USD 2,655,888	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/9/2048	493,076	0.01
USD 1,443,304	Freddie Mac REMICS 4% 25/7/2049	225,060	0.00
USD 1,164,120	Freddie Mac REMICS 4% 25/9/2050	221,750	0.00
USD 5,457,810	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	1,015,168	0.01
USD 1,502,871	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/6/2050	280,891	0.00
USD 1,626,412	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/10/2050	346,522	0.00
USD 490,000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5 6.983% 25/10/2050	496,568	0.01
USD 4,655,448	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 5.583% 25/1/2042	4,250,643	0.05
USD 318,575	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 4.894% 25/12/2042	318,727	0.00
USD 1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 6.894% 25/3/2030	1,604,904	0.02
USD 402,171	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 10.394% 25/5/2025	407,423	0.00
USD 241,961	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 13.944% 25/1/2025	245,843	0.00
USD 2,286,000	Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	2,023,339	0.02
USD 2,002,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	1,740,075	0.02
USD 2,167,000	Freeport-McMoRan 3.875% 15/3/2023	2,167,940	0.02
USD 782,435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3.713% 25/10/2027	736,674	0.01
USD 1,262,121	FREMF 2018-K732 Mortgage Trust 4.188% 25/5/2025	1,230,812	0.01
USD 4,972,000	FREMF 2018-KW05 Trust 3.786% 25/4/2028	4,338,858	0.05
USD 83,491,759	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0.1% 25/1/2029	365,435	0.00
USD 3,038,646	Fremont Home Loan Trust 2006-3 2.724% 25/2/2037	2,356,433	0.03
USD 1,355,000	Fresno Unified School District 4% 1/8/2046	1,307,780	0.01
USD 3,211,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2,825,038	0.03
USD 3,575,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	3,341,724	0.04
USD 4,712,000	Frontier Communications 6.75% 1/5/2029	4,086,223	0.04
USD 2,915,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	3,013,673	0.03
USD 4,530,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	4,319,785	0.05
USD 1,125,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	1,032,930	0.01
USD 10,309,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 4.58% 19/8/2037	10,237,290	0.11
USD 776,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028	709,252	0.01
USD 2,501,562	GAM Resecuritization Trust 2018-B 3.5% 27/8/2051	2,347,626	0.03
USD 226,000	GATX 3.5% 15/3/2028	209,505	0.00
USD 1,770,000	General Mills 4.2% 17/4/2028	1,766,978	0.02
USD 3,265,000	General Motors 5.2% 1/4/2045	2,780,141	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	General Motors 5.4% 2/10/2023	2,021,350	0.02
USD 2,890,000	General Motors 5.4% 15/10/2029	2,826,018	0.03
USD 1,309,000	General Motors 5.95% 1/4/2049	1,228,349	0.01
EUR 822,000	General Motors Financial 0.6% 20/5/2027	696,341	0.01
USD 3,500,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	3,115,437	0.03
USD 612,000	General Motors Financial 2.35% 8/1/2031	479,504	0.01
USD 3,995,000	General Motors Financial 2.7% 20/8/2027	3,558,705	0.04
USD 2,500,000	General Motors Financial 3.8% 7/4/2025	2,436,512	0.03
USD 1,400,000	General Motors Financial 4.35% 9/4/2025	1,381,832	0.02
USD 1,810,000	George Washington University/The 4.126% 15/9/2048	1,672,109	0.02
USD 860,000	Georgia State Road & Tollway Authority 4% 15/7/2038	880,394	0.01
USD 269,000	Georgia-Pacific 3.6% 1/3/2025	265,153	0.00
USD 1,650,000	Georgia-Pacific 3.734% 15/7/2023	1,647,910	0.02
USD 1,600,000	Gilead Sciences 1.2% 1/10/2027	1,386,333	0.02
USD 612,000	Gilead Sciences 1.65% 1/10/2030	501,272	0.01
USD 2,885,000	Gilead Sciences 2.8% 1/10/2050	2,006,519	0.02
USD 2,000,000	Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026	1,967,602	0.02
USD 1,174,000	Global Payments 2.65% 15/2/2025	1,119,142	0.01
USD 650,000	Global Payments 3.2% 15/8/2029	571,521	0.01
USD 300,000	Global Payments 3.75% 1/6/2023	299,704	0.00
USD 1,145,000	Global Payments 4% 1/6/2023	1,145,297	0.01
USD 389,000	Global Payments 4.15% 15/8/2049	300,454	0.00
USD 950,000	GLP Capital / GLP Financing II 3.35% 1/9/2024	908,815	0.01
USD 1,086,000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	946,675	0.01
USD 904,000	Golden Entertainment 7.625% 15/4/2026	916,557	0.01
USD 840,000	Golden State Tobacco Securitization 3.487% 1/6/2036	697,618	0.01
USD 424,000	Goldman Sachs 0.855% 12/2/2026	386,469	0.00
EUR 10,300,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029	8,520,225	0.09
USD 3,340,000	Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,978,484	0.03
USD 9,310,000	Goldman Sachs 1.217% 6/12/2023	9,010,945	0.10
EUR 5,600,000	Goldman Sachs 1.25% 7/2/2029	4,792,304	0.05
USD 1,709,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,522,171	0.02
USD 6,500,000	Goldman Sachs 1.542% 10/9/2027	5,723,060	0.06
USD 2,818,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	2,511,666	0.03
USD 2,035,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	1,618,774	0.02
USD 612,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032	498,132	0.01
USD 1,558,000	Goldman Sachs 2.908% 21/7/2042	1,149,569	0.01
USD 4,633,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	4,396,228	0.05
USD 5,170,841	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	4,421,378	0.05
USD 3,710,431	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	3,196,436	0.04
USD 6,133,000	GoTo 5.5% 1/9/2027	4,476,080	0.05
USD 4,445,262	Government National Mortgage Association 0.312% 16/10/2054	63,935	0.00
USD 6,246,128	Government National Mortgage Association 0.538% 16/3/2055	122,890	0.00
USD 3,762,108	Government National Mortgage Association 0.58% 16/9/2053	53,349	0.00
USD 662,128	Government National Mortgage Association 0.58% 16/10/2056	18,969	0.00
USD 2,925,300	Government National Mortgage Association 0.602% 16/9/2055	72,877	0.00
USD 648,693	Government National Mortgage Association 0.695% 16/8/2057	19,884	0.00
USD 406,887	Government National Mortgage Association 0.763% 16/2/2050	10,667	0.00
USD 3,224,540	Government National Mortgage Association 0.774% 16/12/2057	123,883	0.00
USD 3,673,644	Government National Mortgage Association 2.5% 20/9/2050	453,360	0.01
USD 15,761,616	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	2,214,948	0.03
USD 3,155,809	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	407,374	0.00
USD 1,080,863	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	131,333	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,434,980	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	310,187	0.00
USD 3,858,127	Government National Mortgage Association 2.5% 20/12/2050	487,188	0.01
USD 830,475	Government National Mortgage Association 2.5% 20/6/2051	104,549	0.00
USD 2,294,418	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	287,795	0.00
USD 1,374,028	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	189,815	0.00
USD 2,038,108	Government National Mortgage Association 3.5% 20/1/2051	346,994	0.00
USD 3,097,718	Government National Mortgage Association 3.5% 20/10/2051	416,157	0.01
USD 1,536,570	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	197,818	0.00
USD 1,374,758	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	185,794	0.00
USD 2,801,771	Government National Mortgage Association 3.5% 20/12/2051	372,228	0.00
USD 2,066,852	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	337,152	0.00
USD 1,269,204	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	184,099	0.00
USD 3,017,703	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	455,490	0.01
USD 1,462,000	Grand Canyon University 3.25% 1/10/2023	1,443,725	0.02
USD 2,102,000	Grand Canyon University 5.125% 1/10/2028	1,953,206	0.02
USD 695,000	Grant County Public Utility District No 2 Priest Rapids Hydroelectric Project 4.584% 1/1/2040	670,969	0.01
EUR 316,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029*	268,961	0.00
USD 641,594	Greenpoint Manufactured Housing 8.29% 15/12/2029	644,446	0.01
USD 1,025,123	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 2.859% 25/3/2036	988,090	0.01
USD 750,000	GS Mortgage II 3.573% 10/12/2030	749,147	0.01
USD 440,000	GS Mortgage II 3.591% 10/9/2037	409,234	0.01
USD 25,000,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0.395% 3/5/2032	160,042	0.00
USD 2,452,265	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.366% 3/5/2032	2,449,886	0.03
USD 818,000	GS Mortgage Trust 2012-GCJ9 4.448% 10/11/2045	813,515	0.01
USD 110,000	GS Mortgage Trust 2014-GC20 4.529% 10/4/2047	105,620	0.00
USD 730,000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3.932% 10/10/2035	674,159	0.01
USD 2,170,000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2.856% 10/5/2034	2,151,631	0.02
USD 619,279	GS Mortgage Trust 2017-GS7 3% 10/8/2050	499,956	0.01
USD 10,123,239	GSAA Home Equity Trust 2006-5 2.804% 25/3/2036	3,859,477	0.04
USD 428,005	GSAA Home Equity Trust 2007-2 5.917% 25/3/2037	99,520	0.00
USD 940,857	GSAMP Trust 2007-HI 2.644% 25/1/2047	522,142	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 5.819% 25/2/2047	1,911,740	0.02
USD 2,862,000	GSK Consumer Healthcare Capital US 3.024% 24/3/2024	2,800,705	0.03
USD 4,705,000	GSK Consumer Healthcare Capital US 3.375% 24/3/2027	4,439,473	0.05
USD 845,447	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 2.794% 25/1/2035	757,912	0.01
USD 3,173,700	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 2.794% 25/3/2035	3,074,105	0.03
USD 803,955	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1 2.794% 25/1/2036	676,245	0.01
USD 1,686,608	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6.5% 25/8/2036	639,922	0.01
USD 584,057	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5.5% 25/1/2037	704,451	0.01
USD 4,131,753	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2.322% 25/6/2047	2,800,047	0.03
USD 1,734,000	GUSAP III 4.25% 21/1/2030	1,619,300	0.02
USD 450,000	GXO Logistics 1.65% 15/7/2026	381,100	0.00
USD 2,377,000	GXO Logistics 2.65% 15/7/2031	1,816,890	0.02
USD 7,150,871	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 2.571% 19/12/2036	6,208,574	0.07
USD 400,371	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 2.616% 19/7/2047	363,760	0.00
USD 2,800,000	Hays Consolidated Independent School District 4% 15/2/2047	2,744,115	0.03
USD 612,000	HCA 2.375% 15/7/2031	487,521	0.01
USD 1,328,000	HCA 3.125% 15/3/2027	1,229,019	0.01
USD 4,777,000	HCA 3.5% 1/9/2030	4,181,508	0.05
USD 2,072,000	HCA 3.5% 15/7/2051	1,447,075	0.02
USD 4,700,000	HCA 4.5% 15/2/2027	4,603,820	0.05
USD 4,000,000	HCA 5% 15/3/2024	4,028,961	0.04
USD 351,000	HCA 5.25% 15/6/2049	316,504	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,452,000	HCA 5.375% 1/2/2025	2,479,769	0.03
USD 390,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 1/7/2030	421,843	0.00
USD 10,820,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 1/1/2045	10,461,657	0.12
USD 7,475,000	Health & Educational Facilities Authority of the State of Missouri 4% 15/5/2048	7,022,290	0.08
USD 1,000,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	879,777	0.01
USD 1,315,000	HF Sinclair 5.875% 1/4/2026	1,329,619	0.02
USD 130,000	Hilton Domestic Operating 4.875% 15/1/2030	119,003	0.00
USD 157,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	150,132	0.00
USD 612,000	Home Depot 1.375% 15/3/2031	494,296	0.01
USD 2,500,000	Home Depot 1.5% 15/9/2028	2,179,245	0.02
USD 946,000	Home Depot 2.375% 15/3/2051	636,106	0.01
USD 1,750,000	Home Depot 2.875% 15/4/2027	1,684,602	0.02
USD 1,190,000	Home Equity Asset Trust 2006-3 3.044% 25/7/2036	1,082,359	0.01
USD 1,546,633	Home Equity Asset Trust 2007-1 2.744% 25/5/2037	1,206,708	0.01
USD 6,869,011	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 2.614% 25/4/2037	4,949,616	0.06
USD 1,484,858	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 2.634% 25/4/2037	1,042,578	0.01
USD 7,261,953	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 2.684% 25/4/2037	5,111,728	0.06
USD 322,416	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3.631% 25/7/2034	315,909	0.00
USD 204,000	Horizon Therapeutics USA 5.5% 1/8/2027	196,178	0.00
USD 280,000	Houston Community College System 5% 15/2/2029	316,570	0.00
USD 2,073,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982% 5/3/2037	1,875,250	0.02
USD 2,120,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	1,881,047	0.02
USD 4,703,000	Howmet Aerospace 5.9% 1/2/2027	4,722,964	0.05
USD 581,000	HP 3% 17/6/2027	539,653	0.01
USD 192,000	Humana 1.35% 3/2/2027	168,327	0.00
USD 886,000	Humana 2.15% 3/2/2032	721,742	0.01
USD 1,193,000	Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028	1,168,291	0.01
USD 925,000	Idaho Health Facilities Authority 5% 1/12/2047	977,567	0.01
USD 65,000	iHeartCommunications 4.75% 15/1/2028	55,974	0.00
USD 1,163,000	iHeartCommunications 5.25% 15/8/2027	1,050,160	0.01
USD 104,490	iHeartCommunications 6.375% 1/5/2026	100,229	0.00
USD 546,993	Impac Secured Assets Trust 2006-3 2.784% 25/11/2036	484,525	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS 3.478% 15/6/2034	1,173,625	0.01
USD 5,620,171	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	5,305,024	0.06
USD 2,669,820	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	2,571,265	0.03
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS 3.613% 15/6/2034	1,863,264	0.02
USD 370,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	353,561	0.00
USD 800,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4.158% 10/7/2035	760,798	0.01
USD 4,305,000	Indiana Finance Authority 4% 1/12/2040	4,199,681	0.05
USD 2,576,958	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 0.285% 25/7/2047	1,350	0.00
USD 478,724	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 2.684% 25/7/2036	449,056	0.01
USD 3,726,883	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 2.804% 25/1/2037	3,450,949	0.04
USD 4,098,692	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 3.395% 25/9/2037	2,890,958	0.03
USD 504,042	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 2.684% 25/8/2037	451,069	0.01
USD 180,000	Intel 3.1% 15/2/2060	125,507	0.00
USD 2,170,000	Intel 3.75% 5/8/2027	2,141,222	0.02
USD 612,000	Intercontinental Exchange 1.85% 15/9/2032	487,084	0.01
USD 946,000	Intercontinental Exchange 3% 15/9/2060	657,640	0.01
USD 1,950,000	International Business Machines 2.95% 15/5/2050	1,398,568	0.02
USD 7,000,000	International Business Machines 3.5% 15/5/2029	6,638,180	0.07
USD 341,000	International Business Machines 3.625% 12/2/2024	340,577	0.00
USD 696,000	International Business Machines 4.25% 15/5/2049	625,373	0.01
USD 4,445,000	International Flavors & Fragrances 1.832% 15/10/2027	3,823,688	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 435,000	International Flavors & Fragrances 3.468% 1/12/2050	322,964	0.00
USD 200,000	IQVIA 5% 15/5/2027	193,639	0.00
USD 341,983	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 6.53% 25/9/2037	320,816	0.00
USD 112,848	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 2.724% 25/12/2036	108,530	0.00
USD 10,336,087	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 2.674% 25/5/2037	2,806,134	0.03
USD 1,455,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4.128% 5/7/2031	1,428,124	0.02
USD 5,397,808	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 3.601% 15/6/2035	5,262,955	0.06
USD 2,485,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	2,476,712	0.03
USD 3,525,000	John Deere Capital 1.25% 10/1/2025	3,333,348	0.04
USD 2,250,000	John Deere Capital 3.35% 18/4/2029	2,156,017	0.02
USD 946,000	Johnson & Johnson 2.25% 1/9/2050	657,786	0.01
USD 200,996	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 3.471% 25/5/2037	176,871	0.00
USD 1,226,841	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.383% 15/1/2049	1,078,090	0.01
USD 2,321,741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.883% 15/1/2049	2,198,365	0.02
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP3 0.75% 15/8/2049	267,624	0.00
USD 248,080	JP Morgan Madison Avenue Trust Series 2014-1 6.694% 25/11/2024	238,336	0.00
USD 762,908	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 2.849% 25/5/2036	745,355	0.01
USD 4,655,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4.628% 25/11/2036	4,930,210	0.06
USD 1,165,690	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0.962% 15/9/2047	13,781	0.00
USD 110,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 4.702% 15/9/2047	105,596	0.00
USD 865,037	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 0.748% 15/9/2047	8,033	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C27 0.5% 15/2/2048	70,691	0.00
USD 1,253,950	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C29 0.717% 15/5/2048	15,602	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4.274% 15/12/2048	1,296,552	0.01
USD 1,198,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4.39% 17/3/2049	1,067,714	0.01
USD 887,395	JPMCC Commercial Mortgage Trust 2017-JP5 3.937% 15/3/2050	798,793	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.75% 15/12/2049	105,215	0.00
USD 470,000	JPMorgan Chase 0.969% 23/6/2025	440,856	0.00
USD 1,727,000	JPMorgan Chase 1.561% 10/12/2025	1,612,152	0.02
USD 612,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	484,385	0.01
USD 2,095,000	JPMorgan Chase 1.953% 4/2/2032	1,674,226	0.02
USD 1,709,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,601,071	0.02
USD 1,664,000	JPMorgan Chase 2.182% 1/6/2028	1,482,688	0.02
USD 1,558,000	JPMorgan Chase 2.525% 19/11/2041	1,104,443	0.01
USD 860,000	JPMorgan Chase 2.7% 18/5/2023	855,418	0.01
USD 1,126,000	JPMorgan Chase 3.109% 22/4/2051	825,381	0.01
USD 1,780,000	JPMorgan Chase 4.005% 23/4/2029	1,696,734	0.02
USD 5,465,000	JPMorgan Chase 4.08% 26/4/2026	5,411,260	0.06
USD 12,611,000	JPMorgan Chase 4.323% 26/4/2028	12,391,872	0.14
USD 4,143,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	4,151,193	0.05
USD 2,400,000	JPMorgan Chase Bank 0% 28/12/2023	2,282,400	0.02
USD 2,486,000	Kaiser Foundation Hospitals 2.81% 1/6/2041	1,938,072	0.02
USD 401,000	Keurig Dr Pepper 3.8% 1/5/2050	318,956	0.00
USD 2,650,000	Keurig Dr Pepper 3.95% 15/4/2029	2,535,568	0.03
USD 788,000	KeyBank NA/Cleveland OH 4.15% 8/8/2025	782,822	0.01
USD 5,000,000	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 4.019% 28/7/2042	4,615,332	0.05
USD 5,776,789	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 3.497% 27/12/2038	5,399,431	0.06
USD 612,000	Kilroy Realty 2.5% 15/11/2032	476,434	0.01
USD 612,000	Kimco Realty 2.25% 1/12/2031	492,925	0.01
USD 1,173,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	1,119,782	0.01
USD 1,250,000	KLA 4.65% 1/11/2024	1,271,205	0.01
USD 1,860,000	Kraft Heinz Foods 4.375% 1/6/2046	1,590,575	0.02
USD 1,840,053	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1.331% 15/2/2036	90,989	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,312,000	Lam Research 3.75% 15/3/2026	1,310,932	0.01
USD 78,000	Lamar Media 3.75% 15/2/2028	70,078	0.00
USD 197,732	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 0% 15/6/2033	179,415	0.00
USD 266,575	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 2.534% 25/6/2037	190,237	0.00
USD 1,062,170	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 2.894% 25/9/2036	935,481	0.01
USD 173,918	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 2.694% 25/3/2037	171,336	0.00
USD 6,294,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 4.444% 25/10/2037	5,479,546	0.06
USD 987,582	Lehman XS Trust Series 2007-16N 4.344% 25/9/2047	1,224,021	0.01
USD 490,468	Lehman XS Trust Series 2007-20N 4.744% 25/12/2037	504,853	0.01
USD 525,538	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST1 2.5% 15/3/2028	503,217	0.01
USD 623,939	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST2 3.25% 15/4/2028	601,970	0.01
USD 380,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	336,275	0.00
USD 800,000	Lexington County Health Services District 5% 1/11/2041	833,720	0.01
EUR 1,322,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	1,202,222	0.01
USD 2,409,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	1,922,816	0.02
USD 9,200,128	Loanpal Solar Loan 2.47% 20/12/2047	7,928,027	0.09
USD 2,805,307	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 2.744% 25/6/2036	1,523,404	0.02
USD 752,229	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 2.744% 25/7/2036	321,354	0.00
USD 6,155,747	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 2.764% 25/8/2036	2,833,552	0.03
USD 1,755,000	Los Angeles Department of Water & Power 5% 1/7/2041	1,960,994	0.02
USD 4,175,000	Los Angeles Department of Water & Power 5% 1/7/2051	4,542,386	0.05
USD 3,375,000	Lowe' s 1.7% 15/10/2030	2,719,993	0.03
USD 1,638,000	Lowe' s 2.625% 1/4/2031	1,409,893	0.02
USD 11,334,000	Lowe' s 3% 15/10/2050	7,926,954	0.09
USD 2,251,000	Lowe' s 3.35% 1/4/2027	2,175,321	0.02
USD 226,000	Lowe' s 4% 15/4/2025	225,873	0.00
USD 3,085,000	Lowe' s 4.25% 1/4/2052	2,662,633	0.03
USD 57,000	Lowe' s 5.125% 15/4/2050	56,349	0.00
USD 306,735	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3.295% 20/4/2048	299,177	0.00
USD 1,949,753	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0.944% 10/3/2050	44,163	0.00
USD 4,400,000	Lumen Technologies 5.125% 15/12/2026	3,830,772	0.04
USD 1,423,000	LYB International Finance III 3.625% 1/4/2051	1,066,412	0.01
USD 1,885,000	Lyford Consolidated Independent School District/TX 4% 15/8/2047	1,810,755	0.02
USD 3,192,000	M/I Homes 4.95% 1/2/2028	2,822,576	0.03
USD 395,000	Macy' s Retail 5.875% 1/4/2029	343,597	0.00
USD 1,425,000	Macy' s Retail 5.875% 15/3/2030	1,221,289	0.01
USD 4,008,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.108% 15/8/2034	3,752,833	0.04
USD 3,529,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.167% 15/8/2034	3,258,520	0.04
USD 392,088	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 5.694% 25/3/2032	392,515	0.00
USD 3,540,000	Magallanes 3.428% 15/3/2024	3,463,296	0.04
USD 3,240,000	Magallanes 3.638% 15/3/2025	3,132,066	0.04
USD 972,000	Marriott Ownership Resorts 6.125% 15/9/2025	972,496	0.01
USD 1,200,000	Massachusetts Development Finance Agency 4% 1/7/2045	1,144,496	0.01
USD 7,110,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 15/11/2032	8,584,442	0.10
USD 2,655,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2044	2,758,857	0.03
USD 990,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2047	1,035,734	0.01
USD 1,005,000	Massachusetts Development Finance Agency 5% 1/7/2048	1,045,863	0.01
USD 800,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	789,764	0.01
USD 845,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2048	849,338	0.01
USD 845,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.6% 1/12/2044	827,923	0.01
USD 3,520,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	3,201,562	0.04
USD 2,545,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,302,110	0.03
USD 1,965,267	Mastr Asset Backed Trust 2004-HE1 4.919% 25/9/2034	1,872,955	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Trust 2007-HE1 2.724% 25/5/2037	1,154,707	0.01
USD 326,293	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 2.692% 25/8/2037	210,305	0.00
USD 302,003	Mastr Specialized Loan Trust 2.704% 25/6/2046	287,740	0.00
USD 143,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	139,475	0.00
USD 435,000	Mattel 5.875% 15/12/2027	432,547	0.00
USD 1,745,000	Mauser Packaging Solutions 5.5% 15/4/2024	1,690,984	0.02
USD 830,000	Maxar Technologies 7.75% 15/6/2027	824,759	0.01
USD 1,030,000	McDonald' s 3.5% 1/7/2027	1,003,025	0.01
USD 410,000	McDonald' s 3.625% 1/9/2049	337,213	0.00
USD 1,085,000	McLaren Health Care 4.386% 15/5/2048	1,022,588	0.01
USD 16,352,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	13,821,893	0.15
USD 3,406,000	Merck 2.15% 10/12/2031	2,920,653	0.03
USD 946,000	Merck 2.45% 24/6/2050	662,958	0.01
USD 3,000,000	Merck 2.9% 10/12/2061	2,119,713	0.02
USD 1,055,288	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 2.864% 25/4/2037	968,775	0.01
USD 4,611,611	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 2.684% 25/5/2037	2,696,872	0.03
USD 4,969,227	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 5.944% 25/10/2037	4,638,543	0.05
USD 825,457	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 2.624% 25/6/2037	191,456	0.00
USD 2,600,000	Meta Platforms 3.5% 15/8/2027	2,529,923	0.03
USD 147,000	Metropolitan Life Global Funding I 1.875% 11/1/2027	132,461	0.00
USD 1,693,000	Metropolitan Life Global Funding I 4.05% 25/8/2025	1,685,263	0.02
USD 2,815,000	Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5% 1/10/2048	2,913,984	0.03
USD 33,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	30,076	0.00
USD 89,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	82,655	0.00
USD 32,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	31,132	0.00
USD 4,105,000	Michigan Finance Authority 4% 15/2/2047	3,887,510	0.04
USD 820,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2028	882,599	0.01
USD 670,000	Michigan Finance Authority 5% 15/11/2041	694,952	0.01
USD 320,000	Microchip Technology 4.25% 1/9/2025	316,246	0.00
USD 2,905,000	Microsoft 2.525% 1/6/2050	2,155,881	0.02
USD 946,000	Microsoft 2.675% 1/6/2060	680,839	0.01
USD 5,995,000	Microsoft 3.125% 3/11/2025	5,903,557	0.07
USD 1,876,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,649,454	0.02
USD 612,000	Mondelez International 1.5% 4/2/2031	486,759	0.01
USD 490,000	Mondelez International 2.625% 4/9/2050	335,534	0.00
USD 231,000	Moody' s 2.55% 18/8/2060	144,439	0.00
USD 715,000	Moody' s 3.1% 29/11/2061	497,656	0.01
EUR 4,400,000	Morgan Stanley 0.497% 7/2/2031	3,499,529	0.04
USD 2,025,000	Morgan Stanley 0.56% 10/11/2023	2,010,476	0.02
USD 3,670,000	Morgan Stanley 0.79% 30/5/2025	3,434,773	0.04
USD 360,000	Morgan Stanley 1.512% 20/7/2027	319,596	0.00
USD 612,000	Morgan Stanley 1.794% 13/2/2032	483,087	0.01
USD 5,498,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	5,007,854	0.06
USD 1,527,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	1,324,266	0.01
USD 1,932,000	Morgan Stanley 2.802% 25/1/2052	1,335,774	0.01
EUR 3,040,000	Morgan Stanley 2.95% 7/5/2032	2,852,019	0.03
USD 4,277,000	Morgan Stanley 3.62% 17/4/2025	4,223,179	0.05
USD 1,108,000	Morgan Stanley 3.625% 20/1/2027	1,079,432	0.01
USD 7,306,000	Morgan Stanley 4.21% 20/4/2028	7,154,544	0.08
USD 2,494,000	Morgan Stanley 4.679% 17/7/2026	2,499,829	0.03
USD 2,187,373	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 3.314% 25/9/2035	1,834,310	0.02
USD 396,053	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 4.344% 25/2/2047	382,755	0.00
USD 3,654,543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.325% 15/12/2047	90,779	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 10,520,884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.325% 15/12/2047	251,526	0.00
USD 3,349,202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0.412% 15/3/2048	23,828	0.00
USD 428,938	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 4.281% 15/7/2050	380,443	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.479% 15/5/2048	1,442,189	0.02
USD 209,922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4.677% 15/10/2048	200,537	0.00
USD 5,104,909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1.46% 15/10/2048	189,443	0.00
USD 175,765	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C33 4.558% 15/5/2050	160,960	0.00
USD 362,592	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2.73% 15/12/2050	273,509	0.00
USD 943,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2014-150E 4.438% 9/9/2032	840,145	0.01
USD 393,508	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-MS1 4.158% 15/5/2048	361,978	0.00
USD 230,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 4.341% 15/11/2034	226,563	0.00
USD 5,229,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-CLS 4.991% 15/11/2034	5,134,286	0.06
USD 2,519,058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2.31% 15/6/2050	221,400	0.00
USD 2,562,856	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4.281% 15/6/2050	2,365,731	0.03
USD 479,686	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 3% 15/7/2051	360,751	0.00
USD 365,563	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H3 5.025% 15/7/2051	340,322	0.00
USD 1,200,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-L1 4.139% 15/10/2051	1,176,803	0.01
USD 2,754,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	2,339,977	0.03
USD 225,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.419% 11/7/2040	210,288	0.00
USD 690,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 3.291% 15/7/2035	684,469	0.01
USD 1,213,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 3.591% 15/7/2035	1,176,332	0.01
USD 357,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 4.941% 15/7/2035	342,195	0.00
USD 746,317	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 2.764% 25/4/2036	559,247	0.01
USD 1,498,845	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 2.579% 26/12/2046	1,418,486	0.02
USD 630,775	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-I 3.079% 25/6/2044	608,363	0.01
USD 2,243,853	Mortgage Loan Resecuritization Trust 2.713% 16/4/2036	2,114,592	0.02
USD 1,677,463	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4.01% 22/6/2043	1,615,803	0.02
USD 4,084,767	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4.2% 22/2/2044	3,902,041	0.04
USD 709,741	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5.97% 22/2/2044	674,915	0.01
USD 5,346,519	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4.37% 21/12/2043	5,095,100	0.06
USD 989,269	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	971,363	0.01
USD 414,786	Mosaic Solar Loans 2017-2 3.82% 22/6/2043	391,937	0.00
USD 2,494,000	Motorola Solutions 2.75% 24/5/2031	2,046,905	0.02
USD 1,475,000	Motorola Solutions 4.6% 23/2/2028	1,458,125	0.02
USD 664,000	Motorola Solutions 5.5% 1/9/2044	632,375	0.01
USD 117,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	99,995	0.00
USD 182,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5% 15/10/2027	163,925	0.00
USD 65,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	62,801	0.00
USD 2,953,000	MSCG Trust 2018-SELF 4.541% 15/10/2037	2,834,528	0.03
USD 440,000	MSCG Trust 2018-SELF 5.441% 15/10/2037	416,100	0.00
USD 455,689	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4.78% 28/11/2035	308,096	0.01
USD 1,605,393	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6.5% 25/3/2034	1,422,144	0.02
USD 368,598	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7.5% 25/3/2034	333,851	0.00
USD 1,620,000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 2.854% 25/4/2037	1,516,893	0.02
USD 1,680,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	1,329,845	0.01
USD 1,832,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	1,545,332	0.02
USD 794,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031	639,324	0.01
USD 648,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	579,284	0.01
USD 1,072,000	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-285M 5.094% 15/2/2033	1,065,734	0.01
USD 388,572	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-FL1 3.341% 15/6/2035	382,139	0.00
USD 2,882,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.5% 15/8/2044	2,675,755	0.03
USD 2,174,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 3.5% 15/12/2044	2,046,120	0.02
USD 1,200,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,029,929	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,110,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-I 2.95% 15/4/2069	1,926,441	0.02
USD 612,000	Nestle 2.5% 14/9/2041	472,167	0.01
EUR 3,000,000	Netflix 3.625% 15/5/2027	2,896,683	0.03
USD 4,489,061	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 3.164% 25/10/2035	4,403,631	0.05
USD 2,660,039	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 3.119% 25/12/2035	2,059,750	0.02
USD 639,000	New Home 7.25% 15/10/2025	528,374	0.01
USD 1,155,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	849,132	0.01
USD 1,900,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 4% 1/7/2051	1,777,587	0.02
USD 1,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	1,189,483	0.01
USD 1,000,000	New York City Municipal Water Finance Authority 3.5% 15/6/2048	885,904	0.01
USD 1,885,000	New York City Municipal Water Finance Authority 4% 15/6/2049	1,796,828	0.02
USD 1,515,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.44% 15/6/2043	1,717,725	0.02
USD 435,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.75% 15/6/2041	507,318	0.01
USD 4,115,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.35% 1/11/2030	3,833,569	0.04
USD 3,300,000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.9% 1/8/2031	3,176,666	0.04
USD 1,115,000	New York State Dormitory Authority 3.19% 15/2/2043	927,213	0.01
USD 2,295,000	New York State Thruway Authority 3% 15/3/2050	1,772,678	0.02
USD 3,490,000	New York State Urban Development 3.32% 15/3/2029	3,347,774	0.04
USD 1,480,000	New York State Urban Development 4% 15/3/2038	1,444,193	0.02
USD 590,000	New York Transportation Development 5% 1/7/2046	604,399	0.01
USD 4,715,000	New York Transportation Development 5.25% 1/1/2050	4,852,148	0.05
USD 1,676,000	Newmont 2.6% 15/7/2032	1,375,045	0.01
USD 1,224,000	Nexstar Media 4.75% 1/11/2028	1,106,172	0.01
USD 1,487,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	1,424,157	0.02
USD 1,500,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	1,307,954	0.02
USD 1,490,000	NextEra Energy Capital 2.44% 15/1/2032	1,249,068	0.01
USD 2,000,000	NextEra Energy Capital 2.94% 21/3/2024	1,967,144	0.02
USD 1,351,000	NextEra Energy Capital 3% 15/1/2052	976,431	0.01
USD 2,170,000	NextEra Energy Capital 4.255% 1/9/2024	2,173,897	0.02
USD 5,800,000	NGPL PipeCo 7.768% 15/12/2037	6,297,573	0.07
USD 206,860	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	199,578	0.00
USD 676,744	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2005-AP1 6.046% 25/2/2035	647,284	0.01
USD 454,652	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AP1 7.134% 25/5/2036	118,037	0.00
USD 80,748	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-S5 2.844% 25/10/2036	93,934	0.00
USD 1,434,052	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2007-2 2.864% 25/6/2037	1,278,189	0.01
USD 1,600,000	Norfolk Southern 2.9% 25/8/2051	1,160,369	0.01
USD 250,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	241,591	0.00
USD 2,895,000	Northern States Power 2.9% 1/3/2050	2,199,602	0.03
USD 1,533,000	Northern States Power 3.2% 1/4/2052	1,221,801	0.01
USD 1,574,000	Northern States Power 4.5% 1/6/2052	1,552,134	0.02
USD 2,959,000	Northern Trust 4% 10/5/2027	2,957,330	0.03
USD 100,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	91,460	0.00
USD 227,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	213,623	0.00
USD 1,600,000	NVIDIA 2.85% 1/4/2030	1,464,126	0.02
USD 1,390,000	NVIDIA 3.5% 1/4/2050	1,169,474	0.01
USD 503,625	Oakwood Mortgage Investors 5.26% 15/1/2019	331,990	0.00
USD 418,804	Oakwood Mortgage Investors 6.93% 15/9/2031	256,782	0.00
USD 1,126,027	Oakwood Mortgage Investors 7.475% 15/8/2027	980,777	0.01
USD 2,212,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	2,478,204	0.03
USD 3,230,000	Ohio Water Development Authority Water Pollution Control Loan Fund 5% 1/12/2050	3,515,801	0.04
USD 381,000	OhioHealth 3.042% 15/11/2050	291,393	0.00
USD 28,148,566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 0.511% 10/5/2039	461,918	0.01
USD 2,232,801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 4.077% 10/5/2039	1,758,094	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
EUR 696,000	Olympus Water US 3.875% 1/10/2028	583,082	0.01
EUR 509,000	Olympus Water US 5.375% 1/10/2029	401,840	0.00
USD 321,000	Omnicom 2.6% 1/8/2031	270,320	0.00
USD 2,500,000	Oncor Electric Delivery 2.95% 1/4/2025	2,438,923	0.03
USD 719,000	Oncor Electric Delivery 4.15% 1/6/2032	721,049	0.01
USD 340,000	Oncor Electric Delivery 5.75% 15/3/2029	369,083	0.00
USD 41,869,799	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0% 10/2/2032	1,256	0.00
USD 8,776,000	One Market Plaza Trust 2017-1MKT 0.218% 10/2/2032	23,614	0.00
USD 2,109,848	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 3.61% 14/3/2029	2,109,795	0.02
USD 4,500,000	Onemain Financial Issuance Trust 2018-1 5.52% 14/3/2029	4,422,503	0.05
USD 3,870,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 4.05% 14/10/2036	3,340,642	0.04
USD 1,270,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2.76% 14/9/2035	1,096,323	0.01
USD 3,210,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3.45% 14/9/2035	2,733,579	0.03
USD 450,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	380,667	0.00
USD 3,831,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.643% 16/6/2036	3,689,684	0.04
USD 2,000,000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 3.179% 25/11/2035	1,719,840	0.02
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CPI 2.654% 25/3/2037	1,549,818	0.02
USD 5,019,902	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,359,709	0.05
USD 5,413,829	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,771,959	0.05
USD 2,096,098	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5.82% 25/3/2037	1,834,861	0.02
USD 1,000,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	873,229	0.01
USD 379,000	Oracle 2.5% 1/4/2025	360,410	0.00
USD 1,800,000	Oracle 2.95% 15/11/2024	1,750,705	0.02
USD 625,000	Oracle 2.95% 15/5/2025	599,577	0.01
USD 8,000,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	6,866,470	0.08
USD 1,921,000	Oracle 3.4% 8/7/2024	1,893,718	0.02
USD 10,342,000	Oracle 3.6% 1/4/2050	7,133,380	0.08
USD 562,000	Oracle 3.85% 1/4/2060	378,580	0.00
USD 3,171,000	Oracle 3.95% 25/3/2051	2,316,985	0.03
USD 2,174,800	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	2,194,386	0.02
USD 1,910,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	1,999,485	0.02
USD 1,860,000	Oregon School Boards Association 5.68% 30/6/2028	1,965,904	0.02
USD 750,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 5.125% 30/4/2031	658,170	0.01
USD 493,123	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 7.82% 15/3/2032	456,252	0.01
USD 859,535	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 3.591% 15/10/2037	876,940	0.01
USD 65,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	54,316	0.00
USD 85,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	78,109	0.00
USD 1,435,000	Owens & Minor 6.625% 1/4/2030	1,322,446	0.01
USD 1,417,488	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6.5% 25/1/2037	1,249,600	0.01
USD 2,605,000	PACCAR Financial 3.55% 11/8/2025	2,585,709	0.03
USD 190,000	Pacific Gas and Electric 4.2% 1/6/2041	143,447	0.00
USD 3,137,500	Pacific Gas and Electric 4.5% 1/7/2040	2,477,709	0.03
USD 1,100,000	Pacific Gas and Electric 4.6% 15/6/2043	853,005	0.01
USD 1,500,000	Pacific Gas and Electric 4.95% 8/6/2025	1,494,311	0.02
USD 1,250,000	Pacific Gas and Electric 5.45% 15/6/2027	1,232,642	0.01
USD 660,000	Pacific Gas and Electric 5.9% 15/6/2032	640,614	0.01
USD 600,000	Paramount Global 3.375% 15/2/2028	563,668	0.01
USD 1,043,000	Paramount Global 4.95% 19/5/2050	863,722	0.01
USD 3,011,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,774,596	0.03
USD 2,627,000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4.875% 15/5/2029	2,316,042	0.03
USD 881,000	Parker-Hannifin 4.25% 15/9/2027	873,803	0.01
USD 78,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	74,954	0.00
USD 4,618,000	Peninsula Pacific Entertainment / Peninsula Pacific Entertainment Finance 8.5% 15/11/2027	4,953,745	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,105,000	Pennsylvania State University/The 4% 1/9/2050	1,069,475	0.01
USD 2,355,000	Pennsylvania Turnpike Commission Oil Franchise Tax Revenue 5% 1/12/2048	2,473,903	0.03
USD 853,000	Periana 5.95% 19/4/2026	784,990	0.01
USD 2,950,000	Pfizer 2.7% 28/5/2050	2,235,448	0.02
USD 4,575,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027	3,466,409	0.04
USD 3,525,000	Pitney Bowes 7.25% 15/3/2029	2,421,620	0.03
USD 2,700,000	PNC Bank 3.25% 1/6/2025	2,652,209	0.03
USD 593,000	PNC Bank 4.2% 1/11/2025	591,112	0.01
USD 2,255,000	Port Authority of New York & New Jersey 4.458% 1/10/2062	2,203,736	0.02
USD 3,005,000	PPL Electric Utilities 3% 1/10/2049	2,284,541	0.03
USD 182,198	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 5.5% 25/5/2035	159,470	0.00
USD 228,000	Principal Life Global Funding II 0.75% 12/4/2024	214,874	0.00
USD 211,000	Principal Life Global Funding II 1.25% 16/8/2026	186,465	0.00
USD 1,685,000	Procter & Gamble 3% 25/3/2030	1,597,069	0.02
USD 1,287,000	Progressive 2.5% 15/3/2027	1,214,059	0.01
USD 445,000	Progressive 3% 15/3/2032	402,595	0.00
USD 1,000,000	Progressive 3.2% 26/3/2030	935,423	0.01
USD 1,095,000	Providence St Joseph Health Obligated 2.7% 1/10/2051	735,030	0.01
USD 3,305,632	PRPM 2020-4 2.951% 25/10/2025	3,201,357	0.04
USD 630,000	QUALCOMM 3.25% 20/5/2027	615,651	0.01
USD 618,285	RALI Series 2007-QH9 Trust 2.107% 25/11/2037	558,432	0.01
USD 920,632	RAMP Series 2004-RS7 Trust 2.879% 25/7/2034	746,921	0.01
USD 500,000	Range Resources 5% 15/3/2023	500,017	0.01
USD 2,728,074	RASC Series 2006-EMX9 Trust 2.924% 25/11/2036	2,251,563	0.03
USD 4,614,929	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 4.846% 25/6/2037	4,597,983	0.05
USD 432,000	Regions Financial 2.25% 18/5/2025	412,605	0.00
USD 74,818	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 2.844% 25/9/2035	66,762	0.00
USD 2,112,000	Republic Services 1.45% 15/2/2031	1,676,927	0.02
USD 2,000,000	Republic Services 2.9% 1/7/2026	1,907,354	0.02
USD 966,025	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 2.844% 25/5/2035	667,234	0.01
USD 2,601,104	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 4.786% 25/8/2036	1,885,369	0.02
USD 227,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	206,188	0.00
USD 2,395,000	Roche 1.93% 13/12/2028	2,101,408	0.02
USD 946,000	Roche 2.607% 13/12/2051	682,083	0.01
USD 3,722,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.625% 1/3/2029	3,001,700	0.03
USD 1,682,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.875% 1/3/2031	1,314,232	0.01
USD 1,735,000	Rockwall Independent School District 5% 15/2/2052	1,899,169	0.02
USD 612,000	Roper Technologies 1.75% 15/2/2031	484,733	0.01
USD 2,550,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	2,127,950	0.02
USD 835,000	RWJ Barnabas Health 3.477% 1/7/2049	686,746	0.01
USD 553,000	Ryder System 2.5% 1/9/2024	535,394	0.01
USD 612,000	S&P Global 1.25% 15/8/2030	491,081	0.01
USD 772,000	Sabre GBLB 7.375% 1/9/2025	734,173	0.01
USD 2,382,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	2,356,167	0.03
USD 23,048	SACO I Trust 2006-9 2.744% 25/8/2036	23,027	0.00
USD 946,000	Salesforce 2.9% 15/7/2051	712,762	0.01
USD 9,100,000	Salt River Project Agricultural Improvement & Power District 5% 1/1/2031	10,702,407	0.12
USD 2,345,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2,640,078	0.03
USD 2,570,000	San Diego Gas & Electric 2.95% 15/8/2051	1,928,106	0.02
USD 1,800,000	Sanger Independent School District 4% 15/8/2047	1,750,039	0.02
USD 4,023,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	3,752,282	0.04
USD 1,770,000	Sasol Financing USA 5.5% 18/3/2031	1,486,273	0.02
USD 1,820,000	Sasol Financing USA 5.875% 27/3/2024	1,820,455	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 750,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	619,847	0.01
EUR 384,000	SCIL IV / SCIL USA 4.375% 1/11/2026*	319,754	0.00
EUR 629,000	SCIL IV / SCIL USA 4.642% 1/11/2026*	598,056	0.01
USD 3,661,877	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	816,510	0.01
USD 4,827,340	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 1.15% 25/7/2056	369,967	0.00
USD 490,256	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 3.258% 25/5/2057	229,420	0.00
USD 170,000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-OP1 3.449% 25/10/2035	144,804	0.00
USD 7,674,000	Select Medical 6.25% 15/8/2026	7,395,357	0.08
USD 1,401,000	Sempra Energy 3.7% 1/4/2029	1,320,228	0.02
USD 1,462,000	Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	1,314,290	0.01
USD 4,904,000	Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023	4,786,301	0.05
USD 1,427,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,250,465	0.01
USD 395,000	Service Properties Trust 5.5% 15/12/2027	342,955	0.00
USD 2,337,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,253,813	0.02
USD 6,028,550	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	5,724,074	0.06
USD 1,268,047	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 2.764% 25/7/2036	306,221	0.00
USD 12,000	Sherwin-Williams 2.2% 15/3/2032	498,712	0.01
USD 2,000,000	Sherwin-Williams 2.95% 15/8/2029	1,803,526	0.02
EUR 630,000	Silgan 2.25% 1/6/2028*	539,216	0.01
USD 395,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	373,785	0.00
USD 1,079,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	1,011,384	0.01
USD 1,245,000	Skyworks Solutions 0.9% 1/6/2023	1,215,082	0.01
USD 7,089,892	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 7.141% 15/10/2041	7,736,920	0.09
USD 1,485,000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4.5% 15/9/2045	1,315,700	0.02
USD 6,689,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 3.5% 17/12/2040	6,411,184	0.07
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3.5% 15/9/2043	1,814,036	0.02
USD 1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	1,518,868	0.02
USD 3,410,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2.5% 15/9/2054	3,114,205	0.04
USD 1,290,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3.2% 15/9/2054	1,214,596	0.01
USD 3,600,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2.5% 15/9/2054	2,965,951	0.03
USD 8,810,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	8,052,008	0.09
USD 3,100,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	2,874,156	0.03
USD 1,690,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	1,589,208	0.02
USD 2,886,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	2,630,232	0.03
USD 30,634	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 3.239% 25/1/2035	27,650	0.00
USD 2,934,000	South Carolina Public Service Authority 6.454% 1/1/2050	3,472,047	0.04
USD 1,590,000	South Dakota Health & Educational Facilities Authority 4% 1/11/2034	1,569,176	0.02
USD 205,000	South Wayne County Water and Sewer Authority 4% 15/2/2030	219,444	0.00
EUR 3,787,000	Southern 1.875% 15/9/2081	2,791,085	0.03
USD 1,681,000	Southern California Edison 3.65% 1/6/2051	1,332,493	0.02
USD 83,000	Southern California Edison 3.7% 1/8/2025	81,749	0.00
USD 545,000	Spartanburg County School District No 7 5% 1/3/2048	590,322	0.01
USD 1,168,000	Sprint 7.125% 15/6/2024	1,210,947	0.01
USD 5,010,000	Sprint 7.875% 15/9/2023	5,163,115	0.06
USD 860,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	762,943	0.01
EUR 100,000	Standard Industries 2.25% 21/11/2026	84,381	0.00
USD 410,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	360,065	0.00
USD 131,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	120,367	0.00
USD 2,285,000	State of California 7.3% 1/10/2039	2,935,556	0.03
USD 630,000	State of California 7.35% 1/11/2039	813,482	0.01
USD 580,000	State of California 7.5% 1/4/2034	744,074	0.01
USD 1,300,000	State of California 7.55% 1/4/2039	1,739,970	0.02
USD 760,000	State of Connecticut 3.31% 15/1/2026	745,094	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,040,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2029	2,346,222	0.03
USD 2,140,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2030	2,480,363	0.03
USD 2,250,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2031	2,635,552	0.03
USD 2,360,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2032	2,788,377	0.03
USD 2,480,000	State of Florida Department of Transportation Turnpike System Revenue 5% 1/7/2033	2,947,668	0.03
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2040	1,729,117	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2041	1,714,695	0.02
USD 1,575,000	State of Georgia 5% 1/7/2029	1,827,461	0.02
USD 1,705,000	State of Georgia 5% 1/7/2030	2,005,084	0.02
USD 1,705,000	State of Georgia 5% 1/7/2031	2,026,525	0.02
USD 2,330,000	State of Louisiana 5% 1/3/2038	2,600,632	0.03
USD 1,400,000	State of Maryland 5% 1/8/2033	1,641,584	0.02
USD 1,885,000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	1,940,509	0.02
USD 4,225,000	State of Minnesota 5% 1/8/2036	4,677,796	0.05
USD 3,080,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	2,764,521	0.03
USD 955,000	State of Ohio 5% 1/3/2039	1,069,354	0.01
USD 2,420,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	2,571,023	0.03
USD 2,800,000	State of Washington 4% 1/2/2036	2,892,755	0.03
USD 2,605,000	State of Wisconsin 5% 1/5/2028	2,949,529	0.03
USD 2,000,000	State Street 1.684% 18/11/2027	1,811,588	0.02
USD 3,853,000	Steel Dynamics 3.25% 15/10/2050	2,669,118	0.03
USD 750,000	Steel Dynamics 3.45% 15/4/2030	670,253	0.01
USD 297,000	Stem 0.5% 1/12/2028	240,015	0.00
USD 916,000	Stillwater Mining 4% 16/11/2026	810,420	0.01
USD 854,250	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3.118% 25/4/2036	548,091	0.01
USD 1,074,711	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 2.904% 25/2/2036	926,845	0.01
USD 288,284	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 2.864% 25/5/2046	190,569	0.00
USD 4,481,192	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	2,821,301	0.03
USD 2,436,583	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	1,526,189	0.02
USD 500,000	Summer BC Bidco B 5.5% 31/10/2026	435,395	0.00
USD 760,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	676,883	0.01
USD 3,023,000	Sunoco / Sunoco Finance 4.5% 30/4/2030	2,606,937	0.03
USD 1,210,000	Sunoco / Sunoco Finance 5.875% 15/3/2028	1,127,057	0.01
USD 157,000	Sunoco / Sunoco Finance 6% 15/4/2027	152,566	0.00
USD 5,467,000	Sutter Health 3.695% 15/8/2028	5,246,290	0.06
USD 2,050,000	Talen Energy Supply 6.625% 15/1/2028	2,083,763	0.02
USD 4,476,000	Talen Energy Supply 7.25% 15/5/2027	4,604,685	0.05
USD 4,233,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	4,015,276	0.04
USD 102,000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 5% 15/1/2028	99,713	0.00
USD 102,000	Targa Resources Partners / Targa Resources Partners Finance 6.5% 15/7/2027	105,262	0.00
USD 1,000,000	Target 2.65% 15/9/2030	899,888	0.01
USD 3,445,000	Tarrant County Cultural Education Facilities Finance 4% 15/2/2047	3,302,545	0.04
USD 1,968,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	1,895,046	0.02
USD 637,000	TEGNA 4.625% 15/3/2028	609,927	0.01
USD 143,000	TEGNA 5% 15/9/2029	137,550	0.00
USD 9,212,000	Tenet Healthcare 4.25% 1/6/2029	7,995,003	0.09
USD 4,338,000	Tenet Healthcare 4.375% 15/1/2030	3,792,744	0.04
USD 102,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/7/2024	99,199	0.00
USD 255,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	232,147	0.00
USD 274,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	261,365	0.00
USD 196,000	Tenet Healthcare 5.125% 1/11/2027	182,747	0.00
USD 2,070,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	1,979,334	0.02
USD 196,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	188,560	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 250,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	243,789	0.00
USD 205,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	200,587	0.00
USD 1,700,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,631,896	0.02
USD 685,000	Texas Instruments 1.75% 4/5/2030	586,931	0.01
USD 969,913	Thornburg Mortgage Trust 2006-3 2.525% 25/6/2046	696,659	0.01
USD 63,603	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 5.341% 25/6/2047	60,773	0.00
USD 2,612,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	2,400,228	0.03
USD 1,000,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	873,514	0.01
USD 612,000	T-Mobile USA 2.25% 15/11/2031	494,824	0.00
USD 1,750,000	T-Mobile USA 2.4% 15/3/2029	1,515,553	0.02
USD 2,453,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	2,054,206	0.02
USD 2,171,000	T-Mobile USA 3.3% 15/2/2051	1,578,087	0.02
USD 844,000	T-Mobile USA 3.4% 15/10/2052	618,329	0.01
USD 1,700,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	1,635,117	0.02
USD 1,535,000	T-Mobile USA 3.875% 15/4/2030	1,433,829	0.02
USD 598,000	T-Mobile USA 4.5% 15/4/2050	529,760	0.01
USD 3,315,000	Tobacco Settlement Financing 6.706% 1/6/2046	3,131,667	0.04
USD 937,000	Toyota Motor Credit 1.8% 13/2/2025	892,037	0.01
USD 612,000	Toyota Motor Credit 1.9% 12/9/2031	508,208	0.01
USD 555,000	Toyota Motor Credit 3.05% 22/3/2027	533,463	0.01
USD 3,195,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	2,906,981	0.03
USD 167,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	151,524	0.00
USD 1,770,000	Triborough Bridge & Tunnel Authority 5% 15/5/2051	1,899,432	0.02
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.564% 17/5/2037	831,120	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.96% 17/5/2037	557,787	0.01
USD 1,910,000	Tri-County Metropolitan Transportation District of Oregon 5% 1/9/2043	2,142,398	0.02
USD 1,294,000	Truist Bank 3.3% 15/5/2026	1,247,246	0.01
USD 1,492,000	Truist Bank 3.8% 30/10/2026	1,459,603	0.02
USD 367,000	TWDC Enterprises 18 3.15% 17/9/2025	359,118	0.00
USD 840,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C11 5.069% 15/6/2051	764,066	0.01
USD 691,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4.788% 15/8/2051	660,581	0.01
EUR 721,000	UGI International 2.5% 1/12/2029	565,122	0.01
USD 650,000	Union Pacific 2.75% 1/3/2026	625,736	0.01
USD 894,000	Union Pacific 2.8% 14/2/2032	799,920	0.01
USD 433,000	Union Pacific 3.25% 5/2/2050	345,279	0.00
USD 98,000	United Rentals North America 3.875% 15/11/2027	91,295	0.00
USD 439,000	United Rentals North America 4.875% 15/1/2028	412,545	0.00
USD 98,000	United Rentals North America 5.25% 15/1/2030	92,051	0.00
USD 132,000	United Rentals North America 5.5% 15/5/2027	131,175	0.00
USD 56,191,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	62,293,534	0.69
USD 6,848,500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2026	7,303,265	0.08
USD 7,312,700	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	7,501,871	0.08
USD 18,124,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/1/2030	20,110,122	0.22
USD 149,777,400	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024	174,620,600	1.94
USD 41,073,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/4/2023	48,427,438	0.54
USD 52,705,000	United States Treasury Note/Bond 0.625% 15/5/2030	43,675,151	0.49
USD 46,479,100	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/2/2031	39,734,184	0.44
USD 15,484,500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/5/2040	10,642,872	0.12
USD 1,065,572,000	United States Treasury Note/Bond 1.25% 30/11/2026	977,246,076	10.86
USD 46,464,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/12/2026*	42,553,133	0.47
USD 14,306,600	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031	12,322,118	0.14
USD 39,031,800	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/8/2029	35,286,424	0.39
USD 8,589,500	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/11/2050	5,959,804	0.07

