

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37作成期 運用報告書(全体版)

第214期 (決算日:2023年7月20日)
 第215期 (決算日:2023年8月21日)
 第216期 (決算日:2023年9月20日)
 第217期 (決算日:2023年10月20日)
 第218期 (決算日:2023年11月20日)
 第219期 (決算日:2023年12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

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

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

◇基準価額の推移

■最近5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33 作成期		円	円	%	%	百万円
	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
第37 作成期	214期(2023年7月20日)	11,194	20	△ 1.2	98.3	1,463
	215期(2023年8月21日)	11,496	20	2.9	98.7	1,498
	216期(2023年9月20日)	11,727	20	2.2	98.6	1,529
	217期(2023年10月20日)	11,685	20	△ 0.2	99.3	1,479
	218期(2023年11月20日)	11,942	20	2.4	99.1	1,514
	219期(2023年12月20日)	11,813	20	△ 0.9	96.9	1,498

(注1) 基準価額の騰落率は税込分配金込み。基準価額は1万円当たり。

(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いません。

(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

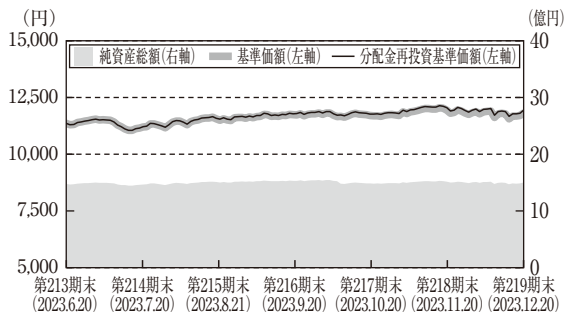
決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託証券 組入比率
			騰 落 率	
第214期	(期 首) 2023年6月20日	円 11,351	% -	% 99.1
	6月末	11,540	1.7	99.1
	(期 末) 2023年7月20日	11,214	△1.2	98.3
第215期	(期 首) 2023年7月20日	11,194	-	98.3
	7月末	11,277	0.7	98.8
	(期 末) 2023年8月21日	11,516	2.9	98.7
第216期	(期 首) 2023年8月21日	11,496	-	98.7
	8月末	11,641	1.3	98.6
	(期 末) 2023年9月20日	11,747	2.2	98.6
第217期	(期 首) 2023年9月20日	11,727	-	98.6
	9月末	11,749	0.2	98.6
	(期 末) 2023年10月20日	11,705	△0.2	99.3
第218期	(期 首) 2023年10月20日	11,685	-	99.3
	10月末	11,704	0.2	99.2
	(期 末) 2023年11月20日	11,962	2.4	99.1
第219期	(期 首) 2023年11月20日	11,942	-	99.1
	11月末	11,829	△0.9	99.1
	(期 末) 2023年12月20日	11,833	△0.9	96.9

(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37作成期：2023年6月21日～2023年12月20日)



第214期首：11,351円

第219期末：11,813円(既払分配金120円)

騰落率：5.1%(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

米国では、当作成期間において金利は小幅上昇となりました。期の前半において、インフレは減速基調で推移していたものの、引き続き米連邦準備制度理事会(FRB)の目標値を上回っていることや底堅い経済状況、FRBが高い政策金利水準をより長期に渡って維持する姿勢を示したことを受けて金利上昇となりました。一方、その後インフレが想定以上に減速したことや、労働市場のひっ迫度合いに緩和がみられていること、FRBが利上げサイクルの終了を示唆したことがなどを受けて金利低下となりました。

6月、FRBは政策金利の据え置きを決定したものの、連邦公開市場委員会(FOMC)メンバーが予想する2023年末時点での政策金利見通しの中央値が50bps引き上げられるなど、今後の追加利上げを示唆する

タカ派的な据え置きとなり、金利上昇となりました。7月、FRBは市場予想通り25bpsの利上げを行い、9月の会合については、データ次第で利上げを実施する可能性もしない可能性もあるとしたものの、雇用統計や4-6月期のGDP成長率等、市場予想を上回る堅調な経済指標が引き続き見られたことから金利上昇となりました。8月、大手格付け会社Fitch社が米国債の格付けを引き下げたことや雇用統計が市場予想を上回ったことに加え、国債の増発が発表されたことを背景に金利は上昇しました。9月、FOMCでは市場予想通り政策金利据え置きとなったものの、政策金利見通しや経済見通しがタカ派に傾いていたことで「より高く長く」政策金利が据え置かれるという観測が広がり、長期ゾーン主導で金利上昇となりました。10月は、中東における軍事衝突が警戒され、一時的に金利が低下する局面があったものの、経済指標が市場予想比堅調であったことや、パウエルFRB議長が追加的な引き締めの可能性について言及したことなどを受けて、金利は長期ゾーン主導で上昇しました。11月は、発表されたインフレ指標など経済指標が市場予想を下回ったことや、四半期定例入札において予想ほど発行が増額されていなかったことから需給不安が後退し、金利低下となりました。12月は、FOMCで市場予想通り政策金利据え置きが発表されたものの、政策金利見通しがハト派に傾いたことや2024年の利下げについて議論し始めたことなどを受けて金利低下となり、米10年国債利回りは3.85%で当作成期を終えました。

欧州では、当作成期において金利は低下しました。期の前半において、インフレは減速基調で推移していたものの、引き続き欧州中央銀行(ECB)の目標値を上回っていることや底堅い経済状況、ECBが必要な限り政策金利を据え置く姿勢を示したことを受けて金利上昇となりました。一方、その後インフレが想定以上に減速したことや、経済指標の鈍化、ECBが利上げサイクルの終了を示唆したことを受けて金利低下と

なりました。

6月、ECB会合において市場予想通り25bpsの利上げが行われたものの、インフレ見通しがヘッドライン・コアともに2023年から2025年まで上方修正されたことがタカ派と捉えられ、金利は上昇しました。7月、ECB会合において場予想通りの25bpsの利上げが行われたものの、グローバルで底堅いマクロ環境が引き続きみられる中、金利は上昇しました。8月、欧州各国のPMI(購買担当者景気指数)が予想を下振れたことや中国経済の先行き不安等から金利は低下しました。9月、ロシアやサウジアラビアによる減産や輸出削減を背景とするエネルギー価格の上昇等を受け金利が上昇したほか、ラガルド総裁が必要な限り政策金利を据え置くと発言したことで金利が上昇しました。10月、ECB会合で市場予想通り利上げが見送られたものの、ラガルド総裁が記者会見で成長率の下振れの可能性等に言及したことや中東情勢の緊迫化を受けたリスクオフから金利は低下しました。11月、インフレ指標等の経済指標が予想を下回ったことや、米国金利低下に追随する形で欧州金利は低下しました。12月、経済指標の鈍化やECB主要メンバーから利上げサイクルの終了を示唆するコメントを背景に金利は低下し、独10年国債利回りは1.97%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長期化し、3~4年の間で機動的に調整しました。当作成期、グローバルに

おけるインフレの低下や労働市場をはじめマクロ環境に緩やかな減速を見られる中、利上げサイクルの終了が近いと判断し、デュレーションを長期化しつつ、日々のボラティリティを鑑みて機動的に調整しました。欧州についても、インフレの減速を受けてECBによる金融引き締めが終盤に近付いていることや、経済指標の鈍化を受けて長期金利中心に保有しました。クレジット資産においては、インフレの低下や景気は減速するものの、深刻なりセッションに陥る可能性は低いと考えクオリティの高い資産クラス中心にリスクを追加しました。新興国においてはインフレの低下や中央銀行の金融政策が緩和に転換していること、また高い利回り水準を評価するものの、中国景気の減速懸念や金利市場のボラティリティ等を鑑み機動的に調整しました。

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)

- ・ 金利デュレーションのポジショニング
- ・ 欧州クレジットや投資適格社債、米国ハイ・イールド社債の保有
- ・ 証券化商品の保有

<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+5.1%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2.9%と上昇したことに加え、当該ファンドが米ドル建てのため、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	2.9%

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おりません。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	第214期	第215期	第216期	第217期	第218期	第219期
	2023年6月21日 ～2023年7月20日	2023年7月21日 ～2023年8月21日	2023年8月22日 ～2023年9月20日	2023年9月21日 ～2023年10月20日	2023年10月21日 ～2023年11月20日	2023年11月21日 ～2023年12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	0.18%	0.17%	0.17%	0.17%	0.17%	0.17%
当期の収益	17円	20円	20円	17円	20円	16円
当期の収益以外	2	-	-	2	-	3
翌期繰越分配対象額	3,549	3,563	3,577	3,575	3,687	3,684

(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>

中央銀行は引き続き難しい政策運営を強いられると

考えるものの、多くの中央銀行の利上げサイクルが終了したことを示唆しています。米国では、インフレが鈍化していること、また労働市場も鈍化が見られていることから、FRBは政策金利を据え置き、市場の焦点は利下げのタイミングに移ると考えます。欧州においては、11月のCPI速報値など最近の経済指標を踏まえると、ECBが2024年4-6月期から利下げを開始する可能性があるとの確信度がさらに高まったと見えています。

足元の市場環境においては、引き続き高クオリティの短期債を選好します。ポートフォリオでは、2024年に向けて利回りカーブがスティープ化する可能性に備え米短中期ゾーンのデュレーションや欧米の投資適格

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)

社債の保有を愛好します。今後、インフレや経済成長の鈍化を背景に金融政策を巡る不透明感が更に後退した場合には米国や欧州のデュレーションを長期化する方針です。日本では、イールド・カーブ・コントロール (YCC) 政策が実質的に撤廃されたことに加え、先月行われたGDP成長率の3%に相当する財政刺激策の発表や足元の円安水準を鑑みて、日本のデュレーションショートを維持する方針です。また、新興国債券においても、メキシコ、ブラジルなど格付けが高くファンダメンタルズが良好で高い利回りを提供しつつ、利下げへの道筋が明確である国を選別的に保有する方針です。

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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・リターンを最大化を目指した運用を行う方針です。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第214期～第219期		項目の概要
	(2023.6.21～2023.12.20)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	92	0.791	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11,632円です。
(投信会社)	(42)	(0.357)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(48)	(0.412)	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)	(3)	(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	10	0.083	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)	(3)	(0.027)	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)	(0.055)	目論見書および運用報告書の作成・印刷費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用等の諸費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	102	0.874	

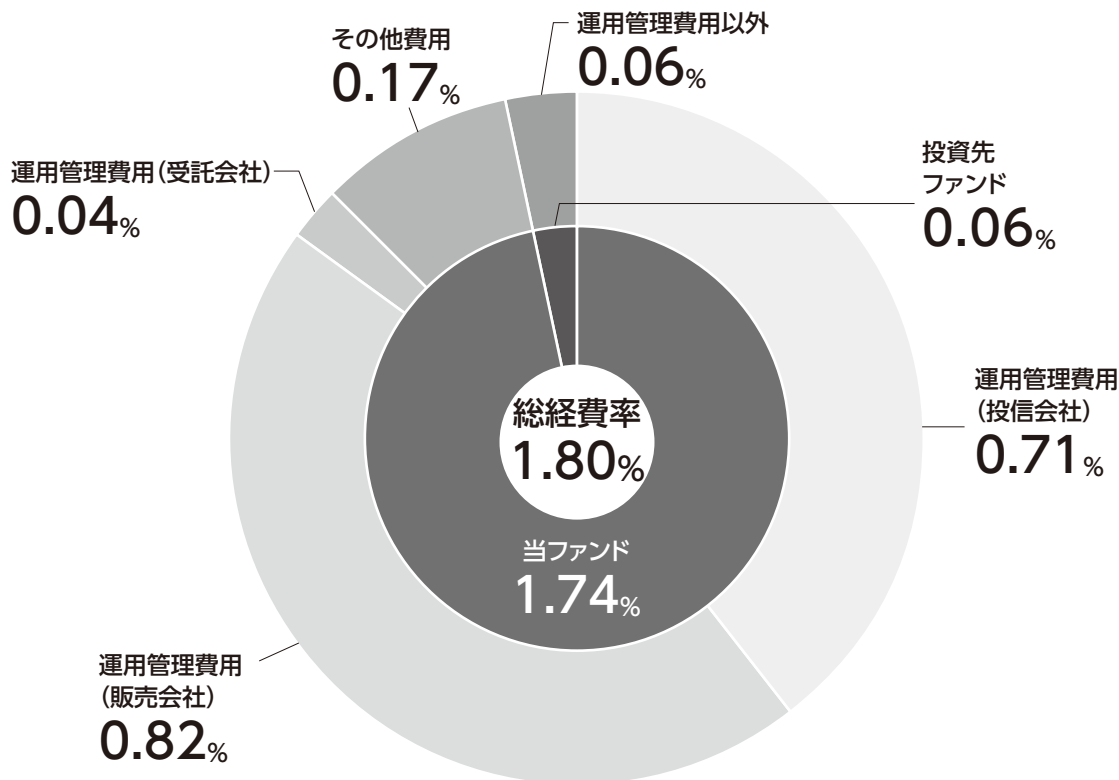
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(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1.80%です。

総経費率(①+②+③)	1.80%
①当ファンドの費用の比率	1.74%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

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

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5)①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2023年6月21日から2023年12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 -	千米・ドル -	千口 47	千米・ドル 459

(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(2023年6月21日から2023年12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
-	千口 -	千円 -	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 47	千円 67,370

(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(2023年6月21日から2023年12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(2023年6月21日から2023年12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 1,005	千米・ドル 9,978	百万円 1,437	% 95.9
BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	6	106	15	1.0
合 計	1,012	10,084	1,452	96.9

(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12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	1,452,504	96.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	51,162	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,503,666	100.0

(注1) 第219期末における外貨建資産(1,485,490千円)の投資信託財産総額(1,503,666千円)に対する比率は、98.8%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=144.03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7月20日現在	2023年8月21日現在	2023年9月20日現在
	第 214 期 末	第 215 期 末	第 216 期 末
(A) 資 産	1,468,496,898 円	1,503,163,255 円	1,534,077,890 円
コール・ローン等	29,658,308	24,707,821	25,377,613
投資証券(評価額)	1,438,838,590	1,478,455,434	1,508,700,277
未 収 入 金	-	-	-
(B) 負 債	4,662,763	4,869,406	4,718,226
未 払 金	-	-	-
未払収益分配金	2,615,296	2,606,606	2,608,212
未払解約金	897	62,272	303
未払信託報酬	1,913,685	2,057,645	1,972,725
その他未払費用	132,885	142,883	136,986
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,463,834,135	1,498,293,849	1,529,359,664
元 本	1,307,648,138	1,303,303,462	1,304,106,289
次期繰越損益金	156,185,997	194,990,387	225,253,375
(D) 受 益 権 総 口 数	1,307,648,138 口	1,303,303,462 口	1,304,106,289 口
1万口当り基準価額(C/D)	11,194 円	11,496 円	11,727 円