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 43,511,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/11/2029	39,688,491	0.44
USD 20,159,800	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041	15,143,869	0.17
USD 19,225,400	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2041	14,880,535	0.17
USD 7,385,700	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2051	5,461,956	0.06
USD 10,376,200	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/11/2051	7,656,501	0.09
USD 10,043,200	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049	8,155,392	0.09
USD 31,898,500	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029	30,208,877	0.34
USD 13,926,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042	11,664,113	0.13
USD 14,761,300	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/11/2049	12,322,226	0.14
USD 110,558,600	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/5/2027	107,345,491	1.19
USD 6,530,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 30/4/2027	6,371,596	0.07
USD 19,130,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/7/2027	18,666,729	0.21
USD 10,379,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/8/2032	10,066,784	0.11
USD 535,565,900	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2032	524,729,056	5.83
USD 264,901,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2052	247,062,226	2.75
USD 567,700	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	529,669	0.01
USD 9,669,300	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2052	9,277,240	0.10
USD 58,982,700	United States Treasury Note/Bond 3.25% 30/6/2027	58,855,979	0.65
USD 34,771,300	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042	33,570,604	0.37
USD 4,836,000	United Wholesale Mortgage 5.5% 15/11/2025	4,262,541	0.05
USD 1,639,000	UnitedHealth 2.9% 15/5/2050	1,222,462	0.01
USD 780,000	UnitedHealth 3.1% 15/3/2026	763,902	0.01
USD 825,000	UnitedHealth 3.125% 15/5/2060	616,131	0.01
USD 1,600,000	UnitedHealth 3.375% 15/4/2027	1,568,789	0.02
USD 3,185,000	UnitedHealth 3.875% 15/12/2028	3,155,252	0.04
USD 500,000	Uniti / Uniti Fiber / CSL Capital 7.875% 15/2/2025	494,108	0.01
USD 1,095,000	University of California 5.77% 15/5/2043	1,228,813	0.01
USD 6,925,000	University of Massachusetts Building Authority 5% 1/11/2052	7,531,895	0.08
USD 2,385,000	University of Michigan 5% 1/4/2047	2,652,827	0.03
USD 54,000	University of Southern California 3.028% 1/10/2039	46,301	0.00
USD 1,865,000	University of Utah/The 4% 1/8/2051	1,791,939	0.02
USD 1,980,000	University of Vermont and State Agricultural College 5% 1/10/2043	2,116,214	0.02
USD 1,380,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	1,336,537	0.01
USD 1,570,000	Univision Communications 7.375% 30/6/2030	1,556,215	0.02
USD 130,476	Upstart Pass-Through Trust Series 2020-ST5 2% 20/7/2027	123,046	0.00
USD 3,267,283	Upstart Pass-Through Trust Series 2021-ST2 2.5% 20/4/2027	3,115,545	0.04
USD 2,081,799	Upstart Pass-Through Trust Series 2021-ST3 2% 20/5/2027	1,983,602	0.02
USD 1,483,058	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/5/2027	1,335,659	0.02
USD 5,250,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	4,808,414	0.05
USD 474,000	US Bancorp 3.1% 27/4/2026	457,287	0.00
USD 3,985,000	US Bancorp 4.548% 22/7/2028	4,015,325	0.04
USD 889,773	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 4.24% 25/11/2047	802,600	0.01
USD 148,962	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 5% 25/11/2047	133,278	0.00
USD 149,781	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 4.26% 25/4/2048	139,340	0.00
USD 2,750,000	Ventas Realty 3.75% 1/5/2024	2,722,816	0.03
USD 1,325,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 1/11/2033	1,101,406	0.01
EUR 1,100,000	Verizon Communications 1.5% 19/9/2039	807,200	0.01
USD 3,437,000	Verizon Communications 1.68% 30/10/2030	2,762,402	0.03
USD 2,600,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	2,304,705	0.03
USD 6,040,000	Verizon Communications 2.355% 15/3/2032	4,991,560	0.05
USD 202,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	190,889	0.00
EUR 200,000	Verizon Communications 2.875% 15/1/2038	181,695	0.00
USD 1,020,000	Verizon Communications 2.875% 20/11/2050	711,033	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,558,000	Verizon Communications 2.987% 30/10/2056	1,749,288	0.02
USD 895,000	Verizon Communications 3.55% 22/3/2051	709,753	0.01
USD 3,470,000	Verizon Communications 3.875% 8/2/2029	3,346,091	0.04
USD 7,340,000	Verizon Communications 4.016% 3/12/2029	7,113,209	0.08
USD 687,000	Verizon Communications 4.125% 16/3/2027	684,728	0.01
USD 1,170,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	1,019,351	0.01
USD 540,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	497,578	0.01
USD 304,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	296,983	0.00
USD 3,066,000	VICI Properties 5.125% 15/5/2032	2,944,770	0.03
USD 1,121,000	VICI Properties 5.625% 15/5/2052	1,036,559	0.01
USD 3,625,000	VICI Properties / VICI Note 3.5% 15/2/2025	3,421,492	0.04
USD 2,429,000	VICI Properties / VICI Note 3.75% 15/2/2027	2,205,350	0.02
USD 1,510,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	1,338,771	0.01
USD 1,858,000	VICI Properties / VICI Note 4.25% 1/12/2026	1,741,931	0.02
USD 138,000	VICI Properties / VICI Note 4.5% 1/9/2026	130,747	0.00
USD 1,633,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,510,794	0.02
USD 2,180,000	VICI Properties / VICI Note 5.625% 1/5/2024	2,183,423	0.02
USD 207,000	VICI Properties / VICI Note 5.75% 1/2/2027	204,048	0.00
USD 1,775,000	Victor Valley Community College District 4% 1/8/2044	1,732,248	0.02
USD 1,930,000	Virginia College Building Authority 1.965% 1/2/2032	1,582,704	0.02
USD 3,070,000	Virginia Commonwealth Transportation Board 4% 15/5/2035	3,182,970	0.04
USD 612,000	Visa 1.1% 15/2/2031	492,408	0.01
USD 946,000	Visa 2% 15/8/2050	626,782	0.01
USD 1,230,000	Vistra 7% 15/6/2171	1,151,477	0.01
USD 5,790,000	Vistra Operations 3.55% 15/7/2024	5,589,323	0.06
USD 2,085,000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	1,946,806	0.02
USD 1,500,000	Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,495,012	0.02
USD 359,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	346,864	0.00
USD 290,000	VMware 0.6% 15/8/2023	280,463	0.00
USD 1,069,000	VMware 1.8% 15/8/2028	894,131	0.01
USD 6,216,000	VMware 2.2% 15/8/2031	4,884,552	0.05
USD 1,800,000	VMware 4.65% 15/5/2027	1,788,357	0.02
USD 6,080,000	VMware 4.7% 15/5/2030	5,823,792	0.06
USD 2,000,000	Volkswagen of America Finance 4.25% 13/11/2023	1,999,485	0.02
USD 14,009,800	Voyager OPTONE Delaware Trust 2.16% 25/2/2038	4,109,709	0.05
USD 946,000	Walmart 2.65% 22/9/2051	720,701	0.01
USD 3,000,000	Walt Disney 2% 1/9/2029	2,603,448	0.03
USD 946,000	Walt Disney 2.75% 1/9/2049	689,798	0.01
USD 1,800,000	Walt Disney 3.8% 22/3/2030	1,750,845	0.02
USD 1,304,000	Walt Disney 6.65% 15/11/2037	1,562,541	0.02
USD 4,658,062	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 1.859% 25/2/2046	4,212,503	0.05
USD 542,617	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 1.849% 25/6/2046	501,683	0.01
USD 1,704,140	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 1.609% 25/6/2047	1,496,511	0.02
USD 8,095,000	Washington Health Care Facilities Authority 4% 1/10/2045	7,856,572	0.09
USD 780,370	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 2.994% 25/11/2035	540,681	0.01
USD 319,016	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.5% 25/11/2035	256,653	0.00
USD 667,670	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6.5% 25/2/2036	567,084	0.01
USD 2,421,648	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	2,285,023	0.03
USD 214,053	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6.85% 25/5/2036	195,861	0.00
USD 936,394	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	914,915	0.01
USD 4,096,625	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4.303% 25/10/2036	1,412,987	0.02
USD 3,736,130	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 2.804% 25/9/2036	1,242,673	0.01
USD 4,595,110	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 2.599% 25/10/2036	3,734,923	0.04

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 925,000	Waste Management 1.15% 15/3/2028	788,817	0.01
USD 612,000	Waste Management 1.5% 15/3/2031	487,323	0.00
USD 833,000	Waste Management 2.95% 1/6/2041	653,850	0.01
USD 921,000	Weekley Homes / Weekley Finance 4.875% 15/9/2028	768,029	0.01
USD 5,520,000	Wells Fargo 2.164% 11/2/2026	5,196,963	0.06
USD 2,602,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	2,599,357	0.03
USD 572,513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4.224% 15/12/2048	548,167	0.01
USD 2,633,561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1.393% 15/8/2049	106,132	0.00
USD 448,469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.115% 15/1/2059	435,402	0.01
USD 2,759,418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 5.148% 15/1/2059	2,619,249	0.03
USD 1,851,126	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 4.118% 15/9/2050	1,653,997	0.02
USD 830,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4.188% 15/11/2050	769,143	0.01
USD 960,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4.002% 15/12/2050	886,698	0.01
USD 2,424,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB 3.241% 13/12/2031	2,393,066	0.03
USD 896,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.874% 15/6/2036	834,384	0.01
USD 316,791	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C44 3% 15/5/2051	233,976	0.00
USD 859,552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4.727% 15/6/2051	790,877	0.01
USD 941,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4.633% 15/8/2051	881,344	0.01
USD 1,675,000	Welltower 2.05% 15/1/2029	1,419,861	0.02
USD 3,615,000	Welltower 2.75% 15/1/2032	3,015,892	0.03
USD 750,000	Welltower 4% 1/6/2025	741,306	0.01
USD 2,795,000	Welltower 4.5% 15/1/2024	2,805,863	0.03
USD 1,190,000	West County Facilities Financing Authority 4% 1/6/2046	1,139,061	0.01
USD 2,038,000	Western Digital 4.75% 15/2/2026	1,963,897	0.02
USD 496,178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4.204% 15/11/2047	451,237	0.01
USD 446,000	William Lyon Homes 6.625% 15/7/2027	439,629	0.01
USD 1,711,000	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3.973% 20/11/2044	1,706,198	0.02
USD 3,949,291	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3.75% 20/8/2045	3,231,321	0.04
USD 5,000,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 4% 1/4/2039	4,836,109	0.05
USD 1,515,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2035	1,601,002	0.02
USD 1,520,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2039	1,592,117	0.02
EUR 603,000	WMG Acquisition 2.25% 15/8/2031	476,415	0.01
USD 1,209,000	Workday 3.7% 1/4/2029	1,143,154	0.01
USD 2,685,000	WRKCo 3.9% 1/6/2028	2,589,396	0.03
USD 2,303,000	WRKCo 4.9% 15/3/2029	2,312,361	0.03
USD 123,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	111,115	0.00
USD 2,042,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	1,952,464	0.02
USD 2,416,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	2,034,490	0.02
USD 2,856,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.75% 15/4/2025	2,851,345	0.03
USD 7,415,000	Xerox 5% 15/8/2025	6,888,795	0.08
USD 2,375,000	Xerox 5.5% 15/8/2028	2,073,172	0.02
USD 808,000	XHR 4.875% 1/6/2029	708,203	0.01
USD 699,000	XHR 6.375% 15/8/2025	684,382	0.01
USD 1,735,000	Ysleta Independent School District 5% 15/8/2056	1,889,425	0.02
		5,675,881,760	63.08
債券合計		7,405,305,869	82.31
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 5,200,000	General Motors Financial 0% 7/11/2022	5,167,549	0.06
USD 4,980,000	General Motors Financial 0% 13/2/2023	4,889,557	0.05
USD 4,980,000	General Motors Financial 0% 14/2/2023	4,888,876	0.05
USD 4,986,000	General Motors Financial 0% 15/2/2023	4,894,059	0.06

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
		19,840,041	0.22
コマーシャル・ペーパー合計		19,840,041	0.22
預託証書			
	米国		
USD 5,390,000	Citibank (New York Branch) 4.06% 1/8/2023	5,385,586	0.06
預託証書合計		5,385,586	0.06
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		7,606,614,967	84.55