項 目	2023年10月20日現在	2023年11月20日現在	2023年12月20日現在
	第 217 期 末	第 218 期 末	第 219 期 末
(A) 資 産	1,484,537,598 円	1,519,650,694 円	1,536,642,021 円
コール・ローン等	15,521,882	18,096,198	18,179,196
投資証券(評価額)	1,469,015,716	1,501,554,496	1,452,504,103
未 収 入 金	-	-	65,958,722
(B) 負 債	4,681,183	4,694,868	37,772,048
未 払 金	-	-	32,975,279
未払収益分配金	2,533,024	2,537,172	2,537,749
未払解約金	50,078	1,338	180,964
未払信託報酬	1,961,851	2,016,345	1,943,125
その他未払費用	136,230	140,013	134,931
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,479,856,415	1,514,955,826	1,498,869,973
元 本	1,266,512,101	1,268,586,031	1,268,874,827
次期繰越損益金	213,344,314	246,369,795	229,995,146
(D) 受 益 権 総 口 数	1,266,512,101 口	1,268,586,031 口	1,268,874,827 口
1万口当り基準価額(C/D)	11,685 円	11,942 円	11,813 円

〈注記事項〉

期首元本額	1,297,335,400円
期中追加設定元本額	27,437,018円
期中一部解約元本額	55,897,591円

■損益の状況

第214期 自 2023年 6月21日 至 2023年 7月20日

第215期 自 2023年 7月21日 至 2023年 8月21日

第216期 自 2023年 8月22日 至 2023年 9月20日

項 目	第 214 期	第 215 期	第 216 期
(A) 配 当 等 収 益	4,351,430 円	4,592,212 円	4,721,744 円
受 取 配 当 金	4,347,665	4,588,961	4,717,665
受 取 利 息	3,765	3,251	4,079
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 19,935,342	39,505,324	30,198,362
売 買 益	5,948,019	57,872,793	30,203,872
売 買 損	△ 25,883,361	△ 18,367,469	△ 5,510
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,118,686	△ 2,202,597	△ 2,181,881
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 17,702,598	41,894,939	32,738,225
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	209,645,863	188,367,915	227,398,243
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 33,141,972	△ 32,665,861	△ 32,274,881
(配 当 等 相 当 額)	(194,812,692)	(194,640,686)	(195,233,589)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 227,954,664)	(△ 227,306,547)	(△ 227,508,470)
(G) 合 計 (D + E + F)	158,801,293	197,596,993	227,861,587
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,615,296	△ 2,606,606	△ 2,608,212
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	156,185,997	194,990,387	225,253,375
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 33,141,972	△ 32,665,861	△ 32,274,881
(配 当 等 相 当 額)	(194,812,692)	(194,640,686)	(195,233,589)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 227,954,664)	(△ 227,306,547)	(△ 227,508,470)
分 配 準 備 積 立 金	269,362,552	269,752,970	271,265,802
繰 越 損 益 金	△ 80,034,583	△ 42,096,722	△ 13,737,546

第217期 自 2023年9月21日 至 2023年10月20日

第218期 自 2023年10月21日 至 2023年11月20日

第219期 自 2023年11月21日 至 2023年12月20日

項 目	第 217 期	第 218 期	第 219 期
(A) 配 当 等 収 益	4,444,368 円	4,847,739 円	4,336,724 円
受 取 配 当 金	4,440,826	4,843,731	4,333,207
受 取 利 息	3,542	4,008	3,517
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,147,138	32,577,667	△ 15,994,052
売 買 益	21,681,129	32,678,922	43,214,160
売 買 損	△ 26,828,267	△ 101,255	△ 59,208,212
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,172,387	△ 2,225,420	△ 2,215,438
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 2,875,157	35,199,986	△ 13,872,766
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	249,136,706	243,681,327	275,677,234
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 30,384,211	△ 29,974,346	△ 29,271,573
(配 当 等 相 当 額)	(190,632,371)	(191,426,249)	(192,200,823)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 221,016,582)	(△ 221,400,595)	(△ 221,472,396)
(G) 合 計 (D + E + F)	215,877,338	248,906,967	232,532,895
(H) 収 益 分 配 金	△ 2,533,024	△ 2,537,172	△ 2,537,749
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	213,344,314	246,369,795	229,995,146
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 30,384,211	△ 29,974,346	△ 29,271,573
(配 当 等 相 当 額)	(190,632,371)	(191,426,249)	(192,200,823)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 221,016,582)	(△ 221,400,595)	(△ 221,472,396)
分 配 準 備 積 立 金	262,165,570	276,344,141	275,260,771
繰 越 損 益 金	△ 18,437,045	-	△ 15,994,052

(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214期 2023年7月20日	第215期 2023年8月21日	第216期 2023年9月20日
1万口当り分配金	20円	20円	20円
	第217期 2023年10月20日	第218期 2023年11月20日	第219期 2023年12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214期末の再投資は2023年7月20日現在の基準価額(1万口当り11,194円)、第215期末の再投資は2023年8月21日現在の基準価額(1万口当り11,496円)、第216期末の再投資は2023年9月20日現在の基準価額(1万口当り11,727円)、第217期末の再投資は2023年10月20日現在の基準価額(1万口当り11,685円)、第218期末の再投資は2023年11月20日現在の基準価額(1万口当り11,942円)、第219期末の再投資は2023年12月20日現在の基準価額(1万口当り11,813円)に基づいて行いました。
- (注5) 第214期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,232,744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)(194,812,692円)、分配準備積立金(269,745,104円)により、分配対象収益は466,790,540円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,615,296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215期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,362,922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)(194,640,686円)、分配準備積立金(267,996,654円)により、分配対象収益は467,000,262円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,606,606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216期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,426,754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)(195,233,589円)、分配準備積立金(269,447,260円)により、分配対象収益は469,107,603円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,608,212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217期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,271,981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)(190,632,371円)、分配準備積立金(262,426,613円)により、分配対象収益は455,330,965円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,533,024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218期計算期末における、費用控除後の配当等収益(4,559,547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(12,206,968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)(191,426,249円)、分配準備積立金(262,114,798円)により、分配対象収益は470,307,562円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,537,172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219期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,121,286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)(192,200,823円)、分配準備積立金(275,677,234円)により、分配対象収益は469,999,343円となり、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、2,537,749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:2022年9月1日～2023年2月28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、入手可能な最新のデータである半期末時点(2023年2月28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・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 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。

2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)

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	8,997,090,506
収益	
預金利息	11,457,003
債券利息、源泉徴収税控除後	147,441,155
スワップ利息	86,425,605
差金決済契約に係る受取利息	3,515
短期金融商品預け入れによる利息	988,742
配当金、源泉徴収税控除後	1,653,208
有価証券貸付による収益	894,361
その他の払戻し	7,385
収益合計	248,870,974
費用	
スワップ利息	101,622,396
差金決済契約配当金、源泉徴収税控除後	500
年間サービス費用	2,614,387
ローン・コミットメント・フィー	27,226
保管および預託報酬	740,733
販売報酬	1,233,806
税金	841,432
投資運用報酬	14,964,769
費用合計	122,045,249
純利益	126,825,725
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(419,675,146)
事後通告証券契約	49,454,151
差金決済取引	(45,044)
上場先物取引	99,125,378
オプション／スワップシオン契約	9,740,460
スワップ取引	(5,944,608)
先渡為替予約	(16,193,301)
その他の取引に係る外国通貨	(1,905,538)
当期実現純評価損	(285,443,648)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	200,566,001
事後通告証券契約	(27,592,995)
差金決済取引	175,776
上場先物取引	4,666,640
オプション／スワップシオン契約	(7,170,756)
スワップ取引	(24,296,663)
先渡為替予約	(6,464,265)
その他の取引に係る外国通貨	2,602,275
当期末実現評価益／(損)の純変動	142,486,013
運用成績による純資産の(減少)／増加	(16,131,910)
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	458,488,873
投資証券買戻しによる正味支払額	(1,649,182,141)
資本の変動による純資産の(減少)／増加	(1,190,693,268)
配当金宣言額	(20,863,916)
期末純資産	7,769,401,412

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)

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

投資有価証券明細表 2023年2月28日現在(未監査)

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
ルクセンブルグ			
955,110	BlackRock Global Funds - Emerging Markets Bond Fund	19,388,733	0.25
122,600	BlackRock Strategic Funds - Emerging Markets Short Duration Bond Fund	13,992,338	0.18
		33,381,071	0.43
米国			
14,000	SPDR S&P 500 ETF Trust	5,563,040	0.07
ファンド合計		38,944,111	0.50
普通株式およびワラント			
ベルギー			
32,829	Anheuser-Busch InBev	2,004,429	0.03
バミューダ			
10,492	Bunge	1,015,835	0.01
カナダ			
5,471	Cameco	151,219	0.01
1,192	George Weston	148,012	0.00
5,649	Hydro One	147,786	0.00
4,930	IGM Financial	150,375	0.00
111,000	Lions Gate Entertainment*	1,197,690	0.02
99,749	Northern Graphite	35,592	0.00
2,310	Restaurant Brands International	149,501	0.00
		1,980,175	0.03
ケイマン諸島			
97,700	Alibaba	1,076,704	0.01
32,600	Baidu	559,878	0.01
1,510	JD.com	67,693	0.00
25,300	JD.com	559,894	0.01
48,400	Meituan	839,246	0.01
26,500	NetEase	408,861	0.01
27,700	Tencent	1,212,603	0.02
38,370	TPB Acquisition I (Wts 19/2/2023)	33,528	0.00
54,500	Wuxi Biologics Cayman	379,813	0.00
211,800	Xiaomi	320,034	0.00
		5,458,254	0.07
中国			
1,128,000	Bank of China	413,892	0.00
13,000	BYD	349,803	0.00
988,000	China Construction Bank	604,205	0.01
56,000	China Merchants Bank	303,223	0.00
1,097,000	Industrial & Commercial Bank of China	547,871	0.01
85,500	Ping An Insurance of China	580,603	0.01
		2,799,597	0.03
キュラソー島			
13,760	Schlumberger	747,292	0.01
フランス			
13,185	BNP Paribas	933,501	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)		
82	Hermes International	150,199	0.00
1,570	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	1,321,651	0.02
14,544	Orange	167,422	0.00
745	Pernod Ricard	156,947	0.00
2,390	Unibail-Rodamco-Westfield	151,976	0.00
		2,881,696	0.04
	ドイツ		
6,921	Deutsche Telekom*	157,103	0.00
151,360	Fresenius	4,174,792	0.06
36,269	Mercedes-Benz	2,807,431	0.04
741	Merck	141,325	0.00
428	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	148,098	0.00
3,464	RWE	148,050	0.00
7,643	Symrise	784,372	0.01
		8,361,171	0.11
	ガーンジー		
361,474	Genius Sports	1,771,223	0.02
	アイルランド		
951	Eaton	165,874	0.00
	イタリア		
255,713	Enel	1,439,713	0.02
	日本		
616,400	Mitsubishi UFJ Financial*	4,355,279	0.06
221,200	Mizuho Financial	3,437,272	0.04
104,700	Sumitomo Mitsui Financial	4,577,703	0.06
		12,370,254	0.16
	ジャージー		
147,242	Glencore	880,459	0.01
	ルクセンブルグ		
33,760	HomeToGo (Wts 31/12/2025)	36	0.00
	オランダ		
1,485	ASML*	917,508	0.01
59,544	ING Groep	844,412	0.01
5,163	Koninklijke Ahold Delhaize	165,114	0.00
6,224	Koninklijke DSM	773,936	0.01
2,266	NXP Semiconductors	402,668	0.01
		3,103,638	0.04
	スウェーデン		
8,221	Swedbank	168,621	0.00
	スイス		
6,440	Chubb	1,369,595	0.02
261	Swisscom*	162,836	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	スイス(続き)		
241,497	Transocean	1,663,914	0.02
		3,196,345	0.04
	台湾		
6,419	Taiwan Semiconductor Manufacturing	563,813	0.01
	英国		
18,239	BP	732,478	0.01
13,497	Pearson	149,848	0.00
12,420	Shell	762,961	0.01
48,598	Shell	1,493,696	0.02
18,354	Standard Chartered	176,234	0.00
		3,315,217	0.04
	米国		
10,334	Activision Blizzard	788,122	0.01
5,267	Adobe	1,700,767	0.02
4,349	Advanced Micro Devices	338,918	0.00
5,712	AES	142,171	0.00
20,489	Alphabet	1,848,517	0.03
6,874	Applied Materials	802,333	0.01
11,915	Archer-Daniels-Midland	959,992	0.01
303,507	Astra Space	167,414	0.00
12,672	Aurora Innovation (Wts 31/12/2028)	3,168	0.00
64	Booking	162,540	0.00
1,577	Broadcom	923,633	0.01
9,936	Caesars Entertainment*	502,861	0.01
41,620	California Resources*	1,761,358	0.02
106,424	Cano Health (Wts 3/6/2026)	33,534	0.00
610	Caterpillar	146,107	0.00
10,708	CF Industries	927,527	0.01
27,839	Chesapeake Energy*	2,258,579	0.03
3,184	Cisco Systems	155,300	0.00
2,400	Corteva	148,944	0.00
24,000	Coterra Energy	604,320	0.01
23,932	CVS Health	2,010,288	0.03
8,952	Datadog	694,317	0.01
366	Deere	154,093	0.00
15,931	Devon Energy	864,257	0.01
151,511	DiamondRock Hospitality	1,337,084	0.02
4,689	Domino's Pizza	1,383,021	0.02
15,587	Dynatrace	677,255	0.01
59,890	Element Solutions	1,237,926	0.02
6,673	Eli Lilly	2,089,650	0.03
9,128	Embark Technology (Wts 31/12/2027)	524	0.00
56,455	EQT	1,887,855	0.02
60,140	Evgo (Wts 15/9/2025)	49,916	0.00
22,932	Forestar	325,634	0.00
54,396	Freeport-McMoRan	2,198,143	0.03
59,822	Green Plains*	2,105,735	0.03
95,621	Halliburton	3,546,583	0.05
4,655	HCA Healthcare	1,146,946	0.01
1,544	Humana	783,410	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)		
38,734	Informatica	670,873	0.01
5,290	Intuit	2,158,743	0.03
4,655	KLA	1,767,178	0.02
134,037	Latch (4/6/2026)	12,398	0.00
11,005	Marathon Oil	282,608	0.00
10,314	Marathon Petroleum	1,303,896	0.02
3,132	McKesson	1,106,473	0.02
132	MercadoLibre*	157,740	0.00
5,624	Microchip Technology*	456,894	0.01
34,876	Micron Technology	2,023,506	0.03
4,300	Microsoft	1,074,054	0.01
171	Morgan Stanley	16,493	0.00
22,338	Mr Cooper	1,064,182	0.01
5,992	NVIDIA	1,407,221	0.02
298,087	Offerpad	163,948	0.00
92,223	Offerpad Solutions (Wts 1/9/2026)	4,546	0.00
2,273	ONEOK	149,086	0.00
7,176	Ovintiv	317,897	0.00
71,219	Park Hotels & Resorts	992,793	0.01
32,025	Pear Therapeutics (Wts 1/12/2026)	3,523	0.00
22,567	Phillips 66	2,338,618	0.03
15,563	Pivotal Investment III	778	0.00
170,868	Planet Labs PBC	774,032	0.01
121,305	Rocket Lab USA	546,479	0.01
2,050	Rockwell Automation	605,488	0.01
4,439	RXO*	90,866	0.00
154,796	Sarcos Technology and Robotics	101,902	0.00
375,884	Sarcos Technology and Robotics (Wts 24/9/2026)	58,826	0.00
519	SBA Communications	135,189	0.00
970	Sempra Energy	145,151	0.00
150,040	Service Properties Trust	1,668,445	0.02
325,291	Sonder	344,809	0.01
64,560	Sunstone Hotel Investors	697,248	0.01
59,061	Symbotic	1,005,218	0.01
8,252	Tesla	1,714,848	0.02
5,018	United Rentals	2,337,585	0.03
9,812	Valero Energy	1,334,432	0.02
61,950	Volta (Wts 26/8/2026)	12,396	0.00
15,351	Walt Disney	1,542,008	0.02
4,777	Williams	144,743	0.00
862	Workday	161,194	0.00
82,846	Xenia Hotels & Resorts	1,183,041	0.02
6,000	Yum China	352,554	0.01
		69,298,644	0.89
普通株式およびワラント合計		121,522,286	1.56

債券

	アンゴラ		
USD 846,000	Angolan Government International Bond 8.75% 14/4/2032	766,688	0.01
	アルゼンチン		
USD 2,325,496	Argentine Republic Government International Bond 1.5% 9/7/2035	665,092	0.01
USD 4,290,189	Generacion Mediterraneo / Central Termica Roca 9.875% 1/12/2027	3,378,524	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 (%)
アルゼンチン(続き)			
USD 677,903	Genneia 8.75% 2/9/2027	646,052	0.01
USD 1,665,150	YPF 7% 30/9/2033	1,191,702	0.02
USD 1,337,000	YPF 7% 15/12/2047	883,256	0.01
		6,764,626	0.09
オーストラリア			
EUR 2,000,000	APA Infrastructure 0.75% 15/3/2029	1,712,959	0.02
EUR 1,000,000	AusNet Services Pty 1.5% 26/2/2027	957,386	0.02
EUR 1,500,000	BHP Billiton Finance 5.625% 22/10/2079	1,607,835	0.02
USD 3,310,000	FMG Resources August 2006 Pty 6.125% 15/4/2032*	3,116,166	0.04
USD 187,500	Linc Energy 0% 10/4/2018	5,625	0.00
EUR 2,700,000	Origin Energy Finance 1% 17/9/2029	2,371,934	0.03
		9,771,905	0.13
オーストリア			
EUR 2,600,000	ams-OSRAM 0% 5/3/2025	2,250,533	0.03
EUR 2,400,000	ams-OSRAM 2.125% 3/11/2027	1,858,633	0.02
EUR 946,000	ams-OSRAM 6% 31/7/2025*	956,072	0.01
USD 3,036,000	BRF 4.35% 29/9/2026	2,651,339	0.04
USD 2,471,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031*	1,976,800	0.03
EUR 4,500,000	Lenzing 5.75% 7/12/2171	4,172,111	0.05
EUR 900,000	Raiffeisen Bank International 4.75% 26/1/2027	938,422	0.01
USD 3,852,000	Suzano Austria 3.125% 15/1/2032	3,033,623	0.04
USD 2,054,000	Suzano Austria 3.75% 15/1/2031	1,740,549	0.02
USD 1,109,000	Suzano Austria 5% 15/1/2030	1,022,853	0.01
USD 699,000	Suzano Austria 5.75% 14/7/2026	702,532	0.01
		21,303,467	0.27
バハマ			
USD 602,000	Intercorp Peru 3.875% 15/8/2029	504,551	0.01
バーレーン			
USD 1,257,000	Bahrain Government International Bond 5.45% 16/9/2032*	1,139,156	0.01
ベルギー			
GBP 1,000,000	Anheuser-Busch InBev 4% 24/9/2025	1,195,055	0.01
GBP 1,000,000	KBC 1.25% 21/9/2027	1,049,549	0.01
EUR 3,900,000	Solvay 2.5% 2/3/2171*	3,741,320	0.05
		5,985,924	0.07
バミューダ			
USD 1,508,540	Digicel 8% 1/4/2025	379,975	0.00
USD 517,000	Inkia Energy 5.875% 9/11/2027	476,063	0.00
USD 25,710,000	PPF 2022-9 6.836% 19/8/2035	25,673,322	0.33
HKD 4,062,966	REXLot 4.5% 17/4/2019	64,705	0.00
HKD 348,254	REXLot 6% 28/4/2017	14,791	0.00
USD 655,000	Star Energy Geothermal Darajat II / Star Energy Geothermal Salak 4.85% 14/10/2038	565,874	0.01
		27,174,730	0.34
ブラジル			
USD 205,000	Banco Bradesco 3.2% 27/1/2025	193,784	0.00
BRL 181,140	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2025	3,336,069	0.04
BRL 119,300	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10% 1/1/2027	2,136,696	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 (%)
ブラジル(続き)			
USD 1,488,000	BRF 4.875% 24/1/2030*	1,136,014	0.01
		6,802,563	0.08
英領バージン諸島			
USD 300,000	Champion Path 4.85% 27/1/2028	250,812	0.01
USD 507,779	Easy Tactic 7.5% 11/7/2028	134,168	0.00
USD 338,000	Fortune Star BVI 5% 18/5/2026	256,578	0.00
USD 400,000	Fortune Star BVI 5.95% 19/10/2025	333,318	0.01
EUR 1,509,000	Global Switch 2.25% 31/5/2027	1,480,659	0.02
USD 200,000	Greenland Global Investment 6.125% 22/4/2025	97,000	0.00
HKD 13,000,000	Link CB 4.5% 12/12/2027	1,743,216	0.02
USD 282,000	New Metro Global 4.8% 15/12/2024	234,765	0.00
USD 242,000	RKPF Overseas 2019 A 6% 4/9/2025	206,457	0.00
USD 369,000	RKPF Overseas 2019 A 6.7% 30/9/2024*	345,015	0.00
USD 486,480	Star Energy Geothermal Wayang Windu 6.75% 24/4/2033	471,545	0.00
USD 850,000	Studio City Finance 5% 15/1/2029	657,233	0.01
		6,210,766	0.07
カナダ			
USD 1,636,262	Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust 5% 15/6/2025	1,618,802	0.02
EUR 4,300,000	Alimentation Couche-Tard 1.875% 6/5/2026*	4,237,332	0.06
USD 563,000	Bausch Health 5.5% 1/11/2025	487,766	0.01
USD 455,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	446,421	0.01
USD 778,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	607,587	0.01
USD 1,159,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 6.25% 15/9/2027	1,018,303	0.01
EUR 2,834,000	Clarios Global / Clarios US Finance 4.375% 15/5/2026	2,846,871	0.04
USD 1,250,000	First Quantum Minerals 6.875% 1/3/2026	1,181,869	0.01
USD 1,350,000	First Quantum Minerals 7.5% 1/4/2025	1,312,817	0.02
USD 343,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	336,963	0.00
USD 2,099,000	Mattamy 4.625% 1/3/2030	1,745,969	0.02
USD 1,748,000	Mattamy 5.25% 15/12/2027	1,563,105	0.02
USD 991,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	972,305	0.01
USD 1,374,000	Open Text 6.9% 1/12/2027	1,392,412	0.02
USD 4,970,000	Rogers Communications 3.8% 15/3/2032	4,319,371	0.06
USD 155,000	Royal Bank of Canada 1.2% 27/4/2026	137,077	0.00
USD 3,540,000	Toronto-Dominion Bank/The 1.95% 12/1/2027	3,135,922	0.04
USD 325,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.8% 10/3/2027	296,338	0.00
GBP 1,000,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.875% 5/4/2027	1,108,962	0.02
		28,766,192	0.38
ケイマン諸島			
USD 500,000	522 Funding CLO 2018-3A 6.858% 20/10/2031	478,071	0.01
USD 2,993,645	ACAS CLO 2015-1 5.685% 18/10/2028	2,962,786	0.04
USD 500,000	ACAS CLO 2015-1 6.395% 18/10/2028	488,719	0.01
USD 3,870,000	ACAS CLO 2015-1 6.995% 18/10/2028	3,606,940	0.05
USD 299,000	Agile 5.75% 2/1/2025	188,370	0.00
USD 322,000	Agile 7.875% 31/1/2172	114,339	0.00
USD 250,000	AGL CLO 11 11.152% 15/4/2034	225,550	0.00
USD 375,000	AGL CLO 3 8.092% 15/1/2033	357,674	0.00
USD 410,000	AGL CLO 5 6.208% 20/7/2034	393,840	0.01
USD 4,700,000	AGL CLO 5 6.508% 20/7/2034	4,578,660	0.06
USD 1,460,000	AGL CLO 7 7.892% 15/7/2034	1,393,252	0.02
USD 250,000	AGL CLO 9 8.508% 20/1/2034	244,198	0.00
USD 1,030,000	AGL CLO 9 12.068% 20/1/2034	988,651	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 400,000	Ahli United Sukuk 3.875% 17/12/2171	369,888	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2015-A 6.392% 17/10/2034	244,476	0.00
USD 250,000	AIMCO CLO Series 2017-A 7.958% 20/4/2034	235,077	0.00
USD 1,560,000	Allegro CLO II-S 6.965% 21/10/2028	1,530,825	0.02
USD 2,270,000	Allegro CLO II-S 7.815% 21/10/2028	2,203,906	0.03
USD 370,000	Allegro CLO IV 6.342% 15/1/2030	367,054	0.01
USD 1,150,000	Allegro CLO VI 5.922% 17/1/2031	1,138,602	0.01
USD 500,000	Allegro CLO XI 6.648% 19/1/2033	490,704	0.01
USD 690,000	Allegro CLO XI 7.798% 19/1/2033	658,651	0.01
USD 4,065,000	ALM VII 0% 15/10/2116	1,992	0.00
USD 527,546	AMMC CLO 21 6.064% 2/11/2030	523,669	0.01
USD 2,350,000	ANCHORAGE CAPITAL CLO 1-R 5.805% 13/4/2031	2,325,407	0.03
USD 840,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 6.065% 13/10/2030	835,445	0.01
USD 1,070,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 6.465% 13/10/2030	1,057,754	0.01
USD 340,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 6.965% 13/10/2030	328,578	0.00
USD 417,000	Anchorage Capital CLO 2013-1 8.015% 13/10/2030	405,451	0.01
USD 783,571	Anchorage Capital CLO 3-R 5.852% 28/1/2031	778,804	0.01
USD 1,650,000	Anchorage Capital CLO 3-R 6.302% 28/1/2031	1,629,740	0.02
USD 1,389,001	Anchorage Capital CLO 4-R 5.852% 28/1/2031	1,380,597	0.02
USD 1,500,000	Anchorage Capital CLO 4-R 6.652% 28/1/2031	1,432,884	0.02
USD 5,223,000	Anchorage Capital CLO 5-R 6.242% 15/1/2030	5,163,000	0.07
USD 1,300,000	Anchorage Capital CLO 5-R 6.642% 15/1/2030	1,262,855	0.02
USD 700,000	Apidos CLO XII 5.872% 15/4/2031	694,957	0.01
USD 1,040,000	Apidos CLO XV 5.818% 20/4/2031	1,031,858	0.01
USD 250,000	Apidos CLO XXXI 6.342% 15/4/2031	245,738	0.00
USD 250,000	Apidos CLO XXXII 7.208% 20/1/2033	247,178	0.00
USD 300,000	Apidos CLO XXXII 8.308% 20/1/2033	291,163	0.00
USD 375,000	Apidos CLO XXXV 10.558% 20/4/2034	346,807	0.00
USD 820,000	Apidos CLO XXXVII 11.115% 22/10/2034	760,617	0.01
USD 1,745,000	Arabian Centres Sukuk 5.375% 26/11/2024*	1,710,100	0.02
USD 1,036,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	955,710	0.01
USD 1,798,000	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2022-FL2 6.412% 15/5/2037	1,779,464	0.02
USD 375,000	ARES XLV CLO 6.842% 15/10/2030	362,593	0.00
USD 1,499,273	Ares XXXVII CLO 5.962% 15/10/2030	1,489,288	0.02
USD 250,000	ASSURANT CLO 5.848% 20/4/2031	247,435	0.00
USD 1,790,000	Bain Capital Credit CLO 2018-2 5.878% 19/7/2031	1,777,802	0.02
USD 2,740,000	Bain Capital Credit CLO 2021-3 7.916% 24/7/2034	2,558,109	0.03
USD 430,000	Bain Capital Credit CLO 2021-4 5.978% 20/10/2034	422,606	0.01
USD 250,000	Ballyrock CLO 14 7.108% 20/1/2034	241,659	0.00
USD 1,410,000	Ballyrock CLO 2020-2 10.958% 20/10/2031	1,330,053	0.02
USD 1,060,000	Bardot CLO 7.815% 22/10/2032	1,003,234	0.01
USD 971,508	Barings Clo 2015-II 5.998% 20/10/2030	966,013	0.01
USD 392,440	Barings CLO 2018-III 5.758% 20/7/2029	390,351	0.01
USD 750,000	Benefit Street Partners CLO V-B 5.898% 20/4/2031	743,865	0.01
USD 2,010,000	Benefit Street Partners CLO VIII 5.908% 20/1/2031	1,997,581	0.03
USD 2,615,741	BlueMountain CLO 2013-2 5.995% 22/10/2030	2,600,486	0.03
USD 530,000	BlueMountain CLO 2015-3 5.808% 20/4/2031	525,371	0.01
USD 250,000	Canyon CLO 2018-1 5.862% 15/7/2031	247,905	0.00
USD 370,000	Canyon CLO 2020-3 12.042% 15/1/2034	345,988	0.00
USD 500,000	Carbone Clo 5.948% 20/1/2031	496,415	0.01
USD 2,013,877	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-1 5.762% 17/4/2031	1,995,781	0.03
USD 4,500,000	CARLYLE US CLO 2017-4 5.972% 15/1/2030	4,471,202	0.06
USD 750,000	CarVal CLO I 7.682% 16/7/2031	715,864	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 350,000	Cayuga Park CLO 6.442% 17/7/2034	339,446	0.00
USD 7,015,755	CBAM 2017-1 6.058% 20/7/2030	6,980,158	0.09
USD 750,000	CBAM 2017-1 7.208% 20/7/2030	720,957	0.01
USD 341,000	China Aoyuan 8.5% 23/1/2022	34,952	0.00
USD 1,264,000	China Evergrande 7.5% 28/6/2023	112,180	0.00
USD 800,000	China Evergrande 8.25% 23/3/2022	68,000	0.00
USD 663,000	China SCE 7.375% 9/4/2024	387,855	0.01
USD 750,000	CIFC Funding 2012-II-R 6.058% 20/1/2028	737,062	0.01
USD 850,000	CIFC Funding 2013-III-R 6.666% 24/4/2031	836,285	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014 5.895% 18/1/2031	248,416	0.00
USD 710,000	CIFC Funding 2014-III 6.015% 22/10/2031	704,471	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2014-II-R 7.616% 24/4/2030	239,987	0.00
USD 3,530,000	CIFC Funding 2017-I 6.515% 23/4/2029	3,523,278	0.05
USD 2,730,000	CIFC Funding 2017-I 7.265% 23/4/2029	2,674,214	0.03
USD 981,784	CIFC Funding 2017-II 5.758% 20/4/2030	973,684	0.01
USD 250,000	CIFC Funding 2017-IV 6.366% 24/10/2030	241,817	0.00
USD 236,782	CIFC Funding 2017-V 5.972% 16/11/2030	235,212	0.00