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式			
97,804	米国 Fanatics	6,546,999	0.07
普通株式合計		6,546,999	0.07
債券			
USD 8,777	バミューダ DGL2 9.125% 1/4/2024	-	0.00
USD 9,164,792	ケイマン諸島 Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	8,617,654	0.10
CNH 917,253	香港 China City Construction International 5.35% 3/7/2017	-	0.00
USD 116,049	インド Videocon Industries 2.8% 31/12/2020	-	0.00
米国			
USD 1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 0% 15/8/2030	937,243	0.01
USD 11,144,350	American Airlines Pass Through Trust 3.5% 15/12/2027	10,239,429	0.11
USD 2,035,000	American Airlines Pass Through Trust 4% 15/12/2025	1,953,600	0.02
USD 250,000	Chesapeake Energy 0% 15/6/2021	-	0.00
USD 5,581,000	Chesapeake Energy 0% 15/2/2022	-	0.00
USD 546,000	Chesapeake Energy 0% 15/8/2022	-	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers 0% 31/12/2049	-	0.00
USD 2,391	Lehman Brothers Special Finance 0% 31/12/2049	-	0.00
USD 1,480,000	Sun Country 7% 15/12/2023	1,435,600	0.02
USD 1,480,000	Sun Country 4.7% 15/12/2025	1,383,800	0.02
USD 1,974,879	Sun Country 4.84% 15/3/2031	1,883,640	0.02
USD 10,740,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 6/11/2018	-	0.00
USD 7,220,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 1/5/2018	-	0.00
USD 630,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018	-	0.00
USD 3,780,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 4/2/2018	-	0.00
USD 3,399,000	Washington Mutual Bank Escrow 0% 16/6/2018	-	0.00
		17,833,312	0.20
債券合計		26,450,966	0.30
その他の譲渡可能な有価証券合計		32,997,965	0.37
投資有価証券合計		7,639,612,932	84.91
その他の純資産		1,357,477,574	15.09
純資産合計(米ドル)		8,997,090,506	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
AUD	4,710,774	USD	3,274,193	Deutsche Bank	21/9/2022	(44,642)
AUD	22,005,671	USD	15,159,374	HSBC Bank	21/9/2022	(73,016)
AUD	8,994,330	USD	6,223,857	JP Morgan	21/9/2022	(57,642)
AUD	26,700,105	USD	18,479,994	Barclays	21/9/2022	(175,286)
AUD	4,104,000	USD	2,847,344	Toronto-Dominion	21/9/2022	(33,778)
AUD	25,535,887	USD	17,700,484	Citigroup	21/9/2022	(193,926)
AUD	1,735,000	JPY	158,816,157	Deutsche Bank	21/9/2022	43,512
AUD	3,514,228	USD	2,421,597	BNP Paribas	21/9/2022	(12,358)
AUD	147,493	USD	100,000	State Street	21/9/2022	1,116
AUD	4,837,214	USD	3,334,010	Goldman Sachs	21/9/2022	(17,776)
AUD	589,976	USD	400,000	Bank of America	21/9/2022	4,468
AUD	49,599,406	USD	34,513,845	Morgan Stanley	21/9/2022	(510,136)
AUD	1,447,394	USD	1,000,000	UBS	21/9/2022	(7,715)
AUD	9,553,000	JPY	888,903,083	BNP Paribas	21/9/2022	135,290
AUD	1,215,000	JPY	109,874,880	Bank of America	21/9/2022	40,155
AUD	1,735,000	JPY	160,294,255	HSBC Bank	21/9/2022	32,846
AUD	856,194	USD	600,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(13,022)
AUD	3,490,000	JPY	326,549,458	Citigroup	21/9/2022	36,393
AUD	20,997,000	USD	14,757,363	RBS	19/9/2022	(362,990)
AUD	4,316,000	CAD	3,921,897	RBS	19/9/2022	(27,156)
BRL	40,302,239	USD	7,858,500	HSBC Bank	21/9/2022	(110,666)
BRL	36,611,591	USD	6,892,000	Citigroup	21/9/2022	146,331
BRL	11,374,713	USD	2,169,000	Goldman Sachs	14/9/2022	21,660
BRL	6,192,933	USD	1,115,000	Citigroup	14/9/2022	77,699
BRL	9,398,245	USD	1,710,000	BNP Paribas	21/9/2022	96,749
BRL	28,944,814	USD	5,480,000	Citigroup	2/9/2022	111,712
BRL	28,499,099	USD	5,500,000	BNP Paribas	2/9/2022	5,605
BRL	37,490,487	USD	7,341,000	HSBC Bank	2/9/2022	(98,393)
CAD	2,729,878	USD	2,150,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(71,622)
CAD	5,717,957	USD	4,425,000	Citigroup	21/9/2022	(71,663)
CAD	2,231,040	USD	1,750,000	Barclays	21/9/2022	(51,409)
CAD	1,767,000	JPY	183,236,150	State Street	21/9/2022	23,146
CAD	4,120,474	USD	3,200,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(62,899)
CAD	7,096,129	USD	5,474,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(71,399)
CAD	4,896,469	USD	3,800,000	HSBC Bank	21/9/2022	(72,099)
CAD	11,067,942	USD	8,579,330	Deutsche Bank	21/9/2022	(152,810)
CAD	4,789,538	USD	3,672,000	BNP Paribas	21/9/2022	(25,511)
CAD	2,935,000	JPY	305,800,585	Deutsche Bank	21/9/2022	28,026
CAD	2,445,790	USD	1,872,000	Bank of America	21/9/2022	(9,911)
CAD	2,708,543	USD	2,091,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(28,864)
CAD	17,838,918	USD	13,849,000	JP Morgan	21/9/2022	(267,433)
CAD	4,000,029	USD	3,103,000	Bank of America	19/9/2022	(57,549)
CHF	10,739,714	USD	11,216,000	BNP Paribas	21/9/2022	(232,738)
CHF	794,863	USD	800,000	Deutsche Bank	21/9/2022	12,889
CHF	2,313,955	USD	2,400,000	HSBC Bank	21/9/2022	(33,571)
CHF	18,844,058	USD	19,634,000	JP Morgan	21/9/2022	(362,610)
CHF	4,155,655	USD	4,330,000	Citigroup	21/9/2022	(80,106)
CHF	11,060,000	EUR	11,001,341	JP Morgan	21/9/2022	290,378
CHF	10,343,396	USD	10,845,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(267,043)
CHF	20,692,655	EUR	20,730,495	Société Générale	21/9/2022	395,437
CHF	1,187,345	EUR	1,191,551	Deutsche Bank	21/9/2022	20,652
CHF	2,537,234	EUR	2,527,000	BNY Mellon	21/9/2022	63,386
CHF	96,349	USD	100,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(1,466)
CHF	2,506,429	USD	2,600,000	Bank of America	21/9/2022	(36,732)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
CHF	10,980,000	EUR	11,162,348	UBS	21/9/2022	47,277
CHF	1,802,967	USD	1,900,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(56,146)
CHF	3,554,128	GBP	3,102,000	Bank of America	19/9/2022	31,972
CHF	3,524,496	USD	3,708,000	BNP Paribas	19/9/2022	(104,176)
CNH	42,760,000	USD	6,392,413	Barclays	14/9/2022	(193,687)
CNH	89,662,292	USD	13,356,138	Deutsche Bank	21/9/2022	(357,360)
CNH	76,799,000	USD	11,411,441	HSBC Bank	14/9/2022	(278,234)
CNH	50,087,156	USD	7,439,550	Morgan Stanley	21/9/2022	(178,171)
CNH	43,328,215	USD	6,436,000	BNP Paribas	21/9/2022	(154,498)
CNH	21,999,907	USD	3,262,000	Citigroup	21/9/2022	(72,567)
CNH	21,727,598	USD	3,218,000	JP Morgan	21/9/2022	(68,045)
CNH	17,734,449	USD	2,615,000	Citigroup	22/9/2022	(43,927)
COP	328,666,313	USD	84,670	UBS	21/9/2022	(10,710)
COP	6,565,660,000	USD	1,481,171	BNY Mellon	23/11/2022	(21,201)
CZK	95,734,408	USD	3,956,000	UBS	19/9/2022	(58,908)
EUR	89,166,000	GBP	76,341,569	Deutsche Bank	21/9/2022	666,786
EUR	68,510,000	USD	70,540,959	Barclays	21/9/2022	(1,912,058)
EUR	14,263,357	USD	14,320,360	Bank of America	21/9/2022	(32,250)
EUR	22,310,000	GBP	19,225,684	BNP Paribas	21/9/2022	22,311
EUR	20,140,000	GBP	17,224,642	Barclays	21/9/2022	172,315
EUR	24,062,705	USD	24,827,571	Deutsche Bank	21/9/2022	(723,105)
EUR	41,475,847	USD	42,899,387	BNP Paribas	21/9/2022	(1,351,558)
EUR	74,577,853	USD	78,230,163	Citigroup	21/9/2022	(3,522,879)
EUR	26,248,786	USD	27,355,725	HSBC Bank	21/9/2022	(1,061,386)
EUR	70,965,388	USD	73,034,998	JP Morgan	21/9/2022	(1,946,446)
EUR	4,423,759	NOK	45,700,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(159,340)
EUR	16,443,844	CHF	16,340,000	Société Générale	21/9/2022	(238,165)
EUR	11,106,980	CHF	11,020,000	HSBC Bank	21/9/2022	(143,649)
EUR	194,004	USD	200,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(5,659)
EUR	11,140,744	CHF	11,070,000	Bank of America	21/9/2022	(160,959)
EUR	2,936,358	USD	3,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(58,547)
EUR	33,752,571	USD	34,403,195	Morgan Stanley	21/9/2022	(592,046)
EUR	20,056,383	NOK	205,700,000	HSBC Bank	21/9/2022	(572,330)
EUR	5,528,534	CHF	5,490,000	JP Morgan	21/9/2022	(76,370)
EUR	10,950,000	USD	11,252,921	Goldman Sachs	21/9/2022	(283,917)
EUR	142,986,479	USD	145,355,273	Toronto-Dominion	21/9/2022	(2,120,637)
EUR	5,466,000	NOK	53,796,571	HSBC Bank	19/9/2022	70,821
EUR	3,552,000	CZK	87,512,186	UBS	19/9/2022	(4,710)
EUR	5,484,000	USD	5,561,506	BNP Paribas	19/9/2022	(68,742)
EUR	5,532,000	USD	5,507,930	Citigroup	19/9/2022	32,912
EUR	5,500,000	USD	5,489,913	JP Morgan	14/9/2022	16,988
EUR	6,880,000	USD	6,851,648	Société Générale	21/9/2022	40,293
EUR	2,669,000	USD	2,670,127	JP Morgan	19/9/2022	3,138
GBP	12,890,131	USD	15,379,246	Morgan Stanley	21/9/2022	(410,191)
GBP	24,566,007	USD	29,498,345	HSBC Bank	21/9/2022	(970,322)
GBP	69,635,469	EUR	81,110,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(384,467)
GBP	24,960,489	EUR	28,650,000	Goldman Sachs	21/9/2022	286,403
GBP	9,126,381	USD	11,057,903	JP Morgan	21/9/2022	(459,615)
GBP	6,932,680	USD	8,420,024	Citigroup	21/9/2022	(369,238)
GBP	11,519,991	USD	13,977,283	Deutsche Bank	21/9/2022	(599,343)
GBP	7,588,418	EUR	8,770,000	Barclays	21/9/2022	27,060
GBP	2,035,000	USD	2,492,743	BNY Mellon	21/9/2022	(129,537)
GBP	7,534,080	EUR	8,710,000	BNP Paribas	21/9/2022	24,063
GBP	9,570,000	USD	11,389,238	Barclays	21/9/2022	(275,785)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
GBP	3,762,397	EUR	4,376,000	Citigroup	21/9/2022	(14,397)
GBP	13,861,775	USD	16,685,678	Goldman Sachs	21/9/2022	(588,271)
GBP	5,042,265	USD	6,004,880	BNP Paribas	21/9/2022	(149,397)
GBP	3,600,898	USD	4,300,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(118,348)
GBP	3,102,000	CHF	3,511,486	Bank of America	19/9/2022	11,630
GBP	5,810,000	USD	6,783,285	UBS	21/9/2022	(36,247)
IDR	-	USD	46,595,782	HSBC Bank	21/9/2022	(293,648)
IDR	89,987,625,000	USD	6,109,969	HSBC Bank	14/12/2022	(74,009)
IDR	89,751,943,050	USD	6,099,351	Bank of America	14/12/2022	(79,199)
IDR	163,070,431,950	USD	11,086,724	BNP Paribas	14/12/2022	(148,701)
JPY	3,812,819,097	USD	28,438,331	JP Morgan	21/9/2022	(926,721)
JPY	16,900,000	USD	126,353	Bank of America	14/9/2022	(4,480)
JPY	121,575,183	USD	900,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(22,767)
JPY	1,436,716,935	USD	10,739,757	Bank of America	21/9/2022	(373,046)
JPY	184,453,065	CAD	1,767,000	Bank of America	21/9/2022	(14,365)
JPY	1,136,950,698	USD	8,445,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(241,269)
JPY	202,733,250	USD	1,500,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(37,167)
JPY	848,484,056	USD	6,288,807	HSBC Bank	21/9/2022	(166,522)
JPY	712,573,679	USD	5,343,000	Citigroup	21/9/2022	(201,385)
JPY	177,496,462	CAD	1,725,000	HSBC Bank	21/9/2022	(32,584)
JPY	1,036,862,805	USD	7,704,000	BNP Paribas	21/9/2022	(222,458)
JPY	124,856,633	CAD	1,210,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(20,317)
JPY	1,214,247,093	USD	9,035,847	Deutsche Bank	21/9/2022	(274,380)
JPY	553,732,889	AUD	6,080,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(172,756)
JPY	110,853,052	AUD	1,215,000	JP Morgan	21/9/2022	(33,097)
JPY	162,689,215	AUD	1,735,000	Citigroup	21/9/2022	(15,565)
JPY	823,559,692	AUD	8,698,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(20,620)
JPY	153,781,368	USD	1,154,577	Standard Chartered Bank	14/9/2022	(45,594)
JPY	739,607,288	USD	5,516,000	Deutsche Bank	22/9/2022	(178,886)
KRW	7,152,252,836	USD	5,450,000	Goldman Sachs	19/9/2022	(111,300)
MXN	347,774,168	USD	16,780,665	Morgan Stanley	21/9/2022	406,310
MXN	253,329,912	USD	12,194,566	Bank of America	21/9/2022	324,980
MXN	108,995,064	USD	5,448,000	Goldman Sachs	19/9/2022	(59,368)
NOK	56,242,507	EUR	5,486,938	Deutsche Bank	21/9/2022	153,361
NOK	19,722,671	USD	2,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(18,767)
NOK	59,148,412	USD	5,995,000	Bank of America	21/9/2022	(53,267)
NOK	101,826,330	USD	10,461,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(232,074)
NOK	8,983,266	USD	900,000	Goldman Sachs	21/9/2022	2,410
NOK	79,828,483	USD	7,986,800	Morgan Stanley	21/9/2022	32,341
NOK	41,042,032	USD	4,173,200	HSBC Bank	21/9/2022	(50,337)
NOK	52,117,168	USD	5,235,000	JP Morgan	21/9/2022	411
NOK	82,684,261	USD	8,377,000	BNP Paribas	21/9/2022	(70,982)
NOK	244,534,936	EUR	23,353,630	JP Morgan	21/9/2022	1,170,508
NOK	36,792,420	USD	3,736,000	Citigroup	21/9/2022	(40,031)
NZD	68,454,892	USD	43,222,877	HSBC Bank	21/9/2022	(1,286,580)
NZD	9,762,249	USD	6,076,858	Morgan Stanley	21/9/2022	(96,387)
NZD	7,838,843	USD	4,927,294	Bank of America	21/9/2022	(125,123)
NZD	7,688,058	USD	4,822,417	Deutsche Bank	21/9/2022	(112,620)
NZD	3,219,173	USD	2,000,000	Standard Chartered Bank	21/9/2022	(27,896)
NZD	9,897,426	USD	6,196,364	JP Morgan	21/9/2022	(133,082)
NZD	6,205,583	USD	3,819,834	Citigroup	21/9/2022	(18,219)
NZD	3,148,619	USD	1,958,618	BNP Paribas	21/9/2022	(29,736)
NZD	1,593,993	USD	1,000,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(23,501)
NZD	36,640,000	USD	22,661,917	Barclays	21/9/2022	(215,810)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
SEK	67,444,906	USD	6,669,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(342,235)
SEK	28,372,234	USD	2,800,000	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(138,501)
SEK	9,971,860	USD	1,000,000	Bank of America	21/9/2022	(64,575)
SEK	92,763,154	USD	8,998,800	Deutsche Bank	21/9/2022	(297,020)
SEK	20,896,639	USD	2,030,000	BNP Paribas	21/9/2022	(69,761)
SEK	6,217,504	USD	600,000	HSBC Bank	21/9/2022	(16,758)
SEK	4,197,954	USD	400,000	State Street	21/9/2022	(6,205)
SEK	46,332,622	USD	4,433,200	Citigroup	21/9/2022	(86,902)
SEK	42,022,514	USD	4,000,000	JP Morgan	21/9/2022	(58,018)
SEK	14,865,085	USD	1,400,000	Goldman Sachs	21/9/2022	(5,559)
SEK	5,288,538	USD	500,000	Barclays	21/9/2022	(3,901)
TRY	16,779,120	USD	926,000	Deutsche Bank	29/9/2022	(21,576)
USD	1,115,000	MXN	22,402,267	Goldman Sachs	14/9/2022	6,369
USD	1,115,000	BRL	5,500,340	Goldman Sachs	14/9/2022	55,688
USD	1,312,242	JPY	170,681,368	Bank of America	14/9/2022	81,386
USD	6,497,944	MXN	132,651,000	Deutsche Bank	21/9/2022	(57,659)
USD	18,134,966	MXN	375,752,120	Citigroup	21/9/2022	(434,676)
USD	44,540,150	AUD	63,182,810	HSBC Bank	21/9/2022	1,224,109
USD	11,481,078	CNH	76,799,000	Barclays	14/9/2022	347,872
USD	6,368,424	KRW	8,000,000,000	UBS	21/9/2022	398,068
USD	43,036,114	IDR	629,596,824,347	JP Morgan	21/9/2022	660,796
USD	1,191,456	MXN	23,793,000	State Street	21/9/2022	15,608
USD	4,736,000	NOK	46,108,382	BNP Paribas	21/9/2022	104,199
USD	2,700,000	CHF	2,596,555	BNP Paribas	21/9/2022	44,562
USD	7,324,000	CAD	9,417,546	BNP Paribas	21/9/2022	154,001
USD	5,214,013	JPY	695,562,682	BNP Paribas	21/9/2022	195,141
USD	9,827,516	CNH	65,967,638	Royal Bank of Canada	21/9/2022	263,868
USD	6,436,000	CNH	43,206,091	Deutsche Bank	21/9/2022	172,203
USD	32,139,134	EUR	30,095,740	Royal Bank of Canada	21/9/2022	1,991,163
USD	5,914,994	AUD	8,648,793	Morgan Stanley	21/9/2022	(14,333)
USD	583,161	EUR	546,000	Commonwealth Bank of Australia	21/9/2022	36,214
USD	1,250,433,755	EUR	1,180,945,113	BNP Paribas	21/9/2022	67,439,078
USD	4,600,000	AUD	6,564,392	Goldman Sachs	21/9/2022	99,672
USD	231,505,140	GBP	186,921,496	HSBC Bank	21/9/2022	14,436,878
USD	1,000,000	CAD	1,279,107	State Street	21/9/2022	26,159
USD	1,400,000	CHF	1,373,372	State Street	21/9/2022	(4,517)
USD	8,885,000	CAD	11,428,747	Royal Bank of Canada	21/9/2022	183,782
USD	832,545	DKK	5,841,000	JP Morgan	21/9/2022	45,845
USD	5,375,000	NOK	52,877,219	Bank of America	21/9/2022	63,238
USD	500,000	SEK	4,985,930	Bank of America	21/9/2022	32,288
USD	5,844,125	CHF	5,649,527	Bank of America	21/9/2022	66,482
USD	5,347,000	CAD	6,927,292	Citigroup	21/9/2022	72,942
USD	8,737,952	AUD	12,566,576	JP Morgan	21/9/2022	122,723
USD	14,887,000	NOK	143,827,423	Deutsche Bank	21/9/2022	438,868
USD	6,965,000	JPY	934,795,932	Bank of America	21/9/2022	219,927
USD	1,872,000	BRL	9,629,381	Goldman Sachs	21/9/2022	20,817
USD	7,304,375	CHF	7,025,622	Citigroup	21/9/2022	119,432
USD	500,000	EUR	480,157	State Street	21/9/2022	19,010
USD	300,000	NZD	472,736	State Street	21/9/2022	10,396
USD	9,282,502	AUD	13,021,000	ANZ	21/9/2022	355,735
USD	9,154,681	JPY	1,227,725,371	Royal Bank of Canada	21/9/2022	295,961
USD	1,700,000	NZD	2,731,865	Royal Bank of Canada	21/9/2022	26,427
USD	3,000,000	CHF	2,938,832	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(5,477)
USD	31,133,679	EUR	30,712,475	Morgan Stanley	21/9/2022	367,899

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	3,096,783	CAD	3,997,956	UBS	21/9/2022	52,960
USD	4,710,408	ZAR	76,614,000	JP Morgan	21/9/2022	227,656
USD	13,081,014	GBP	11,011,000	State Street	21/9/2022	294,156
USD	8,337,124	MXN	175,230,000	RBS	21/9/2022	(322,730)
USD	3,900,000	SEK	40,074,445	BNP Paribas	21/9/2022	140,759
USD	1,000,000	NZD	1,606,106	Goldman Sachs	21/9/2022	16,080
USD	200,000	EUR	190,861	Goldman Sachs	21/9/2022	8,808
USD	28,194,818	GBP	23,575,381	Goldman Sachs	21/9/2022	817,191
USD	3,268,560	MXN	68,722,000	Morgan Stanley	21/9/2022	(127,677)
USD	6,892,295	ZAR	111,920,538	UBS	21/9/2022	343,727
USD	113,516,895	EUR	109,433,652	JP Morgan	21/9/2022	3,893,315
USD	5,465,000	SEK	55,363,601	Deutsche Bank	21/9/2022	271,539
USD	5,200,000	NOK	51,353,479	Morgan Stanley	21/9/2022	41,304
USD	8,991,137	AUD	12,968,699	Deutsche Bank	21/9/2022	100,226
USD	23,697,567	GBP	19,629,268	Deutsche Bank	21/9/2022	902,483
USD	33,964,510	EUR	33,376,289	Citigroup	21/9/2022	530,294
USD	1,800,000	AUD	2,604,775	Citigroup	21/9/2022	14,253
USD	8,107,000	JPY	1,087,025,568	Citigroup	21/9/2022	263,507
USD	11,233,000	JPY	1,489,775,634	HSBC Bank	21/9/2022	483,440
USD	2,995,000	JPY	398,572,491	Goldman Sachs	21/9/2022	119,078
USD	1,734,000	BRL	8,987,322	Barclays	21/9/2022	6,248
USD	9,951,000	SEK	102,232,945	Citigroup	21/9/2022	360,893
USD	9,996,000	NOK	98,987,567	JP Morgan	21/9/2022	52,239
USD	16,508,041	NZD	26,574,677	Barclays	21/9/2022	228,073
USD	814,985	MXN	17,174,000	JP Morgan	21/9/2022	(33,753)
USD	3,300,000	NZD	5,244,347	HSBC Bank	21/9/2022	87,248
USD	6,836,402	EUR	6,607,354	HSBC Bank	21/9/2022	217,582
USD	224,627	HKD	1,759,000	HSBC Bank	21/9/2022	414
USD	6,386,000	CAD	8,243,806	HSBC Bank	21/9/2022	109,621
USD	8,690,000	CHF	8,325,632	JP Morgan	21/9/2022	175,565
USD	111,544,368	EUR	108,282,353	Bank of America	21/9/2022	3,074,091
USD	7,368,000	CHF	6,990,641	Morgan Stanley	21/9/2022	218,830
USD	16,067,310	NZD	25,642,057	Citigroup	21/9/2022	358,677
USD	400,000	NOK	3,916,071	Citigroup	21/9/2022	6,612
USD	11,410,695	CNH	76,799,000	HSBC Bank	21/9/2022	276,772
USD	6,364,000	TRY	124,543,480	Goldman Sachs	29/9/2022	(349,106)
USD	11,744,500	CHF	11,293,306	Deutsche Bank	21/9/2022	195,094
USD	3,404,496	NZD	5,413,288	Deutsche Bank	21/9/2022	88,251
USD	26,289,835	EUR	25,805,345	Deutsche Bank	21/9/2022	439,703
USD	2,070,000	NOK	20,429,037	UBS	21/9/2022	17,808
USD	13,816,807	JPY	1,857,459,890	JP Morgan	21/9/2022	414,202
USD	9,350,969	JPY	1,258,632,189	Deutsche Bank	21/9/2022	269,238
USD	17,710,737	GBP	14,663,754	JP Morgan	21/9/2022	682,008
USD	7,000,000	CHF	6,688,649	HSBC Bank	21/9/2022	159,670
USD	46,332,072	EUR	45,494,610	Barclays	21/9/2022	758,505
USD	22,785,311	EUR	21,579,000	RBS	21/9/2022	1,168,860
USD	14,442,881	GBP	11,906,257	Morgan Stanley	21/9/2022	616,380
USD	1,800,000	SEK	18,286,740	HSBC Bank	21/9/2022	84,586
USD	8,586,330	CAD	11,083,402	JP Morgan	21/9/2022	148,038
USD	10,881,323	NZD	17,506,647	JP Morgan	21/9/2022	156,539
USD	5,400,000	NOK	53,665,885	HSBC Bank	21/9/2022	9,014
USD	5,480,275	EUR	5,254,602	Standard Chartered Bank	21/9/2022	216,554
USD	900,000	CAD	1,173,004	Standard Chartered Bank	21/9/2022	6,939
USD	400,000	GBP	333,035	Standard Chartered Bank	21/9/2022	13,252

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	100,000	GBP	83,674	Commonwealth Bank of Australia	21/9/2022	2,831
USD	5,734,000	CAD	7,429,178	Morgan Stanley	21/9/2022	77,834
USD	1,200,000	NOK	11,937,939	Goldman Sachs	21/9/2022	779
USD	1,601,815	GBP	1,313,700	Bank of America	21/9/2022	76,240
USD	900,000	CAD	1,176,621	Bank of America	21/9/2022	4,185
USD	2,687,255	NZD	4,257,063	Bank of America	21/9/2022	79,326
USD	2,086,000	BRL	11,391,229	Morgan Stanley	21/9/2022	(103,887)
USD	800,000	JPY	108,325,840	State Street	21/9/2022	18,369
USD	6,215,000	SEK	65,187,376	JP Morgan	21/9/2022	100,006
USD	2,800,000	CAD	3,626,509	Deutsche Bank	21/9/2022	38,976
USD	1,100,000	JPY	150,189,183	Morgan Stanley	21/9/2022	16,301
USD	1,900,000	SEK	19,621,322	Morgan Stanley	21/9/2022	59,393
USD	5,446,782	AUD	7,959,044	BNP Paribas	21/9/2022	(9,676)
USD	9,444,338	IDR	142,909,734,697	Bank of America	14/12/2022	(141,396)
USD	11,218,940	IDR	170,610,637,569	Goldman Sachs	14/12/2022	(224,846)
USD	13,747,697	EUR	13,660,000	UBS	21/9/2022	63,990
USD	37,512,530	NZD	60,362,137	Morgan Stanley	21/9/2022	533,956
USD	12,435,554	GBP	10,270,847	Citigroup	21/9/2022	508,221
USD	7,535,109	IDR	114,209,627,734	Citigroup	14/12/2022	(125,553)
USD	5,566,787	IDR	84,810,000,000	BNP Paribas	14/12/2022	(121,882)
USD	2,169,000	BRL	12,078,077	Citigroup	14/9/2022	(157,121)
USD	3,325,000	BRL	18,550,175	Citigroup	21/9/2022	(241,146)
USD	4,923,397	GBP	4,138,167	BNP Paribas	21/9/2022	117,824
USD	28,126,842	CNH	190,662,816	JP Morgan	21/9/2022	485,529
USD	6,317,967	CNH	42,760,000	Goldman Sachs	14/9/2022	119,241
USD	1,710,000	BRL	9,386,216	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(94,437)
USD	3,659,984	NZD	5,866,551	BNP Paribas	21/9/2022	66,065
USD	300,000	SEK	3,063,738	RBS	21/9/2022	12,602
USD	1,600,000	CHF	1,545,856	UBS	21/9/2022	19,088
USD	5,179,000	ZAR	86,003,868	HSBC Bank	21/9/2022	146,838
USD	1,200,000	BRL	6,585,342	BNP Paribas	21/9/2022	(65,987)
USD	5,462,000	BRL	29,121,176	Citigroup	2/9/2022	(163,780)
USD	18,000	BRL	96,298	Morgan Stanley	2/9/2022	(604)
USD	200,000	SEK	2,037,728	Barclays	21/9/2022	8,848
USD	2,586,000	JPY	351,670,140	Nomura	21/9/2022	48,505
USD	5,587,756	EUR	5,500,000	JP Morgan	14/9/2022	80,855
USD	700,000	SEK	7,120,828	Goldman Sachs	21/9/2022	32,021
USD	900,000	CAD	1,153,505	Goldman Sachs	21/9/2022	21,785
USD	600,000	AUD	851,715	Standard Chartered Bank	21/9/2022	16,092
USD	5,500,000	BRL	28,979,667	JP Morgan	2/9/2022	(98,443)
USD	300,000	JPY	39,152,037	Barclays	21/9/2022	17,496
USD	3,218,000	CNH	21,779,366	Bank of America	21/9/2022	60,540
USD	2,562,500	CNH	17,305,367	Goldman Sachs	21/9/2022	53,657
USD	6,927,390	EUR	6,750,000	Société Générale	21/9/2022	165,675
USD	1,800,000	NOK	17,476,105	Royal Bank of Canada	21/9/2022	44,445
USD	7,341,000	BRL	37,660,919	BNP Paribas	2/9/2022	65,466
USD	2,582,384	MXN	52,643,000	Goldman Sachs	13/9/2022	(23,291)
USD	2,764,802	EUR	2,669,000	BNP Paribas	19/9/2022	91,537
USD	6,346,000	COP	26,852,583,100	Citigroup	19/9/2022	301,524
USD	23,042,680	EUR	22,566,000	Standard Chartered Bank	19/9/2022	440,616
USD	1,255,500	GBP	1,050,601	Barclays	21/9/2022	35,458
USD	5,448,000	MXN	110,145,148	Deutsche Bank	19/9/2022	2,510
USD	3,696,000	CLP	3,322,704,000	Citigroup	22/9/2022	16,072
USD	1,884,554	EUR	1,841,000	Morgan Stanley	23/11/2022	32,383

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
USD	2,930,742	MXN	59,806,290	HSBC Bank	23/11/2022	11,432
USD	20,604,705	MXN	415,034,000	BNY Mellon	13/9/2022	61,730
USD	7,588,610	COP	33,253,290,000	JP Morgan	23/11/2022	194,259
USD	5,548,390	AUD	7,978,000	JP Morgan	19/9/2022	79,118
USD	5,450,000	KRW	7,206,535,000	Citigroup	19/9/2022	70,782
USD	800,000	AUD	1,159,834	Royal Bank of Canada	21/9/2022	4,856
USD	1,756,000	ZAR	30,043,994	Citigroup	21/9/2022	(1,901)
USD	1,756,000	ZAR	29,855,863	BNP Paribas	21/9/2022	9,107
USD	7,341,000	BRL	37,792,570	HSBC Bank	4/10/2022	99,829
USD	22,705,397	AUD	32,850,000	Barclays	21/9/2022	184,525
USD	1,830,000	BRL	9,317,116	JP Morgan	4/10/2022	44,812
USD	8,094,000	EUR	8,102,646	HSBC Bank	9/9/2022	(16,031)
USD	8,094,000	CAD	10,543,406	HSBC Bank	9/9/2022	66,047
USD	8,094,000	AUD	11,752,185	HSBC Bank	9/9/2022	38,683
USD	8,094,000	GBP	6,921,451	HSBC Bank	9/9/2022	58,136
ZAR	115,374,000	USD	7,140,633	UBS	21/9/2022	(389,999)
ZAR	35,162,960	USD	2,061,065	JP Morgan	21/9/2022	(3,649)
ZAR	103,217,166	USD	6,026,965	Bank of America	21/9/2022	12,363
ZAR	42,892,589	USD	2,576,500	Citigroup	21/9/2022	(66,817)
ZAR	43,115,521	USD	2,623,000	HSBC Bank	19/9/2022	(99,793)
ZAR	61,782,336	USD	3,696,000	Bank of America	19/9/2022	(80,374)
ZAR	36,644,395	USD	2,168,750	Goldman Sachs	21/9/2022	(24,654)
未実現純評価益						83,649,286
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	93,270,052	USD	65,089,200	BNY Mellon	15/9/2022	(1,152,411)
USD	94,806	AUD	135,501	BNY Mellon	15/9/2022	1,919
未実現純評価損						(1,150,492)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,614,132,156	USD	1,251,201,870	BNY Mellon	15/9/2022	(22,232,886)
USD	10,300,848	CAD	13,300,000	BNY Mellon	15/9/2022	174,485
未実現純評価損						(22,058,401)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	209,867,835	USD	219,805,435	BNY Mellon	15/9/2022	(5,279,467)
USD	2,073,900	CHF	1,989,101	BNY Mellon	15/9/2022	40,658
未実現純評価損						(5,238,809)
ヘッジを使用したオフショア中国人民元建投資証券クラス						
CNY	27,954	USD	4,137	BNY Mellon	15/9/2022	(84)
USD	20	CNY	141	BNY Mellon	15/9/2022	-
未実現純評価損						(84)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,235,405,270	USD	1,262,260,526	BNY Mellon	15/9/2022	(25,197,795)
USD	17,154,398	EUR	17,156,807	BNY Mellon	15/9/2022	(25,093)
未実現純評価損						(25,222,888)

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	1,029,375,761	USD	1,247,148,446	BNY Mellon	15/9/2022	(51,881,442)
USD	26,965,640	GBP	22,574,587	BNY Mellon	15/9/2022	753,098
未実現純評価損						<u>(51,128,344)</u>
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	3,071,647	USD	391,701	BNY Mellon	15/9/2022	(224)
USD	2,545	HKD	19,966	BNY Mellon	15/9/2022	1
未実現純評価損						<u>(223)</u>
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	50,163,408,575	USD	373,014,168	BNY Mellon	15/9/2022	(11,222,922)
USD	2,379,517	JPY	326,838,339	BNY Mellon	15/9/2022	22,330
未実現純評価損						<u>(11,200,592)</u>
ヘッジを使用したポーランド・ズロチ建投資証券クラス						
PLN	92,697,010	USD	20,002,609	BNY Mellon	15/9/2022	(425,742)
USD	204,654	PLN	963,798	BNY Mellon	15/9/2022	1,099
未実現純評価損						<u>(424,643)</u>
ヘッジを使用したスウェーデン・クローナ建投資証券クラス						
SEK	11,017,623	USD	1,085,031	BNY Mellon	15/9/2022	(51,786)
USD	5,926	SEK	63,249	BNY Mellon	15/9/2022	(5)
未実現純評価損						<u>(51,791)</u>
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	107,892,158	USD	78,287,629	BNY Mellon	15/9/2022	(1,069,647)
USD	1,467,018	SGD	2,037,097	BNY Mellon	15/9/2022	9,076
未実現純評価損						<u>(1,060,571)</u>
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 9,564,769,949米ドル)						<u>(33,887,552)</u>

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

未決済上場先物取引 2022年8月31日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益/(損) (米ドル)
(720)	EUR	Euro BOBL	2022年9月	88,756,629	2,238,728
364	EUR	Euro Bund	2022年9月	53,975,328	(118,589)
(324)	EUR	Euro BUXL	2022年9月	53,859,038	1,599,472
(5,384)	EUR	Euro Schatz	2022年9月	585,277,530	2,240,625
(809)	EUR	Euro-BTP	2022年9月	97,138,019	4,943,035
(259)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年9月	279,012,040	(110,226)
765	AUD	Australian 10 Year Bond	2022年9月	62,942,782	497,142
(1,325)	AUD	Australian 3 Year Bond	2022年9月	97,798,368	(253,918)
(27)	EUR	Dax Index	2022年9月	8,736,913	41,877
(420)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2022年9月	14,920,627	(312,805)
(1,161)	EUR	EURO STOXX Banks Index	2022年9月	4,616,964	(67,154)
10	GBP	FTSE 100 Index	2022年9月	847,943	15,851
28	EUR	FTSE MIB Market Index	2022年9月	3,045,612	(7,703)
151	USD	MSCI Emerging Markets Index	2022年9月	7,469,215	(107,175)
20	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2022年9月	4,982,300	(190,525)
(452)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2022年9月	41,925,260	(3,072,521)
25	USD	S&P 500 E-Mini Index	2022年9月	5,000,937	(24,635)
280	KRW	Korean 10 Year Bond	2022年9月	23,127,658	(680,273)
(181)	EUR	3 Month EURIBOR	2022年12月	44,441,067	9,054
(774)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年12月	105,481,687	713,771
2,667	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	312,330,703	(2,001,396)
(7,154)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年12月	897,491,656	1,038,553
(539)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年12月	81,203,719	(320,675)
(299)	GBP	Long Gilt	2022年12月	37,586,825	664,785
6,432	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	1,340,217,740	(1,660,437)
(11,968)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	1,327,232,494	4,294,722
28	USD	30 Day Federal Funds	2023年1月	11,232,399	(21,939)
(2,224)	EUR	3 Month EURIBOR	2023年3月	543,640,756	2,290,100
582	USD	3 Month SOFR	2023年3月	140,058,300	(302,663)
465	GBP	3 Month SONIA	2023年3月	130,009,686	(630,384)
44	USD	3 Month SOFR	2023年6月	10,576,500	(10,563)
(125)	USD	3 Month SOFR	2023年9月	30,060,937	55,776
4	GBP	3 Month SONIA	2023年9月	1,110,585	232
(1,954)	USD	3 Month SOFR	2024年6月	472,501,625	952,575
2,043	EUR	3 Month EURIBOR	2025年3月	499,958,679	(508,933)
合計				7,418,568,521	11,193,784

スワップ 2022年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (6,274,819)	ファンドはITRAXX.XO.34.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2025	(843,172)	10,505
CDS	USD 5,940,000	ファンドはCDX.NA.HY.35.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2025	288,232	(51,120)
CDS	EUR (10,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2026	(3,149)	(2,906)
CDS	USD 3,045,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	16,649	203,628
CDS	USD 3,045,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	14,836	203,628
CDS	USD 1,827,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	7,089	122,177
CDS	USD 3,395,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	14,520	227,034
CDS	USD 158,927,000	ファンドはCDX.NA.IG.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	645,007	(622,815)
CDS	EUR 26,382,000	ファンドはITRAXX.FINSR.37.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	(80,038)	325,014
CDS	USD 856,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	28,762	8,190
CDS	USD 515,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	11,038	71,572
CDS	USD 215,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	3,890	29,880
CDS	USD 500,000	ファンドはTenet Healthcareに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2024	(21,527)	(23,599)
CDS	USD 3,044,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	81	35,741
CDS	USD 3,045,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	82	35,753
CDS	USD 3,040,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	82	35,694
CDS	USD 3,044,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	755	35,741
CDS	USD 4,260,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	1,057	50,019
CDS	USD 1,844,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	457	21,651
CDS	USD 2,740,000	ファンドはOccidental Petroleumに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2024	(673,952)	(11,003)
CDS	USD (525,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(32,847)	56,710
CDS	USD (510,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(41,253)	55,090

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (725,000)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(52,322)	78,314
CDS	USD (256,667)	ファンドはSprint Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2025	(19,318)	27,725
CDS	EUR (70,977)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2027	(4,190)	(1,908)
CDS	EUR (26,683)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2027	(1,575)	(717)
CDS	EUR (900,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/6/2027	(44,333)	(24,195)
CDS	USD 48,084,998	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/6/2027	517,065	3,215,585
CDS	USD 750,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	23,074	7,175
CDS	USD 500,000	ファンドはBeazer Homes USAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	16,225	4,784
CDS	USD 500,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2024	(7,283)	9,907
CDS	USD 1,250,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	23,322	11,850
CDS	USD (818,182)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capitalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2025	(88,989)	59,770
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capitalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2025	(53,136)	35,862
CDS	EUR (650,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/12/2025	(69,710)	18,015
CDS	USD (1,750,000)	ファンドはAT&Tに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2027	(8,230)	(19,106)
CDS	EUR (1,400,000)	ファンドはSaipem Finance Internationalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	BNP Paribas	20/6/2027	(156,126)	(211,100)
CDS	USD 750,000	ファンドはBorgwarnerに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(4,842)	5,859
CDS	USD 441,176	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(2,728)	3,593
CDS	USD 308,824	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	(1,898)	2,515
CDS	EUR 3,600,000	ファンドはUniCreditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/6/2027	18,762	417,092
CDS	USD 390,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	23,229	54,200
CDS	USD 750,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2024	87,570	91,935
CDS	USD 215,000	ファンドはAlly Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(4,470)	(17,388)
CDS	USD 325,000	ファンドはAlly Financialに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(6,760)	(26,284)
CDS	EUR (130,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Citibank	20/12/2026	(40,939)	(37,776)
CDS	USD 1,000,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2026	4,835	8,131

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,006,313	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	15,428	6,517
CDS	EUR 503,105	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	7,713	3,258
CDS	EUR 1,050,582	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	9,776	6,804
CDS	EUR 3,340,000	ファンドはBayerische Motoren Werkeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	37,431	21,632
CDS	USD 2,990,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	(19,429)	199,950
CDS	USD 2,980,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	(18,191)	199,281
CDS	USD 3,806,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	(22,484)	254,518
CDS	USD 250,000	ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	(6,794)	(18,367)
CDS	USD 650,000	ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	(31,638)	(47,754)
CDS	EUR 3,340,000	ファンドはMercedes-Benzに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2027	33,446	35,425
CDS	USD (2,261,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Citigroup	17/9/2058	(354,707)	(365,894)
CDS	USD 1,440,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Citigroup	17/9/2058	186,328	233,033
CDS	USD 24,464,000	ファンドはCDX.NA.HY.33.V12に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	20/12/2024	834,146	(468,913)
CDS	EUR (110,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2026	(5,843)	(52)
CDS	EUR (2,260,000)	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(320,364)	(144,026)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはAltice Franceに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(41,109)	(18,481)
CDS	EUR (244,777)	ファンドはIntrumに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(30,982)	(11,124)
CDS	EUR (155,223)	ファンドはIntrumに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/12/2026	(19,743)	(7,054)
CDS	EUR (2,680,000)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	(197,495)	(72,046)
CDS	EUR (147,145)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	(8,968)	(3,956)
CDS	EUR (391,407)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	(23,855)	(10,522)
CDS	EUR (425,714)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	5,820	(11,444)
CDS	EUR (638,572)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	20/6/2027	8,171	(17,167)
CDS	USD (645,000)	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1.5%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	17/1/2047	45,140	(9,355)
CDS	USD 3,537,032	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Credit Suisse	17/9/2058	(42,067)	(3,935)
CDS	USD (491,207)	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Credit Suisse	11/5/2063	(63,444)	(105,181)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR 1,006,000	ファンドは Anheuser Busch Inbev に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/6/2027	972	(8,061)
CDS	USD (98,000)	ファンドは CMBX.NA.9.BBB- に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Deutsche Bank	17/9/2058	(5,085)	(15,859)
CDS	USD 2,841,548	ファンドは CMBX.NA.9.AAA に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	17/9/2058	(34,233)	(3,161)
CDS	USD 241,520	ファンドは CMBX.NA.6.AAA に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	(97)	(54)
CDS	USD 565,361	ファンドは CMBX.NA.6.AAA に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	11/5/2063	53	(127)
CDS	EUR (402,000)	ファンドは Casino Guichard Perrachon に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(31,112)	(73,123)
CDS	EUR (95,541)	ファンドは Novafives に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(3,026)	(10,118)
CDS	EUR (54,459)	ファンドは Novafives に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2023	(1,438)	(5,767)
CDS	USD 210,000	ファンドは Pitney Bowes に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	3,777	29,185
CDS	USD 250,000	ファンドは Staples に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	8,206	30,645
CDS	USD 825,000	ファンドは Tenet Healthcare に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(29,300)	(39,979)
CDS	USD 800,000	ファンドは Tenet Healthcare に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(28,412)	(38,767)
CDS	USD 875,000	ファンドは Tenet Healthcare に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(31,151)	(42,402)
CDS	USD 894,000	ファンドは Tenet Healthcare に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2024	(37,691)	(42,195)
CDS	USD 165,000	ファンドは Macys に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(11,411)	11,085
CDS	USD 250,000	ファンドは Simon Property に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(16,740)	(1,592)
CDS	USD 290,000	ファンドは Simon Property に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(15,203)	(1,847)
CDS	USD 665,000	ファンドは Southwest Airlines に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(13,792)	(1,637)
CDS	USD 665,000	ファンドは Southwest Airlines に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(12,949)	(1,637)
CDS	USD 1,040,000	ファンドは Southwest Airlines に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(37,330)	(2,560)
CDS	EUR (90,000)	ファンドは CMA CGM に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2026	(8,309)	(42)
CDS	EUR (401,312)	ファンドは TK Elevator Holdco に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2026	(7,922)	(1,372)
CDS	USD 3,525,000	ファンドは Caterpillar に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2026	18,549	(70,706)
CDSUSD	(291,773,229)	ファンドは CDX.NA.HY.38.V2 に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2027	(4,799,431)	(2,990,736)
CDS	EUR (425,714)	ファンドは CMA CGM に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2027	4,165	(11,444)
CDS	EUR 8,620,000	ファンドは ITRAXX.EUR.37.V1 に係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2027	58,909	69,299
CDS	EUR 5,010,000	ファンドは Bayerische Motoren Werke に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	49,074	32,448

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 2,950,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(37,767)	197,275
CDS	USD 2,940,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(39,929)	196,606
CDS	USD 3,886,000	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(52,777)	259,868
CDS	USD 2,000,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	7,751	(40,116)
CDS	USD 6,078,440	ファンドはChile Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	164,889	132,640
CDS	USD 5,144,000	ファンドはColombia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	105,294	368,861
CDS	USD 15,591,000	ファンドはIndonesia Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(61,705)	114,995
CDS	EUR 30,046,188	ファンドはITRAXX.XO.37V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	430,876	913,265
CDS	EUR 5,790,000	ファンドはLloyds Bankingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	112,878	15,480
CDS	USD 150,000	ファンドはMacysに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(2,909)	23,189
CDS	USD 550,000	ファンドはParamount Globalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(3,472)	14,212
CDS	USD 22,900,795	ファンドはPhilippine Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(58,262)	56,369
CDS	USD 2,605,200	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	50,982	198,134
CDS	USD 1,736,800	ファンドはRepublic of South Africa Government Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	39,603	132,090
CDS	USD 1,420,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	13,286	11,564
CDS	USD 1,350,000	ファンドはSouthwest Airlinesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	(3,536)	17,559
CDS	USD 3,462,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	60,850	831,259
CDS	USD 1,731,000	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	59,876	415,630
CDS	USD 865,500	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	28,764	207,815
CDS	USD 865,500	ファンドはTurkey Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2027	28,764	207,815
CDS	USD 645,000	ファンドはCMBX.NA.7.AAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	17/1/2047	(27,276)	9,355

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(15,625)	(34,720)
CDS	USD (948,150)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(14,726)	(32,811)
CDS	USD (1,003,333)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(17,739)	(34,720)
CDS	USD (1,841,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(74,839)	(297,926)
CDS	USD (220,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(11,009)	(35,602)
CDS	USD (1,129,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(65,179)	(182,704)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(351,852)	(364,114)
CDS	USD (660,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	17/9/2058	(33,513)	(106,807)
CDS	EUR (660,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(54,661)	(120,052)
CDS	EUR (268,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(25,497)	(48,748)
CDS	EUR (480,000)	ファンドはCasino Guichard Perrachonに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2023	(9,035)	(87,311)
CDS	USD 1,644,000	ファンドはKB Homeに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(22,649)	(58,469)
CDS	USD 822,410	ファンドはRealogyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	10,429	8,441
CDS	USD 820,000	ファンドはRR Donnelley & Sonsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2023	(39,808)	(28,791)
CDS	USD 250,000	ファンドはTenet Healthcareに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2024	(10,894)	(12,115)
CDS	USD 290,000	ファンドはAvis Budgetに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(23,460)	(12,148)
CDS	USD 1,110,000	ファンドはAvis Budgetに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2024	(85,980)	(42,686)
CDS	EUR (1,130,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2025	(129,773)	39,159
CDS	USD 1,380,000	ファンドはAvis Budgetに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2025	(145,597)	(49,005)
CDS	USD (850,000)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capitalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(94,936)	62,095
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO Holdings / CCO Holdings Capitalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(54,296)	35,862
CDS	EUR (1,300,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(126,517)	36,031
CDS	EUR (300,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(31,058)	8,315
CDS	EUR (20,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(2,071)	554
CDS	EUR (1,340,000)	ファンドはVirgin Media Financeに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/12/2025	(138,725)	37,139

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2026	(100,487)	(74,415)
CDS	EUR (260,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2026	(103,559)	(74,415)
CDS	EUR (393,314)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(25,107)	(10,573)
CDS	EUR (147,863)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(9,439)	(3,975)
CDS	EUR (369,715)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(23,601)	(9,939)
CDS	EUR (138,990)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(8,873)	(3,736)
CDS	EUR (104,587)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(6,663)	(2,812)
CDS	EUR (39,319)	ファンドはCMA CGMに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(2,505)	(1,057)
CDS	EUR (1,070,000)	ファンドはLadbroke's Coralに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(24,542)	(156,729)
CDS	EUR (1,300,000)	ファンドはNovafivesに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	JP Morgan	20/6/2027	(82,253)	(375,883)
CDS	USD 840,000	ファンドはCaterpillarに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	2,524	(16,849)
CDS	USD 500,000	ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	11,034	(36,734)
CDS	USD 425,000	ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	5,584	(31,224)
CDS	USD 250,000	ファンドはFord Motor Creditに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	(4,241)	(18,367)
CDS	USD 500,000	ファンドはGeneral Motorsに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	(9,371)	(62,653)
CDS	EUR 5,010,000	ファンドはMercedes-Benzに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	44,447	53,138
CDS	USD 75,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/6/2027	570	611
CDS	USD (507,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	(26,465)	(82,047)
CDS	USD (400,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/9/2058	25,870	(64,731)
CDS	USD (35,000)	ファンドはCMBX.NA.10.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	JP Morgan	17/11/2059	(2,193)	(5,357)
CDS	USD 491,207	ファンドはCMBX.NA.6.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	JP Morgan	11/5/2063	61,393	105,181
CDS	EUR (17,800,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/3/2023	47,086	34,347
CDS	EUR (7,875,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	11,858	274,259
CDS	EUR (4,800,000)	ファンドはEDP - Energias de Portugalに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	7,228	167,167
CDS	EUR (7,875,000)	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	41,503	13,241
CDS	EUR (4,800,000)	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2023	25,297	8,071

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 250,000	ファンドはStaplesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2023	14,640	19,283
CDS	USD 3,445,000	ファンドはBoeingに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/12/2024	51,246	32,658
CDS	USD 811,501	ファンドはBrazilian Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(42,932)	14,848
CDS	USD 1,250,000	ファンドはSimon Propertyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2025	(66,858)	(7,962)
CDS	EUR (290,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2025	(130,367)	(82,059)
CDS	USD (282,209)	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2026	(1,938)	(3,826)
CDS	EUR (2,700,000)	ファンドはADLER Real Estateに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/12/2026	(844,866)	(784,586)
CDS	USD (1,750,000)	ファンドはVerizon Communicationsに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	20/6/2027	(12,916)	(16,847)
CDS	EUR 4,440,000	ファンドはBritish American Tobaccoに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	73,031	55,219
CDS	USD 19,921,000	ファンドはMexico Government International Bondに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	422,626	538,806
CDS	EUR 680,851	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	7,765	6,537
CDS	EUR 1,117,021	ファンドはNaturgy Energyに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	12,740	10,725
CDS	USD (2,006,667)	ファンドはCMBX.NA.9.Aに係るデフォルト・プロテクションを提供し、2%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(35,923)	(69,440)
CDS	USD (700,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(113,907)	(113,280)
CDS	USD (9,149,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,439,784)	(1,480,569)
CDS	USD (6,630,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(1,051,146)	(1,072,923)
CDS	USD (2,250,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(352,231)	(364,114)
CDS	USD (500,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	51,709	(80,914)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(241,228)	(731,465)
CDS	USD (3,616,400)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(196,340)	(585,237)
CDS	USD (4,520,500)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(229,943)	(731,546)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(225,947)	(731,465)
CDS	USD (4,520,000)	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・プロテクションを提供し、3%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	17/9/2058	(226,222)	(731,465)
CDS	USD 1,987,097	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(23,631)	(2,210)
CDS	USD 3,606,580	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(42,895)	(4,012)
CDS	USD 3,994,064	ファンドはCMBX.NA.9.AAAに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、0.5%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	(52,160)	(4,443)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 646,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	70,201	104,541
CDS	USD 507,000	ファンドはCMBX.NA.9.BBB-に係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、3%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/9/2058	55,097	82,047
IFS	EUR 12,883,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを提供し、7.67%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2023	(18,237)	(19,034)
IFS	USD 12,883,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、3.24%の固定金利を支払う	Bank of America	20/8/2023	2,010	2,010
IFS	USD 1,850,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、2.951%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2027	14,824	14,824
IFS	USD 9,240,000	ファンドはUSCPIU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、2.8675%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2027	104,324	104,324
IFS	GBP 1,645,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを提供し、3.85%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/7/2031	(343,168)	(343,168)
IFS	EUR 6,680,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを提供し、2.693%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/8/2032	29,758	29,758
IFS	EUR 2,195,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、2.731%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2032	17,750	18,395
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを提供し、3.423%の固定金利を受け取る	Bank of America	15/3/2048	(387,028)	(387,028)
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bpsに係るデフォルト・ プロテクションを提供し、3.525%の固定金利を受け取る	Morgan Stanley	15/11/2046	(584,856)	(584,856)
IRS	USD 469,854,799	ファンドは1.079%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	18/3/2021	(17,880,174)	(17,880,174)
IRS	USD 4,020,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.0955%の固定金利を支払う	Bank of America	19/9/2022	111,856	111,856
IRS	MXN 393,224,917	ファンドは4.415%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	28/2/2023	(504,999)	(504,999)
IRS	MXN 393,224,917	ファンドは4.495%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	3/3/2023	(506,323)	(506,323)
IRSCLP	19,211,685,000	ファンドはCLP 6ヶ月Sinacofi Chile Interbank Rateの 変動金利を受け取り、1.42%の固定金利を支払う	Bank of America	1/4/2023	1,828,213	1,828,213
IRSCLP	19,211,685,000	ファンドは1.65%の固定金利を受け取り、CLP 6ヶ月 Sinacofi Chile Interbank Rateの変動金利を支払う	Bank of America	28/5/2023	(1,859,889)	(1,859,889)
IRS	USD 194,737,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 1.5005%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2023	1,814,555	3,439,416
IRS	MXN 279,585,258	ファンドは4.68%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	27/2/2024	(983,774)	(983,774)
IRS	MXN 278,683,371	ファンドは4.855%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2024	(950,914)	(950,914)
IRS	USD 232,932,853	ファンドは1.1285%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2024	(8,553,527)	(8,553,527)
IRS	USD 349,576,239	ファンドは1.12925%の固定金利を受け取り、 USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	(12,851,796)	(12,851,796)
IRS	USD 354,810,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、 0.398%の固定金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	18,397,534	18,397,534
IRS	USD 104,313,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、 0.447%の固定金利を支払う	Bank of America	19/3/2024	5,405,303	5,405,303
IRS	PLN 66,743,500	ファンドはPLN 3ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、 6.15%の固定金利を支払う	Bank of America	11/4/2024	184,356	184,356
IRS	EUR 43,791,200	ファンドはEUR 1H EURIBORの変動金利を受け取り、 1.447%の固定金利を支払う	Bank of America	11/5/2024	345,339	346,609
IRS	USD 87,929,483	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、 0.525%の固定金利を支払う	Bank of America	6/6/2024	4,922,410	4,922,410

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 79,318,511	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5705%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	4,466,672	4,466,672
IRS	EUR 142,220,900	ファンドはEUR 1日EURIBORの変動金利を受け取り、1.545%の固定金利を支払う	Bank of America	6/7/2024	945,955	966,881
IRS	USD 73,770,363	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.51%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2024	4,313,855	4,313,855
IRS	USD 109,280,260	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5425%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2024	6,367,337	6,367,337
IRS	MXN 478,108,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、9.51%の固定金利を支払う	Bank of America	18/7/2024	(51,818)	(51,818)
IRS	USD 72,845,435	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5465%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	4,263,974	4,263,974
IRS	USD 36,422,718	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.548%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	2,130,997	2,130,997
IRS	USD 145,204,848	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.487%の固定金利を支払う	Bank of America	23/7/2024	8,676,648	8,676,648
IRS	GBP 98,060,000	ファンドは2.5975%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	4/8/2024	(1,698,703)	(1,698,703)
IRS	PLN 86,542,000	ファンドはPLN 3ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、6.3%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2024	182,409	182,409
IRS	GBP 98,290,000	ファンドは2.83697%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	10/8/2024	(1,441,276)	(1,441,276)
IRS	USD 11,574,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9395%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	346,504	346,504
IRS	USD 110,244,063	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5555%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	6,615,022	6,615,022
IRS	USD 71,761,051	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.566%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	4,294,086	4,294,086
IRS	GBP 19,870,000	ファンドは3.76%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2024	(72,814)	(72,664)
IRS	USD 73,323,670	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.565%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	4,476,416	4,476,416
IRS	USD 36,295,220	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5665%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,214,788	2,214,788
IRS	USD 36,845,135	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.56886%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,246,687	2,246,687
IRS	USD 36,845,140	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、0.5704%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	2,245,606	2,245,606
IRS	USD 32,570,000	ファンドは3.25%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/9/2024	(57,978)	(169,540)
IRS	USD 19,990,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.216%の固定金利を支払う	Bank of America	8/11/2024	122,775	122,775
IRS	USD 11,945,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.059%の固定金利を支払う	Bank of America	18/1/2025	93,008	93,008
IRS	USD 11,940,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.0945%の固定金利を支払う	Bank of America	7/2/2025	79,586	79,586
IRS	USD 65,616,484	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、2%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2025	1,785,384	1,785,384
IRS	USD 2,868,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.125%の固定金利を支払う	Bank of America	21/2/2025	16,504	16,504
IRS	USD 6,100,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.243%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2025	21,216	21,216
IRS	USD 3,000,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.4685%の固定金利を支払う	Bank of America	2/3/2025	(2,935)	(2,935)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 13,480,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.862%の固定金利を支払う	Bank of America	18/4/2025	124,883	124,883
IRS	USD 6,810,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.9765%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2025	47,770	47,770
IRS	USD 10,000,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.065%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2025	50,520	50,520
IRS	USD 100,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.1245%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2025	393	393
IRS	USD 3,037,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.224%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2025	4,275	4,275
IRS	USD 3,037,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.2385%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2025	3,445	3,445
IRS	USD 14,170,000	ファンドは0.098%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2025	(482,715)	(1,211,004)
IRS	USD 3,016,000	ファンドは2.4385%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/7/2025	(45,105)	(45,105)
IRS	USD 12,065,000	ファンドは2.491%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/7/2025	(168,565)	(168,565)
IRS	AUD 71,605,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.69%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2025	10,584	10,584
IRS	AUD 71,605,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.71%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2025	1,656	1,656
IRS	USD 3,740,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.085%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	5,895	5,895
IRS	USD 35,300,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.1045%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	42,808	42,808
IRS	CNY 109,515,000	ファンドは2.245%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月CNRの変動金利を支払う	Bank of America	21/12/2025	405	405
IRS	CNY 109,515,000	ファンドは2.24%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月CNRの変動金利を支払う	Bank of America	21/12/2025	(1,889)	(1,889)
IRS	EUR 46,840,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.85%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2026	1,278,926	1,278,926
IRS	USD 13,050,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.245%の固定金利を支払う	Bank of America	25/2/2026	11,510	183,334
IRS	EUR 47,320,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.635%の固定金利を支払う	Bank of America	4/3/2026	1,492,878	1,492,878
IRS	USD 10,620,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.42%の固定金利を支払う	Bank of America	6/3/2026	7,737	131,763
IRS	EUR 6,210,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.777%の固定金利を支払う	Bank of America	7/5/2026	57,065	57,065
IRS	USD 181,181,900	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.15%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2026	85,273	318,099
IRS	EUR 473,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.14993%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2026	877	877
IRS	USD 6,240,000	ファンドは2.039%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/8/2026	(87,689)	(87,689)
IRS	USD 6,325,000	ファンドは2.2665%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2026	(62,147)	(62,147)
IRS	USD 3,246,500	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.8885%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	64,587	64,587
IRS	EUR 3,010,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.11301%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	9,586	9,586
IRS	EUR 3,000,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.1677%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	6,487	6,487

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 6,330,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.668%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2026	14,905	14,905
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.807%の固定金利を支払う	Bank of America	3/9/2026	(352)	(352)
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8095%の固定金利を支払う	Bank of America	3/9/2026	(413)	(413)
IRS	USD 16,935,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.04%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2027	56,656	43,109
IRS	USD 116,466,427	ファンドは1.549%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/3/2027	(7,631,636)	(7,631,636)
IRS	USD 3,833,000	ファンドは1.735%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/3/2027	(221,869)	(221,869)
IRS	EUR 31,140,000	ファンドは0.92799%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2027	(260,612)	(304,358)
IRS	EUR 121,800,000	ファンドは0.94%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	7/4/2027	(1,162,986)	(1,176,893)
IRS	EUR 53,250,000	ファンドは1.37%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	23/4/2027	(304,930)	(302,674)
IRS	EUR 81,690,000	ファンドは1.673%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	12/5/2027	(225,278)	(236,073)
IRS	USD 6,714,000	ファンドは1.36%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2027	(50,046)	(508,874)
IRS	USD 7,540,000	ファンドは1.35%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2027	(55,987)	(574,778)
IRS	USD 8,320,000	ファンドは1.2145%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/8/2027	(57,153)	(702,180)
IRS	GBP 105,180,000	ファンドはGBP 1H SONIAの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2027	835,532	835,532
IRS	GBP 105,390,000	ファンドはGBP 1H SONIAの変動金利を受け取り、1.98697%の固定金利を支払う	Bank of America	10/8/2027	743,131	743,131
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.974%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(140,828)	(140,828)
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.9985%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(137,681)	(137,681)
IRS	USD 2,790,000	ファンドは1.9875%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/9/2027	(139,094)	(139,094)
IRS	USD 5,954,500	ファンドは2.943%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/11/2027	(32,355)	(32,355)
IRS	USD 289,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、2.9025%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2028	5,388	5,388
IRS	USD 3,930,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、3.035%の固定金利を支払う	Bank of America	13/9/2028	45,416	45,416
IRS	USD 64,027,800	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2029	24,070	216,443
IRS	USD 3,450,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6815%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2029	8,115	8,115
IRS	USD 3,015,000	ファンドは3.116%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/6/2029	27,447	27,447
IRS	USD 18,395,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.96%の固定金利を支払う	Bank of America	30/6/2029	103,370	(8,654)
IRS	USD 1,050,000	ファンドは2.929%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2029	(1,941)	(1,941)
IRS	EUR 2,330,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.185%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2030	330,082	330,406

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 15,435,000	ファンドは0.6475%の固定金利を受け取り、 USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/9/2030	(2,770,999)	(2,770,999)
IRS	USD 15,435,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、 0.6965%の固定金利を支払う	Bank of America	25/9/2030	2,717,384	2,717,384
IRS	USD 12,348,000	ファンドは0.6795%の固定金利を受け取り、 USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	29/9/2030	(2,191,344)	(2,191,344)
IRS	USD 12,348,000	ファンドはUSD 3ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、 0.75%の固定金利を支払う	Bank of America	29/9/2030	2,129,538	2,129,538
IRS	EUR 6,510,000	ファンドは0.6142%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(856,670)	(856,670)
IRS	EUR 28,050,000	ファンドは0.7895%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(3,311,725)	(3,311,725)
IRS	EUR 8,470,000	ファンドは1.2395%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(705,749)	(705,749)
IRS	EUR 9,690,000	ファンドは1.465%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(637,002)	(638,754)
IRS	EUR 41,810,000	ファンドは1.6988%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(2,001,599)	(2,001,599)
IRS	EUR 6,340,000	ファンドは1.9045%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(202,863)	(202,863)
IRS	EUR 18,325,000	ファンドは0.767%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2031	(2,195,360)	(2,195,360)
IRS	USD 14,140,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.502%の固定金利を支払う	Bank of America	10/3/2031	152,205	444,927
IRS	USD 10,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.262%の固定金利を支払う	Bank of America	30/3/2031	(19)	173
IRS	EUR 2,150,000	ファンドは1.6119%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(131,528)	(131,528)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.711%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(57,138)	(57,138)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは1.72254%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(56,343)	(56,343)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.7317%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(55,336)	(55,336)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは1.745%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(54,358)	(54,179)
IRS	EUR 7,520,000	ファンドは1.9275%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(267,876)	(267,876)
IRS	EUR 2,145,000	ファンドは2.0077%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(62,480)	(62,480)
IRS	EUR 2,145,000	ファンドは2.0742%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(50,930)	(50,930)
IRS	EUR 2,150,000	ファンドは2.092%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(47,950)	(47,950)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは2.124%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(21,268)	(21,268)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.2162%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(13,164)	(13,164)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.23%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(11,799)	(11,963)
IRS	EUR 7,520,000	ファンドは2.358%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(5,747)	(5,747)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.41437%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	4,085	4,085

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 1,075,000	ファンドは2.4995%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	11,495	11,495
IRS	EUR 1,075,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.64005%の固定金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(23,729)	(23,729)
IRS	EUR 7,240,000	ファンドは1.86%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	(299,649)	(297,472)
IRS	EUR 1,079,000	ファンドは2.37%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/8/2031	1,989	224
IRS	EUR 41,523,251	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.02%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2031	7,873,523	7,873,523
IRS	USD 9,990,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.425%の固定金利を支払う	Bank of America	23/9/2031	100,712	1,177,875
IRS	USD 2,972,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.11567%の固定金利を支払う	Bank of America	27/9/2031	423,903	423,903
IRS	USD 139,346,104	ファンドは1.5638%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/10/2031	(17,640,693)	(17,640,693)
IRS	USD 72,617,577	ファンドは1.59%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/11/2031	(9,164,346)	(9,164,346)
IRS	MXN 58,122,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.6%の固定金利を支払う	Bank of America	1/1/2032	(217,232)	(217,232)
IRS	MXN 89,548,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.565%の固定金利を支払う	Bank of America	12/1/2032	(344,804)	(344,804)
IRS	USD 156,867,514	ファンドは1.7343%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/1/2032	(18,272,030)	(18,272,030)
IRS	USD 5,370,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.7575%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2032	510,008	510,008
IRS	EUR 1,160,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.8395%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2032	150,245	150,245
IRS	USD 4,980,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.308%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2032	51,172	658,625
IRS	EUR 580,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.8575%の固定金利を支払う	Bank of America	1/3/2032	75,667	75,667
IRS	USD 5,050,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.687%の固定金利を支払う	Bank of America	7/3/2032	512,281	512,281
IRS	USD 3,815,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.59%の固定金利を支払う	Bank of America	9/3/2032	417,679	417,679
IRS	USD 6,587,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.652%の固定金利を支払う	Bank of America	10/3/2032	687,583	687,583
IRS	EUR 850,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.905%の固定金利を支払う	Bank of America	14/3/2032	107,661	107,661
IRS	EUR 590,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.024%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	68,662	68,662
IRS	USD 4,490,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9485%の固定金利を支払う	Bank of America	16/3/2032	359,161	359,161
IRS	EUR 590,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.046%の固定金利を支払う	Bank of America	17/3/2032	67,487	67,487
IRS	USD 3,750,548	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.98555%の固定金利を支払う	Bank of America	18/3/2032	288,647	288,647
IRS	USD 7,483,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.106%の固定金利を支払う	Bank of America	23/3/2032	501,849	501,849
IRS	USD 4,449,352	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.1245%の固定金利を支払う	Bank of America	23/3/2032	291,570	291,570
IRS	EUR 1,610,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.1255%の固定金利を支払う	Bank of America	29/3/2032	173,091	173,091

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 5,301,448	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.263%の固定金利を支払う	Bank of America	29/3/2032	286,995	286,995
IRS	USD 4,493,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.3125%の固定金利を支払う	Bank of America	7/4/2032	225,179	225,179
IRS	EUR 600,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.338%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	53,440	53,440
IRS	USD 10,222,322	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.3525%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	478,389	478,389
IRS	USD 4,500,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.41%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	189,047	189,047
IRS	USD 8,180,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.4225%の固定金利を支払う	Bank of America	8/4/2032	335,130	335,130
IRS	USD 4,502,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.4135%の固定金利を支払う	Bank of America	11/4/2032	187,996	187,996
IRS	USD 4,567,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.554%の固定金利を支払う	Bank of America	13/4/2032	137,253	137,253
IRS	USD 5,373,819	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.588%の固定金利を支払う	Bank of America	19/4/2032	146,463	146,463
IRS	USD 3,863,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6187%の固定金利を支払う	Bank of America	20/4/2032	95,405	95,405
IRS	USD 3,866,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.65335%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	84,308	84,308
IRS	USD 4,605,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7234%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	73,475	73,475
IRS	EUR 600,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.641%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	37,626	37,626
IRS	MXN 109,165,000	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIEの変動金利を受け取り、8.955%の固定金利を支払う	Bank of America	21/4/2032	62,649	62,649
IRS	USD 5,760,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6375%の固定金利を支払う	Bank of America	25/4/2032	133,388	133,388
IRS	USD 7,618,000	ファンドは2.513%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/4/2032	(255,856)	(255,856)
IRS	USD 3,050,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7245%の固定金利を支払う	Bank of America	3/5/2032	48,514	48,514
IRS	USD 13,950,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、0.505%の固定金利を支払う	Bank of America	4/5/2032	136,964	2,816,881
IRS	USD 7,638,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.85%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2032	41,174	41,174
IRS	USD 13,630,000	ファンドは2.87%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/5/2032	(80,786)	(35,203)
IRS	USD 5,973,136	ファンドは2.6565%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/5/2032	(129,402)	(129,402)
IRS	USD 63,216,532	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.58%の固定金利を支払う	Bank of America	24/5/2032	1,764,860	1,778,785
IRS	USD 11,858,932	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.585%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2032	328,833	328,833
IRS	USD 6,666,000	ファンドは2.5278%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/5/2032	(217,023)	(217,023)
IRS	USD 5,170,704	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.715%の固定金利を支払う	Bank of America	3/6/2032	86,863	86,863
IRS	GBP 4,540,000	ファンドは2.7075%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	7/6/2032	(117,981)	(117,981)
IRS	USD 6,660,568	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.84671%の固定金利を支払う	Bank of America	8/6/2032	37,831	37,831

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 24,565,000	ファンドは2.767%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2032	(305,105)	(305,105)
IRS	USD 5,970,050	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.77467%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2032	70,278	70,278
IRS	USD 5,952,826	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.83485%の固定金利を支払う	Bank of America	13/6/2032	39,808	39,808
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.9425%の固定金利を支払う	Bank of America	14/6/2032	(12,654)	(12,654)
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.948%の固定金利を支払う	Bank of America	14/6/2032	(15,080)	(15,080)
IRS	USD 3,675,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.155%の固定金利を支払う	Bank of America	15/6/2032	(75,065)	(75,065)
IRS	USD 14,784,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.07269%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2032	(199,049)	(199,049)
IRS	USD 7,457,888	ファンドは2.981%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2032	42,550	42,550
IRS	USD 7,373,000	ファンドは2.769%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2032	(90,719)	(90,719)
IRS	USD 6,144,167	ファンドは2.818%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	5/7/2032	(49,972)	(49,972)
IRS	USD 5,925,920	ファンドは2.696%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/7/2032	(109,730)	(109,730)
IRS	USD 4,057,349	ファンドは2.6095%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	7/7/2032	(105,025)	(105,025)
IRS	USD 2,941,500	ファンドは2.6715%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/7/2032	(60,625)	(60,625)
IRS	USD 3,489,271	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.892%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2032	6,377	6,377
IRS	EUR 12,710,000	ファンドは2.048%の固定金利を受け取り、 EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(93,119)	(93,119)
IRS	EUR 12,710,000	ファンドは2.111%の固定金利を受け取り、 EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(58,463)	(58,463)
IRS	EUR 25,420,000	ファンドは2.266%の固定金利を受け取り、 EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	53,604	53,604
IRS	USD 14,080,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.816%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(49,440)	(49,440)
IRS	USD 28,150,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.873%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2032	(163,608)	(163,608)
IRS	EUR 8,974,000	ファンドは2.4425%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2032	(44,889)	(44,889)
IRS	AUD 17,115,000	ファンドは4.16%の固定金利を受け取り、 AUD 3ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2032	(10,193)	(10,193)
IRS	AUD 17,115,000	ファンドは4.14%の固定金利を受け取り、 AUD 3ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2032	(18,930)	(18,930)
IRS	EUR 2,000,000	ファンドは2.099%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	(39,480)	(39,480)
IRS	USD 7,211,000	ファンドは2.58638%の固定金利を受け取り、 USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	(201,614)	(201,614)
IRS	USD 2,260,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.5125%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2032	19,904	19,904
IRS	EUR 8,460,000	ファンドは1.8035%の固定金利を受け取り、 EUR 1日EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2032	(152,701)	(152,701)
IRS	EUR 8,580,000	ファンドは1.568%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2032	(549,377)	(555,388)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 679,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.276%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2032	12,483	12,483
IRS	USD 19,242,000	ファンドは2.534%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	10/8/2032	(626,099)	(626,099)
IRS	EUR 9,310,000	ファンドは1.747%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2032	(191,994)	(191,994)
IRS	USD 11,520,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.4025%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2032	153,470	153,470
IRS	CAD 1,363,000	ファンドは3.26%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	18/8/2032	(22,852)	(26,502)
IRS	USD 450,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.93%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2032	38,046	38,046
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6425%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	15,817	15,817
IRS	USD 2,210,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.645%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	50,931	50,931
IRS	USD 1,355,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.65%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	6,031	30,644
IRS	USD 2,715,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.651%の固定金利を支払う	Bank of America	19/8/2032	61,167	61,167
IRS	CAD 2,700,000	ファンドは3.42%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	22/8/2032	(24,709)	(24,709)
IRS	CAD 1,362,000	ファンドは3.461%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	(8,871)	(8,871)
IRS	USD 890,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7265%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	14,278	14,278
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.72735%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	10,859	10,859
IRS	USD 1,355,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7355%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	20,687	20,687
IRS	USD 7,211,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7435%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2032	105,124	105,124
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.767%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	8,538	8,538
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	7,103	7,103
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8045%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	12,683	12,683
IRS	USD 2,040,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.808%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	18,410	18,410
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.80918%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	12,135	12,135
IRS	USD 680,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8145%の固定金利を支払う	Bank of America	24/8/2032	5,756	5,756
IRS	USD 5,420,000	ファンドは2.665%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2032	(15,341)	(15,341)
IRS	USD 1,360,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.854%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2032	6,883	6,883
IRS	GBP 881,000	ファンドは2.8415%の固定金利を受け取り、GBP 1H SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(10,769)	(10,769)
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.874%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	2,253	2,253
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.88%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	1,904	1,904

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.902%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	624	624
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.905%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	449	449
IRS	USD 675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.9165%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(220)	(220)
IRS	USD 1,310,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.919%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2032	(709)	(709)
IRS	EUR 26,300,000	ファンドは2.1175%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2032	(125,680)	(125,680)
IRS	CAD 2,715,000	ファンドは3.5595%の固定金利を受け取り、CAD 6ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2032	(844)	(844)
IRS	USD 1,362,333	ファンドは2.828%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	29/8/2032	(9,949)	(9,949)
IRS	USD 1,300,000	ファンドは2.873%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/8/2032	(4,447)	(4,447)
IRS	USD 1,445,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.9075%の固定金利を支払う	Bank of America	31/8/2032	637	637
IRS	USD 7,277,057	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.92%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(4,516)	(4,516)
IRS	EUR 16,610,000	ファンドは2.2185%の固定金利を受け取り、EUR 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(7,833)	(7,833)
IRS	USD 45,530,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6925%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	80,347	80,347
IRS	USD 1,362,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.93947%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(3,135)	(3,135)
IRS	USD 1,365,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.944%の固定金利を支払う	Bank of America	1/9/2032	(3,674)	(3,674)
IRS	USD 1,864,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.6885%の固定金利を支払う	Bank of America	6/2/2033	191,742	191,742
IRS	EUR 12,306,000	ファンドは1.91%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2033	(613,434)	(613,434)
IRS	USD 1,498,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.835%の固定金利を支払う	Bank of America	7/5/2034	(6,003)	(6,003)
IRS	USD 4,200,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.59%の固定金利を支払う	Bank of America	29/5/2034	67,044	67,044
IRS	USD 6,450,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.6%の固定金利を支払う	Bank of America	29/5/2034	97,661	97,661
IRS	USD 10,600,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.605%の固定金利を支払う	Bank of America	30/5/2034	155,968	155,968
IRS	USD 294,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.364%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2034	9,924	9,924
IRS	USD 1,405,000	ファンドは2.748%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2034	(3,206)	(3,206)
IRS	USD 8,890,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.497%の固定金利を支払う	Bank of America	12/2/2035	25,597	916,204
IRS	USD 1,000,000	ファンドは1.81%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/2/2037	(77,111)	(77,111)
IRS	USD 2,114,015	ファンドは2.9895%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,168	2,168
IRS	USD 1,789,031	ファンドは2.993%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,055	2,055
IRS	USD 3,766,381	ファンドは3.00397%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	5,776	5,776

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 1,883,191	ファンドは3.0055%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/5/2037	2,989	2,989
IRS	USD 1,013,516	ファンドは2.8025%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/5/2037	(5,613)	(5,613)
IRS	USD 1,066,859	ファンドは2.8175%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/5/2037	(5,347)	(5,347)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.14946%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(34,433)	(34,433)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.19748%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(31,073)	(31,073)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.2215%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(29,392)	(29,392)
IRS	EUR 1,846,800	ファンドは2.32113%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(22,420)	(22,420)
IRS	EUR 3,596,400	ファンドは2.50712%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2037	(18,315)	(18,315)
IRS	USD 1,855,217	ファンドは2.9285%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	(2,111)	(2,111)
IRS	USD 1,855,217	ファンドは2.9555%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	(356)	(356)
IRS	USD 1,952,860	ファンドは3.07028%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2037	7,477	7,477
IRS	USD 3,902,202	ファンドは2.9985%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	5,082	5,082
IRS	USD 3,905,720	ファンドは3.029%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	9,257	9,257
IRS	USD 3,902,202	ファンドは3.0593%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2037	13,389	13,389
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.52853%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/6/2037	(7,392)	(7,392)
IRS	USD 1,952,860	ファンドは3.1175%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/6/2037	10,656	10,656
IRS	USD 1,949,341	ファンドは3.154%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	15/6/2037	13,126	13,126
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.80506%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/6/2037	11,754	11,754
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.909%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	28/6/2037	18,824	18,824
IRS	EUR 374,000	ファンドは2.6325%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/7/2037	59	59
IRS	EUR 1,798,200	ファンドは2.545%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	20/7/2037	(5,528)	(5,528)
IRS	EUR 4,345,000	ファンドは2.2315%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	13/8/2037	(63,597)	(63,597)
IRS	USD 5,490,000	ファンドは2.9505%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	24/8/2037	(2,733)	(2,733)
IRS	USD 5,605,000	ファンドは3.027%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2037	12,120	12,120
IRS	USD 4,160,000	ファンドは3.119%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	26/8/2037	22,304	22,304
IRS	USD 2,775,000	ファンドは3.0525%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/8/2037	8,452	8,452
IRS	USD 5,731,000	ファンドは1.835%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	17/1/2039	(418,752)	(418,752)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 5,030,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、0.7065%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2040	81,600	1,532,569
IRS	USD 8,083,900	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.93%の固定金利を支払う	Bank of America	26/11/2041	(46,745)	(62,200)
IRS	USD 1,484,174	ファンドは2.5735%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	27/5/2042	(4,197)	(4,197)
IRS	USD 2,593,961	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.1955%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2047	(1,058)	(1,058)
IRS	USD 1,299,654	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.132%の固定金利を支払う	Bank of America	21/5/2047	1,683	1,683
IRS	USD 1,898,672	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.14%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2047	1,945	1,945
IRS	EUR 1,260,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.27%の固定金利を支払う	Bank of America	18/1/2048	(28,571)	(28,571)
IRS	USD 4,870,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0775%の固定金利を支払う	Bank of America	5/7/2049	29,225	52,924
IRS	USD 3,370,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.445%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2049	19,303	151,393
IRS	USD 3,440,000	ファンドは1.449%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2050	(62,658)	(824,178)
IRS	USD 18,194,800	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	25/1/2051	(161,146)	(436,587)
IRS	USD 33,463,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.81%の固定金利を支払う	Bank of America	28/1/2051	(296,393)	(805,094)
IRS	USD 18,855,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	1/2/2051	(166,840)	(417,263)
IRS	USD 10,566,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	4/2/2051	(93,499)	(234,493)
IRS	USD 10,880,700	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	5/2/2051	(96,278)	(241,458)
IRS	USD 4,010,000	ファンドは1.585%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	19/2/2051	(77,320)	(862,862)
IRS	USD 4,450,600	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2051	139,727	(99,540)
IRS	USD 16,715,200	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2051	526,207	(392,407)
IRS	USD 2,732,300	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.8%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2051	86,015	(64,142)
IRS	USD 1,343,000	ファンドは1.614%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/6/2051	(26,348)	(281,961)
IRS	USD 36,909,800	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.79%の固定金利を支払う	Bank of America	21/1/2052	1,171,966	(897,347)
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.765%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	17,702	17,702
IRS	EUR 330,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.648%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	11,202	11,202
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.708%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	19,993	19,993
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.729%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	19,149	19,149
IRS	EUR 660,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.73728%の固定金利を支払う	Bank of America	14/4/2052	18,816	18,816
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	22/4/2052	6,921	7,065

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.8599%の固定金利を支払う	Bank of America	25/4/2052	2,666	2,666
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.85%の固定金利を支払う	Bank of America	28/4/2052	9,703	9,273
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.9%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2052	6,965	6,961
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.9095%の固定金利を支払う	Bank of America	2/5/2052	6,530	6,530
IRS	EUR 1,895,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、0.72806%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	54,672	54,672
IRS	EUR 815,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、0.74936%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	22,457	22,457
IRS	EUR 815,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、0.799%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	19,996	19,996
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.8535%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	2,800	2,800
IRS	JPY 10,082,160	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.857%の固定金利を支払う	Bank of America	9/5/2052	2,733	2,733
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.91%の固定金利を支払う	Bank of America	12/5/2052	6,777	6,403
IRS	USD 880,000	ファンドは2.0085%の固定金利を受け取り、USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/5/2052	(1,895)	(1,895)
IRS	USD 3,513,036	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.902%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	280	280
IRS	USD 7,026,075	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.91718%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	(2,050)	(2,050)
IRS	USD 3,513,036	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.9225%の固定金利を支払う	Bank of America	17/5/2052	(1,482)	(1,482)
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.983%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2052	3,260	3,260
IRS	USD 880,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.0525%の固定金利を支払う	Bank of America	19/5/2052	(133)	(133)
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、2.038%の固定金利を支払う	Bank of America	20/5/2052	558	558
IRS	USD 1,531,324	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、1.894%の固定金利を支払う	Bank of America	21/5/2052	400	400
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、0.95%の固定金利を支払う	Bank of America	23/5/2052	10,361	10,361
IRS	JPY 19,611,570	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.88%の固定金利を支払う	Bank of America	23/5/2052	4,478	4,478
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.02637%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(7,189)	(7,189)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.0713%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(5,331)	(5,331)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.11%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	(3,731)	(3,731)
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、1.031%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	6,997	6,997
IRS	EUR 680,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を受け取り、1.057%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	5,922	5,922
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.85%の固定金利を支払う	Bank of America	26/5/2052	4,624	4,624
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、0.7915%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	6,430	6,430

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 946,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.98%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	3,260	3,305
IRS	USD 946,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.99%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	2,263	2,818
IRS	USD 475,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.02794%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	486	486
IRS	USD 1,785,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.03%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	2,163	1,639
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0455%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	113	113
IRS	USD 5,352,444	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0585%の固定金利を支払う	Bank of America	27/5/2052	(2,946)	(2,946)
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.85752%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	13,359	13,359
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.89209%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	11,038	11,038
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9075%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	10,003	10,003
IRS	EUR 2,284,200	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.97108%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	5,734	5,734
IRS	EUR 4,985,550	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.22706%の固定金利を支払う	Bank of America	28/5/2052	(25,000)	(25,000)
IRS	EUR 805,000	ファンドは1.302%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/5/2052	5,020	5,020
IRS	EUR 13,896,000	ファンドは1.6487%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	30/5/2052	(357,205)	(808,695)
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.2135%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2052	585	585
IRS	EUR 680,000	ファンドは1.2403%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	2/6/2052	1,692	1,692
IRS	USD 950,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0785%の固定金利を支払う	Bank of America	3/6/2052	(1,575)	(1,575)
IRS	USD 2,694,243	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.946%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(2,860)	(2,860)
IRS	USD 2,650,787	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9725%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(4,531)	(4,531)
IRS	USD 2,836,045	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.99146%の固定金利を支払う	Bank of America	4/6/2052	(6,163)	(6,163)
IRS	USD 950,000	ファンドは2.15%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	6/6/2052	5,080	5,103
IRS	EUR 805,000	ファンドは1.3%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	5,037	4,966
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.63%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	22,300	22,292
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.24828%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(2,203)	(2,203)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.2785%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(3,540)	(3,540)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.29422%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(4,235)	(4,235)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.31167%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,007)	(5,007)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3165%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,221)	(5,221)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.32558%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(5,623)	(5,623)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.341%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(6,305)	(6,305)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3608%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,181)	(7,181)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.37%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,272)	(7,588)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.3705%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(7,610)	(7,610)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.37987%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(8,025)	(8,025)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.38%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(8,163)	(8,031)
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.5%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(13,248)	(13,340)
IRS	USD 945,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.014%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	1,506	1,506
IRS	USD 945,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0925%の固定金利を支払う	Bank of America	9/6/2052	(2,313)	(2,313)
IRS	EUR 2,397,600	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.25485%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(13,979)	(13,979)
IRS	USD 5,668,572	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9455%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(6,090)	(6,090)
IRS	USD 5,672,091	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.959%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(7,965)	(7,965)
IRS	USD 5,668,572	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.0055%の固定金利を支払う	Bank of America	11/6/2052	(14,403)	(14,403)
IRS	USD 950,000	ファンドは2.105%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/6/2052	2,977	2,977
IRS	USD 950,000	ファンドは2.138%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	13/6/2052	4,590	4,590
IRS	USD 965,000	ファンドは2.0885%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	2,239	2,239
IRS	USD 965,000	ファンドは2.10274%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	2,946	2,946
IRS	USD 965,000	ファンドは2.10523%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	3,070	3,070
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9115%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	6,551	6,551
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9785%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	3,224	3,224
IRS	USD 480,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.03438%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	223	223
IRS	USD 940,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.055%の固定金利を支払う	Bank of America	16/6/2052	(560)	(560)
IRS	JPY 25,029,525	ファンドはJPY 1H TONARの変動金利を受け取り、0.985%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	740	740
IRS	USD 2,779,747	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.9565%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	(3,793)	(3,793)
IRS	USD 2,776,229	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.964%の固定金利を支払う	Bank of America	17/6/2052	(4,297)	(4,297)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.003%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	20/6/2052	(1,964)	(1,964)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 725,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.445%の固定金利を支払う	Bank of America	23/6/2052	(10,932)	(10,932)
IRS	EUR 2,393,302	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.19426%の固定金利を支払う	Bank of America	26/6/2052	(9,694)	(9,694)
IRS	EUR 2,393,797	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.2055%の固定金利を支払う	Bank of America	26/6/2052	(10,486)	(10,486)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.086%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	8/7/2052	2,350	2,350
IRS	USD 965,000	ファンドは2.01254%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2052	(1,226)	(1,226)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.049%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2052	582	582
IRS	EUR 1,700,000	ファンドは1.15%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	(5,633)	(4,548)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.1715%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	(1,165)	(1,165)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.299%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/7/2052	5,411	5,411
IRS	USD 965,000	ファンドは2.0225%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2052	(655)	(655)
IRS	USD 965,000	ファンドは2.023%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/7/2052	(630)	(630)
IRS	EUR 2,272,050	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.957%の固定金利を支払う	Bank of America	22/7/2052	6,614	6,614
IRS	JPY 49,810,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.99%の固定金利を支払う	Bank of America	26/7/2052	1,114	1,114
IRS	USD 965,000	ファンドは2.062%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2052	1,378	1,378
IRS	USD 1,880,000	ファンドは2.11484%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	28/7/2052	7,786	7,786
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.95715%の固定金利を支払う	Bank of America	1/8/2052	3,773	3,773
IRS	EUR 728,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9625%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	10,116	10,116
IRS	EUR 1,285,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.965%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	17,662	17,662
IRS	EUR 1,285,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.9705%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	17,233	17,233
IRS	USD 965,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、1.9518%の固定金利を支払う	Bank of America	4/8/2052	4,004	4,004
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.048%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	5/8/2052	(7,396)	(7,396)
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.07%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(6,223)	(6,223)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.1275%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(3,145)	(3,145)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.15035%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	(2,009)	(2,009)
IRS	USD 940,000	ファンドは2.1%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	3,323	3,323
IRS	USD 940,000	ファンドは2.101%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	3,371	3,371
IRS	USD 965,000	ファンドは2.135%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	5,669	5,144