USD 600,000	CIFC Funding 2017-V 7.642% 16/11/2030	571,879	0.01
USD 5,640,000	CIFC Funding 2018-II 5.848% 20/4/2031	5,595,552	0.07
USD 250,000	CIFC Funding 2018-II 6.408% 20/4/2031	246,350	0.00
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 7.792% 15/1/2032	238,875	0.00
USD 234,615	Clear Creek CLO 6.008% 20/10/2030	232,640	0.00
USD 1,400,000	Clear Creek CLO 7.758% 20/10/2030	1,277,834	0.02
USD 430,000	Country Garden 2.7% 12/7/2026	260,150	0.01
USD 1,298,000	Dar Al-Arkan Sukuk 6.875% 21/3/2023	1,293,126	0.02
USD 4,211,539	Deer Creek Clo 2017-1 5.988% 20/10/2030	4,174,640	0.05
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 6.458% 20/10/2030	494,675	0.01
USD 500,000	Deer Creek Clo 2017-1 11.158% 20/10/2030	443,819	0.01
USD 1,488,000	DP World Salaam 6% 1/1/2172	1,482,407	0.02
USD 10,667,000	Dryden 53 CLO 5.912% 15/1/2031	10,605,399	0.14
USD 464,041	Dryden XXVI Senior Loan Fund 5.692% 15/4/2029	460,502	0.01
USD 5,987,284	Dryden XXVIII Senior Loan Fund 6.064% 15/8/2030	5,953,096	0.08
USD 1,000,000	Eaton Vance CLO 2018-1 6.992% 15/10/2030	958,031	0.01
USD 1,781,000	Fantasia 0% 5/7/2022	261,478	0.01
USD 925,000	Fantasia 6.95% 17/12/2021	136,548	0.00
USD 794,000	Fantasia 9.25% 28/7/2023	113,145	0.00
USD 2,580,000	Fantasia 11.75% 17/4/2022	367,650	0.01
USD 411,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	58,567	0.00
USD 5,730,000	Gaci First Investment 4.75% 14/2/2030	5,608,237	0.07
USD 6,517,000	Gaci First Investment 5% 13/10/2027	6,468,122	0.09
USD 250,000	Galaxy XXII CLO 5.992% 16/4/2034	246,813	0.00
USD 405,949	Galaxy XXIII CLO 5.686% 24/4/2029	402,604	0.01
USD 250,000	Generate CLO 2 5.965% 22/1/2031	247,548	0.00
USD 793,153	Generate CLO 3 6.058% 20/10/2029	788,145	0.01
USD 5,995,000	Generate CLO 3 6.558% 20/10/2029	5,952,315	0.08
USD 4,240,000	Generate CLO 3 8.408% 20/10/2029	4,131,870	0.05
USD 1,520,000	Generate CLO 3 11.208% 20/10/2029	1,374,827	0.02
USD 730,000	Generate CLO 3 12.058% 20/10/2029	592,954	0.01
USD 2,090,000	Gilbert Park CLO 6.742% 15/10/2030	2,008,859	0.03
USD 2,717,000	Gilbert Park CLO 7.742% 15/10/2030	2,561,863	0.03
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 5.828% 20/4/2034	490,899	0.01
USD 460,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 6.358% 20/10/2032	450,390	0.01
USD 581,584	GoldenTree Loan Opportunities IX 5.912% 29/10/2029	579,289	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 1,166,000	Goldentree Loan Opportunities X 5.928% 20/7/2031	1,157,729	0.02
USD 1,255,000	Goldentree Loan Opportunities XI 5.865% 18/1/2031	1,247,078	0.02
USD 2,610,000	Goldentree Loan Management US CLO 1 10.158% 20/10/2034	2,348,181	0.03
USD 2,900,000	Golub Capital Partners CLO 55B 11.368% 20/7/2034	2,602,691	0.03
USD 310,430	Grippen Park CLO 6.068% 20/1/2030	308,895	0.00
USD 4,124,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	3,101,207	0.04
USD 320,000	Highbridge Loan Management 12-2018 6.045% 18/7/2031	313,566	0.00
USD 80,000	Highbridge Loan Management 7-2015 6.564% 15/3/2027	78,453	0.00
USD 2,810,790	HPS Loan Management 6-2015 5.806% 5/2/2031	2,792,554	0.04
USD 1,924,000	IHS 5.625% 29/11/2026*	1,647,478	0.02
USD 1,249,000	IHS 5.625% 29/11/2026	1,069,491	0.01
USD 2,326,000	IHS 6.25% 29/11/2028	1,915,147	0.02
USD 780,000	Jingrui 12% 25/7/2022	68,644	0.00
USD 750,000	LCM XIV 5.848% 20/7/2031	743,585	0.01
USD 227,414	LCM XXI 5.688% 20/4/2028	226,719	0.00
USD 759,000	Liberty Costa Rica Senior Secured Finance 10.875% 15/1/2031	721,050	0.01
USD 2,654,546	Loanpal Solar Loan 2021-1 2.29% 20/1/2048	2,066,429	0.03
USD 600,000	Madison Park Funding XIII 6.698% 19/4/2030	586,388	0.01
USD 433,155	Madison Park Funding XLI 5.645% 22/4/2027	429,304	0.01
USD 1,385,000	Madison Park Funding XLI 6.465% 22/4/2027	1,350,723	0.02
USD 700,000	Madison Park Funding XXX 9.742% 15/4/2029	641,057	0.01
USD 1,695,000	MAF Global 4.75% 7/5/2024	1,673,368	0.02
USD 744,000	MAF Global 6.375% 20/9/2171	727,710	0.01
USD 250,000	Marble Point CLO XVII 8.558% 20/4/2033	234,917	0.00
USD 256,000	Melco Resorts Finance 5.375% 4/12/2029	214,400	0.00
USD 200,000	Melco Resorts Finance 5.625% 17/7/2027	177,530	0.00
USD 448,000	MGM China 4.75% 1/2/2027	392,016	0.01
USD 150,000	Modern Land China 7% 30/12/2023	12,574	0.00
USD 201,417	Modern Land China 8% 30/12/2024	17,068	0.00
USD 636,075	Modern Land China 9% 30/12/2025	56,251	0.00
USD 1,099,087	Modern Land China 9% 30/12/2027	92,337	0.00
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 6.389% 20/1/2035	833,920	0.01
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 39 12.008% 20/1/2032	240,173	0.00
USD 250,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 46 6.458% 20/1/2036	247,530	0.00
USD 250,000	Ocean Trails Clo X 6.592% 15/10/2034	238,405	0.00
USD 460,000	OCP CLO 2014-5 5.902% 26/4/2031	456,910	0.01
USD 1,320,000	OCP CLO 2014-5 7.722% 26/4/2031	1,188,653	0.02
USD 1,170,000	OCP CLO 2014-7 5.106% 20/7/2029	1,057,597	0.01
USD 1,100,000	OCP CLO 2014-7 6.458% 20/7/2029	1,088,679	0.01
USD 360,000	OCP CLO 2017-14 6.865% 20/11/2030	347,425	0.00
USD 250,000	Octagon Investment Partners 18-R 5.752% 16/4/2031	247,804	0.00
USD 250,000	Octagon Loan Funding 6.615% 18/11/2031	245,792	0.00
USD 1,433,000	OHA Loan Funding 2013-2 5.962% 23/5/2031	1,421,802	0.02
USD 744,000	Oryx Funding 5.8% 3/2/2031	724,678	0.01
USD 290,000	OZLM Funding IV 6.515% 22/10/2030	287,310	0.00
USD 3,200,000	OZLM VI 0% 17/4/2031	201,901	0.00
USD 500,000	OZLM VII 6.392% 17/7/2029	493,180	0.01
USD 815,000	OZLM VIII 7.942% 17/10/2029	788,600	0.01
USD 250,000	OZLM XX 6.458% 20/4/2031	242,425	0.00
USD 580,000	Palmer Square CLO 2014-1 5.922% 17/1/2031	576,655	0.01
USD 1,840,000	Palmer Square CLO 2018-1 5.825% 18/4/2031	1,825,860	0.02
USD 500,000	Palmer Square CLO 2018-2 6.442% 16/7/2031	492,379	0.01
USD 460,000	Palmer Square CLO 2020-3 6.464% 15/11/2031	453,574	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 330,000	Parallel 2015-1 6.558% 20/7/2027	326,404	0.00
USD 1,049,714	Pearl II 6% 29/12/2049	37,233	0.00
USD 836,000	Pearl III 9% 22/10/2025	296,780	0.00
USD 500,000	Pikes Peak CLO 1 5.996% 24/7/2031	496,665	0.01
USD 375,000	Pikes Peak Clo 4 8.042% 15/7/2034	357,884	0.00
USD 500,000	Pikes Peak CLO 6 11.345% 18/5/2034	454,891	0.01
USD 989,522	Prima Capital CRE Securitization 2015-IV 4% 24/8/2049	960,335	0.01
USD 9,164,792	Prima Capital CRE Securitization 2016-VI 4% 24/8/2040	8,258,344	0.11
USD 565,000	Redsun Properties 7.3% 13/1/2025	97,745	0.00
USD 785,000	Redsun Properties 9.7% 16/4/2023	133,399	0.00
USD 1,000,000	Regatta IX Funding 6.592% 17/4/2030	989,813	0.01
USD 2,180,000	Regatta IX Funding 7.242% 17/4/2030	2,132,619	0.03
USD 500,000	Regatta IX Funding 8.692% 17/4/2030	491,546	0.01
USD 1,230,000	Regatta VIII Funding 6.492% 17/10/2030	1,213,472	0.02
USD 910,000	Regatta VIII Funding 7.992% 17/10/2030	887,583	0.01
USD 250,000	Regatta XVI Funding 6.842% 15/1/2033	247,367	0.00
USD 500,000	Regatta XVI Funding 8.692% 15/1/2033	482,988	0.01
USD 10,872,992	Rockford Tower CLO 2017-3 5.998% 20/10/2030	10,811,865	0.14
USD 1,000,000	Rockford Tower CLO 2018-1 6.015% 20/5/2031	992,872	0.01
USD 1,250,000	Rockford Tower CLO 2018-1 6.635% 20/5/2031	1,234,068	0.02
USD 341,000	Rockford Tower CLO 2018-2 5.968% 20/10/2031	337,983	0.00
USD 836,000	Ronshine China 7.1% 25/1/2025	81,510	0.00
USD 200,000	Ronshine China 7.35% 15/12/2023	19,500	0.00
USD 1,500,000	RR 19 11.292% 15/10/2035	1,405,134	0.02
USD 250,000	RR 3 5.882% 15/1/2030	248,420	0.00
USD 2,000,000	RR 4 6.342% 15/4/2030	1,962,717	0.03
USD 519,000	Sands China 4.875% 18/6/2030	452,828	0.01
USD 380,000	Seagate HDD Cayman 4.875% 1/3/2024	373,877	0.01
USD 1,660,000	Seagate HDD Cayman 9.625% 1/12/2032	1,826,988	0.02
USD 300,000	Seazen 6% 12/8/2024	251,250	0.00
USD 250,000	Seneca Park CLO 2014-1 0% 17/7/2026	628	0.00
USD 3,030,635	Shackleton 2013-III CLO 5.912% 15/7/2030	3,005,000	0.04
USD 220,000	Shelf Drilling 8.875% 15/11/2024	222,324	0.00
USD 2,184,000	Shelf Drilling North Sea 10.25% 31/10/2025	2,204,838	0.03
USD 300,000	Shui On Development 5.75% 12/11/2023	294,000	0.01
USD 2,713,794	Silver Creek CLO 6.048% 20/7/2030	2,694,605	0.04
USD 750,000	Silver Creek CLO 8.158% 20/7/2030	723,955	0.01
USD 774,000	Sinic 0% 18/6/2022	15,480	0.00
USD 328,778	Steele Creek Clo 2017-1 6.042% 15/10/2030	326,278	0.00
USD 2,213,000	Strata CLO I 0% 15/1/2118	1,050,642	0.01
USD 410,000	Strata CLO I 11.872% 15/1/2031	375,205	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 6.792% 15/1/2034	482,597	0.01
USD 490,000	Symphony CLO XXIII 10.942% 15/1/2034	449,903	0.01
USD 263,000	Tiaa Clo III 5.942% 16/1/2031	261,275	0.00
USD 750,000	Tiaa Clo III 6.292% 16/1/2031	738,768	0.01
USD 2,750,000	TICP CLO IX 5.948% 20/1/2031	2,737,482	0.04
USD 500,000	TICP CLO XI 5.988% 20/10/2031	495,554	0.01
GBP 800,000	Trafford Centre Finance 4.832% 28/7/2035	747,762	0.01
USD 644,000	Transocean 8.75% 15/2/2030	654,607	0.01
USD 609,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	622,155	0.00
USD 351,000	TRESTLES CLO II 6.488% 25/7/2031	339,737	0.00
USD 11,930,000	Triaxx Prime CDO 2006-1 5.215% 3/3/2039	66,474	0.00
USD 950,000	TRINITAS CLO IV 6.195% 18/10/2031	925,778	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 590,000	Trinitas CLO XIV 6.818% 25/1/2034	579,907	0.01
USD 625,000	Trinitas CLO XIV 7.818% 25/1/2034	606,219	0.01
USD 1,855,000	Voya CLO 2013-2 5.891% 25/4/2031	1,842,565	0.02
USD 1,040,000	Voya CLO 2016-1 7.551% 20/1/2031	933,120	0.01
USD 3,334,792	Voya Clo 2017-4 5.922% 15/10/2030	3,316,242	0.04
USD 234,000	Wynn Macau 5.125% 15/12/2029*	190,629	0.00
USD 280,000	Wynn Macau 5.5% 15/1/2026	255,700	0.00
USD 200,000	Wynn Macau 5.5% 1/10/2027	174,500	0.00
USD 1,000,000	York CLO 1 6.465% 22/10/2029	992,410	0.01
USD 250,000	York CLO 1 7.825% 22/10/2029	244,325	0.00
		268,719,210	3.45
チリ			
USD 2,032,000	Chile Government International Bond 4.34% 7/3/2042	1,736,258	0.02
USD 3,205,000	Empresa Nacional del Petroleo 3.75% 5/8/2026	2,980,177	0.04
USD 1,326,000	VTR Comunicaciones 5.125% 15/1/2028*	935,265	0.01
		5,651,700	0.07
中国			
CNY 48,000,000	China Development Bank 3.3% 1/2/2024	6,967,069	0.09
コロンビア			
USD 4,090,000	Colombia Government International Bond 3.125% 15/4/2031	2,958,614	0.04
USD 1,623,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	1,442,315	0.02
USD 1,261,000	Colombia Government International Bond 4.125% 22/2/2042	770,471	0.01