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 940,000	ファンドは2.15%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	11/8/2052	5,829	5,734
IRS	GBP 1,247,000	ファンドは1.90281%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(24,000)	(24,000)
IRS	GBP 2,495,000	ファンドは1.907%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(47,388)	(47,388)
IRS	GBP 1,247,000	ファンドは1.92999%の固定金利を受け取り、 GBP 1日 SONIAの変動金利を支払う	Bank of America	12/8/2052	(21,956)	(21,956)
IRS	EUR 5,405,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を 受け取り、0.955%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2052	16,023	16,023
IRS	USD 1,775,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.10894%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(7,143)	(7,143)
IRS	USD 1,770,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.11568%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(7,734)	(7,734)
IRS	USD 845,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.1165%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(3,728)	(3,728)
IRS	USD 3,545,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.13505%の固定金利を支払う	Bank of America	14/8/2052	(19,012)	(19,012)
IRS	CAD 580,000	ファンドはCAD 6ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、 3.26%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2052	8,632	11,766
IRS	EUR 690,000	ファンドはEUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を 受け取り、1.26152%の固定金利を支払う	Bank of America	18/8/2052	(2,996)	(2,996)
IRS	EUR 820,000	ファンドは1.2013%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	19/8/2052	572	572
IRS	CAD 1,155,000	ファンドはCAD 6ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、 3.382%の固定金利を支払う	Bank of America	22/8/2052	2,840	2,840
IRS	CAD 575,000	ファンドはCAD 6ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、 3.396%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2052	239	239
IRS	EUR 850,000	ファンドは1.2775%の固定金利を受け取り、 EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	4,558	4,558
IRS	USD 855,000	ファンドは2.1155%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	3,844	3,844
IRS	USD 850,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.04%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2052	(531)	(531)
IRS	GBP 365,000	ファンドはGBP 1日 SONIAの変動金利を受け取り、 2.525%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	8,836	8,836
IRS	USD 850,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.0495%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	(945)	(945)
IRS	USD 8,050,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 1.9395%の固定金利を支払う	Bank of America	26/8/2052	(9,676)	(9,676)
IRS	USD 8,055,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 1.937%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(9,192)	(9,192)
IRS	USD 4,028,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 1.975%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(8,323)	(8,323)
IRS	USD 5,860,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.01%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2052	(17,101)	(17,101)
IRS	CAD 1,170,000	ファンドはCAD 6ヶ月 CDORの変動金利を受け取り、 3.4495%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2052	(8,586)	(8,586)
IRS	USD 845,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.05%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2052	(435)	(988)
IRS	USD 930,000	ファンドは2.7735%の固定金利を受け取り、 USD 1日 SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	21/2/2053	(15,813)	26,966
IRS	USD 2,710,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 0.621%の固定金利を支払う	Bank of America	12/7/2053	39,075	1,059,094

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	USD 480,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、1.645%の固定金利を支払う	Bank of America	15/1/2055	77,882	77,882
IRS	USD 150,500	ファンドは1.6525%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	1/12/2056	(1,377)	(21,140)
IRS	BRL 64,965,000	ファンドは5.42%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/1/2023	(415,430)	(415,430)
IRS	MXN 279,950,277	ファンドはMXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.71%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/11/2026	625,478	625,478
IRS	BRL 30,597,000	ファンドは11.694%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2025	(41,489)	(41,489)
IRS	MXN 274,683,000	ファンドは6.02%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,276,806)	(1,276,806)
IRS	MXN 414,800,000	ファンドは7.481%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(1,157,058)	(1,157,058)
IRS	BRL 8,497,537	ファンドは12.4%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	847,472	847,472
IRS	BRL 14,017,904	ファンドは8.195%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	223,724	223,724
IRS	BRL 10,765,416	ファンドは8.375%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	197,792	197,792
IRS	BRL 29,228,390	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	1,108,337	1,108,337
IRS	BRL 6,194,622	ファンドは9.45%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2023	234,899	234,899
IRS	BRL 21,841,287	ファンドは11.65%の固定金利を受け取り、BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	JP Morgan	2/1/2025	(33,589)	(33,589)
IRS	THB 710,287,976	ファンドはTHB 3ヶ月 BKIBORの変動金利を受け取り、2.17%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/9/2024	(58,498)	(58,498)
IRS	MXN 144,525,723	ファンドはMXN 1ヶ月 MXIBTIEの変動金利を受け取り、7.64%の固定金利を支払う	UBS	18/11/2026	340,576	340,576
TRS	USD 6,000,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(178,127)	(179,276)
TRS	USD 4,771,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(109,157)	(110,170)
TRS	USD 10,190,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	295,241	292,603
TRS	USD 2,500,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	43,225	42,499
TRS	USD 2,044,049	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(20,237)	(21,392)
TRS	USD 11,075,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/9/2022	(516,506)	(533,727)
TRS	USD (591)	ファンドはUSD 1H SOFR - 10bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0 bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	19,929	19,929
TRS	USD (628)	ファンドはUSD 1H SOFR - 12bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	559	559
TRS	USD (9,200)	ファンドはUSD 1H SOFR - 13bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	8,188	8,188
TRS	USD (8,412)	ファンドはUSD 1H SOFR - 8bpsを受け取り、PPG Industries + 0bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	7,487	7,487
TRS	USD (4,206)	ファンドはUSD 1H SOFR - 8bpsを受け取り、Sherwin Williams + 0 bpsを支払う	BNP Paribas	2/9/2022	141,826	141,826
TRS	USD 9,592,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(338,749)	(340,440)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 4,985,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(118,812)	(119,871)
TRS	USD 5,107,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(69,147)	(70,331)
TRS	USD 6,356,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	62,864	61,100
TRS	USD 5,494,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(185,614)	(189,313)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(365,803)	(379,267)
TRS	USD 10,762,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(58,260)	(55,717)
TRS	USD 32,159,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(100,516)	(104,341)
TRS	USD 6,075,300	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	14,026	12,711
TRS	USD 1,922,796	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(12,292)	(13,080)
TRS	USD 5,530,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/9/2022	(237,456)	(245,327)
TRS	EUR 3,200,000	ファンドはEUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(74,116)	(75,219)
TRS	EUR 8,179,000	ファンドはiBoxx Euro Corporate + 0bpsを受け取り、EUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/12/2022	(289,727)	(287,703)
TRS	USD 2,517	ファンドはUSD 1H SOFR + 20bpsを受け取り、S5INDU PERFORMANCE SHELL +0 bpsを支払う	Citibank	9/9/2022	54,137	54,137
TRS	USD (5,000)	ファンドはUSD 1H SOFR - 25bpsを受け取り、Pitney Bowes + 0 bpsを支払う	Citibank	27/12/2022	4,650	4,650
TRS	EUR 300,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、EUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(6,187)	(6,304)
TRS	USD 11,032,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	158,811	156,650
TRS	USD 24,515,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(211,457)	(218,164)
TRS	USD 6,356,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(30,294)	(32,033)
TRS	USD 8,170,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(79,829)	(82,202)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(455,317)	(470,651)
TRS	USD 11,034,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(373,515)	(387,316)
TRS	USD 11,052,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(281,909)	(296,097)
TRS	USD 5,524,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(123,521)	(134,920)
TRS	USD 11,047,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(132,461)	(155,256)
TRS	USD 3,668,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/9/2022	(51,492)	(59,750)
TRS	EUR 6,500,000	ファンドはEUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、iboxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(501,358)	(501,596)
TRS	EUR 2,600,000	ファンドはEUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、iboxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(168,880)	(169,097)

スワップ 2022年8月31日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	EUR 2,370,000	ファンドはEUR 3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、Markit iBoxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/12/2022	(129,449)	(129,643)
TRS	USD 17,000	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	JP Morgan	16/9/2022	(90,837)	(90,837)
TRS	USD 8,274,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(465)	(2,153)
TRS	USD 8,170,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(66,694)	(69,102)
TRS	USD 8,314,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/9/2022	(257,737)	(271,498)
TRS	USD 48,322	ファンドはJPMEMBIBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 65bpsを支払う	JP Morgan	15/11/2022	(1,230,313)	(1,230,313)
TRS	USD 47,678	ファンドはJPMEMBIBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 65bpsを支払う	JP Morgan	16/11/2022	(1,055,280)	(1,055,280)
TRS	USD 90,094,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	2,812,083	2,789,652
TRS	USD 10,749,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(110,002)	(114,638)
TRS	USD 4,502,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(93,118)	(95,337)
TRS	USD 4,502,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(83,581)	(85,800)
TRS	USD 19,228,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(583,052)	(595,995)
TRS	USD 5,530,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(244,305)	(252,176)
TRS	USD 3,668,000	ファンドはMarkit iBoxx US Dollar Liquid + 0bpsを受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/9/2022	(46,062)	(54,321)
合計	(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 7,946,073.031 米ドル)				<u>(23,536,498)</u>	<u>(14,922,666)</u>

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IFS: インフレーション・スワップ

IRS: 金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

買建オプション 2022年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ 損(米ドル)	時価 (米ドル)
56,262,071	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.09	29/9/2022	(60,332)	2,016
56,262,071	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.005	29/9/2022	181,261	781,685
6,444,034	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 136	29/9/2022	(36,648)	9,749
790,000	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1	3/10/2022	211,935	335,363
18,780,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 125	21/12/2022	(21,350)	55,742
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(111,386)	14,015
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(111,386)	14,015
1,490,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/4/2023	(88,531)	20,537
2,200,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/5/2023	(171,437)	37,783
14,380,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 130.04	8/9/2022	(168,493)	41
14,380,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 130.04	8/9/2022	(168,493)	41
32,540,000	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 115	21/9/2022	(261,296)	-
130,240,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.985	13/10/2022	(70,739)	1,071,609
19,570,000	コール	OTC USD/CNH	BNP Paribas	USD 6.8	17/10/2022	125,863	180,658
111,480,000	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1	2/11/2022	499,472	1,720,442
4,410,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.9	12/2/2022	86,455	145,438
18,486,000	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.85	20/9/2022	100,726	174,116
16,596,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.98	22/9/2022	(64,075)	62,348
172,500	プット	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7	11/10/2022	44,765	71,589
132,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	10/11/2022	57,279	128,159
15,805,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 16.5	10/11/2022	(14,221)	174,576
1,030,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	21/12/2022	19,097	61,069
862,500	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.85	18/1/2023	(13,901)	29,814
15,986,000	コール	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.702	15/9/2022	(68,183)	26,350
16,780,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 115	13/9/2022	(36,748)	-
53,255,170	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.79	26/9/2022	463,237	895,456
16,282,000	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.83	28/9/2022	103,010	199,497
17,195,000	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.8	11/10/2022	174,556	282,025
12,117,000	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 0.99	26/10/2022	(14,472)	134,002
43,987,729	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.8	27/10/2022	341,815	756,840
1,350,000	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 122	8/12/2022	(120,766)	32,999
895,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 7	12/2/2022	104,632	219,639
21,910,000	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 6.9	22/9/2022	23,839	120,331
26,043,000	プット	OTC EUR/NOK	HSBC Bank	EUR 9.39	30/9/2022	(270,737)	3,634
10,900,000	コール	OTC EUR/CNH	HSBC Bank	EUR 7	18/11/2022	(8,895)	125,993
37,113,297	プット	OTC EUR/CHF	JP Morgan	EUR 0.965	14/9/2022	(197,113)	78,097
88,628,770	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	15/9/2022	461,112	1,319,128
13,070,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 130.04	15/9/2022	(202,090)	1,018
345,000	プット	OTC USD/SEK	JP Morgan	USD 9.5	19/9/2022	(34,074)	81
11,052,000	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 16.9	20/10/2022	(47,813)	177,814
8,993,000	プット	OTC EUR/NOK	JP Morgan	EUR 9.35	26/10/2022	(58,912)	5,400
9,270,000	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 130	15/11/2022	(15,330)	41,124
7,366,000	コール	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 70	8/9/2022	(75,997)	205
7,366,000	プット	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 970	8/9/2022	372,631	571,366
860,000	コール	OTC USD/CNH	Morgan Stanley	USD 7.2	11/10/2022	7,753	28,823
748,680	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 109	12/10/2022	(20,963)	-
16,845,300	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 116	12/10/2022	(82,295)	11
16,300,000	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 134	26/10/2022	(128,740)	121,155
30,341,000	プット	OTC EUR/NOK	Morgan Stanley	EUR 9.65	16/11/2022	(126,753)	145,828
17,387,000	プット	OTC USD/CAD	RBC	USD 1.25	10/4/2022	(50,992)	2,125
64,834,996	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 130	8/9/2022	(817,073)	172
9,290,000	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 127	21/9/2022	(65,727)	282
5,615,000	コール	OTC USD/JPY	RBC	USD 135	10/12/2022	135,928	174,465
2,020,000	コール	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.1	9/6/2022	(129,952)	-

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
13,540,000	コール	OTC EUR/CHF	UBS	EUR 1.06	5/9/2022	(70,482)	-
561,600	コール	OTC AUD/USD	UBS	AUD 0.76	22/9/2022	(31,102)	229
1,487	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 400	2/9/2022	(323,553)	556,881
1,249	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 115	16/9/2022	(171,235)	190,472
1,367	プット	Apple	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	(132,846)	7,519
347	プット	Apple	Exchange Traded	USD 140	16/9/2022	(144,934)	10,237
513	コール	BASF	Exchange Traded	EUR 52	16/9/2022	(107,176)	513
1,057	コール	BASF	Exchange Traded	EUR 56	16/9/2022	(176,133)	1,057
366	コール	Cellnex Telecom	Exchange Traded	EUR 54	16/9/2022	(50,472)	-
163	プット	Dollar Tree	Exchange Traded	USD 145	16/9/2022	32,391	147,515
35	コール	Domino's Pizza	Exchange Traded	USD 400	16/9/2022	(47,272)	7,700
111	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	16/9/2022	(39,319)	19,203
80	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 350	16/9/2022	(5,620)	80
80	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 850	16/9/2022	(71,465)	1,841
120	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 700	16/9/2022	(101,972)	960
214	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,000	16/9/2022	(108,266)	5,673
120	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 300	16/9/2022	(229,225)	18,668
477	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 400	16/9/2022	(626,899)	144,116
477	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 700	16/9/2022	(519,986)	790,968
836	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 140	16/9/2022	(53,044)	2,091
1,033	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 130	16/9/2022	(33,474)	2,584
175	プット	First Quantum Minerals	Exchange Traded	CAD 18	16/9/2022	(9,538)	1,266
925	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 10	16/9/2022	(30,973)	925
55	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 200	16/9/2022	(79,167)	1,437
55	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 7,000	16/9/2022	(180,362)	19,792
363	コール	General Motors	Exchange Traded	USD 38	16/9/2022	(63,858)	73,689
1,058	プット	Intel	Exchange Traded	USD 32.5	16/9/2022	62,180	125,902
44	コール	Intuit	Exchange Traded	USD 490	16/9/2022	(77,120)	6,050
125	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 14	16/9/2022	(2,836)	1,875
530	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 290	16/9/2022	(379,866)	21,465
399	コール	Mosaic	Exchange Traded	USD 70	16/9/2022	(234,082)	5,187
120	プット	Sherwin-Williams	Exchange Traded	USD 240	16/9/2022	(49,948)	97,200
1,081	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 97.125	16/9/2022	(126,063)	13,513
2,531	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	16/9/2022	(1,231,911)	56,947
75	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 405	16/9/2022	64,004	84,225
675	プット	Uber Technologies	Exchange Traded	USD 15	16/9/2022	(28,330)	675
37	コール	United Rentals	Exchange Traded	USD 350	16/9/2022	(26,778)	925
75	コール	Valero Energy	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	8,270	63,187
144	プット	Vertiv Holdings	Exchange Traded	USD 7.5	16/9/2022	(9,033)	144
185	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	(58,872)	4,440
750	コール	Western Digital	Exchange Traded	USD 60	16/9/2022	(30,568)	3,375
141	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 118.5	23/9/2022	565	58,383
166	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 116.5	23/9/2022	(1,188)	118,016
442	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 116	23/9/2022	(2,106)	238,265
1,326	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 117	23/9/2022	96,078	1,232,766
10	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 900	30/9/2022	340,295	654,750
57	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 100	30/9/2022	2,754,471	4,485,615
482	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 410	30/9/2022	459,930	798,192
2,660	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 415	30/9/2022	3,356,440	5,274,780
489	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.125	14/10/2022	(13,267)	110,025
425	プット	Carnival	Exchange Traded	USD 5	21/10/2022	(10,044)	3,613
55	プット	Change Healthcare	Exchange Traded	USD 17	21/10/2022	(68)	1,375
38	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	21/10/2022	(39,700)	22,705
266	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,000	21/10/2022	(91,321)	50,163

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
210	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 400	21/10/2022	50,846	167,337
135	プット	iHeartCommunications	Exchange Traded	USD 7.5	21/10/2022	(5,932)	6,750
425	プット	KB Home	Exchange Traded	USD 25	21/10/2022	3,015	30,812
109	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 290	21/10/2022	(35,168)	33,245
8	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	21/10/2022	(13,538)	18,800
23	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 500	21/10/2022	(219,472)	54,395
125	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 5	21/10/2022	(6,799)	938
160	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 6	21/10/2022	(3,242)	3,440
1,088	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 430	21/10/2022	(527,385)	236,640
15	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 316.67	21/10/2022	(10,160)	14,663
99	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 320	21/10/2022	(75,149)	88,605
185	コール	Walt Disney	Exchange Traded	USD 130	21/10/2022	(50,270)	15,818
350	プット	Xerox Holdings	Exchange Traded	USD 15	21/10/2022	4,948	17,500
86	コール	Dynatrace	Exchange Traded	USD 45	18/11/2022	(33,278)	14,620
109	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 330	18/11/2022	(1,878)	117,175
54	コール	Generac Holdings	Exchange Traded	USD 300	18/11/2022	(81,470)	21,600
5	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	18/11/2022	(5,586)	23,475
138	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 380	18/11/2022	66,312	140,898
39	コール	Tesla	Exchange Traded	USD 320	18/11/2022	(29,239)	57,037
250	コール	Western Digital	Exchange Traded	USD 65	18/11/2022	(18,156)	3,500
375	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 20	16/12/2022	(15,148)	6,563
352	コール	Commerzbank	Exchange Traded	EUR 9	16/12/2022	(27,995)	4,050
45	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,000	16/12/2022	(26,406)	10,647
130	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 100	16/12/2022	(85,283)	86,942
137	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 300	16/12/2022	(12,335)	148,092
400	コール	EURO STOXX Bank Index	Exchange Traded	EUR 100	16/12/2022	(41,676)	8,504
425	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 8	16/12/2022	(17,519)	3,188
48	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 15	16/12/2022	(803)	1,320
14	コール	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	Exchange Traded	EUR 640	16/12/2022	13,967	75,457
4	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 300	16/12/2022	(2,089)	28,080
1,082	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	16/12/2022	(1,223,449)	696,267
249	プット	STOXX Europe 600	Exchange Traded	EUR 350	16/12/2022	(82,741)	66,013
146	プット	Automobiles & Parts Index STOXX Europe 600	Exchange Traded	EUR 470	16/12/2022	(10,616)	153,366
47	プット	Chemicals Index STOXX Europe 600	Exchange Traded	EUR 840	16/12/2022	(20,299)	14,811
103	プット	Chemicals Index STOXX Europe 600	Exchange Traded	EUR 40	16/12/2022	28,699	180,328
28	プット	STOXX Europe 600 Personal & Household Goods Index	Exchange Traded	EUR 800	16/12/2022	(16,212)	15,056
79	コール	Abbott Laboratories	Exchange Traded	USD 125	20/1/2023	(42,441)	5,530
14	コール	Adobe	Exchange Traded	USD 480	20/1/2023	(38,822)	11,235
20	コール	Align Technology	Exchange Traded	USD 290	20/1/2023	(46,833)	37,900
140	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	20/1/2023	(61,484)	60,900
5	コール	Booking Holdings	Exchange Traded	USD 600	20/1/2023	(79,939)	11,550
88	コール	Dynatrace	Exchange Traded	USD 45	20/1/2023	(25,035)	23,980
27	コール	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 340	20/1/2023	(22,237)	34,897
88	コール	Glencore	Exchange Traded	GBP 5.8	20/1/2023	(36,841)	12,627
13	コール	Humana	Exchange Traded	USD 500	20/1/2023	8,586	36,660
15	コール	Intuit	Exchange Traded	USD 450	20/1/2023	(818)	59,625
91	コール	Otis Worldwide	Exchange Traded	USD 85	20/1/2023	(21,363)	10,920
500	プット	PG&E	Exchange Traded	USD 7	20/1/2023	(4,959)	7,500
65	コール	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 6,000	20/1/2023	(44,506)	488

買建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
48	コール	salesforce.com	Exchange Traded	USD 210	20/1/2023	(57,917)	11,712
48	コール	salesforce.com	Exchange Traded	USD 200	20/1/2023	(48,289)	18,240
16	コール	ServiceNow	Exchange Traded	USD 550	20/1/2023	(65,236)	24,320
62	コール	XPO Logistics	Exchange Traded	USD 57.5	20/1/2023	(13,716)	28,830
651	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 97.125	10/3/2023	(298,080)	117,994
649	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.75	10/3/2023	(394,443)	214,981
652	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.375	10/3/2023	(290,316)	387,125
1,089	コール	Nasdaq-100 Index	Goldman Sachs	USD 707.725	16/9/2022	(236,074)	1,421
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 896,415,716米ドル)						(3,419,666)	29,778,206

売建オプション 2022年8月31日現在

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
(112,608,663)	プット	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 0.975	29/9/2022	55,177	(451,475)
(18,780,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 120	21/12/2022	12,860	(16,531)
(14,380,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 124.71	8/9/2022	56,082	-
(14,380,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 124.71	8/9/2022	56,082	-
(32,540,000)	プット	OTC USD/JPY	Barclays	USD 112	21/9/2022	150,986	-
(130,240,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.965	13/10/2022	30,954	(533,475)
(111,480,000)	プット	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 0.98	2/11/2022	(206,478)	(968,873)
(18,486,000)	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.95	20/9/2022	(22,944)	(51,043)
(22,128,000)	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 0.95	22/9/2022	34,842	(14,639)
(23,707,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 15.75	10/11/2022	867	(76,183)
(4,390,000)	コール	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	10/11/2022	12,649	(140,308)
(23,980,000)	コール	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.716	15/9/2022	40,367	(8,363)
(16,780,000)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 109	13/9/2022	41,950	-
(53,255,170)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.99	26/9/2022	753	(116,994)
(16,282,000)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 6.93	28/9/2022	(22,938)	(72,859)
(12,117,000)	プット	OTC EUR/USD	Goldman Sachs	EUR 0.96	26/10/2022	29,644	(38,324)
(43,987,729)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 7.05	27/10/2022	(18,960)	(129,809)
(43,987,729)	コール	OTC USD/CNH	Goldman Sachs	USD 7.05	27/10/2022	(55,469)	(129,809)
(21,910,000)	コール	OTC USD/CNH	HSBC Bank	USD 7	22/9/2022	1,871	(36,449)
(37,113,297)	プット	OTC EUR/CHF	JP Morgan	EUR 0.94	14/9/2022	50,549	(7,085)
(88,628,770)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 7	15/9/2022	154,691	(95,951)
(13,070,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 124.71	15/9/2022	90,049	(3)
(17,195,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	11/10/2022	(120,392)	(282,025)
(19,570,000)	コール	OTC USD/CNH	JP Morgan	USD 6.8	17/10/2022	(20,674)	(180,659)
(16,578,000)	プット	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 16.35	20/10/2022	35,841	(102,337)
(7,368,000)	コール	OTC USD/ZAR	JP Morgan	USD 18	20/10/2022	9,113	(61,583)
(9,270,000)	プット	OTC USD/JPY	JP Morgan	USD 125	15/11/2022	5,801	(11,719)
(7,366,000)	コール	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 40	8/9/2022	115,068	(659)
(11,048,000)	プット	OTC USD/CLP	Morgan Stanley	USD 920	8/9/2022	(236,018)	(332,302)
(5,615,000)	コール	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 135	12/10/2022	(126,704)	(174,465)
(16,300,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 130	26/10/2022	75,580	(44,975)
(30,341,000)	プット	OTC EUR/NOK	Morgan Stanley	EUR 9.35	16/11/2022	37,045	(36,464)
(18,717,000)	プット	OTC USD/JPY	Morgan Stanley	USD 109	10/12/2022	31,295	-
(64,834,996)	プット	OTC USD/JPY	RBC	USD 125	8/9/2022	299,927	-
(4,847)	プット	S&P 500 Index	Citibank	USD 700	16/9/2022	710,775	(55,051)
(1,137)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 380	2/9/2022	234,331	(9,665)
(1,037)	コール	Alphabet	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	100,376	(12,963)
(1,714)	プット	Apple	Exchange Traded	USD 115	16/9/2022	73,409	(2,571)
(163)	プット	Dollar Tree	Exchange Traded	USD 125	16/9/2022	28,426	(12,714)
(954)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 550	16/9/2022	1,258,565	(712,468)
(110)	プット	FTSE 100 Index	Exchange Traded	GBP 600	16/9/2022	245,617	(7,981)
(530)	コール	Microsoft	Exchange Traded	USD 310	16/9/2022	53,938	(4,770)
(75)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 385	16/9/2022	(19,151)	(26,325)
(37)	プット	United Rentals	Exchange Traded	USD 270	16/9/2022	9,821	(11,748)
(75)	プット	Valero Energy	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	17,982	(20,850)
(185)	プット	Walt Disney	Exchange Traded	USD 110	16/9/2022	(13,455)	(32,468)
(1,722)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 115	23/9/2022	33,258	(484,313)
(575)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 114	23/9/2022	(5,366)	(76,367)
(87)	プット	US Treasury 5 Year Note	Exchange Traded	USD 111.25	23/9/2022	(10,385)	(73,406)
(57)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 100	30/9/2022	(1,006,362)	(1,633,620)
(10)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 900	30/9/2022	(117,437)	(227,400)
(2,660)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 390	30/9/2022	(1,247,280)	(1,956,430)
(482)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 385	30/9/2022	(166,780)	(284,621)
(434)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.5	14/10/2022	(139,323)	(322,788)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建オプション 2022年8月31日現在(続き)

契約数	コール/ プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価益/ (損)(米ドル)	時価 (米ドル)
(38)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 260	21/10/2022	21,404	(8,151)
(210)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 200	21/10/2022	(24,315)	(81,935)
(109)	プット	Microsoft	Exchange Traded	USD 250	21/10/2022	(25,239)	(63,765)
(21)	プット	Nasdaq-100 Index	Exchange Traded	USD 600	21/10/2022	(242,778)	(518,595)
(23)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 250	21/10/2022	148,874	(24,265)
(2,175)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 440	21/10/2022	662,857	(204,450)
(15)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 233.33	21/10/2022	1,813	(12,075)
(219)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 240	21/10/2022	(1,685)	(208,598)
(5)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 700	21/10/2022	(196,675)	(210,563)
(185)	プット	Walt Disney	Exchange Traded	USD 110	21/10/2022	(32,326)	(74,463)
(86)	プット	Dynatrace	Exchange Traded	USD 35	18/11/2022	4,181	(18,490)
(109)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 260	18/11/2022	6,950	(40,766)
(54)	プット	Generac Holdings	Exchange Traded	USD 220	18/11/2022	(67,783)	(116,640)
(138)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 340	18/11/2022	(20,146)	(46,575)
(39)	プット	Tesla	Exchange Traded	USD 240	18/11/2022	(9,740)	(55,478)
(352)	プット	Commerzbank	Exchange Traded	EUR 7.2	16/12/2022	(18,534)	(36,448)
(14)	プット	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	Exchange Traded	EUR 520	16/12/2022	18,970	(14,216)
(438)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 96.25	16/12/2022	(22,833)	(213,525)
(1,298)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 310	16/12/2022	794,702	(332,937)
(146)	プット	STOXX Europe 600					
(103)	プット	Automobiles & Parts Index	Exchange Traded	EUR 400	16/12/2022	4,192	(67,554)
		STOXX Europe 600					
		Chemicals Index	Exchange Traded	EUR 940	16/12/2022	(11,462)	(79,087)
(977)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96.25	13/1/2023	(93,948)	(848,769)
(977)	プット	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 96	13/1/2023	(63,144)	(549,563)
(79)	プット	Abbott Laboratories	Exchange Traded	USD 105	20/1/2023	(13,410)	(55,103)
(14)	プット	Adobe	Exchange Traded	USD 400	20/1/2023	(15,462)	(64,085)
(20)	プット	Align Technology	Exchange Traded	USD 230	20/1/2023	3,947	(47,500)
(140)	プット	Alphabet	Exchange Traded	USD 100	20/1/2023	15,505	(65,100)
(5)	プット	Booking Holdings	Exchange Traded	USD 2,000	20/1/2023	(47,141)	(114,000)
(88)	プット	Dynatrace	Exchange Traded	USD 35	20/1/2023	11,069	(26,180)
(27)	プット	Eli Lilly	Exchange Traded	USD 280	20/1/2023	7,392	(35,303)
(88)	プット	Glencore	Exchange Traded	GBP 4.5	20/1/2023	(7,168)	(40,457)
(13)	プット	Humana	Exchange Traded	USD 390	20/1/2023	19,223	(7,865)
(15)	プット	Intuit	Exchange Traded	USD 370	20/1/2023	20,028	(27,000)
(91)	プット	Otis Worldwide	Exchange Traded	USD 65	20/1/2023	4,976	(17,973)
(96)	プット	salesforce.com	Exchange Traded	USD 160	20/1/2023	(29,748)	(140,400)
(16)	プット	ServiceNow	Exchange Traded	USD 450	20/1/2023	(11,077)	(79,280)
(62)	プット	XPO Logistics	Exchange Traded	USD 45	20/1/2023	7,588	(17,205)
(651)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.625	10/3/2023	158,017	(207,506)
(652)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 96.75	10/3/2023	31,609	(684,600)
(649)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.125	3/10/2023	189,657	(425,906)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-791,614,104米ドル)						1,818,765	(15,966,251)

買建スワップション 2022年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 6,550,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(96,317)	42,374
EUR 6,550,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(32,871)	42,374
EUR 19,800,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	21/9/2022	(172,863)	233,568
USD 5,000,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	7,694	46,205
USD 2,500,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	4,590	23,102
USD 16,100,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を15/6/2024より毎年受け取り、3.9%の固定金利を15/12/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	13/6/2023	(117,700)	164,050
USD 19,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.62%の固定金利を30/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/5/2025より毎年支払う。	Bank of America	28/5/2024	(113,222)	741,700
USD 19,255,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を30/5/2025より毎年受け取り、2.62%の固定金利を30/11/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	28/5/2024	175,100	1,030,022
USD 9,295,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を25/8/2028より毎年受け取り、3.15%の固定金利を25/2/2028より半年毎に支払う。	Bank of America	23/8/2027	21,114	270,220
EUR 19,400,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.FINSR.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	(37,371)	27,973
EUR 19,300,000	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	(165,237)	22,841
EUR 12,800,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	19/10/2022	(22,852)	7,847

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR 7,400,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	(15,938)	76,736
EUR 7,400,000	ファンドは、コール・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	19/10/2022	(85)	1,416
EUR 6,700,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	14,490	97,891
USD 20,250,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を26/6/2024より毎年受け取り、2.96%の固定金利を26/12/2023より半年毎に支払う。	Barclays	22/6/2023	(135,814)	638,748
USD 20,250,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.96%の固定金利を26/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2024より毎年支払う。	Barclays	22/6/2023	10,078	784,641
EUR 36,480,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.05%の固定金利を4/3/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	29/2/2024	(124,752)	31,378
USD 4,070,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.94%の固定金利を12/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/6/2025より毎年支払う。	Barclays	10/6/2024	27,662	214,678
USD 4,070,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を12/6/2025より毎年受け取り、2.94%の固定金利を12/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	10/6/2024	(17,751)	169,265
USD 16,800,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を25/4/2024より毎年受け取り、3.25%の固定金利を25/10/2023より半年毎に支払う。	BNP Paribas	21/4/2023	(28,804)	334,076
EUR 14,030,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に受け取り、2.63%の固定金利を15/9/2023より毎年支払う。	Citibank	13/9/2022	(136,424)	49,569
USD 8,085,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を11/6/2025より毎年受け取り、2.805%の固定金利を11/12/2024より半年毎に支払う。	Citibank	7/6/2024	14,781	374,564
USD 8,085,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.805%の固定金利を11/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を11/6/2025より毎年支払う。	Citibank	7/6/2024	15,993	375,776

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 10,460,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.232%の固定金利を27/8/2025より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を27/2/2026より毎年支払う。	Citibank	25/2/2025	(155,781)	100,728
USD 10,460,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を27/2/2026より毎年受け取り、1.232%の固定金利を27/8/2025より半年毎に支払う。	Citibank	25/2/2025	531,548	1,408,319
USD 10,193,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.79%の固定金利を29/12/2028より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を29/6/2029より毎年支払う。	Citibank	27/6/2028	(22,671)	586,397
USD 33,500,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.24%の固定金利を16/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/6/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	14/6/2023	445,320	1,771,920
USD 33,500,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/6/2024より毎年受け取り、3.24%の固定金利を16/12/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/6/2023	(573,341)	753,259
USD 17,655,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.43%の固定金利を14/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	(246,627)	368,649
USD 17,655,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年受け取り、2.43%の固定金利を14/2/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	386,030	1,001,306
EUR 71,730,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.35%の固定金利を12/2/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を12/8/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	8/2/2024	(212,489)	92,356
USD 10,890,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を9/4/2027より毎年受け取り、2.342%の固定金利を9/10/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	7/4/2026	(139,695)	822,717
USD 10,890,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.342%の固定金利を9/10/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/4/2027より毎年支払う。	Deutsche Bank	7/4/2026	17,564	422,987
USD 6,000,000	ファンドは、プット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	(15,843)	37,617
USD 427,133,762	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を13/2/2024より毎年受け取り、3.75%の固定金利を13/8/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	9/2/2023	213,469	1,494,870

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
GBP 229,114,058	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはGBP SONIAの変動金利を3/4/2024より毎年受け取り、2.47%の固定金利を3/4/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	3/4/2023	3,311,506	4,812,317
EUR 315,429,398	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR6ヶ月EURIBORの変動金利を4/11/2023より半年毎に受け取り、1%の固定金利を4/5/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	2/5/2023	3,107,925	4,782,149
USD 9,295,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を23/6/2028より毎年受け取り、3.29%の固定金利を23/12/2027より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	21/6/2027	(51,752)	249,871
USD 33,073,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.8725%の固定金利を1/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/9/2024より毎年支払う。	JP Morgan	30/8/2023	43,029	1,270,038
USD 33,073,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を1/9/2024より毎年受け取り、2.8725%の固定金利を1/3/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/8/2023	(6,894)	1,220,114
USD 2,255,000	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1HSOFRの変動金利を29/4/2039より毎年受け取り、2.725%の固定金利を29/10/2038より半年毎に支払う。	JP Morgan	27/4/2038	10,333	102,588
USD 2,255,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.725%の固定金利を29/10/2038より半年毎に受け取り、USD1日SOFRの変動金利を29/4/2039より毎年支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(95,404)	145,394
USD 2,777,500	ファンドは、ブット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD1日SOFRの変動金利を24/2/2040より毎年受け取り、2.62%の固定金利を24/8/2029より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/2/2039	10,258	128,206
USD 2,777,500	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.62%の固定金利を24/8/2039より半年毎に受け取り、USD1日SOFRの変動金利を24/2/2040より毎年支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(110,549)	173,189
EUR 6,666,667	ファンドは、ブット・オプションを購入してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/10/2022	65,081	165,326
USD 29,055,610	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.26%の固定金利を30/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	27/10/2022	(211,621)	58,925
USD 551,236,172	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは0.8%の固定金利を20/9/2023より半年毎に受け取り、USD3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	(1,748,367)	4,564

買建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 4,280,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.195%の固定金利を1/10/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/4/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/3/2024	(107,022)	96,813
USD 4,280,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を1/4/2025より毎年受け取り、2.195%の固定金利を1/10/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/3/2024	108,272	312,107
USD 4,215,000	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.169%の固定金利を9/12/2025より半年毎に受け取り、USD 1日 SOFRの変動金利を9/6/2026より毎年支払う。	UBS	5/6/2025	(57,167)	41,833
USD 4,215,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を9/6/2026より毎年受け取り、1.169%の固定金利を9/12/2025より半年毎に支払う。	UBS	5/6/2025	211,654	586,290
EUR 7,557,000	ファンドは、プット・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を20/7/2028より半年毎に受け取り、3%の固定金利を20/1/2029より毎年支払う。	UBS	18/1/2028	(48,277)	452,943
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 925,357,362米ドル)				3,731,990	29,264,806