USD 2,031,000	Colombia Government International Bond 4.125% 15/5/2051	1,182,357	0.01
USD 3,202,000	Colombia Government International Bond 4.5% 28/1/2026	3,017,541	0.04
USD 4,903,000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	4,849,742	0.06
USD 1,303,000	Colombia Telecomunicaciones 4.95% 17/7/2030	1,024,357	0.01
COP 14,314,000,000	Colombian TES 7% 26/3/2031	2,123,497	0.03
COP 11,793,500,000	Colombian TES 7% 30/6/2032	1,677,542	0.02
COP 15,809,000,000	Colombian TES 7.25% 18/10/2034	2,167,563	0.03
USD 6,371,000	Ecopetrol 4.125% 16/1/2025*	6,109,072	0.08
USD 1,488,000	Ecopetrol 4.625% 2/11/2031	1,110,420	0.01
USD 816,000	Ecopetrol 5.875% 18/9/2023	813,144	0.01
USD 1,036,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	690,235	0.01
USD 8,547,000	Ecopetrol 6.875% 29/4/2030	7,617,514	0.10
USD 1,634,000	Ecopetrol 8.875% 13/1/2033	1,602,545	0.02
USD 909,000	Empresas Publicas de Medellin 4.25% 18/7/2029	671,971	0.01
USD 2,528,000	Oleoducto Central 4% 14/7/2027*	2,179,269	0.03
USD 2,399,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029	1,865,864	0.02
USD 1,499,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029*	1,165,874	0.02
USD 1,930,000	SURA Asset Management 4.875% 17/4/2024	1,905,571	0.02
		46,945,478	0.60
コートジボワール			
USD 3,466,000	Ivory Coast Government International Bond 6.375% 3/3/2028*	3,318,695	0.04
キプロス			
EUR 725,000	Bank of Cyprus 2.5% 24/6/2027	658,674	0.01
チェコ共和国			
CZK 55,690,000	Czech Republic Government Bond 1.2% 13/3/2031	1,899,117	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 (%)
チェコ共和国(続き)			
CZK 81,270,000	Czech Republic Government Bond 5% 30/9/2030	3,674,748	0.05
		5,573,865	0.07
デンマーク			
EUR 2,500,000	Danske Bank 1.375% 17/2/2027	2,418,716	0.03
GBP 1,600,000	Danske Bank 2.25% 14/1/2028	1,687,165	0.02
EUR 5,810,000	Danske Bank 4.125% 10/1/2031	6,112,144	0.08
EUR 400,000	Nykredit Realkredit 4.125% 15/4/2171	392,826	0.01
		10,610,851	0.14
ドミニカ共和国			
USD 1,116,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI 6.75% 30/3/2029	1,097,865	0.01
USD 2,122,000	Dominican Republic International Bond 4.5% 30/1/2030	1,826,188	0.02
USD 3,425,000	Dominican Republic International Bond 4.875% 23/9/2032	2,870,184	0.04
USD 1,116,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	1,036,479	0.01
USD 1,859,000	Dominican Republic International Bond 5.95% 25/1/2027	1,825,538	0.02
USD 1,324,000	Dominican Republic International Bond 6.875% 29/1/2026	1,342,996	0.02
USD 3,027,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031	3,032,203	0.04
		13,031,453	0.16
エクアドル			
USD 95,484	Ecuador Government International Bond 0% 31/7/2030	30,117	0.00
USD 534,131	Ecuador Government International Bond 1.5% 31/7/2040	171,401	0.00
USD 1,165,440	Ecuador Government International Bond 2.5% 31/7/2035	419,430	0.01
USD 444,717	Ecuador Government International Bond 5.5% 31/7/2030	219,218	0.00
		840,166	0.01
エジプト			
USD 4,071,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	2,412,067	0.03
USD 1,116,000	Egypt Government International Bond 7.5% 16/2/2061	661,230	0.01
USD 986,000	Egypt Government International Bond 8.5% 31/1/2047	638,435	0.01
		3,711,732	0.05
フィンランド			
EUR 1,200,000	Ahlstrom-Munksjo 3 Oy 3.625% 4/2/2028*	1,087,500	0.01
USD 600,000	Ahlstrom-Munksjo 3 Oy 4.875% 4/2/2028	512,373	0.01
EUR 100,000	Citycon 4.496% 22/2/2172	66,881	0.00
EUR 1,525,000	Finnair 4.25% 19/5/2025*	1,454,647	0.02
GBP 3,700,000	Nordea Bank 1.625% 9/12/2032	3,647,069	0.05
EUR 3,270,000	OP Corporate Bank 2.875% 15/12/2025	3,380,209	0.04
EUR 200,000	SBB Treasury 0.75% 14/12/2028	140,920	0.00
EUR 1,200,000	SBB Treasury 1.125% 26/11/2029	836,299	0.01
		11,125,898	0.14
フランス			
EUR 7,316	Accor 0.7% 7/12/2027	356,084	0.00
EUR 23,845	Air France-KLM 0.125% 25/3/2026	430,326	0.01
EUR 1,800,000	Air France-KLM 7.25% 31/5/2026	1,940,699	0.02
EUR 500,000	Air France-KLM 8.125% 31/5/2028	536,243	0.01
EUR 757,000	Altice France 2.125% 15/2/2025	740,807	0.01
EUR 2,739,000	Altice France 2.5% 15/1/2025*	2,695,646	0.03
EUR 2,896,000	Altice France 5.875% 1/2/2027*	2,742,406	0.04
EUR 700,000	Arkema 1.5% 21/1/2172*	659,088	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 900,000	Atos 0% 6/11/2024	846,102	0.01
EUR 1,000,000	Atos 1.75% 7/5/2025	968,977	0.01
EUR 1,200,000	Banque Federative du Credit Mutuel 3.75% 1/2/2033	1,227,998	0.02
EUR 2,100,000	Banque Federative du Credit Mutuel 4% 21/11/2029	2,224,175	0.03
EUR 2,300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 5.125% 13/1/2033	2,395,658	0.03
EUR 1,600,000	BNP Paribas 1.125% 17/4/2029*	1,432,688	0.02
GBP 1,000,000	BNP Paribas 1.875% 14/12/2027	1,031,837	0.01
EUR 2,000,000	BNP Paribas 2.75% 25/7/2028	1,971,614	0.03
GBP 1,000,000	BNP Paribas 3.375% 23/1/2026	1,149,813	0.01
EUR 3,000,000	BNP Paribas 4.375% 13/1/2029*	3,174,393	0.04
USD 1,581,000	BNP Paribas 4.625% 1/12/2027	1,348,842	0.02
USD 1,800,000	BNP Paribas 5.125% 13/1/2029	1,765,228	0.02
USD 800,000	BNP Paribas 6.625% 25/9/2171*	786,696	0.01
EUR 400,000	BNP Paribas 7.375% 6/11/2030	428,035	0.01
USD 800,000	BNP Paribas 7.375% 19/2/2172*	789,383	0.01
USD 1,600,000	BNP Paribas 7.75% 16/2/2172*	1,634,000	0.02
EUR 1,800,000	BPCE 0.5% 15/9/2027	1,659,290	0.02
EUR 7,600,000	BPCE 4.5% 13/1/2033	7,914,511	0.10
EUR 1,600,000	BPCE 5.125% 25/1/2035	1,646,232	0.02
EUR 700,000	Burger King France 7.232% 1/11/2026*	741,772	0.01
EUR 2,800,000	Casino Guichard Perrachon 3.992% 31/1/2172	643,150	0.01
EUR 767,000	Casino Guichard Perrachon 5.25% 15/4/2027	468,876	0.01
EUR 700,000	Casino Guichard Perrachon 6.625% 15/1/2026	446,216	0.00
EUR 759,000	Chrome Bidco 3.5% 31/5/2028*	660,551	0.01
EUR 2,500,000	Credit Agricole 1% 22/4/2026	2,477,434	0.03
EUR 3,000,000	Credit Agricole 4% 18/1/2033	3,151,768	0.04
EUR 2,500,000	Credit Agricole 4% 23/12/2171*	2,314,023	0.03
GBP 5,500,000	Credit Agricole 4.875% 23/10/2029	6,529,401	0.08
EUR 400,000	Credit Agricole 7.25% 23/9/2028*	430,652	0.01
EUR 8,202,000	d' Infrastructures des Metiers de l' Environnement 0.625% 16/9/2028	6,992,867	0.09
EUR 1,600,000	Electricite de France 2.875% 15/3/2171*	1,444,511	0.02
EUR 200,000	Electricite de France 3% 3/12/2171	175,086	0.00
EUR 1,800,000	Electricite de France 3.375% 15/9/2171	1,474,295	0.02
EUR 2,100,000	Electricite de France 4% 4/10/2171	2,146,663	0.03
EUR 2,700,000	Electricite de France 4.25% 25/1/2032*	2,794,086	0.03
EUR 1,400,000	Electricite de France 4.625% 25/1/2043	1,395,904	0.02
EUR 400,000	Electricite de France 5% 22/1/2172	397,826	0.00
EUR 3,000,000	Electricite de France 5.375% 29/1/2172*	3,085,808	0.04
GBP 2,600,000	Electricite de France 6% 29/7/2171	2,913,906	0.04
EUR 1,800,000	Electricite de France 7.5% 9/6/2028*	1,919,455	0.02
EUR 1,864,000	Faurecia 2.75% 15/2/2027	1,745,748	0.02
EUR 900,000	Faurecia 3.125% 15/6/2026	887,688	0.01
EUR 1,303,000	Faurecia 3.75% 15/6/2028	1,216,741	0.02
EUR 1,125,000	Faurecia 7.25% 15/6/2026	1,230,324	0.02
EUR 113,350	FCT Autonoria 2019 3.603% 25/9/2035	119,869	0.00
EUR 68,113	FCT Autonoria 2019 4.003% 25/9/2035	71,155	0.00
EUR 135,816	FCT Autonoria 2019 5.103% 25/9/2035	142,435	0.00
EUR 113,350	FCT Autonoria 2019 6.103% 25/9/2035	117,514	0.00
EUR 27,579	FCT E-Carat 10 3.906% 20/12/2028	29,288	0.00
EUR 41,368	FCT E-Carat 10 4.756% 20/12/2028	43,813	0.00
EUR 209,164	FCT Noria 2018-1 3.514% 25/6/2038	220,757	0.00
EUR 209,164	FCT Noria 2018-1 4.664% 25/6/2038	218,330	0.00
EUR 222,296	FCT Noria 2021 3.103% 25/10/2049	233,598	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 (%)
フランス(続き)			
EUR 222,296	FCT Noria 2021 3.503% 25/10/2049	231,404	0.00
EUR 666,887	FCT Noria 2021 3.903% 25/10/2049	686,709	0.01
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 4.443% 25/2/2038	307,888	0.01
EUR 2,664,000	Goldstory 5.375% 1/3/2026*	2,653,231	0.03
EUR 675,000	Goldstory 8.216% 1/3/2026	711,072	0.01
EUR 300,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 3.643% 27/5/2061	310,359	0.01
EUR 400,000	iliad 1.5% 14/10/2024	406,552	0.01
EUR 300,000	iliad 2.375% 17/6/2026	288,048	0.00
EUR 1,100,000	iliad 5.375% 14/6/2027	1,144,158	0.02
EUR 2,000,000	iliad 5.625% 15/2/2030	2,057,960	0.03
EUR 920,000	Iliad 5.125% 15/10/2026	923,718	0.01
EUR 300,000	Iliad 5.625% 15/10/2028	293,409	0.00
EUR 12,306	Korian 0.875% 6/3/2027	571,730	0.01
GBP 1,800,000	Korian 4.125% 15/6/2171	1,720,703	0.02
EUR 700,000	La Financiere Atalian 4% 15/5/2024	642,728	0.01
EUR 1,066,000	La Financiere Atalian 5.125% 15/5/2025	753,693	0.01
GBP 1,640,000	La Financiere Atalian 6.625% 15/5/2025	1,329,225	0.02
EUR 1,900,000	La Poste 3.125% 29/1/2172*	1,874,716	0.02
EUR 528,000	Loxam 3.25% 14/1/2025	534,532	0.01
EUR 2,957,000	Loxam 3.75% 15/7/2026*	2,899,470	0.04
EUR 300,000	Loxam 4.25% 15/4/2024*	318,706	0.00
EUR 1,306,000	Loxam 4.5% 15/2/2027*	1,286,078	0.02
EUR 400,000	Loxam 4.5% 15/4/2027	368,786	0.00
EUR 200,000	Loxam 5.75% 15/7/2027*	189,365	0.00
EUR 400,000	Novafives 5% 15/6/2025*	349,861	0.01
EUR 1,800,000	Orano 2.75% 8/3/2028*	1,744,123	0.02
EUR 1,070,000	Paprec 3.5% 1/7/2028	975,151	0.01
EUR 2,135,000	Picard Groupe 3.875% 1/7/2026	2,049,314	0.03
EUR 300,000	Quatrim 5.875% 15/1/2024*	299,336	0.00
EUR 3,900,000	RCI Banque 2.625% 18/2/2030	3,826,944	0.05
EUR 850,000	RCI Banque 4.625% 13/7/2026	902,911	0.01
EUR 500,000	Renault 2.375% 25/5/2026	488,094	0.01
GBP 1,000,000	Societe Generale 1.875% 3/10/2024	1,150,795	0.01
EUR 6,500,000	Societe Generale 4.25% 6/12/2030	6,677,274	0.09
EUR 3,400,000	Societe Generale 4.25% 16/11/2032*	3,605,114	0.05
USD 1,600,000	Societe Generale 7.375% 4/4/2171*	1,581,112	0.02
EUR 1,900,000	Societe Generale 7.875% 18/1/2029	2,054,366	0.03
USD 1,800,000	Societe Generale 7.875% 18/6/2171	1,795,428	0.02
USD 800,000	Societe Generale 8% 29/3/2171	796,443	0.01
USD 960,000	Societe Generale 9.375% 22/11/2027	1,015,200	0.01
EUR 1,300,000	Solvay Finance 5.425% 12/11/2171	1,388,189	0.02
EUR 1,451,000	Solvay Finance 5.869% 3/6/2171	1,555,853	0.02
EUR 2,700,000	Suez 2.875% 19/4/2171	2,810,255	0.04
EUR 375,000	Tereos Finance Groupe I 7.25% 15/4/2028	398,335	0.00
EUR 7,572,000	TotalEnergies 1.75% 4/4/2171	7,732,715	0.10
EUR 1,243,000	TotalEnergies 2% 17/4/2171	1,144,114	0.01
EUR 700,000	TotalEnergies 2% 4/9/2171	572,914	0.01
EUR 3,727,000	TotalEnergies 2.625% 26/2/2172	3,740,957	0.05
GBP 1,000,000	TotalEnergies Capital International 1.66% 22/7/2026	1,099,727	0.01
EUR 600,000	Unibail-Rodamco-Westfield 2.125% 25/7/2023	584,421	0.01
EUR 1,264,000	Vallourec 8.5% 30/6/2026*	1,358,102	0.02
		167,579,569	2.16

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	ドイツ		
EUR 200,000	ADLER Real Estate 1.875% 27/4/2023	203,604	0.00
USD 3,800,000	Allianz 3.2% 30/4/2171*	2,866,508	0.04
EUR 900,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	890,122	0.01
EUR 11,000,000	Bayer 2.375% 12/11/2079	10,806,278	0.14
EUR 750,000	Bayer 3.75% 1/7/2074	774,984	0.01
EUR 5,100,000	Bayer 4.5% 25/3/2082*	5,063,591	0.07
EUR 17,920,000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.7% 15/8/2032*	17,601,188	0.23
EUR 2,458,000	Cheplapharm Arzneimittel 3.5% 11/2/2027*	2,324,943	0.03
EUR 2,732,000	Cheplapharm Arzneimittel 4.375% 15/1/2028	2,578,386	0.03
EUR 800,000	Commerzbank 5.125% 18/1/2030	848,185	0.01
EUR 4,000,000	Commerzbank 6.125% 9/4/2171	4,023,996	0.05
EUR 3,100,000	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate 1.875% 15/10/2024	2,455,143	0.03
EUR 6,900,000	Deutsche Bahn Finance 0.95% 22/4/2171*	6,699,948	0.09
EUR 5,000,000	Deutsche Bank 1.75% 19/11/2030	4,224,580	0.05
EUR 3,700,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	3,475,230	0.05
GBP 1,000,000	Deutsche Bank 2.625% 16/12/2024	1,142,916	0.02
EUR 2,700,000	Deutsche Bank 3.25% 24/5/2028	2,666,299	0.03
USD 1,275,000	Deutsche Bank 3.547% 18/9/2031	1,060,581	0.01
GBP 1,000,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2026	1,154,010	0.02
EUR 2,000,000	Deutsche Bank 4% 24/6/2032	1,917,753	0.03
EUR 2,200,000	Deutsche Bank 4.5% 30/4/2171	1,902,308	0.02
EUR 1,100,000	Deutsche Bank 5% 5/9/2030	1,136,787	0.01
USD 841,000	Deutsche Bank 6.72% 18/1/2029	848,040	0.01
EUR 200,000	Deutsche Bank 6.75% 30/4/2171	193,935	0.00
EUR 11,900,641	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond 0.1% 15/4/2026*	15,258,942	0.19
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 1.625% 16/11/2023	521,154	0.01
EUR 800,000	Deutsche Lufthansa 2.875% 16/5/2027	757,724	0.01
EUR 800,000	Deutsche Lufthansa 3.5% 14/7/2029	738,360	0.01
EUR 500,000	Deutsche Lufthansa 3.75% 11/2/2028	481,946	0.01
EUR 900,000	DIC Asset 2.25% 22/9/2026	683,039	0.01
EUR 3,200,000	E.ON 3.5% 26/10/2037	3,133,623	0.04
EUR 700,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 1.125% 5/11/2079	694,288	0.01
EUR 6,400,000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg 2.125% 31/8/208	4,818,833	0.06
EUR 100,000	FCT Autonomia DE 2023 0% 26/1/2043	106,504	0.00
EUR 300,000	FCT Autonomia DE 2023 0% 26/1/2043	319,510	0.00
EUR 400,000	FCT Autonomia DE 2023 0% 26/1/2043	426,014	0.01
EUR 100,000	FCT Autonomia DE 2023 0% 26/1/2043	106,504	0.00
EUR 4,700,000	Fresenius 2.875% 24/5/2030*	4,405,238	0.06
EUR 2,700,000	Fresenius 4.25% 28/5/2026	2,849,400	0.04
EUR 700,000	Fresenius 5% 28/11/2029	743,350	0.01
EUR 1,860,000	Gruenthal 3.625% 15/11/2026*	1,810,616	0.02
EUR 1,856,000	Gruenthal 4.125% 15/5/2028*	1,732,323	0.02
EUR 1,236,000	HT Troplast 9.25% 15/7/2025	1,276,901	0.02
EUR 779,000	IHO Verwaltungs 3.75% 15/9/2026	758,383	0.01
EUR 969,715	IHO Verwaltungs 3.875% 15/5/2027*	916,856	0.01
USD 200,000	IHO Verwaltungs 6% 15/5/2027	186,236	0.00
EUR 2,568,000	LANXESS 4.5% 6/12/2076*	2,716,885	0.04
EUR 342,000	Nidda Healthcare 3.5% 30/9/2024*	355,747	0.01
EUR 2,440,000	Nidda Healthcare 7.5% 21/8/2026*	2,543,972	0.03
EUR 1,144,000	PCF 4.75% 15/4/2026*	1,045,694	0.01
EUR 1,156,000	PCF 7.038% 15/4/2026*	1,155,760	0.01
EUR 2,200,000	ProGroup 3% 31/3/2026*	2,138,629	0.03
EUR 193,281	Red & Black Auto Germany 8 UG 3.152% 15/9/2030	204,420	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ドイツ(続き)			
EUR 386,561	Red & Black Auto Germany 8 UG 3.352% 15/9/2030	403,132	0.01
EUR 96,640	Red & Black Auto Germany 8 UG 3.752% 15/9/2030	99,368	0.00
EUR 2,239,000	Renk 5.75% 15/7/2025	2,347,578	0.03
EUR 1,003,000	RWE 1% 26/11/2033	762,651	0.01
EUR 2,100,000	RWE 2.5% 24/8/2025	2,165,983	0.03
EUR 2,550,000	RWE 2.75% 24/5/2030	2,474,796	0.03
EUR 1,383,000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2% 15/7/2025	1,360,286	0.02
EUR 1,851,591	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 6% 30/7/2026	1,900,632	0.02
EUR 1,166,000	Tele Columbus 3.875% 2/5/2025*	1,007,777	0.01
EUR 952,000	thyssenkrupp 1.875% 6/3/2023*	1,009,786	0.01
EUR 2,719,000	TK Elevator Midco 4.375% 15/7/2027	2,633,794	0.03
EUR 1,652,000	TK Elevator Midco 7.038% 15/7/2027*	1,753,120	0.02
EUR 1,300,000	Vantage Towers 0% 31/3/2025	1,336,263	0.02
EUR 6,300,000	Vantage Towers 0.375% 31/3/2027*	6,312,350	0.08
EUR 7,700,000	Vantage Towers 0.75% 31/3/2030*	7,546,850	0.10
EUR 2,100,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	2,103,713	0.03
EUR 2,100,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028*	1,879,369	0.02
EUR 1,605,000	Volkswagen Leasing 0% 19/7/2024*	1,615,659	0.02
EUR 4,211,000	Volkswagen Leasing 0.625% 19/7/2029*	3,505,962	0.05
EUR 1,600,000	ZF Finance 2% 6/5/2027	1,465,709	0.02
EUR 400,000	ZF Finance 2.25% 3/5/2028	355,790	0.00
EUR 800,000	ZF Finance 2.75% 25/5/2027	754,745	0.01
EUR 2,200,000	ZF Finance 3% 21/9/2025*	2,208,248	0.03
EUR 100,000	ZF Finance 3.75% 21/9/2028	94,501	0.00
EUR 2,400,000	ZF Finance 5.75% 3/8/2026	2,571,209	0.03
		179,415,437	2.30
ガーナ			
USD 1,489,000	Ghana Government International Bond 7.625% 16/5/2029	565,820	0.01
ギリシャ			
EUR 2,820,000	Hellenic Republic Government Bond 0% 12/2/2026	2,687,114	0.03
EUR 430,000	Hellenic Republic Government Bond 1.75% 18/6/2032	366,573	0.01
EUR 1,443,000	Hellenic Republic Government Bond 4.25% 15/6/2033	1,518,050	0.02
		4,571,737	0.06
グアテマラ			
USD 1,772,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	1,454,759	0.02
USD 1,066,000	Guatemala Government Bond 4.5% 3/5/2026	1,025,209	0.01
USD 876,000	Guatemala Government Bond 4.65% 7/10/2041	708,807	0.01
USD 971,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	933,056	0.01
USD 1,280,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	1,229,981	0.02
		5,351,812	0.07
ガンジー			
USD 56,516	Doric Nimrod Air Alpha 2013-1 Class A Pass Through Trust 5.25% 30/5/2025	56,248	0.00
香港			
USD 402,000	Bank of East Asia 5.875% 19/3/2171	385,362	0.00
USD 200,000	Hong Kong Government International Bond 4.5% 11/1/2028	200,406	0.00
USD 941,000	Yango Justice International 7.5% 15/4/2024	30,583	0.00
USD 680,000	Yango Justice International 7.5% 17/2/2025	22,100	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
香港(続き)			
USD 490,000	Yango Justice International 7.875% 4/9/2024	15,925	0.00
		654,376	0.00
ハンガリー			
USD 1,971,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029	1,927,884	0.03
USD 330,000	Hungary Government International Bond 5.375% 25/3/2024	329,426	0.00
USD 653,000	Hungary Government International Bond 6.75% 25/9/2052	673,406	0.01
		2,930,716	0.04
インド			
USD 375,000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 2/2/2026	351,873	0.00
USD 400,000	Oil India 5.125% 4/2/2029	382,538	0.01
USD 400,000	Power Finance 4.5% 18/6/2029	364,111	0.00
		1,098,522	0.01
インドネシア			
USD 300,000	Bank Negara Indonesia Persero 3.75% 30/3/2026	277,500	0.00
USD 1,360,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027*	1,309,160	0.02
USD 1,988,000	Freeport Indonesia 4.763% 14/4/2027	1,915,848	0.02
USD 3,992,000	Indonesia Government International Bond 4.1% 24/4/2028	3,855,892	0.05
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.55% 11/1/2028	196,375	0.00
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 4.85% 11/1/2033	196,250	0.00
USD 200,000	Indonesia Government International Bond 5.65% 11/1/2053	203,500	0.00
IDR 123,815,000,000	Indonesia Treasury Bond 6.375% 15/4/2032	7,889,288	0.10
IDR 113,046,000,000	Indonesia Treasury Bond 7% 15/2/2033	7,477,566	0.10
IDR 43,543,000,000	Indonesia Treasury Bond 7.125% 15/6/2038	2,857,806	0.04
IDR 20,182,000,000	Indonesia Treasury Bond 8.25% 15/5/2036	1,460,838	0.02
USD 2,068,000	Pertamina Persero 3.65% 30/7/2029	1,892,470	0.03
USD 600,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 3.8% 23/6/2050	469,500	0.01
USD 1,032,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 4.4% 6/6/2027	1,013,940	0.01
		31,015,933	0.40
国際機関(International)			
EUR 5,807,200	European Union 3% 4/3/2053	5,547,485	0.07
EUR 7,126,000	European Union 3.375% 4/11/2042	7,349,353	0.10
		12,896,838	0.17
アイルランド			
GBP 899,664	Agora UK 2021 5.052% 22/7/2031	1,041,186	0.01
EUR 600,000	AIB 4.625% 23/7/2029	621,741	0.01
EUR 1,200,000	AIB 5.25% 9/4/2171	1,186,137	0.01
EUR 5,149,000	AIB 6.25% 23/12/2171	5,192,212	0.07
EUR 800,000	AlbaCore EURO CLO I 8.288% 18/10/2034	717,210	0.01
EUR 2,680,000	Alme Loan Funding V 7.698% 15/7/2031	2,611,721	0.03
EUR 838,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 3.888% 15/4/2034	851,714	0.01
EUR 180,000	Anchorage Capital Europe CLO 2 8.738% 15/4/2034	175,262	0.00
EUR 200,000	Anchorage Capital Europe CLO 2021-4 8.159% 25/4/2034	185,932	0.00
EUR 1,000,000	Aqueduct European CLO 5-2020 4.342% 20/4/2034	983,253	0.01
EUR 1,023,000	Aqueduct European Clo 7-2022 5.247% 15/3/2036	1,090,875	0.01
EUR 1,200,000	Ares European CLO VII 3.788% 15/10/2030	1,232,775	0.02
EUR 2,150,000	Ares European CLO X 5.088% 15/10/2031	2,121,135	0.03
EUR 858,000	Ares European CLO XII 4.042% 20/4/2032	883,005	0.01
EUR 875,000	Ares European CLO XII 5.342% 20/4/2032	863,768	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 2,100,000	Armada Euro CLO III 5.588% 15/7/2031	2,094,433	0.03
USD 3,778,000	ASG Finance Designated Activity 7.875% 3/12/2024	3,667,305	0.05
GBP 1,541,946	Atom Mortgage 5.752% 22/7/2031	1,689,067	0.02
EUR 300,000	Aurium CLO II 8.161% 22/6/2034	284,550	0.00
EUR 499,536	Aurium CLO IV 3.018% 16/1/2031	524,071	0.01
EUR 550,000	Avoca CLO XIV 0% 12/1/2031	244,078	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 6.984% 12/1/2031	142,750	0.00
EUR 150,000	Avoca CLO XIV 8.634% 12/1/2031	136,346	0.00
EUR 380,000	Avoca CLO XV 6.418% 15/4/2031	340,109	0.00
EUR 350,000	Avoca CLO XVIII 4.038% 15/4/2031	353,554	0.01
EUR 290,000	Avoca CLO XXII 3.588% 15/4/2035	290,050	0.00
EUR 1,000,000	Avoca CLO XXIII 5.338% 15/4/2034	982,083	0.01
EUR 175,000	Bank of Ireland 4.875% 16/7/2028	185,827	0.00
EUR 300,000	BBAM European CLO I 8.303% 22/7/2034	281,812	0.00
EUR 800,000	BBAM European CLO II 8.398% 15/10/2034	744,870	0.01
EUR 800,000	Bilbao CLO II 8.673% 20/8/2035	746,340	0.01
EUR 300,000	BlueMountain 2021-1 CLO 7.698% 15/4/2034	275,516	0.00
EUR 250,000	Bluemountain Euro 2021-2 CLO 4.038% 15/10/2035	251,924	0.00
EUR 900,000	BlueMountain Fuji CLO III 5.188% 15/1/2031	882,411	0.01
EUR 800,000	BlueMountain Fuji CLO IV 8.073% 25/2/2034	756,686	0.01
EUR 2,300,000	Bridgepoint CLO IV 5.081% 20/1/2037	2,468,596	0.03
EUR 800,000	Cairn CLO XIV 8.578% 29/10/2034	755,012	0.01
EUR 300,000	Capital Four CLO II 8.198% 15/1/2034	283,122	0.00
EUR 582,000	Capital Four CLO III 8.348% 15/10/2034	541,649	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO I 8.148% 15/7/2032	385,407	0.01
EUR 400,000	CIFC European Funding CLO II 3.888% 15/4/2033	405,454	0.01
EUR 500,000	CIFC European Funding CLO III 4.788% 15/1/2034	507,576	0.01
EUR 200,000	CIFC European Funding CLO III 7.898% 15/1/2034	187,343	0.00
EUR 1,580,000	Clontarf Park CLO 5.59% 5/8/2030	1,636,141	0.02
EUR 539,000	Contego CLO IX 8.427% 24/1/2034	501,693	0.01
EUR 2,400,000	Contego CLO VI 3.078% 15/4/2034	2,483,551	0.03
EUR 800,000	Contego CLO VIII 8.509% 25/1/2034	746,145	0.01
EUR 1,750,000	CVC Cordatus Loan Fund 0% 20/5/2036	1,861,484	0.02
EUR 330,000	CVC Cordatus Loan Fund IV 3.967% 22/2/2034	331,155	0.00
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund V 3.893% 21/7/2030	413,288	0.01