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Bank of America	19/10/2022	61,945	(31,033)
USD (5,325,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を7/11/2023より毎年受け取り、2.56%の固定金利を7/5/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	3/11/2022	68,778	(35,192)
USD (5,325,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.06%の固定金利を7/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を7/11/2023より毎年支払う。	Bank of America	3/11/2022	31,408	(72,563)
USD (9,180,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/11/2023より毎年受け取り、2.44%の固定金利を16/5/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	14/11/2022	100,401	(50,084)
USD (24,690,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.475%の固定金利を14/8/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/2/2024より毎年支払う。	Bank of America	10/2/2023	(565,733)	(1,224,956)
USD (24,690,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/2/2024より毎年受け取り、2.475%の固定金利を14/8/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	10/2/2023	349,303	(309,920)
USD (9,388,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を15/3/2024より毎年受け取り、1.93%の固定金利を15/9/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	13/3/2023	262,681	(46,418)
USD (9,388,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.93%の固定金利を15/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/3/2024より毎年支払う。	Bank of America	13/3/2023	(509,739)	(818,839)
USD (9,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.605%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	12/4/2023	175,785	(194,270)
USD (9,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.605%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Bank of America	12/4/2023	(61,905)	(431,960)
USD (28,693,986)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/4/2024より毎年受け取り、3.45%の固定金利を20/10/2023より半年毎に支払う。	Bank of America	18/4/2023	2,106	(431,890)
USD (128,790,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を15/12/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を15/6/2024より毎年支払う。	Bank of America	13/6/2023	137,282	(144,446)
USD (17,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.765%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年支払う。	Bank of America	24/6/2024	8,024	(248,640)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (17,980,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年受け取り、2.765%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	24/6/2024	39,236	(217,429)
USD (31,877,988)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.855%の固定金利を28/2/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/8/2026より毎年支払う。	Bank of America	26/8/2025	35,069	(1,670,403)
USD (31,877,988)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を28/8/2026より毎年受け取り、2.855%の固定金利を28/2/2026より半年毎に支払う。	Bank of America	26/8/2025	(106,186)	(1,811,658)
USD (4,647,500)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を25/8/2028より毎年受け取り、2.15%の固定金利を25/2/2028より半年毎に支払う。	Bank of America	23/8/2027	597	(110,023)
EUR (6,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	79,816	(22,942)
EUR (10,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	21/9/2022	65,877	(35,490)
EUR (6,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、ITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に支払う。	Barclays	21/9/2022	(100,643)	(231,857)
EUR (7,400,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	42,196	(34,795)
EUR (21,485,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	(345,240)	(532,805)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/10/2022	45,825	(72,402)
EUR (6,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	16/11/2022	26,528	(46,686)
EUR (6,600,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	16/11/2022	28,591	(45,989)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (14,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.178%の固定金利を11/7/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を11/1/2024より毎年支払う。	Barclays	9/1/2023	(29,820)	(2,209,461)
USD (44,130,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を16/1/2024より毎年受け取り、1.25%の固定金利を16/7/2023より半年毎に支払う。	Barclays	12/1/2023	175,775	(2,069)
USD (44,130,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.75%の固定金利を16/7/2023より半年毎に受け取り、USD 1日 SOFRの変動金利を16/1/2024より毎年支払う。	Barclays	12/1/2023	(1,278,867)	(1,456,711)
EUR (4,375,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.7%の固定金利を25/1/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を25/7/2023より半年毎に支払う。	Barclays	23/1/2023	(39,949)	(99,376)
USD (9,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を17/4/2024より毎年受け取り、2.63%の固定金利を17/10/2023より半年毎に支払う。	Barclays	13/4/2023	155,449	(202,966)
USD (9,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.63%の固定金利を17/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/4/2024より毎年支払う。	Barclays	13/4/2023	(61,098)	(419,513)
USD (19,790,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年受け取り、1.48%の固定金利を16/2/2024より半年毎に支払う。	Barclays	14/8/2023	15,870	(91,269)
USD (19,790,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.48%の固定金利を16/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年支払う。	Barclays	14/8/2023	329,799	(2,366,151)
EUR (72,960,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.05%の固定金利を4/3/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を4/9/2024より半年毎に支払う。	Barclays	29/2/2024	(1,445,917)	(1,997,296)
USD (17,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.18%の固定金利を20/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年支払う。	Barclays	17/6/2024	70,600	(191,458)
USD (17,980,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、3.18%の固定金利を20/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	17/6/2024	(31,593)	(293,651)
USD (17,385,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.735%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/6/2025より毎年支払う。	Barclays	24/6/2024	(1,287)	(244,894)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (17,385,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、2.735%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Barclays	24/6/2024	38,325	(205,282)
USD (1,255,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/3/2030より毎年受け取り、1.4075%の固定金利を14/3/2030より半年毎に支払う。	Barclays	12/3/2029	2,803	(72,657)
USD (1,255,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.79%の固定金利を14/9/2029より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/3/2030より毎年支払う。	Barclays	12/3/2029	4,811	(79,814)
EUR (12,900,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	BNP Paribas	21/9/2022	119,217	(22,363)
USD (134,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4%の固定金利を25/10/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を25/4/2024より毎年支払う。	BNP Paribas	21/4/2023	38,616	(383,484)
EUR (14,030,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.13%の固定金利を15/9/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/3/2023より半年毎に支払う。	Citibank	13/9/2022	48,366	(2,160)
USD (9,610,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を3/10/2023より毎年受け取り、2.07%の固定金利を3/4/2023より半年毎に支払う。	Citibank	29/9/2022	167,844	(1,292)
USD (9,610,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.57%の固定金利を3/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/10/2023より毎年支払う。	Citibank	29/9/2022	(162,499)	(327,791)
USD (54,305,155)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.88%の固定金利を2/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/11/2023より毎年支払う。	Citibank	31/10/2022	(712,717)	(1,109,144)
USD (57,080,119)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.75%の固定金利を9/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/5/2024より毎年支払う。	Citibank	5/5/2023	348,327	(610,619)
USD (53,491,389)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.67%の固定金利を27/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/6/2024より毎年支払う。	Citibank	23/6/2023	180,433	(733,185)
USD (45,020,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を21/9/2023より毎年受け取り、1.95%の固定金利を21/3/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/9/2022	144,064	-
USD (5,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.54%の固定金利を12/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	7/10/2022	25,389	(676,020)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (9,830,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/10/2023より毎年受け取り、2.34%の固定金利を14/4/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	12/10/2022	151,119	(15,991)
USD (9,830,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.84%の固定金利を14/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	12/10/2022	(4,036)	(192,281)
USD (7,650,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.78%の固定金利を17/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	(37,122)	(174,822)
USD (7,650,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年受け取り、2.28%の固定金利を17/4/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	104,857	(9,893)
USD (5,665,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.535%の固定金利を17/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/10/2023より毎年支払う。	Deutsche Bank	13/10/2022	26,502	(678,343)
USD (18,760,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を20/1/2024より毎年受け取り、1.36%の固定金利を20/7/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	18/1/2023	74,838	(1,327)
USD (28,120,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を13/4/2024より毎年受け取り、2.8825%の固定金利を13/10/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	172,010	(117,275)
USD (28,120,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.8825%の固定金利を13/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を13/4/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	11/4/2023	(89,476)	(378,760)
USD (9,266,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.765%の固定金利を18/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/5/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	16/5/2023	(5,192)	(352,667)
USD (9,266,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/5/2024より毎年受け取り、2.765%の固定金利を18/11/2023より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	16/5/2023	88,796	(258,679)
USD (4,669,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を21/7/2024より毎年受け取り、2.75%の固定金利を21/1/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	19/7/2023	24,670	(144,746)
USD (4,669,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を21/1/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を21/7/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	19/7/2023	(22,774)	(190,227)
USD (12,708,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.435%の固定金利を14/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	(271,619)	(717,352)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (12,708,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/8/2024より毎年受け取り、2.435%の固定金利を14/2/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	10/8/2023	178,467	(267,266)
EUR (71,730,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.35%の固定金利を12/2/2025より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を12/8/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	8/2/2024	(1,203,557)	(1,653,665)
USD (3,990,268)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を8/5/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を8/11/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/5/2024	8,788	(111,319)
USD (3,990,268)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を8/5/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を8/11/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	6/5/2024	11,147	(108,960)
USD (17,385,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年受け取り、2.78%の固定金利を26/12/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	24/6/2024	33,699	(212,733)
USD (17,385,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.78%の固定金利を26/12/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2025より毎年支払う。	Deutsche Bank	24/6/2024	8,237	(238,195)
USD (30,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.15%の固定金利を18/12/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/6/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	16/6/2025	427,647	(1,259,853)
USD (30,000,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/6/2026より毎年受け取り、3.15%の固定金利を18/12/2025より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	16/6/2025	(408,314)	(2,095,814)
USD (18,214,776)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	130,763	(803,655)
USD (5,506,299)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	(66,343)	(348,816)
USD (5,506,299)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	39,530	(242,944)
USD (18,214,776)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	28/7/2025	(219,461)	(1,153,879)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (615,318)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年受け取り、2.545%の固定金利を31/1/2026より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	3,755	(26,950)
USD (615,318)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.545%の固定金利を31/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	(8,526)	(39,230)
USD (27,068,934)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.545%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	215,422	(1,124,490)
USD (27,068,934)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.484%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を31/7/2026より毎年支払う。	Deutsche Bank	29/7/2025	(455,170)	(1,795,083)
EUR (105,926,397)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2%の固定金利を9/9/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を9/3/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/9/2022	(198,659)	(469,882)
EUR (6,500,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	64,730	(7,530)
USD (6,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NAHY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	10,209	(10,284)
USD (5,000,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NAHY.38.V2の変動金利を20/6/2027より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	21/9/2022	(650)	(8,570)
EUR (6,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	19/10/2022	31,746	(73,499)
USD (53,540,807)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.05%の固定金利を28/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/10/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	26/10/2022	(354,779)	(692,086)
USD (54,182,125)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.92%の固定金利を4/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	2/11/2022	(592,081)	(1,023,100)
USD (87,128,964)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.9%の固定金利を15/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	10/11/2022	(1,183,804)	(1,802,548)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (4,487,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.821%の固定金利を15/11/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/11/2022	78,585	(24,257)
EUR (4,487,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.821%の固定金利を15/11/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を15/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	11/11/2022	(175,583)	(269,343)
USD (63,645,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1HSOFRの変動金利を17/11/2023より毎年受け取り、1.74%の固定金利を17/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/11/2022	349,260	(1,583)
USD (63,645,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1HSOFRの変動金利を17/11/2023より毎年受け取り、1.78%の固定金利を17/5/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/11/2022	332,323	(1,813)
USD (53,201,779)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.2%の固定金利を28/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/11/2023より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/11/2022	(10,526)	(616,445)
EUR (5,080,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.75%の固定金利を14/12/2023より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を14/6/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	12/12/2022	(32,032)	(84,434)
USD (854,267,523)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは4.4%の固定金利を13/8/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を13/2/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	9/2/2023	(41,342)	(1,178,710)
USD (174,553,141)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.22%の固定金利を27/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/3/2023	(1,663,804)	(3,126,559)
USD (56,890,021)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.28%の固定金利を28/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/3/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	24/3/2023	(523,541)	(1,007,106)
GBP (458,228,116)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.22%の固定金利を3/4/2023より毎年受け取り、GBP SONIAの変動金利を3/4/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	3/4/2023	(5,060,409)	(6,561,221)
EUR (630,858,796)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.75%の固定金利を4/5/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を4/11/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	2/5/2023	(4,185,937)	(5,815,086)
USD (54,834,240)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.57%の固定金利を15/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	11/5/2023	297,659	(755,707)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (10,125,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.104%の固定金利を20/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を20/6/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	15/6/2023	117,615	(267,641)
USD (10,125,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を20/6/2024より毎年受け取り、3.104%の固定金利を20/12/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	15/6/2023	(75,691)	(460,947)
EUR (26,501,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.5%の固定金利を27/8/2028より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を27/2/2028より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/8/2027	(100,094)	(659,924)
USD (17,304,865)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはCDX.NA.HY.38.V2の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	21/9/2022	70,995	(8,840)
USD (16,150,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.22%の固定金利を4/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/11/2023より毎年支払う。	JP Morgan	2/11/2022	(168,274)	(718,850)
USD (5,580,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.45%の固定金利を7/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を7/12/2023より毎年支払う。	JP Morgan	5/12/2022	(534,288)	(704,478)
USD (8,952,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.421%の固定金利を19/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を19/12/2023より毎年支払う。	JP Morgan	15/12/2022	(898,538)	(1,150,089)
EUR (2,352,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.81%の固定金利を10/2/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を10/8/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	8/2/2023	(89,281)	(162,743)
EUR (2,352,500)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を10/8/2023より半年毎に受け取り、1.81%の固定金利を10/2/2024より毎年支払う。	JP Morgan	8/2/2023	48,482	(24,980)
USD (14,550,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年受け取り、2.278%の固定金利を27/9/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	23/3/2023	323,612	(152,355)
USD (14,550,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.278%の固定金利を27/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を27/3/2024より毎年支払う。	JP Morgan	23/3/2023	(441,435)	(917,402)
USD (9,266,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.674%の固定金利を24/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を24/5/2024より毎年支払う。	JP Morgan	22/5/2023	(61,013)	(392,967)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (9,266,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を24/5/2024より毎年受け取り、2.674%の固定金利を24/11/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	22/5/2023	102,233	(229,722)
USD (13,955,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を23/8/2024より毎年受け取り、2.678%の固定金利を23/2/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	21/8/2023	87,460	(416,315)
USD (13,955,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.678%の固定金利を23/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を23/8/2024より毎年支払う。	JP Morgan	21/8/2023	(120,864)	(624,639)
USD (11,300,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.265%の固定金利を6/3/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/9/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	1/9/2022	11,069	(1,615,799)
USD (116,003,796)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.91%の固定金利を6/4/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/10/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	4/10/2022	(592,797)	(1,486,026)
EUR (6,666,667)	ファンドは、コール・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドはITRAXX.XO.37.V1の変動金利を20/6/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	19/10/2022	54,755	(18,175)
USD (107,641,689)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を31/10/2023より毎年受け取り、2.47%の固定金利を30/4/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	27/10/2022	202,959	(14,913)
USD (5,037,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.2%の固定金利を9/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/11/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	7/11/2022	55,826	(49,979)
USD (5,037,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を9/11/2023より毎年受け取り、2.7%の固定金利を9/5/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	7/11/2022	32,105	(52,539)
USD (109,447,660)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.35%の固定金利を12/6/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/12/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	8/12/2022	143,489	(1,030,337)
USD (8,953,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.4325%の固定金利を15/6/2023より半年毎に受け取り、USD 1日 SOFRの変動金利を15/12/2023より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/12/2022	(888,804)	(1,142,174)
EUR (2,352,500)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.798%の固定金利を14/2/2024より毎年受け取り、EUR 6ヶ月 EURIBORの変動金利を14/8/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	10/2/2023	(93,007)	(165,237)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
EUR (2,352,500)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を14/8/2023より半年毎に受け取り、1.798%の固定金利を14/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	10/2/2023	47,581	(24,648)
USD (233,257,979)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年受け取り、1.4%の固定金利を17/2/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	737,821	(30,783)
USD (233,257,979)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.7%の固定金利を17/8/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	(2,908,990)	(3,786,836)
USD (233,257,979)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.6%の固定金利を17/8/2023より半年毎に受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を17/2/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	15/2/2023	(3,158,275)	(4,143,583)
USD (9,192,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を6/3/2024より毎年受け取り、1.724%の固定金利を6/3/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	2/3/2023	271,117	(26,933)
USD (9,192,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.724%の固定金利を6/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/3/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	2/3/2023	(647,885)	(945,935)
USD (9,388,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.84%の固定金利を13/9/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を13/3/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	9/3/2023	(566,955)	(881,923)
USD (9,388,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を13/3/2024より毎年受け取り、1.84%の固定金利を13/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	9/3/2023	277,558	(37,410)
USD (551,236,172)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、0.4%の固定金利を20/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	604,987	(1,373)
USD (551,236,172)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD 3ヶ月BBA SOFRの変動金利を20/6/2023より四半期毎に受け取り、0.6%の固定金利を20/9/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	16/3/2023	1,044,813	(2,536)
USD (58,188,598)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.4%の固定金利を10/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	6/4/2023	(233,479)	(901,193)
USD (26,900,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.849%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	159,797	(107,186)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (26,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.849%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	(106,501)	(373,483)
USD (26,900,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年受け取り、2.831%の固定金利を14/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	160,585	(104,380)
USD (26,900,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.831%の固定金利を14/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を14/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	12/4/2023	(114,787)	(379,752)
USD (9,700,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/4/2024より毎年受け取り、2.575%の固定金利を18/10/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/4/2023	153,681	(186,425)
USD (9,700,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.575%の固定金利を18/10/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/4/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/4/2023	(107,418)	(447,524)
USD (31,327,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を9/6/2024より毎年受け取り、2.84%の固定金利を9/12/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	7/6/2023	44,341	(1,013,594)
USD (31,327,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.84%の固定金利を9/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/6/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	7/6/2023	(46,444)	(1,116,003)
USD (20,971,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.46%の固定金利を10/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/8/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	8/8/2023	(409,228)	(1,155,795)
USD (20,971,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を10/8/2024より毎年受け取り、2.46%の固定金利を10/2/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	8/8/2023	291,771	(454,796)
USD (21,980,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.4075%の固定金利を16/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/8/2023	206,704	(2,748,814)
USD (21,980,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/8/2024より毎年受け取り、1.4075%の固定金利を16/2/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/8/2023	26,681	(89,370)
USD (3,887,390)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.828%の固定金利を15/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	6,808	(114,090)
USD (3,887,390)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年受け取り、2.828%の固定金利を15/11/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	18,098	(102,800)

ブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジー(愛称: BR Win)

売建スワップション 2022年8月31日現在(続き)

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (6,690,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.87%の固定金利を15/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を15/5/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	13/5/2024	963	(171,639)
USD (16,785,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは1.99%の固定金利を22/2/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/8/2025より毎年支払う。	Morgan Stanley	20/8/2024	(121,410)	(1,439,868)
USD (11,012,597)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	83,464	(485,887)
USD (11,012,597)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.555%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	(128,281)	(697,632)
USD (11,012,598)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年受け取り、2.53%の固定金利を30/1/2026より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	92,172	(475,528)
USD (11,012,598)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.53%の固定金利を30/1/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/7/2026より毎年支払う。	Morgan Stanley	28/7/2025	(141,305)	(709,005)
USD (4,590,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3%の固定金利を22/5/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/11/2023より毎年支払う。	Nomura	18/11/2022	3,539	(80,343)
USD (4,590,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を22/11/2023より毎年受け取り、2.5%の固定金利を22/5/2023より半年毎に支払う。	Nomura	18/11/2022	52,276	(31,607)
USD (5,510,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を2/6/2024より毎年受け取り、2.715%の固定金利を2/12/2023より半年毎に支払う。	Nomura	31/5/2023	37,687	(148,000)
USD (5,510,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.715%の固定金利を2/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/6/2024より毎年支払う。	Nomura	31/5/2023	(39,049)	(224,736)
USD (8,155,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.1%の固定金利を22/11/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/5/2025より毎年支払う。	Nomura	20/5/2024	(20,988)	(177,564)
USD (8,155,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を22/5/2025より毎年受け取り、2.1%の固定金利を22/11/2024より半年毎に支払う。	Nomura	20/5/2024	20,663	(122,049)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー)	-2,835,781,783米ドル			(23,197,409)	(97,324,388)

差金決済取引 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価損 (米ドル)
	ベルギー		
15,499	Telenet Group Holding	Bank of America	(18,142)
			(18,142)
	中国		
(63,250)	ZTO Express Cayman	Bank of America	(79,508)
			(79,508)
	イタリア		
417,353	Telecom Italia	Bank of America	(13,486)
			(13,486)
	英国		
60,814	Liberty Global	Bank of America	(80,883)
			(80,883)
合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 3,224,513米ドル)			(192,019)

事後通告証券契約 2022年8月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (1,688,600)	Fannie Mae or Freddie Mac 2% TBA	(1,460,177)	(0.02)
USD (146,106,300)	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	(130,992,993)	(1.46)
USD (2,190,200)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(2,036,458)	(0.02)
USD 43,482,300	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	41,634,302	0.46
USD 127,951,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	125,441,961	1.39
USD (59,493,250)	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	(59,354,975)	(0.66)
USD 234,614,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	237,523,763	2.64
USD (151,563,050)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(140,843,468)	(1.56)
USD (639,300,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(626,007,361)	(6.96)
USD (303,000,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	(301,917,011)	(3.35)
USD 210,000,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	212,284,569	2.36
T B A 合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 1,879,497,039米ドル)		(645,727,848)	(7.18)

< 参考情報 >

ブラックロック・グローバル・ファンズ
USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドの運用状況について
(計算期間: 2021年9月1日~2022年8月31日)

ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド(以下BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド)はブラックロック・ワールド・インカム・ストラテジーが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回(毎年8月末日)です。従って、入手可能な直前の計算期間(決算)である2022年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

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

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

■損益及び純資産変動計算書

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

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

	BGF USダラー・ショート・ デュレーション・ボンド・ファンド 米ドル
期首純資産	1,799,880,962
収益	
預金利息	216,785
債券利息、源泉徴収税控除後	34,284,593
スワップ利息	451,396
短期金融商品預け入れによる利息	273,995
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	1,277,074
配当金、源泉徴収税控除後	-
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	-
有価証券貸付による収益	181,051
投資運用報酬リベート	147,170
その他の払戻し	2,940
収益合計	36,835,004
費用	
差金決済契約に係る支払利息	-
スワップ利息	358,157
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	-
年間サービス費用	1,152,981
ローン・コミットメント・フィー	11,679
保管および預託報酬	214,519
販売報酬	757,277
税金	722,043
投資運用報酬	8,897,694
費用合計	12,114,350
純利益	24,720,654
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(43,735,275)
事後通告証券契約	(14,942)
差金決済取引	-
上場先物取引	3,567,595
オプション／スワップシジョン契約	-
スワップ取引	898,364
先渡為替予約	7,916,490
その他の取引に係る外国通貨	(314,249)
当期実現純評価損	(31,682,017)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	(128,641,194)
事後通告証券契約	5,652
差金決済取引	-
上場先物取引	1,227,181
オプション／スワップシジョン契約	-
スワップ取引	150,223
先渡為替予約	5,160,684
その他の取引に係る外国通貨	(8,897)
当期末実現評価益／(損)の純変動	(122,106,351)
運用成績による純資産の減少	(129,067,714)
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	842,990,604
投資証券買戻しによる正味支払額	(928,812,827)
資本の変動による純資産の減少	(85,822,223)
配当金宣言額	(2,734,206)
期末純資産	1,582,256,819

BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
オーストラリア			
USD 91,000	GALF Bond Issuer Pty 3.4% 30/9/2026	86,759	0.01
USD 26,000	Mineral Resources 8% 1/11/2027	26,138	0.00
USD 400,000	Mirvac Finance 3.625% 18/3/2027	382,246	0.02
USD 260,000	Santos Finance 4.125% 14/9/2027	243,750	0.02
USD 8,450,000	Westpac Banking 3.15% 16/1/2024	8,371,615	0.53
		9,110,508	0.58
オーストリア			
USD 235,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	186,496	0.01
バーレーン			
USD 200,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/5/2030	201,940	0.01
ベルギー			
EUR 1,400,000	KBC 0.5% 3/12/2029	1,273,264	0.08
EUR 900,000	KBC 1.125% 25/1/2024	886,599	0.05
EUR 600,000	KBC 1.5% 29/3/2026	574,816	0.04
		2,734,679	0.17
パミューダ諸島			
USD 200,000	Geopark 5.5% 17/1/2027	175,274	0.01
USD 240,000	Li & Fung 4.5% 18/8/2025	217,726	0.01
USD 18,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	16,991	0.00
USD 3,000	Weatherford International 11% 1/12/2024	3,060	0.00
		413,051	0.02
ブラジル			
USD 5,000,000	Banco Bradesco 2.85% 27/1/2023	4,972,462	0.31
USD 358,000	Brazilian Government International Bond 3.875% 12/6/2030	313,061	0.02
		5,285,523	0.33
英領バージン諸島			
USD 500,000	Huarong Finance 2017 4.25% 7/11/2027	404,716	0.03
USD 400,000	Hysan MTN 2.875% 2/6/2027	373,621	0.02
USD 460,000	Ocean Laurel 2.375% 20/10/2025	413,685	0.03
USD 240,000	SF Investment 2021 2.375% 17/11/2026	220,068	0.01
USD 500,000	Sinochem Offshore Capital 2.25% 24/11/2026*	451,365	0.03
USD 550,000	Sinopec Overseas Development 2017 3.625% 12/4/2027*	541,263	0.03
USD 300,000	Yunda Investment 2.25% 19/8/2025	269,563	0.02
		2,674,281	0.17
カナダ			
USD 8,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 3.875% 15/1/2028	7,174	0.00
USD 167,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	150,096	0.01
USD 129,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	114,360	0.01
USD 75,000	Bombardier 6% 15/2/2028	66,501	0.00
USD 244,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	230,883	0.01
USD 116,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	92,355	0.00
USD 1,005,000	Canadian Pacific Railway 1.75% 2/12/2026	913,372	0.06
USD 652,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	645,526	0.04
USD 5,030,000	CPPIB Capital 0.5% 16/9/2024	4,729,851	0.30
USD 1,885,000	Enbridge 2.5% 14/2/2025	1,809,056	0.12
USD 47,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	41,844	0.00
USD 58,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	50,282	0.00
USD 144,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	122,295	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ(続き)			
USD 129,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	124,821	0.01
USD 73,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	56,444	0.01
USD 46,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	44,232	0.00
USD 3,975,000	OMERS Finance Trust 1.1% 26/3/2026	3,614,572	0.23
USD 136,000	Open Text 3.875% 15/2/2028	116,204	0.01
USD 56,000	Parkland 5.875% 15/7/2027	53,674	0.00
EUR 730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	708,066	0.04
USD 110,000	Videotron 5.125% 15/4/2027	103,313	0.01
		13,794,921	0.87
ケイマン諸島			
USD 650,000	Allegro CLO II-S 4.882% 21/10/2028	628,799	0.04
USD 2,000,000	Allegro CLO IV 4.062% 15/1/2030	1,951,587	0.12
USD 550,000	Allegro CLO XI 4.588% 19/1/2033	538,280	0.03
USD 3,250,000	Apidos CLO XXIX 4.333% 25/7/2030	3,175,579	0.20
USD 385,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	349,925	0.02
USD 1,450,000	ASSURANT CLO 3.75% 20/4/2031	1,427,977	0.09
USD 300,000	Baidu 3.625% 6/7/2027*	285,964	0.02
USD 3,500,000	Bean Creek CLO 3.73% 20/4/2031	3,445,605	0.22
USD 520,000	Benefit Street Partners CLO V-B 3.8% 20/4/2031	512,652	0.03
USD 500,000	Canyon CLO 2018-1 3.582% 15/7/2031	491,496	0.03
USD 1,750,000	Carbone Clo 3.85% 20/1/2031	1,725,938	0.11
USD 2,333,392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 3.652% 15/7/2031	2,302,206	0.15
USD 1,250,000	CARLYLE US CLO 2018-4 4.78% 20/1/2031	1,194,857	0.08
USD 340,000	CDBL Funding 1 3.5% 24/10/2027	321,040	0.02
USD 350,000	China Mengniu Dairy 1.875% 17/6/2025	324,032	0.02
USD 200,000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman 2.45% 9/2/2026	169,623	0.01
USD 1,000,000	CIFC Funding 2017-V 3.92% 16/11/2030	991,613	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 3.702% 15/1/2032	246,523	0.02
USD 7,000,000	CIFC Funding 2019-I 3.81% 20/4/2032	6,886,139	0.44
USD 1,000,000	Clear Creek CLO 3.91% 20/10/2030	988,431	0.06
USD 6,255,000	Deer Creek Clo 2017-1 3.89% 20/10/2030	6,194,951	0.39
USD 225,000	Doha Finance 2.375% 31/3/2026	208,064	0.01
USD 222,000	Fantasia 10.875% 9/1/2023	21,645	0.00
USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	19,500	0.00
USD 2,150,000	Galaxy XXII CLO 3.94% 16/4/2034	2,099,507	0.13
USD 2,500,000	Goldentree Loan Management US Clo 3 4.01% 20/4/2030	2,430,555	0.15
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 3.78% 20/10/2032	489,407	0.03
USD 1,000,000	Goldentree Loan Opportunities XI 3.81% 18/1/2031	991,662	0.06
USD 200,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	161,941	0.01
USD 92,000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5.75% 20/1/2026	85,201	0.01
USD 1,187,902	ICG US CLO 2015-1 3.878% 19/10/2028	1,178,425	0.07
USD 400,000	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 3.82% 16/7/2031	394,419	0.03
USD 350,000	Longfor 3.9% 16/4/2023*	341,250	0.02
USD 250,000	MAF Sukuk 4.638% 14/5/2029*	253,121	0.02
USD 250,000	Marble Point CLO XXII 4.633% 25/7/2034	235,371	0.02
USD 250,000	Milos CLO 3.78% 20/10/2030	246,744	0.02
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 4.09% 18/10/2029	483,316	0.03
USD 4,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 3.66% 18/10/2030	4,801,528	0.30
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 3.868% 19/10/2031	494,864	0.03
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 4.438% 19/10/2031	290,590	0.02
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 3.82% 16/10/2033	833,908	0.05
USD 750,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 4.227% 20/1/2035	727,452	0.05
USD 520,000	OCP CLO 2017-14 4.134% 20/11/2030	516,067	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 8,600,000	Peace Park CLO 3.84% 20/10/2034	8,253,039	0.52
USD 3,920,000	Pikes Peak CLO 1 3.963% 24/7/2031	3,862,468	0.24
USD 200,000	Redsun Properties 10.5% 3/10/2022	17,000	0.00
USD 4,690,000	Regatta VIII Funding 3.99% 17/10/2030	4,654,472	0.29
USD 1,000,000	Regatta VIII Funding 4.44% 17/10/2030	977,270	0.06
USD 250,000	Regatta X Funding 4.19% 17/1/2031	240,524	0.02
USD 1,750,000	Regatta XVI Funding 4.562% 15/1/2033	1,721,466	0.11
USD 275,000	Rockford Tower CLO 2017-3 3.9% 20/10/2030	272,783	0.02
USD 525,000	RR 19 3.652% 15/10/2035	509,845	0.03
USD 2,500,000	RR 3 3.602% 15/1/2030	2,469,819	0.16
USD 480,000	Sharjah Sukuk Program 2.942% 10/6/2027	439,897	0.03
USD 510,000	SNB Funding 2.9% 29/1/2027*	485,909	0.03
USD 1,000,000	Symphony CLO XXIII 4.112% 15/1/2034	973,859	0.06
USD 550,000	Tencent 3.595% 19/1/2028	515,944	0.03
USD 1,000,000	TICP CLO V 2016-1 4.49% 17/7/2031	971,058	0.06
USD 900,000	Trinitas CLO XVIII 3.88% 20/1/2035	874,255	0.06
		78,697,362	4.97
チリ			
USD 200,000	Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	186,636	0.01
USD 235,000	Colbun 3.15% 19/1/2032	200,319	0.01
USD 280,000	Empresa Nacional del Petroleo 4.375% 30/10/2024	278,168	0.02
		665,123	0.04
中国			
USD 210,000	Guoren Property & Casualty Insurance 3.35% 1/6/2026	192,446	0.01
USD 330,000	ZhongAn Online P&C Insurance 3.5% 8/3/2026	270,435	0.02
		462,881	0.03
コロンビア			
USD 311,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	279,447	0.02
USD 200,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	189,509	0.01
USD 260,000	Colombia Government International Bond 8.125% 21/5/2024	270,797	0.02
USD 350,000	Ecopetrol 4.625% 2/11/2031	273,437	0.02
USD 340,000	Ecopetrol 5.375% 26/6/2026	320,587	0.02
USD 340,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024	337,639	0.02
		1,671,416	0.11
デンマーク			
USD 3,160,000	Danske Bank 0.976% 10/9/2025	2,904,448	0.19
USD 3,065,000	Danske Bank 1.621% 11/9/2026	2,719,139	0.17
		5,623,587	0.36
ドミニカ共和国			
USD 298,000	Banco de Reservas de la Republica Dominicana 7% 1/2/2023	299,117	0.02
USD 250,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	228,738	0.01
USD 254,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	232,398	0.02
		760,253	0.05
フィンランド			
EUR 905,000	CRH Finland Services 0.875% 5/11/2023*	892,592	0.06
フランス			
USD 202,000	Altice France 5.5% 15/1/2028	166,066	0.01
USD 326,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	310,932	0.02
EUR 200,000	Arkema 0.125% 14/10/2026	179,123	0.01
EUR 300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 0.75% 8/6/2026	278,429	0.02
EUR 500,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	475,150	0.03
USD 925,000	BPCE 2.045% 19/10/2027	808,334	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
フランス(続き)			
EUR 500,000	Capgemini 0.625% 23/6/2025	475,963	0.03
USD 250,000	Constellium 3.75% 15/4/2029	206,588	0.01
EUR 900,000	Engie 0.375% 28/2/2023*	897,322	0.06
EUR 160,306	FCT Autonoria 2019 0.909% 25/9/2035	159,081	0.01
EUR 160,066	FCT Autonoria 2019 2.759% 25/9/2035	156,284	0.01
EUR 741,795	FCT Noria 2021 0.759% 25/10/2049	722,547	0.04
EUR 463,622	FCT Noria 2021 1.159% 25/10/2049	446,975	0.03
EUR 649,070	FCT Noria 2021 1.559% 25/10/2049	619,669	0.04
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 2.218% 25/2/2038	287,212	0.02
EUR 1,410,404	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 1.218% 27/8/2061	1,407,366	0.09
EUR 1,000,000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 1.868% 27/8/2061	972,159	0.06
EUR 400,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 1.468% 27/5/2061	382,534	0.03
USD 362,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	331,270	0.02
EUR 800,000	Pernod Ricard 0% 24/10/2023	785,714	0.05
EUR 400,000	PSA Banque France 0% 22/1/2025	374,245	0.02
EUR 600,000	Schneider Electric 0.25% 9/9/2024	581,907	0.04
EUR 2,200,000	Societe Generale 1.375% 23/2/2028*	2,161,320	0.14
		13,186,190	0.84
ドイツ			
EUR 535,000	Amphenol Technologies 0.75% 4/5/2026*	495,781	0.03
EUR 600,000	BASF 0.101% 5/6/2023	595,147	0.04
EUR 1,105,000	BASF 2% 5/12/2022*	1,108,494	0.07
EUR 600,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	564,988	0.03
EUR 200,000	Commerzbank 0.75% 24/3/2026	185,840	0.01
EUR 290,000	Covestro 0.875% 3/2/2026	264,680	0.01
EUR 600,000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	560,521	0.04
USD 1,310,000	Deutsche Bank 1.447% 1/4/2025	1,223,876	0.08
EUR 800,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	705,024	0.04
USD 3,385,000	Deutsche Bank 2.552% 7/1/2028	2,894,650	0.18
USD 2,085,000	Deutsche Bank 6.119% 14/7/2026	2,090,413	0.13
EUR 1,315,000	E.ON 0% 24/10/2022	1,314,284	0.09
EUR 210,000	E.ON 0.875% 8/1/2025	202,842	0.01
EUR 300,000	KION 1.625% 24/9/2025	279,642	0.02
EUR 300,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.723% 15/9/2030	292,609	0.02
EUR 400,000	Red & Black Auto Germany 8 UG 0.923% 15/9/2030	384,911	0.02
EUR 1,100,000	Volkswagen Bank 1.875% 31/1/2024	1,090,944	0.07
EUR 600,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	577,573	0.04
EUR 520,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	450,048	0.03
EUR 330,000	Volkswagen Leasing 0.375% 20/7/2026	294,328	0.02
EUR 2,455,000	Volkswagen Leasing 1% 16/2/2023	2,453,995	0.15
EUR 700,000	ZF Finance 3% 21/9/2025	637,558	0.04
		18,668,148	1.17
グアテマラ			
USD 200,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	162,181	0.01
USD 210,000	Guatemala Government Bond 5.375% 24/4/2032	202,003	0.01
		364,184	0.02
香港			
USD 400,000	CITIC 3.875% 28/2/2027*	390,127	0.03
USD 300,000	CMB International Leasing Management 1.25% 16/9/2024	279,563	0.02
USD 200,000	CMB International Leasing Management 1.875% 12/8/2025	183,409	0.01
USD 315,000	GLP China 2.95% 29/3/2026	253,260	0.02
		1,106,359	0.08

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ハンガリー			
USD 200,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	193,112	0.01
インド			
USD 200,000	Export-Import Bank of India 3.375% 5/8/2026	191,112	0.01
USD 468,000	Hindustan Petroleum 4% 12/7/2027	444,145	0.03
USD 300,000	ICICI Bank 3.8% 14/12/2027	285,811	0.02
USD 200,000	ICICI Bank 4% 18/3/2026	195,042	0.01
USD 465,000	Power Finance 3.75% 18/6/2024	456,627	0.03
USD 718,000	REC 3.875% 7/7/2027	672,199	0.04
		2,244,936	0.14
インドネシア			
USD 700,000	Pertamina Persero 1.4% 9/2/2026	630,875	0.04
USD 251,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	253,824	0.02
USD 225,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	227,531	0.01
USD 500,000	Perusahaan Perseroan Persero Perusahaan Listrik Negara 4.125% 15/5/2027	484,759	0.03
		1,596,989	0.10
アイルランド			
USD 2,200,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.45% 29/10/2026	1,945,917	0.12
USD 1,700,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,625,529	0.10
USD 2,160,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 3.3% 23/1/2023	2,151,311	0.14
GBP 899,664	Agora UK 2021 2.787% 22/7/2031	998,396	0.06
GBP 969,633	Atom Mortgage 3.487% 22/7/2031	1,074,383	0.07
GBP 1,199,155	Atom Mortgage 4.387% 22/7/2031	1,274,342	0.08
EUR 525,000	ESB Finance 3.494% 12/1/2024	535,715	0.03
EUR 561,000	Fresenius Finance Ireland 0% 1/10/2025	512,860	0.03
GBP 736,753	Frost CMBS 2021-1 3.043% 20/11/2033	836,474	0.05
EUR 1,050,696	Haus European Loan Conduit No 39 0.917% 28/7/2051	1,013,674	0.06
EUR 796,770	Haus European Loan Conduit No 39 1.367% 28/7/2051	751,920	0.05
EUR 636,816	Haus European Loan Conduit No 39 1.667% 28/7/2051	584,078	0.04
EUR 691,800	Haus European Loan Conduit No 39 2.267% 28/7/2051	633,740	0.04
EUR 1,001,508	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.089% 17/8/2033	956,013	0.06
EUR 918,882	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 1.739% 17/8/2033	864,489	0.06
EUR 324,546	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 2.239% 17/8/2033	316,812	0.02
EUR 1,000,794	Last Mile PE 2021 1.239% 17/8/2031	969,152	0.06
EUR 1,316,723	Last Mile PE 2021 1.389% 17/8/2031	1,294,897	0.08
EUR 678,857	Last Mile PE 2021 1.539% 17/8/2031	647,502	0.04
EUR 918,807	Last Mile PE 2021 1.939% 17/8/2031	850,263	0.05
USD 264,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	249,612	0.01
EUR 2,001,394	Pearl Finance 2020 1.739% 17/11/2032	1,978,458	0.13
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 2.239% 17/11/2032	1,133,449	0.07
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 2.839% 17/11/2032	1,338,359	0.09
USD 1,476,529	Prodigy Finance CM2021-1 3.694% 25/7/2051	1,443,488	0.09
EUR 458,250	River Green Finance 2020 1.122% 22/1/2032	449,254	0.03
EUR 238,875	River Green Finance 2020 1.472% 22/1/2032	229,590	0.01
EUR 636,873	SCF Rahoituspalvelut IX 1.039% 25/10/2030	623,131	0.04
USD 2,850,000	SMBC Aviation Capital Finance 1.9% 15/10/2026	2,448,173	0.16
USD 605,000	SMBC Aviation Capital Finance 2.3% 15/6/2028	497,263	0.03
GBP 798,138	Taurus 2021-1 UK 2.543% 17/5/2031	893,998	0.06
GBP 321,638	Taurus 2021-1 UK 3.343% 17/5/2031	349,052	0.02
GBP 262,075	Taurus 2021-1 UK 4.293% 17/5/2031	281,699	0.02
GBP 487,039	Taurus 2021-4 UK 2.643% 17/8/2031	545,573	0.03
GBP 290,859	Taurus 2021-4 UK 3.793% 17/8/2031	308,997	0.02
EUR 1,477,000	Vita Scientia 2022-1 1.3% 27/2/2033	1,477,821	0.09
		34,085,384	2.14