EUR 400,000	CVC Cordatus Loan Fund XIX 5.902% 23/12/2033	399,078	0.01
EUR 158,000	CVC Cordatus Loan Fund XX 7.691% 22/6/2034	145,747	0.00
EUR 250,000	Euro-Galaxy III CLO 4.767% 24/4/2034	250,742	0.00
EUR 510,000	Euro-Galaxy III CLO 5.667% 24/4/2034	512,311	0.01
EUR 593,000	Fair Oaks Loan Funding III 8.398% 15/10/2034	569,626	0.01
EUR 1,510,000	Fidelity Grand Harbour CLO 2021-1 5.888% 15/10/2034	1,438,428	0.02
GBP 459,099	Frost CMBS 2021-1 5.296% 20/11/2033	547,638	0.01
EUR 731,000	GE Capital European Funding Unlimited 6.025% 1/3/2038	915,999	0.01
EUR 550,000	Glencore Capital Finance 1.25% 1/3/2033	409,705	0.01
EUR 700,000	Harvest CLO XVIII 3.488% 15/10/2030	711,243	0.01
EUR 390,000	Harvest CLO XXIII 5.342% 20/10/2032	383,157	0.01
EUR 714,793	Haus European Loan Conduit No 39 3.118% 28/7/2051	722,803	0.01
EUR 210,939	Haus European Loan Conduit No 39 3.568% 28/7/2051	201,637	0.00
EUR 840,757	Haus European Loan Conduit No 39 3.868% 28/7/2051	769,245	0.01
EUR 130,000	Henley CLO IV 3.799% 25/4/2034	130,911	0.00
EUR 250,000	Henley CLO IV 5.449% 25/4/2034	249,570	0.00
EUR 300,000	Henley CLO IV 7.699% 25/4/2034	273,783	0.00
EUR 450,000	Invesco Euro Clo III 4.038% 15/7/2032	454,757	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 212,892	Invesco Euro Clo III 10.358% 15/7/2032	197,168	0.00
EUR 625,000	Invesco Euro CLO IV 3.988% 15/4/2033	633,602	0.01
EUR 565,921	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 3.432% 17/8/2033	579,358	0.01
EUR 344,631	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 3.732% 17/8/2033	343,134	0.00
EUR 1,331,397	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.082% 17/8/2033	1,314,246	0.02
EUR 1,030,949	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.582% 17/8/2033	991,187	0.01
EUR 938,803	Last Mile PE 2021 3.882% 17/8/2031	943,501	0.01
EUR 1,060,777	Last Mile PE 2021 4.282% 17/8/2031	1,048,880	0.01
EUR 1,250,000	Madison Park Euro Funding XVI 5.488% 25/5/2034	1,226,983	0.02
EUR 1,050,000	Man GLG Euro CLO 5.788% 15/10/2032	1,034,122	0.01
EUR 150,000	Marino Park CLO 7.958% 16/1/2034	142,665	0.00
EUR 188,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 7.808% 17/4/2034	174,767	0.00
EUR 699,000	Neuberger Berman Loan Advisers Euro CLO 2 8.348% 15/4/2034	658,674	0.01
EUR 120,000	North Westerly VII ESG CLO 8.314% 15/5/2034	110,986	0.00
EUR 250,000	Northwoods Capital 19 Euro 4.398% 25/11/2033	254,544	0.00
EUR 300,000	Northwoods Capital 21 Euro 8.453% 22/7/2034	281,941	0.00
EUR 200,000	Northwoods Capital 23 Euro 8.256% 15/3/2034	184,783	0.00
EUR 425,000	OAK Hill European Credit Partners V Designated Activity 4.293% 21/1/2035	431,622	0.01
EUR 450,000	OAK Hill European Credit Partners VI 3.542% 20/1/2032	459,817	0.01
EUR 800,000	OCP Euro CLO 2017-2 3.638% 15/1/2032	825,449	0.01
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 4.642% 20/4/2033	251,477	0.00
EUR 250,000	OCP Euro CLO 2019-3 5.642% 20/4/2033	250,862	0.00
EUR 200,000	OCP Euro CLO 2019-3 8.362% 20/4/2033	190,386	0.00
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 4.582% 17/11/2032	1,155,718	0.01
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 5.182% 17/11/2032	1,392,024	0.02
EUR 650,000	Penta CLO 11 5.104% 15/11/2034	668,618	0.01
EUR 470,000	Penta CLO 11 7.454% 15/11/2034	486,757	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 4.149% 25/7/2034	506,748	0.01
EUR 500,000	Penta CLO 6 4.749% 25/7/2034	497,862	0.01
USD 1,618,528	Prodigy Finance CM2021-1 5.867% 25/7/2051	1,566,018	0.02
USD 882,709	Prodigy Finance CM2021-1 7.117% 25/7/2051	908,516	0.01
USD 710,000	Prodigy Finance CM2021-1 8.367% 25/7/2051	704,096	0.01
USD 480,000	Prodigy Finance CM2021-1 10.517% 25/7/2051	482,609	0.01
EUR 400,000	Providus Clo III 8.588% 18/7/2034	380,221	0.01
EUR 800,000	Providus Clo VI 8.813% 20/5/2034	751,177	0.01
EUR 441,350	River Green Finance 2020 3.443% 22/1/2032	446,392	0.01
EUR 320,100	River Green Finance 2020 3.793% 22/1/2032	323,706	0.00
EUR 409,000	Rockfield Park CLO 8.238% 16/7/2034	387,072	0.01
EUR 2,657,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 3.897% 20/12/2031	2,744,451	0.04
EUR 710,000	Rockford Tower Europe CLO 2018-1 4.517% 20/12/2031	722,125	0.01
EUR 2,480,000	Rockford Tower Europe CLO 2019-1 3.942% 20/1/2033	2,544,523	0.03
EUR 976,000	RRE 5 Loan Management 4.038% 15/1/2037	981,502	0.01
EUR 430,000	RRE 9 Loan Management 3.988% 15/10/2036	435,411	0.01
GBP 2,746,094	Scorpio European Loan Conduit No. 34 6.165% 17/5/2029	3,264,387	0.04
USD 865,000	Shire Acquisitions Investments Ireland 2.875% 23/9/2023	852,510	0.01
EUR 250,000	Sound Point Euro CLO III Funding 4.588% 15/4/2033	248,585	0.00
EUR 300,000	Sound Point Euro CLO V Funding 8.289% 25/7/2035	278,217	0.00
EUR 1,350,000	St Paul' s CLO XII 3.888% 15/4/2033	1,381,809	0.02
EUR 650,000	Sutton Park CLO 4.354% 15/11/2031	671,044	0.01
EUR 750,000	Sutton Park CLO 5.004% 15/11/2031	761,850	0.01
EUR 352,637	Taurus 2019-1 FR 3.962% 2/2/2031	365,801	0.00
EUR 377,168	Taurus 2019-1 FR 4.462% 2/2/2031	390,025	0.01
GBP 3,206,283	Taurus 2019-2 UK 5.865% 17/11/2029	3,834,044	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
アイルランド(続き)			
GBP 1,887,447	Taurus 2019-2 UK 6.165% 17/11/2029	2,240,391	0.03
GBP 879,540	Taurus 2021-1 UK 5.245% 17/5/2031	1,015,912	0.01
GBP 536,063	Taurus 2021-1 UK 5.595% 17/5/2031	608,277	0.01
GBP 546,982	Taurus 2021-1 UK 6.545% 17/5/2031	618,518	0.01
GBP 545,490	Taurus 2021-4 UK 4.895% 17/8/2031	647,710	0.01
GBP 5,215,070	Taurus 2021-4 UK 5.695% 17/8/2031	5,907,243	0.08
GBP 1,729,127	Taurus 2021-4 UK 6.045% 17/8/2031	1,946,127	0.03
EUR 2,300,000	Tikehau CLO VII 3.61% 20/10/2035	2,460,742	0.03
GBP 557,000	Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.875% 15/7/2028*	571,286	0.01
EUR 250,000	Voya Euro CLO II 3.958% 15/7/2035	252,842	0.00
EUR 500,000	Voya Euro CLO II 4.438% 15/7/2035	500,629	0.01
EUR 446,000	Voya Euro CLO II 8.308% 15/7/2035	417,609	0.01
EUR 439,000	Voya Euro CLO III 3.938% 15/4/2033	447,247	0.01
		117,524,209	1.52
マン島			
USD 2,760,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	2,357,827	0.03
イスラエル			
USD 843,000	Bank Leumi Le-Israel 7.129% 18/7/2033	846,806	0.01
USD 824,000	Leviathan Bond 5.75% 30/6/2023	820,910	0.01
		1,667,716	0.02
イタリア			
EUR 1,933,000	A2A 4.5% 19/9/2030	2,069,980	0.03
EUR 675,000	ASTM 1.5% 25/1/2030	566,438	0.01
EUR 500,000	ASTM 2.375% 25/11/2033	401,615	0.00
EUR 289,679	Autoflorence 2 3.146% 24/12/2044	300,232	0.01
EUR 373,604	Autoflorence 2 3.546% 24/12/2044	379,504	0.01
EUR 200,339	Autoflorence 2 4.746% 24/12/2044	205,314	0.00
EUR 7,389,000	Azzurra Aeroporti 2.125% 30/5/2024	7,619,011	0.10
EUR 1,127,000	Azzurra Aeroporti 2.625% 30/5/2027	1,048,856	0.01
EUR 1,600,000	Banco BPM 2.875% 29/6/2031	1,493,442	0.02
EUR 971,000	Banco BPM 3.25% 14/1/2031*	945,065	0.01
EUR 2,555,000	Banco BPM 3.375% 19/1/2032*	2,388,237	0.03
EUR 294,000	Banco BPM 5% 14/9/2030*	308,129	0.00
EUR 137,000	Brignole 2021 2.799% 24/7/2036	143,199	0.00
EUR 100,000	Brignole 2021 3.599% 24/7/2036	102,646	0.00
EUR 5,978,852	Cassia 2022-1 5.154% 22/5/2034	6,095,804	0.08
EUR 2,857,839	Cassia 2022-1 6.154% 22/5/2034	2,751,107	0.03
EUR 700,000	Castor 7.296% 15/2/2029	728,078	0.01
EUR 602,000	Cedacri Mergeco 7.279% 15/5/2028*	623,929	0.01
EUR 2,212,000	Centurion Bidco 5.875% 30/9/2026	2,124,294	0.03
EUR 949,000	doValue 3.375% 31/7/2026	923,218	0.01
EUR 1,000,000	Enel 1.875% 6/8/2030	767,073	0.01
EUR 1,125,000	Enel 6.375% 16/4/2028	1,198,164	0.01
EUR 1,905,000	Eni 0.375% 14/6/2028	1,676,051	0.02
EUR 5,323,000	Eni 2% 11/5/2171	4,783,060	0.06
EUR 7,100,000	Eni 2.625% 13/1/2172	6,960,867	0.09
EUR 1,900,000	FCA Bank 0% 16/4/2024	1,928,457	0.02
EUR 600,000	Fiber Bidco 11% 25/10/2027	684,239	0.01
EUR 300,000	FIS Fabbrica Italiana Sintetici 5.625% 1/8/2027	279,649	0.00
EUR 700,000	Gamma Bidco 5.125% 15/7/2025*	745,193	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 (%)
イタリア(続き)			
EUR 300,000	Gamma Bidco 6.25% 15/7/2025	321,315	0.00
EUR 454,000	IMA Industria Macchine Automatiche 3.75% 15/1/2028	420,079	0.01
EUR 531,000	Inter Media and Communication 6.75% 9/2/2027	533,883	0.01
GBP 759,000	Intesa Sanpaolo 2.5% 15/1/2030	734,617	0.01
GBP 2,900,000	Intesa Sanpaolo 5.148% 10/6/2030*	2,948,999	0.04
EUR 500,000	Intesa Sanpaolo 5.5% 1/3/2172	454,335	0.01
EUR 400,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 4/3/2029	429,205	0.01
EUR 1,773,000	Intesa Sanpaolo 5.875% 20/6/2171	1,776,328	0.02
EUR 2,527,000	Intesa Sanpaolo 7.75% 11/7/2171*	2,669,502	0.04
EUR 886,000	Koromo Italy 0% 26/2/2035	943,620	0.01
EUR 300,000	Lottomatica 9.75% 30/9/2027	342,590	0.01
EUR 3,400,000	Nexi 0% 24/2/2028	2,657,679	0.04
EUR 925,000	Poste Italiane 2.625% 24/6/2171*	758,854	0.01
EUR 252,216	Progetto Quinto 2.664% 27/10/2036	266,686	0.00
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 5.279% 28/12/2031	607,418	0.01
EUR 2,681,000	Rekeep 7.25% 1/2/2026	2,468,769	0.03
EUR 1,132,000	TeamSystem 6.038% 15/2/2028*	1,169,387	0.01
EUR 2,306,000	Telecom Italia 1.625% 18/1/2029	1,863,409	0.02
EUR 469,000	Telecom Italia 2.375% 12/10/2027	423,552	0.01
EUR 699,000	Telecom Italia 2.75% 15/4/2025	708,093	0.01
EUR 400,000	Telecom Italia 2.875% 28/1/2026	393,903	0.01
EUR 200,000	Telecom Italia 3% 30/9/2025	202,391	0.00
EUR 1,254,000	Telecom Italia 4% 11/4/2024	1,319,527	0.02
EUR 889,000	Telecom Italia 6.875% 15/2/2028	957,884	0.01
EUR 900,000	UniCredit 2.731% 15/1/2032	823,308	0.01
EUR 1,625,000	UniCredit 4.45% 16/2/2029	1,661,920	0.02
EUR 5,675,000	UniCredit 4.8% 17/1/2029*	6,017,299	0.08
EUR 300,000	UniCredit 4.875% 20/2/2029	316,399	0.00
EUR 1,200,000	UniCredit 5.375% 3/6/2171*	1,193,477	0.02
EUR 2,200,000	UniCredit 6.625% 3/12/2171	2,331,375	0.03
USD 1,900,000	UniCredit 7.296% 2/4/2034	1,802,588	0.02
EUR 1,600,000	UniCredit 7.5% 3/6/2171*	1,675,122	0.02
		91,434,364	1.18
ジャマイカ			
USD 553,557	Digicel International Finance/Digicel international 8% 31/12/2026	247,820	0.00
USD 1,386,646	Digicel International Finance/Digicel international 8.75% 25/5/2024	1,207,838	0.02
USD 843,566	Digicel International Finance/Digicel international 13% 31/12/2025	428,268	0.01
		1,883,926	0.03
日本			
EUR 4,760,000	East Japan Railway 2.614% 8/9/2025*	4,909,844	0.06
USD 3,000,000	Mizuho Financial 3.261% 22/5/2030*	2,629,901	0.03
EUR 820,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026*	817,592	0.01
EUR 1,280,000	Nissan Motor 3.201% 17/9/2028	1,213,066	0.02
USD 2,205,000	Nomura 5.099% 3/7/2025*	2,185,807	0.03
USD 905,000	Rakuten 10.25% 30/11/2024	908,349	0.01
EUR 2,288,000	SoftBank 2.125% 6/7/2024	2,294,120	0.03
EUR 1,100,000	SoftBank 3.125% 19/9/2025	1,073,977	0.01
EUR 400,000	SoftBank 4.5% 20/4/2025*	407,276	0.01
USD 300,000	SoftBank 4.75% 19/9/2024*	287,625	0.00
EUR 1,281,000	SoftBank 4.75% 30/7/2025*	1,304,661	0.02
USD 300,000	SoftBank 6% 30/7/2025	289,875	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
日本(続き)			
USD 1,400,000	SoftBank 6% 19/1/2172*	1,366,716	0.02
USD 2,487,000	Sumitomo Mitsui Financial 2.472% 14/1/2029	2,107,193	0.03
USD 4,085,000	Takeda Pharmaceutical 2.05% 31/3/2030	3,321,572	0.04
USD 2,600,000	Takeda Pharmaceutical 5% 26/11/2028	2,562,578	0.04
		27,680,152	0.36
ジャージー			
GBP 700,000	AA Bond 4.875% 31/7/2043	830,090	0.01
EUR 1,000,000	Adient Global 3.5% 15/8/2024	1,041,447	0.01
USD 1,500,000	Aptiv / Aptiv 3.25% 1/3/2032	1,247,693	0.02
EUR 499,000	Avis Budget Finance 4.5% 15/5/2025	522,514	0.01