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	マン島		
USD 209,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	179,106	0.01
	イスラエル		
USD 215,170	Leviathan Bond 5.75% 30/6/2023	214,900	0.01
	イタリア		
EUR 440,000	ACEA 0% 28/9/2025	404,202	0.02
EUR 910,000	ASTM 1% 25/11/2026	807,240	0.05
EUR 1,120,000	Autoflorence 2 0.746% 24/12/2044	1,113,477	0.07
EUR 608,000	Autoflorence 2 0.796% 24/12/2044	582,624	0.04
EUR 414,000	Autoflorence 2 1.196% 24/12/2044	388,437	0.02
EUR 222,000	Autoflorence 2 2.396% 24/12/2044	210,045	0.01
EUR 143,000	Brignole 2021 0.846% 24/7/2036	137,983	0.01
EUR 100,000	Brignole 2021 1.646% 24/7/2036	95,376	0.01
EUR 979,765	Cassia 2022-1 2.891% 22/5/2034	952,007	0.06
EUR 468,531	Cassia 2022-1 3.891% 22/5/2034	468,937	0.03
EUR 270,000	FCA Bank 0% 16/4/2024	259,138	0.02
EUR 180,000	FCA Bank 0.125% 16/11/2023	175,414	0.01
EUR 620,000	FCA Bank 0.5% 18/9/2023	609,443	0.04
EUR 407,862	Progetto Quinto 0.469% 27/10/2036	403,607	0.02
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 2.935% 28/12/2031	575,490	0.04
EUR 320,000	Snam 0% 15/8/2025	295,054	0.02
USD 310,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	297,969	0.02
USD 1,165,000	UniCredit 2.569% 22/9/2026	1,020,609	0.06
EUR 1,180,000	UniCredit 6.95% 31/10/2022	1,189,268	0.08
		9,986,320	0.63
	日本		
EUR 621,000	Asahi 0.01% 19/4/2024	599,632	0.04
EUR 290,000	Asahi 0.155% 23/10/2024	277,001	0.01
USD 1,000,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.08% 19/4/2028	971,135	0.06
USD 5,735,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.788% 18/7/2025	5,760,433	0.37
EUR 1,045,000	Mizuho Financial 0.523% 10/6/2024	1,011,337	0.06
EUR 185,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026	174,712	0.01
USD 2,671,000	Nissan Motor 3.043% 15/9/2023	2,626,419	0.17
USD 2,697,000	Nissan Motor 3.522% 17/9/2025	2,558,429	0.16
USD 1,320,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027	1,224,991	0.08
USD 270,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027*	250,566	0.01
USD 910,000	NTT Finance 4.372% 27/7/2027	915,182	0.06
		16,369,837	1.03
	ジャージー		
USD 1,772,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,690,547	0.11
EUR 1,230,000	Heathrow Funding 1.5% 12/10/2027	1,172,363	0.07
		2,862,910	0.18
	リベリア		
USD 112,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	90,693	0.01
USD 2,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 1/4/2028	1,543	0.00
USD 131,000	Royal Caribbean Cruises 9.125% 15/6/2023	131,984	0.01
USD 31,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	30,733	0.00
		254,953	0.02
	ルクセンブルグ		
USD 200,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance / Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	169,533	0.01
USD 365,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	295,742	0.02
EUR 460,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.208% 4/6/2026	431,072	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ルクセンブルグ(続き)			
EUR 1,897,000	BL Consumer Credit 2021 0.809% 25/9/2038	1,892,880	0.12
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 1.159% 25/9/2038	512,905	0.03
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 1.709% 25/9/2038	645,474	0.04
EUR 355,000	BL Consumer Credit 2021 2.909% 25/9/2038	333,923	0.02
USD 106,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	98,737	0.01
USD 200,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	162,500	0.01
EUR 700,000	FACT Master 0.953% 20/7/2028	675,233	0.04
EUR 979,533	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.123% 14/11/2034	972,170	0.06
EUR 522,418	Germany Compartment Consumer 2020-1 1.723% 14/11/2034	518,477	0.04
EUR 391,813	Germany Compartment Consumer 2020-1 2.473% 14/11/2034	383,008	0.03
USD 200,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	169,747	0.01
EUR 370,000	Highland 0.318% 15/12/2026	328,739	0.02
EUR 405,000	Holcim Finance Luxembourg 0.125% 19/7/2027*	350,591	0.02
EUR 665,000	Medtronic Global 0% 2/12/2022	664,392	0.04
EUR 483,000	Medtronic Global 0% 15/10/2025	449,067	0.03
EUR 635,000	Medtronic Global 0.375% 7/3/2023	632,939	0.04
EUR 1,515,000	SIG Combibloc PurchaseCo 1.875% 18/6/2023*	1,497,556	0.09
EUR 270,000	SIG Combibloc PurchaseCo 2.125% 18/6/2025	258,400	0.02
EUR 605,000	Simon International Finance 1.375% 18/11/2022	605,379	0.04
USD 200,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028	184,000	0.01
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	475,550	0.03
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024	470,765	0.03
EUR 900,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 24/3/2025*	834,187	0.05
		14,012,966	0.89
モーリシャス			
USD 250,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	240,313	0.02
メキシコ			
USD 200,000	BBVA Bancomer 5.125% 18/1/2033	178,999	0.01
USD 221,000	Comision Federal de Electricidad 4.688% 15/5/2029	200,021	0.02
USD 200,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	197,250	0.01
USD 200,000	Grupo KUO 5.75% 7/7/2027	188,566	0.01
USD 350,000	Mexico City Airport Trust 4.25% 31/10/2026	331,625	0.02
USD 380,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	379,810	0.03
USD 200,000	Mexico Government International Bond 4.75% 27/4/2032	194,200	0.01
USD 280,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	210,840	0.01
USD 262,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	203,941	0.01
USD 419,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	390,717	0.03
USD 129,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	118,842	0.01
USD 200,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026	190,883	0.01
		2,785,694	0.18
モロッコ			
USD 316,000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032	237,220	0.02
オランダ			
EUR 701,000	American Medical Systems Europe 1.375% 8/3/2028	642,105	0.04
EUR 600,000	Bayer Capital 1.5% 26/6/2026	567,370	0.04
EUR 890,000	BMW Finance 0% 14/4/2023	884,516	0.06
EUR 490,000	Conti-Gummi Finance 1.125% 25/9/2024	477,860	0.03
EUR 1,115,000	Digital Dutch Finco 0.625% 15/7/2025*	1,031,083	0.07
EUR 560,436	Domi 2021-1 0.349% 15/6/2053	551,742	0.03
EUR 1,726,379	Domi 2022-1 0.798% 15/4/2054	1,711,393	0.11
EUR 832,243	Dutch Property Finance 2020-2 1.002% 28/1/2058	825,158	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 1.562% 28/1/2058	281,263	0.02
EUR 2,253,382	Dutch Property Finance 2021-1 0.862% 28/7/2058	2,225,989	0.14
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 1.312% 28/7/2058	706,797	0.04
EUR 1,098,103	Dutch Property Finance 2021-2 0.912% 28/4/2059	1,082,161	0.07
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.012% 28/4/2059	768,661	0.05
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 1.262% 28/4/2059	458,058	0.03
EUR 275,000	E.ON International Finance 0.75% 30/11/2022	274,894	0.02
EUR 1,155,000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	1,110,959	0.07
USD 520,000	Equate Petrochemical 4.25% 3/11/2026	511,550	0.03
EUR 230,000	GSK Consumer Healthcare Capital NL 1.25% 29/3/2026	217,767	0.01
EUR 700,000	Heimstaden Bostad Treasury 0.25% 13/10/2024	642,587	0.04
EUR 330,000	IMCD 2.125% 31/3/2027	298,785	0.02
EUR 500,000	ING Groep 0.1% 3/9/2025	471,217	0.03
EUR 800,000	ING Groep 1% 20/9/2023	793,414	0.05
USD 900,000	ING Groep 1.726% 1/4/2027	799,488	0.05
EUR 1,000,312	Jubilee Place 0.852% 17/1/2059	989,321	0.06
EUR 407,000	Jubilee Place 1.102% 17/1/2059	369,939	0.03
EUR 201,000	Jubilee Place 1.602% 17/1/2059	179,369	0.01
EUR 431,920	Jubilee Place 2020-1 1.002% 17/10/2057	427,570	0.03
EUR 620,783	Jubilee Place 2021-1 0.832% 17/7/2058	614,012	0.04
EUR 700,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025*	672,731	0.04
EUR 112,218	Magoi 2019 1.385% 27/7/2039	109,005	0.01
EUR 450,000	Mercedes-Benz International Finance 0.25% 6/11/2023	442,212	0.03
USD 120,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.7% 1/5/2025	113,929	0.01
EUR 200,000	Redexis Gas Finance 1.875% 28/5/2025	191,297	0.01
USD 80,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	70,003	0.00
USD 111,000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	108,959	0.01
EUR 935,000	Siemens Financieringsmaatschappij 0.375% 6/9/2023	926,315	0.06
EUR 665,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	670,513	0.04
USD 27,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	22,883	0.00
EUR 410,000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	378,800	0.02
USD 311,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	299,086	0.02
EUR 720,000	Viterrra Finance 0.375% 24/9/2025	634,521	0.04
EUR 1,000,000	Vonovia Finance 0.125% 6/4/2023*	991,827	0.06
USD 194,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	173,420	0.01
		25,720,529	1.63
オマーン			
USD 200,000	Oman Government International Bond 7.375% 28/10/2032	217,500	0.01
USD 267,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	259,352	0.02
		476,852	0.03
パナマ			
USD 225,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	181,669	0.01
USD 250,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior 2.375% 14/9/2025	232,500	0.01
USD 295,000	Banco Nacional de Panama 2.5% 11/8/2030	237,514	0.02
USD 162,000	Carnival 4% 1/8/2028	134,580	0.01
USD 208,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	164,382	0.01
USD 16,000	Carnival 6% 1/5/2029	12,343	0.00
USD 5,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	4,266	0.00
USD 108,000	Carnival 10.5% 1/2/2026	111,445	0.01
USD 248,000	Panama Government International Bond 2.252% 29/9/2032	193,194	0.01
USD 238,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	229,263	0.02
		1,501,156	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
パラグアイ			
USD 319,000	Paraguay Government International Bond 4.95% 28/4/2031	307,982	0.02
USD 332,000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026	332,763	0.02
		640,745	0.04
ペルー			
USD 341,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/1/2026	319,593	0.02
USD 116,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	99,231	0.01
USD 201,000	Peruvian Government International Bond 4.125% 25/8/2027	197,578	0.01
USD 200,000	SAN Miguel Industrias Pet / NG PET R&P Latin America 3.5% 2/8/2028	169,094	0.01
		785,496	0.05
フィリピン			
USD 200,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	198,250	0.01
ポルトガル			
EUR 236,350	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 2.309% 25/1/2035	226,474	0.02
EUR 1,024,185	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.309% 25/1/2035	959,712	0.06
EUR 800,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 2 2.876% 23/9/2038	771,161	0.05
EUR 1,500,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo10.785% 28/10/2040	1,488,071	0.09
EUR 200,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo11.035% 28/10/2040	191,812	0.01
EUR 700,000	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/ViriatoFinanceNo11.635% 28/10/2040	659,234	0.04
		4,296,464	0.27
ルーマニア			
EUR 69,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	54,363	0.00
EUR 66,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029	54,849	0.00
USD 254,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	248,126	0.02
		357,338	0.02
サウジアラビア			
USD 865,000	Saudi Arabian Oil 2.875% 16/4/2024	849,322	0.05
シンガポール			
USD 360,000	BOC Aviation 3.5% 18/9/2027	341,494	0.02
USD 470,000	BPRL International Singapore 4.375% 18/1/2027	452,317	0.03
USD 465,000	Oil India International 4% 21/4/2027	445,490	0.03
USD 473,000	ONGC Videsh Vankorneft 3.75% 27/7/2026	453,897	0.03
		1,693,198	0.11
南アフリカ			
USD 200,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.3% 12/10/2028	177,596	0.01
USD 213,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029	189,321	0.01
		366,917	0.02
韓国			
USD 200,000	GS Caltex 4.5% 5/1/2026	197,764	0.01
USD 320,000	Hyundai Capital Services 3.625% 29/8/2027	301,971	0.02
USD 200,000	KB Kookmin Card 4% 9/6/2025	197,188	0.01
USD 450,000	Kia 1.75% 16/10/2026	400,982	0.03
USD 200,000	Korea Electric Power 3.625% 14/6/2025	196,521	0.01
USD 300,000	Korea Gas 3.875% 13/7/2027	293,934	0.02
USD 200,000	Korea Western Power 4.125% 28/6/2025	197,788	0.01
USD 200,000	LOTTE Property & Development 4.5% 1/8/2025	200,264	0.02
USD 350,000	Mirae Asset 1.375% 7/7/2024	327,948	0.02
USD 200,000	Mirae Asset 2.625% 30/7/2025	186,653	0.01
USD 200,000	NongHyup Bank 4% 6/1/2026	198,325	0.01
		2,699,338	0.17

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スペイン			
EUR 909,668	Autonoria Spain 2021 FT 0.709% 31/1/2039	905,459	0.06
EUR 727,734	Autonoria Spain 2021 FT 0.859% 31/1/2039	711,067	0.04
EUR 181,933	Autonoria Spain 2021 FT 1.609% 31/1/2039	172,659	0.01
EUR 470,088	Autonoria Spain 2021 FT 2.709% 31/1/2039	443,528	0.03
EUR 188,035	Autonoria Spain 2021 FT 3.959% 31/1/2039	177,558	0.01
EUR 500,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025*	467,694	0.03
EUR 200,000	Banco de Sabadell 1.125% 11/3/2027	181,454	0.01
USD 600,000	Banco Santander 1.722% 14/9/2027	518,054	0.03
USD 1,600,000	Banco Santander 2.746% 28/5/2025	1,506,307	0.10
EUR 500,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	467,539	0.03
EUR 403,962	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.528% 20/3/2033	402,715	0.03
EUR 346,253	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 0.778% 20/3/2033	339,841	0.02
EUR 173,127	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 1.778% 20/3/2033	167,375	0.01
EUR 288,545	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 20/3/2033	273,009	0.02
		6,734,259	0.43
スウェーデン			
USD 1,600,000	Svenska Handelsbanken 1.418% 11/6/2027	1,422,213	0.09
EUR 241,000	Volvo Treasury 0% 11/2/2023	240,081	0.01
		1,662,294	0.10
スイス			
EUR 1,300,000	Credit Suisse 3.25% 2/4/2026	1,259,593	0.08
EUR 715,000	UBS 0.25% 29/1/2026	666,667	0.04
EUR 875,000	UBS 0.75% 21/4/2023	872,379	0.06
USD 3,220,000	UBS 1.494% 10/8/2027	2,802,042	0.18
USD 2,680,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,636,601	0.17
		8,237,282	0.53
英国			
USD 200,000	Antofagasta 2.375% 14/10/2030	163,000	0.01
GBP 521,872	Atlas Funding 2021-1 2.501% 25/7/2058	600,602	0.04
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.101% 25/7/2058	114,517	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.301% 25/7/2058	113,087	0.01
GBP 100,000	Atlas Funding 2021-1 3.851% 25/7/2058	112,526	0.01
GBP 1,699,000	Azure Finance NO 2 4.691% 20/7/2030	1,964,651	0.12
USD 235,000	Barclays 3.932% 7/5/2025	230,192	0.02
USD 4,535,000	Barclays 5.501% 9/8/2028	4,496,119	0.28
GBP 202,000	Barley Hill NO 2 3.091% 27/8/2058	226,568	0.01
GBP 115,000	Barley Hill NO 2 3.391% 27/8/2058	127,135	0.01
EUR 545,000	BAT International Finance 0.875% 13/10/2023	538,696	0.03
USD 1,000,000	BAT International Finance 1.668% 25/3/2026	894,358	0.06
GBP 837,000	Brants Bridge 2022-1 0% 12/12/2064	972,445	0.06
GBP 1,680,059	Brass No 10 1.891% 16/4/2069	1,936,582	0.12
GBP 348,000	Canada Square Funding 2021-2 2.584% 17/6/2058	390,988	0.02
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 2.984% 17/6/2058	112,960	0.01
GBP 1,302,401	Canada Square Funding 6 2.411% 17/1/2059	1,494,417	0.09
GBP 431,000	Canada Square Funding 6 2.861% 17/1/2059	475,285	0.03
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 3.011% 17/1/2059	342,147	0.02
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 3.411% 17/1/2059	186,092	0.01
GBP 474,931	CMF 2020-1 2.291% 16/1/2057	548,923	0.03
GBP 220,000	CMF 2020-1 2.691% 16/1/2057	251,932	0.02
GBP 105,000	CMF 2020-1 2.941% 16/1/2057	118,914	0.01
GBP 689,866	Dowson 2021-2 2.371% 20/10/2028	798,073	0.05
GBP 700,000	Dowson 2021-2 2.891% 20/10/2028	796,384	0.05
GBP 800,000	Dowson 2021-2 3.291% 20/10/2028	893,715	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 331,000	Dowson 2022-1 3.441% 20/1/2029	373,813	0.02
GBP 172,000	Dowson 2022-1 3.941% 20/1/2029	194,840	0.01
GBP 100,000	Dowson 2022-1 4.391% 20/1/2029	111,065	0.01
GBP 577,000	Economic Master Issuer 1.991% 25/6/2073	660,430	0.04
GBP 187,000	Economic Master Issuer 2020-1 2.161% 25/6/2072	216,879	0.01
USD 200,000	eG Global Finance 6.75% 7/2/2025	189,263	0.01
GBP 1,075,455	Elvet Mortgages 2020-1 2.268% 22/3/2065	1,246,546	0.08
GBP 967,403	Elvet Mortgages 2021-1 1.957% 22/10/2063	1,110,173	0.07
GBP 914,628	Finsbury Square 2.019% 16/12/2067	1,036,569	0.06
GBP 828,000	Finsbury Square 2.369% 16/12/2067	931,848	0.06
GBP 1,045,000	Finsbury Square 2.619% 16/12/2067	1,172,189	0.07
GBP 298,964	Finsbury Square 2020-1 2.169% 16/3/2070	346,207	0.02
GBP 224,959	Finsbury Square 2020-1 2.719% 16/3/2070	258,113	0.02
GBP 179,648	Finsbury Square 2020-2 2.669% 16/6/2070	208,597	0.01
GBP 1,577,639	Finsbury Square 2021-2 2.169% 16/12/2071	1,791,170	0.11
GBP 730,000	Finsbury Square 2021-2 2.619% 16/12/2071	792,084	0.05
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 2.769% 16/12/2071	389,287	0.02
GBP 201,000	Finsbury Square 2021-2 3.069% 16/12/2071	219,063	0.01
USD 280,000	Fresnillo 4.25% 2/10/2050	216,205	0.01
GBP 1,095,000	Funding IV 2.741% 15/9/2024	1,272,232	0.08
GBP 605,000	Funding IV 3.391% 15/9/2024	702,251	0.04
GBP 230,000	Funding IV 3.891% 15/9/2024	266,942	0.02
GBP 580,000	Funding V 2.441% 15/10/2025	669,914	0.04
GBP 424,000	Funding V 2.891% 15/10/2025	478,144	0.03
GBP 115,000	Funding V 3.391% 15/10/2025	129,082	0.01
GBP 210,000	Funding VI 4.791% 15/7/2026	240,634	0.02
GBP 1,230,979	Gemgarto 2021-1 1.959% 16/12/2067	1,414,297	0.09
GBP 668,000	Gemgarto 2021-1 2.469% 16/12/2067	755,593	0.05
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 2.669% 16/12/2067	240,569	0.01
GBP 858,049	Gemgarto 2021-1 6.369% 16/12/2067	996,303	0.06
USD 600,000	GSK Consumer Healthcare Capital UK 3.125% 24/3/2025	578,719	0.04
GBP 1,309,000	Harben Finance 2.354% 28/9/2055	1,445,930	0.09
GBP 730,000	Harben Finance 2.604% 28/9/2055	774,712	0.05
GBP 441,000	Harben Finance 2.954% 28/9/2055	456,441	0.03
GBP 608,471	Hops Hill No 1 2.641% 27/5/2054	699,259	0.04
GBP 124,993	Hops Hill No 1 3.291% 27/5/2054	142,573	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 3.541% 27/5/2054	225,068	0.01
GBP 99,997	Hops Hill No 1 4.041% 27/5/2054	112,629	0.01
USD 1,605,000	HSBC 2.999% 10/3/2026	1,522,300	0.10
EUR 1,200,000	Informa 1.5% 5/7/2023	1,194,731	0.07
EUR 2,255,000	Informa 2.125% 6/10/2025	2,170,143	0.14
GBP 2,414,676	Jupiter Mortgage NO 1 2.374% 20/7/2060	2,772,803	0.17
GBP 217,750	Lanark Master Issuer 2.263% 22/12/2069	252,637	0.02
GBP 1,434,190	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 2.441% 12/6/2057	1,652,268	0.10
GBP 630,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.191% 12/6/2057	723,600	0.05
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 3.591% 12/6/2057	418,816	0.03
GBP 530,758	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.224% 20/7/2058	602,668	0.04
GBP 266,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.524% 20/7/2058	295,663	0.02
GBP 159,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 2.824% 20/7/2058	169,625	0.01
GBP 103,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 3.224% 20/7/2058	110,068	0.01
GBP 412,833	London Wall Mortgage Capital 2.443% 15/5/2051	468,631	0.03
GBP 462,094	London Wall Mortgage Capital 2.493% 15/5/2052	525,444	0.03
USD 4,800,000	LSEGA Financing 1.375% 6/4/2026	4,331,894	0.27

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 305,000	Mortimer BTL 2021-1 2.51% 23/6/2053	336,732	0.02
GBP 108,000	Mortimer BTL 2021-1 2.86% 23/6/2053	117,676	0.01
EUR 600,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	567,983	0.04
USD 3,025,000	NatWest 1.642% 14/6/2027	2,653,747	0.17
USD 1,780,000	NatWest 2.359% 22/5/2024	1,749,390	0.11
EUR 900,000	NatWest Markets 0.125% 18/6/2026	804,033	0.05
USD 1,810,000	NatWest Markets 1.6% 29/9/2026	1,600,107	0.10
GBP 954,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 2.661% 15/3/2029	1,094,695	0.07
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 3.241% 15/3/2029	881,321	0.06
GBP 735,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 2.591% 15/11/2029	834,654	0.05
GBP 404,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 3.041% 15/11/2029	451,319	0.03
GBP 1,156,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 2.991% 15/4/2030	1,315,122	0.08
GBP 1,702,224	Oat Hill NO 2 2.541% 27/5/2046	1,963,440	0.12
GBP 80,524	Orbita Funding 2020-1 2.271% 17/3/2027	93,527	0.01
GBP 958,609	Pierpont BTL 2021-1 2.21% 22/12/2053	1,087,040	0.07
GBP 1,355,000	Pierpont BTL 2021-1 2.66% 22/12/2053	1,519,865	0.10
GBP 1,260,000	Polaris 2022-1 3.041% 23/10/2059	1,403,300	0.09
GBP 421,000	Polaris 2022-1 3.191% 23/10/2059	463,109	0.03
GBP 307,000	Polaris 2022-1 3.691% 23/10/2059	336,866	0.02
GBP 538,000	Polaris 2022-1 5.091% 23/10/2059	582,347	0.04
GBP 2,218,616	Precise Mortgage Funding 2019-1B 2.541% 12/12/2055	2,568,958	0.16
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.141% 16/10/2056	130,929	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.391% 16/10/2056	111,930	0.01
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 3.641% 16/10/2056	111,592	0.01
GBP 780,734	Residential Mortgage 32 2.652% 20/6/2070	903,868	0.06
GBP 525,000	Residential Mortgage 32 3.602% 20/6/2070	600,408	0.04
GBP 334,794	RMAC No 1 1.61% 12/6/2044	367,305	0.02
USD 322,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	293,387	0.02
GBP 905,000	Sage AR Funding No 1 2.943% 17/11/2030	1,032,184	0.06
GBP 385,000	Sage AR Funding No 1 3.643% 17/11/2030	434,637	0.03
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 3.843% 17/11/2030	601,740	0.04
USD 2,235,000	Santander UK 3.373% 5/1/2024	2,223,788	0.14
GBP 570,484	Satus 2021-1 2.391% 17/8/2028	660,222	0.04
GBP 605,000	Satus 2021-1 2.891% 17/8/2028	687,192	0.04
GBP 743,000	Satus 2021-1 3.291% 17/8/2028	826,515	0.05
GBP 122,000	Satus 2021-1 3.591% 17/8/2028	131,689	0.01
GBP 247,000	Satus 2021-1 4.891% 17/8/2028	263,129	0.02
GBP 6,130,560	Silk Road Finance Number Six 2.26% 21/9/2067	7,140,498	0.45
GBP 916,000	Silverstone Master Issuer 1.869% 21/1/2070	1,054,039	0.07
GBP 1,396,000	Silverstone Master Issuer 2.049% 21/1/2070	1,620,235	0.10
USD 625,000	Standard Chartered 0.991% 12/1/2025	591,375	0.04
GBP 120,000	Stanlington No 2 3.091% 12/6/2056	132,578	0.01
GBP 110,000	Stanlington No 2 3.541% 12/6/2056	120,040	0.01
GBP 303,000	Stanlington No 2 4.641% 12/6/2056	338,092	0.02
GBP 491,748	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.23% 12/7/2063	562,083	0.04
GBP 156,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.48% 12/7/2063	171,015	0.01
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 2.78% 12/7/2063	114,727	0.01
GBP 585,563	Tower Bridge Funding 2020-1 2.772% 20/9/2063	679,712	0.04
GBP 1,060,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.502% 20/9/2063	1,226,696	0.08
GBP 145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 3.852% 20/9/2063	167,670	0.01
GBP 115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 4.852% 20/9/2063	133,122	0.01
GBP 1,904,942	Tower Bridge Funding 2021-1 2.479% 21/7/2064	2,194,214	0.14
GBP 381,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.079% 21/7/2064	435,351	0.03

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 3.429% 21/7/2064	415,888	0.03
GBP 253,000	Tower Bridge Funding 2021-1 3.729% 21/7/2064	283,771	0.02
GBP 252,999	Tower Bridge Funding 2021-2 2.793% 20/11/2063	282,358	0.02
GBP 139,999	Tower Bridge Funding 2021-2 3.193% 20/11/2063	154,726	0.01
GBP 169,999	Tower Bridge Funding 2021-2 3.493% 20/11/2063	181,142	0.01
GBP 747,497	Tower Bridge Funding 2022-1 2.122% 20/12/2063	852,033	0.05
GBP 293,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.402% 20/12/2063	320,657	0.02
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 2.652% 20/12/2063	280,170	0.02
GBP 719,869	Turbo Finance 9 2.521% 20/8/2028	835,012	0.05
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 3.341% 20/8/2028	1,825,812	0.12
GBP 637,522	Twin Bridges 2020-1 2.591% 12/12/2054	740,057	0.05
GBP 1,145,000	Twin Bridges 2020-1 3.341% 12/12/2054	1,319,271	0.08
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 3.591% 12/12/2054	445,627	0.03
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 4.341% 12/12/2054	256,971	0.02
GBP 2,800,067	Twin Bridges 2021-1 2.191% 12/3/2055	3,182,728	0.20
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 2.941% 12/3/2055	475,173	0.03
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 3.441% 12/3/2055	234,382	0.01
GBP 1,101,638	Twin Bridges 2021-2 2.001% 12/9/2055	1,238,643	0.08
GBP 443,000	Twin Bridges 2021-2 2.241% 12/9/2055	476,369	0.03
GBP 338,000	Twin Bridges 2021-2 2.491% 12/9/2055	360,943	0.02
GBP 188,000	Twin Bridges 2021-2 2.841% 12/9/2055	195,113	0.01
GBP 192,841	Twin Bridges 2021-2 4.241% 12/9/2055	223,347	0.01
GBP 1,495,294	Twin Bridges 2022-1 2.111% 1/12/2055	1,677,047	0.11
GBP 891,000	Twin Bridges 2022-1 2.341% 1/12/2055	937,557	0.06
GBP 723,000	Twin Bridges 2022-1 2.641% 1/12/2055	738,999	0.05
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 3.041% 1/12/2055	359,899	0.02
GBP 658,368	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	775,783	0.05
USD 300,000	Virgin Media Secured Finance 5.5% 15/5/2029	267,789	0.02
EUR 530,000	Virgin Money UK 0.375% 27/5/2024	521,069	0.03
EUR 314,000	WPP Finance 2013 3% 20/11/2023	317,921	0.02
		127,840,682	8.08
米国			
USD 5,673,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3.901% 10/8/2035	5,434,154	0.34
USD 2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016-225L 3.597% 10/2/2036	2,023,618	0.13
USD 5,662,000	7-Eleven 0.8% 10/2/2024	5,392,956	0.34
USD 1,165,000	7-Eleven 0.95% 10/2/2026	1,036,330	0.07
EUR 320,000	AbbVie 1.25% 1/6/2024	315,446	0.02
EUR 1,305,000	AbbVie 1.5% 15/11/2023	1,303,695	0.08
USD 1,750,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,654,277	0.11
USD 200,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	168,204	0.01
USD 117,000	AdaptHealth 6.125% 1/8/2028	108,898	0.01
USD 49,000	ADT Security 4.125% 15/6/2023	48,681	0.00
USD 191,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	182,348	0.01
USD 223,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	225,132	0.01
USD 1,185,000	Air Lease 1.875% 15/8/2026	1,040,591	0.07
USD 53,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	43,791	0.00
USD 123,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	112,670	0.01
USD 68,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	64,782	0.00
USD 1,905,000	Alexander Funding Trust 1.841% 15/11/2023	1,811,814	0.11
USD 22,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	21,876	0.00
USD 483,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4.25% 15/10/2027	437,492	0.03
USD 410,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	385,622	0.02
USD 79,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	73,460	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 252,000	American Airlines 11.75% 15/7/2025	277,478	0.02
USD 161,000	American Airlines Aadvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	153,861	0.01
USD 42,000	American Builders & Contractors Supply 4% 15/1/2028	38,078	0.00
USD 3,025,000	American Express 2.55% 4/3/2027	2,820,868	0.18
USD 3,600,000	American Express 3.95% 1/8/2025	3,567,140	0.23
EUR 700,000	American International 1.875% 21/6/2027	658,672	0.04
EUR 1,400,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	1,216,424	0.08
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	920,596	0.06
USD 925,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	840,511	0.05
USD 500,000	American Tower 1.45% 15/9/2026	440,257	0.03
USD 1,245,000	American Tower 1.6% 15/4/2026	1,119,772	0.07
USD 450,000	American Tower 2.4% 15/3/2025	427,079	0.03
USD 85,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	74,335	0.01
USD 88,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	67,130	0.00
USD 13,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 5.75% 1/3/2027	12,338	0.00
USD 173,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7.875% 15/5/2026	176,333	0.01
USD 79,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	81,466	0.01
USD 1,430,000	Aon / Aon Global 2.85% 28/5/2027	1,338,846	0.08
USD 75,000	APX 6.75% 15/2/2027	73,577	0.01
USD 79,000	Aramark Services 5% 1/4/2025	77,254	0.01
USD 78,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	71,980	0.00
USD 96,000	Aramark Services 6.375% 1/5/2025	94,681	0.01
USD 117,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	107,533	0.01
USD 146,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	138,074	0.01
USD 118,000	Arconic 6.125% 15/2/2028	110,956	0.01
USD 100,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	90,754	0.01
USD 538,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	530,777	0.03
USD 228,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	205,678	0.01
EUR 845,000	AT&T 1.05% 5/9/2023*	838,711	0.05
USD 5,035,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	4,611,434	0.29
USD 241,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	222,000	0.01
USD 114,000	Avaya 6.125% 15/9/2028	62,621	0.00
USD 1,380,000	Aviation Capital 1.95% 30/1/2026	1,192,763	0.08
USD 1,665,000	Aviation Capital 1.95% 20/9/2026	1,398,248	0.09
USD 299,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	248,894	0.02
USD 3,054,000	Ball 5.25% 1/7/2025	3,028,973	0.19
USD 11,318	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 2.465% 25/11/2033	10,459	0.00
USD 4,950,000	Bank of America 1.197% 24/10/2026	4,431,846	0.28
USD 2,694,000	Bank of America 1.319% 19/6/2026	2,454,609	0.16
USD 2,825,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	2,638,872	0.17
USD 2,325,000	Bank of America 1.734% 22/7/2027	2,080,700	0.13
USD 4,365,000	Bank of America 1.843% 4/2/2025	4,196,452	0.27
USD 1,575,000	Bank of America 2.015% 13/2/2026	1,478,228	0.09
USD 5,295,000	Bank of America 3.004% 20/12/2023	5,275,938	0.33
USD 4,135,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,148,609	0.26
USD 2,710,000	Bank of New York Mellon 3.43% 13/6/2025	2,679,503	0.17
USD 2,095,000	Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026	2,108,167	0.13
USD 2,935,000	BAT Capital 2.789% 6/9/2024	2,846,923	0.18
USD 8,120,000	BAT Capital 3.222% 15/8/2024	7,936,785	0.50
EUR 510,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	472,742	0.03
EUR 310,000	Becton Dickinson 1.401% 24/5/2023	309,809	0.02
USD 176,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	175,033	0.01
USD 122,000	Black Knight InfoServ 3.625% 1/9/2028	111,986	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,500,000	Blackstone Private Credit Fund 3.25% 15/3/2027	3,012,150	0.19
USD 1,965,000	Blackstone Private Credit Fund 4% 15/1/2029	1,701,369	0.11
USD 258,000	Block 2.75% 1/6/2026	230,114	0.02
USD 93,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	92,701	0.01
USD 1,500,000	Boeing 2.196% 4/2/2026	1,374,694	0.09
EUR 840,000	Booking 0.1% 8/3/2025	789,919	0.05
USD 128,000	Booz Allen Hamilton 3.875% 1/9/2028	114,067	0.01
USD 343,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	339,913	0.02
USD 75,000	Boyne USA 4.75% 15/5/2029	66,975	0.00
USD 1,535,000	Broadcom 3.15% 15/11/2025	1,486,405	0.09
USD 2,700,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,602,199	0.16
USD 84,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GCSI Sellco 4.5% 1/4/2027	71,569	0.00
USD 77,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	72,167	0.01
USD 70,000	Buckeye Partners 4.5% 1/3/2028	61,915	0.00
USD 134,000	BWX Technologies 4.125% 30/6/2028	123,631	0.01
USD 1,130,000	BX Trust 2018-BILT 4.161% 15/5/2030	1,081,454	0.07
USD 397,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	388,448	0.02
USD 84,000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5.75% 1/7/2025	82,701	0.01
USD 28,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	26,079	0.00
USD 157,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	151,476	0.01
USD 85,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	72,535	0.01
USD 125,000	Calpine 5.25% 1/6/2026	121,737	0.01
USD 57,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	52,224	0.00
USD 1,545,000	Capital One Financial 1.878% 2/11/2027	1,365,296	0.09
USD 1,715,000	Capital One Financial 2.636% 3/3/2026	1,628,752	0.10
USD 3,000,000	Capital One Financial 2.986% 6/12/2024	2,923,867	0.19
USD 2,820,000	Capital One Financial 4.927% 10/5/2028	2,798,252	0.18
USD 7,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	6,702	0.00
USD 126,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	104,853	0.01
USD 457,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	436,460	0.03
USD 313,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	288,303	0.02
USD 176,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	171,468	0.01
USD 2,430,160	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2.622% 10/8/2049	2,345,226	0.15
USD 76,000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/7/2025	72,664	0.00
USD 4,000,000	CDW / CDW Finance 4.125% 1/5/2025	3,936,639	0.25
USD 93,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	91,232	0.01
USD 7,625,000	Celanese US 5.9% 5/7/2024	7,693,443	0.49
USD 422,000	Centene 2.45% 15/7/2028	356,446	0.02
USD 162,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	156,549	0.01
USD 142,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	135,780	0.01
USD 3,180,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3.217% 10/11/2049	3,020,328	0.19
USD 64,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	58,767	0.00
USD 1,555,000	Charles Schwab 2.45% 3/3/2027	1,456,527	0.09
USD 3,999,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23/7/2025	3,994,886	0.25
USD 208,000	Cheniere Energy 4.625% 15/10/2028	200,499	0.01
USD 178,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	174,696	0.01
USD 128,301	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 3.074% 20/12/2035	120,825	0.01
USD 141,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	123,587	0.01
USD 44,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	37,661	0.00
USD 65,000	CHS/Community Health Systems 8% 15/3/2026	60,409	0.00
EUR 340,000	Chubb INA 0.3% 15/12/2024	323,898	0.02
USD 42,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	37,971	0.00
USD 231,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	221,841	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 141,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	137,868	0.01
USD 1,340,000	Citigroup 0.981% 1/5/2025	1,263,932	0.08
USD 6,880,000	Citigroup 1.462% 9/6/2027	6,083,928	0.38
USD 135,000	Citigroup 3.106% 8/4/2026	129,814	0.01
USD 1,120,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,082,888	0.07
USD 2,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3.251% 10/5/2035	2,679,257	0.17
USD 4,105,233	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC11 2.815% 10/4/2046	4,084,211	0.26
USD 838,645	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 3.552% 10/3/2047	832,265	0.05
USD 3,380,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3.855% 10/5/2047	3,337,237	0.21
USD 4,800,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3.137% 10/2/2048	4,654,397	0.29
USD 5,523,941	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2.935% 10/4/2048	5,313,032	0.34
USD 4,101,125	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC33 3.778% 10/9/2058	4,008,254	0.25
USD 2,827,573	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.779% 10/7/2049	2,742,460	0.17
USD 2,899,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.902% 10/7/2049	2,742,443	0.17
USD 6,345,171	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 2.684% 10/10/2049	5,917,378	0.37
USD 308,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	264,568	0.02
USD 132,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	125,751	0.01
USD 592,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	530,456	0.03
USD 129,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	120,213	0.01
USD 138,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	132,511	0.01
USD 19,000	CNX Resources 6% 15/1/2029	17,840	0.00
USD 267,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	266,822	0.02
USD 6,440,000	COMM 2013-CCRE10 Mortgage Trust 4.21% 10/8/2046	6,421,374	0.41
USD 254,943	COMM 2013-CCRE7 Mortgage Trust 2.739% 10/3/2046	254,253	0.02
USD 800,000	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 4.048% 10/6/2046	789,379	0.05
USD 4,868,987	COMM 2013-CCRE9 Mortgage Trust 4.411% 10/7/2045	4,835,961	0.31
USD 127,934	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 1.873% 12/4/2035	126,461	0.01
USD 3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3.732% 10/8/2049	2,894,229	0.18
USD 4,250,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3.828% 15/7/2047	4,188,028	0.27
USD 5,134,667	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	5,020,747	0.32
USD 5,000,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 4.006% 10/4/2047	4,948,453	0.31
USD 1,084,495	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 3.367% 10/6/2047	1,076,208	0.07
USD 1,017,167	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3.548% 10/9/2047	1,008,378	0.06
USD 560,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3.178% 10/2/2035	532,185	0.03
USD 8,677,982	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 1.017% 10/5/2048	156,599	0.01
USD 1,462,725	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3.445% 10/8/2048	1,444,970	0.09
USD 4,785,241	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3.445% 10/7/2048	4,668,680	0.30
USD 765,000	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 4.228% 10/5/2051	753,054	0.05
USD 142,000	CommScope 6% 1/3/2026	134,005	0.01
USD 51,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	46,148	0.00
USD 180,000	Comstock Resources 6.75% 1/3/2029	171,741	0.01
USD 242,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	222,032	0.01
USD 74,000	Consensus Cloud Solutions 6.5% 15/10/2028	66,301	0.00
USD 93,000	Consolidated Communications 6.5% 1/10/2028	76,027	0.01
USD 89,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	70,217	0.00
USD 4,000	Coty /HFC Prestige Products /HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	3,526	0.00
USD 263,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	251,600	0.02
USD 86,000	Crowdstrike 3% 15/2/2029	74,944	0.01
USD 143,000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4.75% 1/2/2026	138,240	0.01
USD 1,820,000	Crown Castle 1.35% 15/7/2025	1,670,583	0.11
USD 8,000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	7,375	0.00
USD 347,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	342,298	0.02
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3.505% 15/4/2050	1,602,956	0.10

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,700,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.224% 15/8/2051	2,660,421	0.17
USD 373,000	CSC 5.25% 1/6/2024	364,795	0.02
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	182,053	0.01
USD 23,000	CTR Partnership / CareTrust Capital 3.875% 30/6/2028	19,415	0.00
USD 149,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	147,927	0.01
USD 1,130,000	CVS Health 3.625% 1/4/2027	1,102,344	0.07
EUR 375,000	Danaher 1.7% 30/3/2024	374,255	0.02
USD 71,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	69,560	0.00
USD 2,238,719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 3.172% 15/5/2035	2,212,696	0.14
USD 1,500,000	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2.632% 10/8/2049	1,411,309	0.09
USD 2,076,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 3.396% 19/12/2030	2,030,125	0.13
USD 114,000	DCP Midstream Operating 5.125% 15/5/2029	111,862	0.01
USD 7,000	DCP Midstream Operating 5.625% 15/7/2027	7,096	0.00
USD 1,810,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1,804,334	0.11
EUR 1,000,000	Digital Euro Finco 2.5% 16/1/2026	964,193	0.06
USD 113,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	104,681	0.01
USD 103,000	DISH DBS 5% 15/3/2023	101,069	0.01
USD 303,000	DISH DBS 5.25% 1/12/2026	250,452	0.02
USD 840,000	DR Horton 1.3% 15/10/2026	729,312	0.05
USD 204,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	178,892	0.01
USD 82,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	80,467	0.01
USD 2,250,000	Edison International 4.7% 15/8/2025	2,235,783	0.14
USD 462,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	402,335	0.02
USD 125,000	Enact 6.5% 15/8/2025	121,911	0.01
USD 34,000	Energizer 6.5% 31/12/2027	31,709	0.00
USD 1,215,000	Energy Transfer 2.9% 15/5/2025	1,152,921	0.07
USD 1,930,000	Energy Transfer 3.45% 15/1/2023	1,930,307	0.12
USD 1,250,000	Energy Transfer 3.6% 1/2/2023	1,248,617	0.08
USD 1,435,000	Energy Transfer 4.5% 15/4/2024	1,433,598	0.09
USD 4,400,000	Energy Transfer 5.875% 15/1/2024	4,463,426	0.28
USD 136,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	127,297	0.01
USD 35,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	33,550	0.00
USD 190,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	187,179	0.01
USD 75,000	EnPro Industries 5.75% 15/10/2026	73,718	0.01
USD 13,000	Entegris 3.625% 1/5/2029	11,076	0.00
USD 236,000	Entegris Escrow 4.75% 15/4/2029	216,221	0.01
USD 69,000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	67,203	0.00
USD 204,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	197,226	0.01
USD 1,005,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	921,243	0.06
USD 3,656,000	Equinix 1.45% 15/5/2026	3,275,069	0.21
USD 2,200,000	Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	2,069,827	0.13
USD 740,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	693,936	0.04
USD 80,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	70,770	0.00
USD 4,486,675	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2035	4,273,269	0.27
USD 378,279	Fannie Mae Pool 2.763% 1/9/2042	387,377	0.02
USD 21,136	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	20,765	0.00
USD 30,788	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	30,123	0.00
USD 345,958	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	339,469	0.02
USD 139,055	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	136,442	0.01
USD 36,810	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	36,118	0.00
USD 21,851	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	21,441	0.00
USD 12,772	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	12,532	0.00
USD 46,669	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	45,799	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 372,544	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	365,559	0.02
USD 51,050	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	50,045	0.00
USD 12,180	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	11,851	0.00
USD 9,905	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	9,695	0.00
USD 242,561	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	237,428	0.02
USD 398,697	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	388,502	0.03
USD 44,008	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	42,975	0.00
USD 15,026	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	14,732	0.00
USD 30,229	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	29,662	0.00
USD 268,209	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	263,176	0.02
USD 297,108	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	291,731	0.02
USD 24,888	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	24,352	0.00
USD 40,710	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	39,946	0.00
USD 35,406	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	34,454	0.00
USD 56,618	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	55,555	0.00
USD 285,495	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	280,048	0.02
USD 13,356	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	13,106	0.00
USD 31,895	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	31,299	0.00
USD 445,809	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	435,252	0.03
USD 301,417	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	293,317	0.02
USD 85,756	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	83,884	0.01
USD 39,316	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	38,581	0.00
USD 252,747	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	245,955	0.02
USD 105,534	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	102,699	0.01
USD 180,429	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	177,054	0.01
USD 395,483	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	388,093	0.03
USD 551,036	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	536,824	0.03
USD 21,446	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	20,913	0.00
USD 8,512	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	8,300	0.00
USD 12,379	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	12,073	0.00
USD 210,475	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	204,816	0.01
USD 237,284	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	231,369	0.02
USD 378,706	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	369,285	0.02
USD 45,005	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	43,953	0.00
USD 19,494	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	19,009	0.00
USD 12,932	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	12,593	0.00
USD 73,022	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	71,138	0.00
USD 144,153	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	140,618	0.01
USD 36,331	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	35,378	0.00
USD 226,566	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	220,929	0.01
USD 24,954	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	24,315	0.00
USD 869,864	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	840,117	0.05
USD 572,545	Fannie Mae Pool 3.155% 1/9/2044	570,867	0.04
USD 89,940	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	88,787	0.01
USD 581,574	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	574,589	0.04
USD 889,297	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	898,049	0.06
USD 750,400	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	754,169	0.05
USD 315,309	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	317,710	0.02
USD 5,073,742	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	5,099,705	0.32
USD 382,762	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	384,961	0.02
USD 24,457	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	24,542	0.00
USD 197,519	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	198,146	0.01
USD 209,988	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	210,814	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 251,538	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	252,903	0.02
USD 311,635	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	310,246	0.02
USD 217,974	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	217,010	0.01
USD 3,181,969	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	3,197,437	0.20
USD 4,184,879	Fannie Mae Pool 4% 1/12/2044	4,194,108	0.27
USD 10,221,681	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	10,271,251	0.65
USD 686,833	Fannie Mae Pool 4.5% 1/3/2047	696,927	0.04
USD 2,060,822	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2047	2,090,546	0.13
USD 278,935	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2047	283,264	0.02
USD 2,282,326	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2047	2,330,327	0.15
USD 372,055	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	380,929	0.02
USD 1,152,537	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2048	1,183,301	0.08
USD 3,548,593	Fannie Mae Pool 4.5% 1/2/2049	3,658,825	0.23
USD 977,265	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2049	1,004,410	0.06
USD 377	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	379	0.00
USD 2,682,025	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2,808,234	0.18
USD 14,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 0.71% 1/4/2025	12,975,122	0.82
USD 16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	14,583,447	0.92
USD 103,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	90,224	0.01
EUR 1,530,000	Fidelity National Information Services 0.125% 3/12/2022	1,528,203	0.10
USD 1,370,000	Fidelity National Information Services 4.5% 15/7/2025	1,374,463	0.09
USD 1,146,000	First-Citizens Bank & Trust 3.929% 19/6/2024	1,135,497	0.07
USD 307,000	FirstEnergy 4.4% 15/7/2027	294,775	0.02
USD 1,076,764	Ford Credit Auto Owner Trust 2018-B 3.38% 15/3/2024	1,076,950	0.07
USD 615,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	537,356	0.03
USD 387,000	Ford Motor Credit 2.9% 16/2/2028	324,383	0.02
USD 1,826,000	Ford Motor Credit 3.37% 17/11/2023	1,778,252	0.11
USD 200,000	Ford Motor Credit 3.81% 9/1/2024	194,892	0.01
USD 200,000	Ford Motor Credit 5.113% 3/5/2029	187,007	0.01
USD 58,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6.5% 1/10/2025	54,213	0.00
USD 491,800	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	475,364	0.03
USD 1,000,952	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	1,006,973	0.06
USD 1,221,796	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	1,230,003	0.08
USD 1,103,310	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	1,112,608	0.07
USD 54,403	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	54,748	0.00
USD 685,115	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	689,471	0.04
USD 229,584	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/7/2047	234,391	0.02
USD 6,891,532	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/3/2049	7,082,379	0.45
USD 100,456,364	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.835% 25/9/2024	1,098,827	0.07
USD 1,503,450	Freddie Mac Non Gold Pool 3.219% 1/5/2045	1,490,649	0.09
USD 5,843,643	Freddie Mac REMICS 1.5% 15/4/2044	5,727,763	0.36
USD 830,654	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	784,355	0.05
USD 2,333,597	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	2,196,144	0.14
USD 1,435,674	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1,372,705	0.09
USD 817,881	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	804,600	0.05
USD 1,673,431	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1,611,898	0.10
USD 1,050,713	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	1,001,938	0.06
USD 1,296,649	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1,295,760	0.08
USD 36,732	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/9/2041	36,982	0.00
USD 80,061	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/11/2041	81,209	0.01
USD 590,000	FREMF 2013-K27 Mortgage Trust 3.619% 25/1/2046	586,471	0.04
USD 465,000	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust 3.746% 25/7/2046	462,273	0.03
USD 62,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	54,548	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 196,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	183,211	0.01
USD 142,000	Gartner 4.5% 1/7/2028	131,258	0.01
USD 55,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	52,191	0.00
USD 30,000	GCI 4.75% 15/10/2028	27,078	0.00
EUR 360,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	334,354	0.02
USD 965,000	General Motors 5.4% 2/10/2023	975,302	0.06
EUR 1,500,000	General Motors Financial 0.85% 26/2/2026	1,361,773	0.09
USD 2,700,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	2,403,337	0.15
USD 900,000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	889,819	0.06
USD 78,000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3.75% 15/12/2027	67,363	0.00
USD 4,200,000	Global Payments 1.2% 1/3/2026	3,715,851	0.24
USD 535,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	476,480	0.03
USD 15,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	12,665	0.00
USD 96,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	90,369	0.01
USD 1,029,000	Goldman Sachs 0.627% 17/11/2023	1,020,770	0.06
USD 1,030,000	Goldman Sachs 0.657% 10/9/2024	989,160	0.06
USD 1,500,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,336,019	0.08
USD 705,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	628,362	0.04
USD 2,925,000	Goldman Sachs 2.64% 24/2/2028	2,663,377	0.17
USD 1,250,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	1,186,118	0.08
USD 970,214	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1.93% 20/7/2048	810,101	0.05
USD 607,743	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	523,554	0.03
USD 83,000	Goodyear Tire & Rubber 9.5% 31/5/2025	86,838	0.01
USD 3,672,513	Government National Mortgage Association 0.646% 16/2/2053	63,781	0.00
USD 1,844,836	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1,810,732	0.11
USD 821,118	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	797,180	0.05
USD 56,000	Graham 5.75% 1/6/2026	55,699	0.00
USD 114,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	100,714	0.01
USD 1,697,682	GS Mortgage Trust 2011-GC5 5.209% 10/8/2044	1,692,667	0.11
USD 990,778	GS Mortgage Trust 2013-GC16 3.813% 10/11/2046	986,313	0.06
USD 3,495,242	GS Mortgage Trust 2014-GC18 4.074% 10/1/2047	3,466,325	0.22
USD 2,960,000	GS Mortgage Trust 2014-GC24 3.931% 10/9/2047	2,916,981	0.18
USD 2,330,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 3.764% 10/7/2048	2,276,235	0.14
USD 1,500,000	GS Mortgage Trust 2015-GC34 3.506% 10/10/2048	1,450,772	0.09
USD 2,916,913	GS Mortgage Trust 2016-GS2 3.05% 10/5/2049	2,770,245	0.18
USD 2,275,346	GS Mortgage Trust 2016-GS3 2.777% 10/10/2049	2,206,972	0.14
USD 8,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	8,065	0.00
USD 38,000	Halliburton 3.8% 15/11/2025	37,760	0.00
USD 200,000	Hanwha Energy USA 4.125% 5/7/2025	197,554	0.01
USD 56,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	49,078	0.00
USD 1,700,000	HCA 5.25% 15/4/2025	1,721,082	0.11
USD 3,500,000	HCA 5.375% 1/2/2025	3,539,638	0.22
USD 893,000	HCA 5.375% 1/9/2026	900,997	0.06
USD 2,722,000	HCA 5.875% 15/2/2026	2,778,917	0.18
USD 820,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	721,417	0.05
USD 65,000	Herc 5.5% 15/7/2027	61,577	0.00
USD 8,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	7,340	0.00
USD 15,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	14,308	0.00
USD 20,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	17,258	0.00
USD 111,000	Hilton Domestic Operating 5.375% 1/5/2025	109,900	0.01
USD 82,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	78,413	0.01
USD 74,000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	52,650	0.00
USD 133,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	118,009	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,470,000	Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028	1,439,553	0.09
USD 1,805,000	Hyundai Capital America 1.65% 17/9/2026	1,582,162	0.10
USD 61,000	IAA 5.5% 15/6/2027	57,730	0.00
USD 10,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	8,558	0.00
USD 70,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.75% 15/9/2024	66,827	0.00
USD 101,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	91,976	0.01
USD 76,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	72,963	0.00
EUR 1,045,000	Illinois Tool Works 0.25% 5/12/2024	999,623	0.06
USD 152,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	129,773	0.01
USD 925,000	Intel 3.75% 5/8/2027	912,733	0.06
USD 2,373,000	Intercontinental Exchange 4% 15/9/2027	2,352,461	0.15
USD 6,430,000	International Flavors & Fragrances 1.23% 1/10/2025	5,792,044	0.37
USD 308,000	IQVIA 5% 15/5/2027	298,204	0.02
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-BCON 3.735% 5/1/2031	3,764,105	0.24
USD 4,720,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-C16 4.166% 15/12/2046	4,676,537	0.30
USD 694,167	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-LC11 2.554% 15/4/2046	691,212	0.04
USD 4,818,941	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP2 2.559% 15/8/2049	4,488,462	0.28
USD 1,431,518	JP Morgan Mortgage Trust 2014-2 3% 25/6/2029	1,366,704	0.09
USD 881,563	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 3.161% 25/6/2046	843,667	0.05
USD 1,272,247	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2013-C17 3.705% 15/1/2047	1,264,818	0.08
USD 1,643,999	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3.657% 15/9/2047	1,624,741	0.10
USD 457,532	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3.288% 15/1/2048	450,846	0.03
USD 1,277,472	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3.504% 15/12/2048	1,228,563	0.08
USD 3,000,000	JPMorgan Chase 0.824% 1/6/2025	2,810,719	0.18
USD 3,900,000	JPMorgan Chase 1.045% 19/11/2026	3,472,873	0.22
EUR 420,000	JPMorgan Chase 1.5% 27/1/2025	410,806	0.03
USD 1,850,000	JPMorgan Chase 1.578% 22/4/2027	1,656,618	0.11
USD 1,234,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,156,069	0.07
USD 2,405,000	JPMorgan Chase 2.301% 15/10/2025	2,297,999	0.15
USD 3,880,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	3,887,673	0.25
USD 185,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	159,405	0.01
USD 3,500,000	KB Home 7.625% 15/5/2023	3,518,457	0.22
USD 855,000	KeyBank NA/Cleveland OH 4.15% 8/8/2025	849,382	0.05
USD 75,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	70,427	0.00
USD 487,000	Kraft Heinz Foods 3.875% 15/5/2027	470,897	0.03
USD 62,000	LABL 5.875% 1/11/2028	55,369	0.00
USD 48,000	Ladder Capital Finance / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	41,755	0.00
USD 7,000	Lamar Media 3.75% 15/2/2028	6,289	0.00
USD 141,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	134,731	0.01
USD 50,000	Legends Hospitality / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	45,821	0.00
USD 31,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	27,384	0.00
USD 3,000	Level 3 Financing 3.625% 15/1/2029	2,412	0.00
USD 96,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	81,002	0.01
USD 57,000	Level 3 Financing 5.25% 15/3/2026	57,950	0.00
USD 50,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	45,072	0.00
USD 57,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	52,501	0.00
USD 99,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	79,020	0.01
USD 21,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	18,488	0.00
USD 70,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	64,320	0.00
USD 246,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	247,553	0.02
USD 1,805,000	Lowe's 3.35% 1/4/2027	1,744,316	0.11
USD 175,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	154,360	0.01
USD 200,000	Lumen Technologies 5.125% 15/12/2026	174,126	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 180,000	Lumen Technologies 6.75% 1/12/2023	182,060	0.01
USD 932,000	LYB International Finance III 1.25% 1/10/2025	841,995	0.05
USD 16,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	15,474	0.00
USD 835,000	MassMutual Global Funding II 2.8% 21/3/2025	807,454	0.05
USD 225,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	219,454	0.01
USD 175,000	Match II 4.625% 1/6/2028	156,033	0.01
USD 101,000	Mauser Packaging Solutions 5.5% 15/4/2024	97,874	0.01
USD 22,000	Maxar Technologies 7.75% 15/6/2027	21,861	0.00
USD 182,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	153,840	0.01
USD 150,000	Meritage Homes 5.125% 6/6/2027	141,121	0.01
USD 2,700,000	Met Tower Global Funding 3.7% 13/6/2025	2,660,300	0.17
USD 4,855,000	Meta Platforms 3.5% 15/8/2027	4,724,146	0.30
USD 55,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	53,509	0.00
USD 126,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	125,682	0.01
USD 80,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	67,212	0.00
USD 121,000	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6.5% 20/6/2027	121,455	0.01
EUR 700,000	MMS USA 0.625% 13/6/2025*	660,640	0.04
USD 40,000	ModivCare 5.875% 15/11/2025	37,749	0.00
USD 146,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	134,924	0.01
USD 4,545,000	Morgan Stanley 0.529% 25/1/2024	4,476,141	0.28
USD 2,300,000	Morgan Stanley 0.56% 10/11/2023	2,283,504	0.14
USD 2,275,000	Morgan Stanley 0.731% 5/4/2024	2,225,975	0.14
USD 1,800,000	Morgan Stanley 0.791% 22/1/2025	1,709,265	0.11
USD 2,755,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	2,509,392	0.16
USD 4,088,642	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 3.38% 15/7/2046	4,090,162	0.26
USD 191,482	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 3.912% 15/7/2046	191,122	0.01
USD 1,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 4.039% 15/11/2046	1,464,805	0.09
USD 1,455,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 4.051% 15/4/2047	1,442,263	0.09
USD 1,263,862	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 3.621% 15/10/2047	1,251,523	0.08
USD 6,616,709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 3.249% 15/2/2048	6,422,872	0.41
USD 2,625,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.372% 15/10/2048	2,543,008	0.16
USD 4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.635% 15/10/2048	4,084,709	0.26
USD 7,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 3.252% 15/10/2048	6,775,033	0.43
USD 2,692,562	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 2.729% 15/9/2049	2,612,964	0.17
USD 3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 3.102% 15/11/2049	2,841,553	0.18
USD 3,465,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11 2.782% 15/8/2049	3,243,526	0.21
USD 47,000	MPH Acquisition 5.5% 1/9/2028	40,415	0.00
USD 215,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5% 15/10/2027	193,647	0.01
USD 29,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	28,019	0.00
USD 114,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	110,580	0.01
EUR 380,000	National Grid North America 0.41% 20/1/2026	348,922	0.02
USD 79,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	70,623	0.00
USD 72,000	Navient 6.75% 15/6/2026	68,171	0.00
USD 97,697	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.641% 15/2/2029	97,684	0.01
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,716,548	0.11
USD 516,210	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.291% 15/11/2068	507,021	0.03
USD 291,653	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	289,493	0.02
USD 125,000	NCR 5% 1/10/2028	117,311	0.01
USD 2,500,000	Netflix 4.375% 15/11/2026	2,441,128	0.15
USD 301,000	New Fortress Energy 6.5% 30/9/2026	283,901	0.02
USD 74,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	71,673	0.00
USD 358,723	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3.25% 25/9/2056	339,382	0.02
USD 1,800,350	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1,743,217	0.11

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	Newell Brands 4.45% 1/4/2026	1,895,120	0.12
USD 56,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	54,140	0.00
USD 300,000	NFP 4.875% 15/8/2028	262,913	0.02
USD 79,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7.5% 1/2/2026	72,788	0.01
USD 113,000	Nielsen Finance / Nielsen Finance 5.625% 1/10/2028	113,355	0.01
USD 4,200,000	Nissan Motor Acceptance 2% 9/3/2026	3,679,900	0.23
USD 164,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	158,484	0.01
USD 117,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	102,745	0.01
USD 375,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	332,668	0.02
USD 47,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	42,986	0.00
USD 8,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	7,529	0.00
USD 265,000	Nucor 2% 1/6/2025	250,277	0.02
USD 116,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	110,329	0.01
USD 82,000	Occidental Petroleum 5.5% 1/12/2025	84,077	0.01
USD 25,000	Occidental Petroleum 5.875% 1/9/2025	25,672	0.00
USD 7,000	Occidental Petroleum 8% 15/7/2025	7,566	0.00
USD 427,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	478,387	0.03
USD 1,415,000	ONE Gas 1.1% 11/3/2024	1,361,682	0.09
USD 113,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	104,692	0.01
USD 76,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	71,760	0.00
USD 4,255,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	3,829,507	0.24
USD 285,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	254,010	0.02
USD 168,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	154,381	0.01
USD 64,000	P&L Development / PLD Finance 7.75% 15/11/2025	51,614	0.00
USD 953,000	Pacific Gas and Electric 3.45% 1/7/2025	911,650	0.06
USD 575,000	Parker-Hannifin 2.7% 14/6/2024	562,600	0.04
USD 118,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	106,566	0.01
USD 77,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	73,993	0.01
USD 535,000	PeaceHealth Obligated 1.375% 15/11/2025	487,712	0.03
USD 68,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	64,111	0.00
USD 1,285,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.7% 15/6/2026	1,143,891	0.07
USD 62,000	Performance Food 5.5% 15/10/2027	58,413	0.00
USD 163,000	Picasso Finance Sub 6.125% 15/6/2025	163,611	0.01
USD 145,000	Pioneer Natural Resources 0.55% 15/5/2023	141,714	0.01
USD 1,395,000	Pioneer Natural Resources 1.125% 15/1/2026	1,249,371	0.08
USD 111,000	Playtika 4.25% 15/3/2029	94,829	0.01
USD 77,000	Post 5.625% 15/1/2028	73,042	0.01
USD 200,000	PRA Health Sciences 2.875% 15/7/2026	178,909	0.01
USD 108,000	Prime Healthcare Services 7.25% 1/11/2025	95,752	0.01
USD 76,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	75,136	0.01
USD 136,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	132,328	0.01
USD 32,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	28,358	0.00
USD 60,000	PTC 3.625% 15/2/2025	56,481	0.00
USD 195,000	PulteGroup 5% 15/1/2027	195,153	0.01
USD 325,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	279,692	0.02
USD 40,000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4.875% 1/11/2026	36,551	0.00
USD 120,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	104,079	0.01
USD 39,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	35,424	0.00
USD 82,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	73,938	0.01
USD 104,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	87,553	0.00
USD 16,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	14,479	0.00
USD 1,665,000	Ryder System 2.85% 1/3/2027	1,541,485	0.10
USD 1,702,000	Sabine Pass Liquefaction 5.75% 15/5/2024	1,728,134	0.11

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 87,000	Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	82,737	0.01
USD 38,000	Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	37,588	0.00
USD 700,000	Santander USA 3.5% 7/6/2024	688,764	0.04
USD 29,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	23,967	0.00
USD 212,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	194,409	0.01
USD 1,315,000	Sealed Air 5.125% 1/12/2024	1,303,783	0.08
USD 147,000	Sealed Air 5.5% 15/9/2025	147,217	0.01
USD 1,890,611	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3.5% 25/8/2057	1,851,750	0.12
USD 3,083,324	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2,966,151	0.19
USD 1,445,000	Sempra Energy 3.3% 1/4/2025	1,408,106	0.09
USD 165,297	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 3.5% 25/8/2047	157,799	0.01
USD 746,900	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	709,177	0.05
USD 675,000	Sherwin-Williams 4.25% 8/8/2025	675,585	0.04
USD 97,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	90,873	0.01
USD 8,000	Silgan 4.125% 1/2/2028	7,389	0.00
USD 56,000	Sinclair Television 5.125% 15/2/2027	48,505	0.00
USD 99,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	88,296	0.01
USD 142,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	124,786	0.01
USD 50,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	47,315	0.00
USD 69,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	70,035	0.00
USD 550,000	SK Battery America 2.125% 26/1/2026	490,465	0.03
USD 42,000	SLM 3.125% 2/11/2026	35,338	0.00
USD 5,581,223	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 2.139% 15/12/2038	5,409,012	0.34
USD 3,867,560	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 2.159% 15/6/2039	3,700,843	0.23
USD 3,835,067	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 2.119% 15/6/2039	3,628,994	0.23
USD 2,054,929	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 2.099% 15/12/2039	1,950,680	0.12
USD 1,091,933	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 2.069% 16/12/2041	1,057,356	0.07
USD 4,217,053	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 7.141% 15/10/2041	4,601,904	0.29
USD 938,767	SLM Student Loan Trust 2013-4 2.994% 25/6/2043	911,755	0.06
USD 27,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	26,233	0.00
USD 3,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	2,929	0.00
USD 85,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	83,631	0.01
USD 1,884,130	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 3.291% 15/9/2034	1,868,666	0.12
USD 509,065	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3.221% 15/9/2037	498,771	0.03
USD 4,751,959	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1.6% 15/9/2054	4,334,939	0.27
USD 1,710,201	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 0% 15/1/2053	1,658,457	0.10
USD 950,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.31% 15/1/2053	883,484	0.06
USD 3,094,345	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1.39% 15/1/2053	2,767,417	0.18
USD 5,417,892	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 3.333% 16/2/2055	5,337,451	0.34
USD 2,310,000	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 0.881% 16/5/2050	2,313,268	0.15
USD 2,403,000	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	2,386,115	0.15
USD 11,273	SoFi Professional Loan Program 2016-C 2.36% 27/12/2032	11,259	0.00
USD 100,497	SoFi Professional Loan Program 2016-D 2.34% 25/4/2033	99,054	0.01
USD 1,114,006	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2.65% 25/9/2040	1,084,657	0.07
USD 1,037,456	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	1,016,124	0.06
USD 1,845,665	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.34% 25/8/2047	1,815,074	0.11
USD 1,659,261	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 3.59% 25/1/2048	1,630,555	0.10
USD 1,563,426	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 3.6% 25/2/2048	1,536,096	0.10
USD 1,515,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	1,380,735	0.09
USD 219,000	Sotheby's 7.375% 15/10/2027	206,796	0.01
USD 30,437	Soundview Home Loan Trust 2003-2 3.744% 25/11/2033	30,036	0.00
USD 5,195,000	Southern 4.475% 1/8/2024	5,214,549	0.33
USD 54,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	48,747	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 54,000	Spirit AeroSystems 5.5% 15/1/2025	52,950	0.00
USD 6,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025	5,831	0.00
USD 73,000	Sprint 7.625% 1/3/2026	77,566	0.01
USD 303,000	Sprint Capital 6.875% 15/11/2028	322,706	0.02
USD 2,045,313	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/9/2029	2,050,064	0.13
USD 249,000	SRM Escrow Issuer 6% 1/11/2028	225,493	0.01
USD 248,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	220,011	0.01
USD 233,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	221,647	0.01
USD 31,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	27,224	0.00
USD 230,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	211,331	0.01
USD 90,000	Staples 7.5% 15/4/2026	76,721	0.01
USD 23,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	20,654	0.00
USD 74,000	Starwood Property Trust 5.5% 1/11/2023	73,760	0.01
USD 67,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	57,759	0.00
USD 165,000	Steel Dynamics 2.4% 15/6/2025	156,606	0.01
USD 74,000	Stevens 6.125% 1/10/2026	74,213	0.01
USD 270,000	Switch 3.75% 15/9/2028	268,150	0.02
USD 52,000	Synaptics 4% 15/6/2029	44,901	0.00
USD 3,076,000	Synchrony Financial 4.5% 23/7/2025	3,014,930	0.19
USD 1,544,000	Synchrony Financial 4.875% 13/6/2025	1,524,287	0.10
USD 267,000	Syneos Health 3.625% 15/1/2029	227,906	0.01
USD 9,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8,227	0.00
USD 222,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	210,581	0.01
USD 41,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	39,480	0.00
USD 120,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	109,085	0.01
USD 122,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	100,955	0.01
USD 56,000	Tenet Healthcare 4.625% 1/9/2024	54,557	0.00
USD 80,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	72,830	0.01
USD 165,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	157,391	0.01
USD 31,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	29,823	0.00
USD 1,290,000	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4.265% 1/8/2036	1,287,954	0.08
EUR 565,000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025	560,265	0.04
USD 272,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	249,947	0.02
USD 1,921,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	1,739,684	0.11
USD 489,000	T-Mobile USA 2.25% 15/2/2026	450,149	0.03
USD 113,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	102,813	0.01
USD 61,000	Triumph 8.875% 1/6/2024	61,853	0.00
USD 40,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	40,248	0.00
USD 127,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	106,093	0.01
USD 106,000	Twitter 3.875% 15/12/2027	98,845	0.01
USD 26,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	22,647	0.00
USD 380,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	363,419	0.02
USD 66,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	65,900	0.00
USD 34,000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	34,452	0.00
USD 2,900,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C1 3.46% 15/6/2050	2,720,135	0.17
USD 3,324,926	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3.225% 15/8/2050	3,158,221	0.20
USD 4,151,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3.212% 15/11/2050	3,909,721	0.25
USD 141,000	United Airlines 4.375% 15/4/2026	129,731	0.01
USD 91,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	80,194	0.01
USD 1,144,420	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15/4/2029	1,147,379	0.07
USD 175,120	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4.875% 15/7/2027	165,051	0.01
USD 15,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.125% 30/4/2023	14,692,276	0.93
USD 30,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.125% 15/8/2023	29,069,722	1.84

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 8,230,900	United States Treasury Note/Bond 0.5% 15/3/2023	8,114,082	0.51
USD 26,500,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 15/11/2024	24,991,777	1.58
USD 6,220,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 15/2/2025	5,934,998	0.38
USD 47,385,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/3/2025	45,450,730	2.87
USD 22,000,000	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041	16,526,211	1.05
USD 27,405,000	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/5/2025	26,904,537	1.70
USD 57,895,000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/6/2025	56,992,652	3.60
USD 57,490,000	United States Treasury Note/Bond 3.125% 15/8/2025	56,964,506	3.60
USD 59,000	Uniti / Uniti Finance / CSL Capital 4.75% 15/4/2028	49,389	0.00
USD 106,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	102,662	0.01
USD 2,700,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	2,472,899	0.16
USD 1,325,000	US Bancorp 4.548% 22/7/2028	1,335,083	0.08
USD 88,000	US Foods 6.25% 15/4/2025	87,893	0.01
USD 280,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	261,520	0.02
USD 75,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	75,395	0.01
USD 400,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	352,028	0.02
USD 355,000	VeriSign 5.25% 1/4/2025	360,924	0.02
USD 141,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	116,008	0.01
USD 7,630,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	6,763,424	0.43
USD 150,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	130,686	0.01
USD 88,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	81,087	0.01
USD 3,095,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	3,023,561	0.19
USD 1,290,000	Virginia Electric and Power 3.75% 15/5/2027	1,271,963	0.08
USD 139,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	134,301	0.01
USD 1,842,000	VMware 1% 15/8/2024	1,725,437	0.11
USD 4,490,000	VMware 1.4% 15/8/2026	3,977,902	0.25
USD 1,925,000	VMware 3.9% 21/8/2027	1,848,689	0.12
USD 52,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	44,785	0.00
USD 1,560,000	Wells Fargo 3.526% 24/3/2028	1,476,134	0.09
USD 3,120,000	Wells Fargo 3.908% 25/4/2026	3,059,609	0.19
USD 2,715,000	Wells Fargo 4.54% 15/8/2026	2,704,568	0.17
USD 1,374,830	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 3.477% 15/8/2050	1,363,026	0.09
USD 4,004,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C27 3.451% 15/2/2048	3,892,576	0.25
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 3.148% 15/5/2048	1,528,850	0.10
USD 4,765,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 3.372% 15/1/2059	4,603,191	0.29
USD 3,075,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 3.635% 15/1/2059	2,985,790	0.19
USD 4,996,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C39 3.418% 15/9/2050	4,769,539	0.30
USD 198,000	WESCO Distribution 7.125% 15/6/2025	199,185	0.01
USD 4,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	4,027	0.00
USD 66,000	Western Midstream Operating 4.65% 1/7/2026	62,793	0.00
USD 202,000	Western Midstream Operating 4.75% 15/8/2028	194,327	0.01
USD 1,770,672	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3.393% 15/8/2047	1,756,389	0.11
USD 70,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	67,967	0.00
USD 780,000	Workday 3.5% 1/4/2027	747,369	0.05
USD 243,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	225,050	0.01
USD 85,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	76,786	0.01
USD 677,000	Zayo 4% 1/3/2027	577,567	0.04
USD 154,000	ZoomInfo Technologies /ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	133,683	0.01
		1,025,444,083	64.81
ウルグアイ			
USD 122,188	Uruguay Government International Bond 4.375% 23/1/2031	125,040	0.01
債券合計		1,451,393,379	91.73

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
	オーストラリア		
USD 3,000,000	National Australia Bank 0% 15/3/2023	2,941,113	0.19
	米国		
USD 5,000,000	Enel Finance America 0% 20/9/2022	4,992,318	0.31
USD 1,700,000	Enel Finance America 0% 21/11/2022	1,687,168	0.11
USD 2,000,000	Enel Finance America 0% 8/9/2023	1,920,268	0.12
USD 1,400,000	General Motors Financial 0% 14/11/2022	1,390,191	0.09
USD 5,590,000	HSBC USA 0% 14/6/2023	5,407,229	0.34
USD 3,000,000	HSBC USA 0% 23/8/2023	2,873,238	0.18
		18,270,412	1.15
		21,211,525	1.34
コマーシャル・ペーパー合計			
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,472,604,904	93.07
投資有価証券合計		1,472,604,904	93.07
その他の純資産		109,651,915	6.93
純資産合計(米ドル)		1,582,256,819	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
CAD	412,060	USD	321,005	State Street	21/9/2022	(7,285)
EUR	2,395,367	USD	2,536,951	Morgan Stanley	21/9/2022	(137,427)
EUR	1,790,000	USD	1,847,681	State Street	21/9/2022	(54,574)
EUR	1,790,000	USD	1,847,702	JP Morgan	21/9/2022	(54,595)
EUR	1,011,000	USD	1,036,309	HSBC Bank	21/9/2022	(23,555)
GBP	4,345,000	USD	5,322,343	BNY Mellon	21/9/2022	(276,580)
GBP	1,815,032	USD	2,221,311	Royal Bank of Canada	21/9/2022	(113,550)
GBP	1,811,000	USD	2,136,125	Toronto-Dominion	21/9/2022	(33,047)
USD	388,977	GBP	310,000	Toronto-Dominion	21/9/2022	28,980
USD	119,113,530	GBP	95,973,000	HSBC Bank	21/9/2022	7,661,971
USD	322,943	CAD	413,000	JP Morgan	21/9/2022	8,508
USD	142,072,603	EUR	134,152,000	BNP Paribas	21/9/2022	7,687,778
USD	3,144,069	GBP	2,588,000	State Street	21/9/2022	138,675
USD	2,209,059	EUR	2,157,000	RBS	21/9/2022	48,316
USD	112,665	EUR	111,590	RBS	14/12/2022	230
未実現純評価益						14,873,845
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	175,750,350	USD	179,589,418	BNY Mellon	15/9/2022	(3,603,258)
USD	2,835,245	EUR	2,815,748	BNY Mellon	15/9/2022	15,756
未実現純評価損						(3,587,502)
ヘッジを使用したシンガポール・ドル建投資証券クラス						
SGD	1,217,689	USD	877,198	BNY Mellon	15/9/2022	(5,703)
未実現純評価損						(5,703)
未実現純評価益合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー-447,634,595米ドル)						11,280,640

未決済上場先物取引 2022年8月31日現在

契約数	通貨	契約／摘要	満期日	基礎となるエクスポージャー (米ドル)	未実現評価益／(損) (米ドル)
(262)	EUR	Euro BOBL	2022年9月	32,297,551	387,927
(2)	EUR	Euro Bund	2022年9月	296,568	5,562
(107)	EUR	Euro Schatz	2022年9月	11,631,630	63,157
(24)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2022年9月	25,854,398	(71,971)
(8)	USD	US Long Bond (CBT)	2022年12月	1,090,250	6,673
(275)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	32,205,078	145,790
(3)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2022年12月	351,328	1,484
(237)	USD	US Ultra 10 Year Note	2022年12月	29,732,391	151,588
(86)	USD	US Ultra Bond (CBT)	2022年12月	12,956,438	(36,969)
3,165	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	659,482,144	(849,877)
(8)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2022年12月	1,666,937	2,898
(1,397)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	154,925,116	430,780
(126)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2022年12月	13,973,203	45,477
合計				976,463,032	282,519

スワップ 2022年8月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益／(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CDS	USD 34,540,000	ファンドはCDX.NA.IG.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/6/2027	150,133	(135,358)
CDS	USD (3,969,900)	ファンドはCDX.NA.HY.38.V2に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/6/2027	(40,895)	(40,692)
IRS	USD 35,755,000	ファンドは2.95053%の固定金利を受け取り、USD 1H SOFRの変動金利を支払う	Bank of America	30/6/2024	(389,162)	(389,162)
IRS	USD 35,755,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、2.77909%の固定金利を支払う	Bank of America	30/11/2026	515,491	515,491
合計	(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 109,235,786米ドル)				235,567	(49,721)

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

事後通告証券契約 2022年8月31日現在

保有高	摘要	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
TBA			
	米国		
USD 15,230,000	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	15,194,602	0.96
TBA合計			
(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 15,194,602米ドル)		15,194,602	0.96