EUR 261,000	Avis Budget Finance 4.75% 30/1/2026	269,959	0.00
GBP 392,000	CPUK Finance 4.5% 28/8/2027	410,948	0.00
GBP 457,000	CPUK Finance 4.875% 28/2/2047	533,472	0.01
GBP 400,000	CPUK Finance 6.5% 28/8/2026	463,486	0.01
GBP 4,951,000	Galaxy Bidco 6.5% 31/7/2026	5,514,192	0.07
GBP 3,105,000	Heathrow Funding 2.625% 16/3/2028	3,134,691	0.04
GBP 1,300,000	Heathrow Funding 2.75% 13/10/2031	1,330,300	0.02
GBP 867,000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 5.844% 10/5/2031	1,076,134	0.01
GBP 1,600,000	Intu Jersey 2 2.875% 1/11/2022	282,907	0.00
GBP 861,000	Kane Bidco 6.5% 15/2/2027*	949,190	0.01
		17,607,023	0.22
ルクセンブルグ			
EUR 400,000	ADLER 2.25% 14/1/2029	177,898	0.00
EUR 2,100,000	ADLER 2.75% 13/11/2026	1,014,873	0.02
EUR 6,400,000	ADLER 3.25% 5/8/2025	3,223,860	0.04
EUR 3,877,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance / Atlas Luxco 4 3.625% 1/6/2028	3,359,108	0.04
GBP 883,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance / Atlas Luxco 4 4.875% 1/6/2028	870,431	0.01
EUR 2,410,000	Altice Financing 2.25% 15/1/2025*	2,396,207	0.03
EUR 300,000	Altice Financing 3% 15/1/2028	254,239	0.00
EUR 1,802,000	Altice Financing 4.25% 15/8/2029	1,542,465	0.02
EUR 400,000	Aroundtown 3.375% 23/12/2171	234,292	0.00
GBP 1,381,000	Aroundtown 4.75% 25/6/2171	873,821	0.01
USD 2,641,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	847,761	0.01
USD 607,000	Atento Luxco 1 8% 10/2/2026	194,847	0.00
EUR 2,327,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.336% 13/8/2041*	1,487,150	0.02
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 3.503% 25/9/2038	552,905	0.01
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 4.053% 25/9/2038	702,456	0.01
EUR 356,000	BL Consumer Credit 2021 5.253% 25/9/2038	361,508	0.00
EUR 1,070,000	Cidron Aida Finco 5% 1/4/2028*	1,004,384	0.01
GBP 2,291,000	Cidron Aida Finco 6.25% 1/4/2028*	2,390,572	0.03
EUR 1,489,000	Cirsa Finance International 4.5% 15/3/2027	1,394,594	0.02
EUR 1,626,000	Cirsa Finance International 4.75% 22/5/2025	1,693,885	0.02
EUR 398,914	Cirsa Finance International 6.25% 20/12/2023*	423,673	0.01
USD 2,422,000	CSN Resources 5.875% 8/4/2032	2,033,069	0.03
EUR 1,528,000	Cullinan Holdco 4.625% 15/10/2026*	1,444,668	0.02
EUR 800,000	Cullinan Holdco 7.078% 15/10/2026	819,977	0.01
EUR 200,000	Dana Financing Luxembourg 3% 15/7/2029	169,540	0.00
USD 909,000	EIG Pearl 3.545% 31/8/2036	763,560	0.01
USD 7,193,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046*	5,499,948	0.07
EUR 2,300,000	European TopSoho 4% 18/10/2021	2,257,077	0.03
EUR 400,000	FACT Master 3.356% 20/7/2028	421,078	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)			
USD 1,575,334	FEL Energy VI 5.75% 1/12/2040	1,328,413	0.02
EUR 4,449,000	Garfunkelux Holdco 3 6.75% 1/11/2025*	3,860,545	0.05
GBP 1,814,000	Garfunkelux Holdco 3 7.75% 1/11/2025*	1,773,569	0.02
EUR 2,250,381	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.125% 14/11/2034	2,360,157	0.03
EUR 818,320	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.875% 14/11/2034	854,562	0.01
USD 765,000	GOL Equity Finance 3.75% 15/7/2024	415,476	0.01
USD 1,788,000	Gol Finance 7% 31/1/2025	806,388	0.01
EUR 2,111,000	Herens Midco 5.25% 15/5/2029*	1,532,765	0.02
USD 731,000	Kenbourne Invest 4.7% 22/1/2028	511,982	0.01
USD 3,666,000	Kenbourne Invest 6.875% 26/11/2024	3,321,084	0.04
USD 1,079,000	Kernel 6.5% 17/10/2024	528,710	0.01
USD 875,000	Kernel 6.75% 27/10/2027	373,892	0.00
EUR 387,000	Kleopatra 2 6.5% 1/9/2026	234,937	0.00
EUR 400,000	Kleopatra Finco 4.25% 1/3/2026	360,094	0.00
EUR 1,056,330	LHMC Finco 2 7.25% 2/10/2025*	1,074,869	0.01
EUR 1,389,248	Lincoln Financing 3.625% 1/4/2024*	1,477,011	0.02
EUR 395,000	Lion/Polaris Lux 4 6.046% 1/7/2026*	409,357	0.01
USD 3,529,717	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	2,909,749	0.04
USD 1,211,680	MC Brazil Downstream Trading 7.25% 30/6/2031	998,857	0.01
EUR 1,080,000	Medtronic Global 2.625% 15/10/2025*	1,116,566	0.01
USD 1,339,200	Millicom International Cellular 5.125% 15/1/2028	1,186,608	0.02
USD 1,620,000	Millicom International Cellular 6.625% 15/10/2026*	1,561,040	0.02
EUR 2,048,000	Monitchem HoldCo 3 5.25% 15/3/2025*	2,152,653	0.03
USD 558,000	Nexa Resources 5.375% 4/5/2027	528,157	0.01
EUR 2,700,000	Prologis International Funding II 3.625% 7/3/2030	2,677,645	0.04
USD 1,923,000	Puma International Financing 5% 24/1/2026	1,756,987	0.02
USD 3,552,000	Puma International Financing 5.125% 6/10/2024*	3,409,920	0.05
EUR 400,000	Rossini 6.343% 30/10/2025	425,108	0.01
EUR 4,230,000	Rossini 6.75% 30/10/2025*	4,527,593	0.06
EUR 12,119,000	SES 2.875% 27/8/2171	10,936,758	0.14
EUR 2,500,000	SES 5.625% 29/1/2172	2,637,855	0.04
USD 1,903,000	Simpar Europe 5.2% 26/1/2031	1,340,768	0.02
EUR 1,475,000	Stena International 7.25% 15/2/2028	1,584,223	0.02
EUR 5,814,000	Summer BC Holdco B 5.75% 31/10/2026	5,492,410	0.07
USD 269,000	Telecom Italia Capital 6.375% 15/11/2033	232,878	0.00
EUR 673,000	Telecom Italia Finance 7.75% 24/1/2033*	763,415	0.01
		105,872,847	1.38
マレーシア			
USD 500,000	TNB Global Ventures Capital 3.244% 19/10/2026	458,755	0.01
マーシャル諸島			
USD 1,330,000	Danaos 8.5% 1/3/2028	1,300,882	0.02
モーリシャス			
USD 333,000	CA Magnum 5.375% 31/10/2026	308,841	0.01
USD 2,521,000	HTA 7% 18/12/2025*	2,402,040	0.03
USD 744,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024	723,540	0.01
USD 292,000	India Green Power 4% 22/2/2027	248,930	0.00
USD 481,000	Network i2i 5.65% 15/4/2171	458,939	0.01
		4,142,290	0.06
メキシコ			
USD 1,508,000	Alfa 5.25% 25/3/2024*	1,500,460	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 (%)
メキシコ(続き)			
USD 1,319,000	Alpek 3.25% 25/2/2031	1,068,370	0.02
USD 340,000	Alpek 3.25% 25/2/2031	275,395	0.00
USD 2,986,000	Axtel 6.375% 14/11/2024	2,724,023	0.03
USD 905,000	Axtel 6.375% 14/11/2024*	825,600	0.01
USD 2,665,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2172	2,387,667	0.03
USD 1,373,000	Banco Mercantil del Norte 5.875% 24/1/2172	1,230,119	0.02
USD 1,380,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2172	1,195,008	0.02
USD 1,173,000	Banco Mercantil del Norte 6.625% 24/1/2172	1,015,756	0.01
USD 228,000	Banco Mercantil del Norte 6.75% 27/9/2171	219,821	0.00
USD 2,480,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	1,779,400	0.02
USD 1,520,000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/2/2032	1,076,498	0.02
EUR 998,000	Cemex 3.125% 19/3/2026*	1,026,358	0.01
USD 4,127,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	4,086,906	0.05
EUR 3,700,000	Fomento Economico Mexicano 2.625% 24/2/2026	4,079,204	0.05
USD 1,492,000	Gruma 4.875% 1/12/2024	1,476,573	0.02
USD 1,220,000	Grupo Bimbo 3.875% 27/6/2024	1,193,648	0.01
USD 744,000	Grupo Bimbo 5.95% 17/7/2171	741,297	0.01
USD 1,441,000	Grupo Bimbo 5.95% 17/7/2171	1,441,126	0.02
USD 623,000	Grupo Televisa SAB 6.625% 15/1/2040	646,182	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 4.75% 6/8/2050	754,882	0.01
USD 926,000	Industrias Penoles 5.65% 12/9/2049	848,093	0.01
USD 1,207,000	Metalsa S A P I De 3.75% 4/5/2031	928,388	0.01
MXN 4,484,100	Mexican Bonos 5.75% 5/3/2026	21,575,451	0.28
MXN 1,486,000	Mexican Bonos 7.5% 3/6/2027	7,459,260	0.10
MXN 530,047	Mexican Bonos 7.5% 26/5/2033	2,549,745	0.03
MXN 1,010,923	Mexican Bonos 7.75% 29/5/2031	5,031,325	0.07
MXN 2,718,643	Mexican Bonos 8.5% 31/5/2029	14,186,469	0.18
MXN 475,712	Mexican Bonos 8.5% 18/11/2038	2,424,835	0.03
USD 2,163,000	Mexico City Airport Trust 4.25% 31/10/2026	2,025,671	0.03
USD 1,705,000	Mexico City Airport Trust 5.5% 31/7/2047	1,270,225	0.02
USD 3,951,000	Mexico Government International Bond 2.659% 24/5/2031	3,192,408	0.04
USD 1,826,000	Mexico Government International Bond 3.75% 11/1/2028	1,708,223	0.02
USD 781,000	Mexico Government International Bond 4.875% 19/5/2033	724,377	0.01
USD 355,000	Mexico Government International Bond 6.35% 9/2/2035	364,052	0.00
USD 1,303,000	Minera Mexico de 4.5% 26/1/2050	986,293	0.01
USD 1,207,000	Nemak 3.625% 28/6/2031	912,171	0.01
USD 2,163,000	Petroleos Mexicanos 4.875% 18/1/2024	2,137,044	0.03
USD 1,303,000	Petroleos Mexicanos 5.5% 27/6/2044*	779,846	0.01
USD 2,231,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	1,710,240	0.02
USD 2,691,000	Petroleos Mexicanos 6.35% 12/2/2048	1,677,213	0.02
USD 1,859,000	Petroleos Mexicanos 6.5% 13/3/2027	1,693,549	0.02
USD 4,601,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	3,680,800	0.05
USD 1,776,000	Petroleos Mexicanos 6.75% 21/9/2047	1,150,315	0.01
USD 1,383,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 16/10/2025	1,376,638	0.02
USD 1,220,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	1,163,880	0.02
MXN 622,560	Petroleos Mexicanos 7.19% 12/9/2024	3,129,908	0.04
USD 10,809,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	10,226,395	0.13
USD 1,375,000	Trust Fibra Uno 4.869% 15/1/2030	1,194,438	0.02
USD 244,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026	233,575	0.00
		127,085,120	1.63
モロッコ			
USD 1,508,000	OCP 4.5% 22/10/2025	1,447,378	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 (%)
	モロッコ(続き)		
USD 1,116,000	OCP 5.125% 23/6/2051	809,100	0.01
		2,256,478	0.03
	オランダ		
EUR 2,100,000	Abertis Infraestructuras Finance 3.248% 24/2/2172	2,010,961	0.03
EUR 500,000	ABN AMRO Bank 4% 16/1/2028	522,135	0.01
EUR 9,100,000	ABN AMRO Bank 4.25% 21/2/2030	9,535,293	0.12
EUR 3,400,000	ABN AMRO Bank 4.375% 22/9/2171	3,341,735	0.04
EUR 1,200,000	Ashland Services 2% 30/1/2028	1,090,232	0.02
EUR 4,200,000	ATF Netherlands 7.078% 20/1/2172	2,708,459	0.04
EUR 720,000	Axalta Coating Systems Dutch B 3.75% 15/1/2025*	754,648	0.01
USD 1,370,000	Braskem Netherlands Finance 7.25% 13/2/2033	1,337,462	0.02
USD 1,598,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	1,610,045	0.02
USD 978,000	Braskem Netherlands Finance 8.5% 23/1/2081	985,372	0.01
EUR 800,000	Cooperatieve Rabobank 4.625% 29/12/2171*	793,524	0.01
GBP 1,000,000	Cooperatieve Rabobank UA 1.875% 12/7/2028	1,048,190	0.01
EUR 9,800,000	Cooperatieve Rabobank UA 4% 10/1/2030	10,181,213	0.13
USD 945,000	Deutsche Telekom International Finance 2.485% 19/9/2023	932,249	0.01
EUR 167,000	Deutsche Telekom International Finance 7.5% 24/1/2033	225,878	0.00
EUR 614,314	Domi 2021-1 2.676% 15/6/2053	648,204	0.01
EUR 167,000	Domi 2023-1 0% 15/2/2055	176,688	0.00
EUR 530,000	Domi 2023-1 0% 15/2/2055	562,949	0.01
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 3.818% 28/1/2058	303,451	0.00
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 3.568% 28/7/2058	771,082	0.01
EUR 655,984	Dutch Property Finance 2021-2 3.168% 28/4/2059	692,711	0.01
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 3.268% 28/4/2059	846,508	0.01
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 3.518% 28/4/2059	508,724	0.01
USD 1,215,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	1,210,183	0.02
USD 1,012,000	Embraer Netherlands Finance 6.95% 17/1/2028	1,007,987	0.01
EUR 1,300,000	EnBW International Finance 3.625% 22/11/2026	1,369,424	0.02
EUR 2,270,000	EnBW International Finance 4% 24/1/2035	2,326,766	0.03
EUR 723,000	Energizer Gamma Acquisition 3.5% 30/6/2029	613,824	0.01
USD 1,066,000	Equate Petrochemical 2.625% 28/4/2028	935,138	0.01
USD 984,000	Equate Petrochemical 4.25% 3/11/2026	948,404	0.01
EUR 800,000	Ferrovial Netherlands 2.124% 14/5/2171*	724,255	0.01
EUR 600,000	Global Switch Finance 1.375% 7/10/2030	520,302	0.01
EUR 1,000,000	ING Groep 0.25% 18/2/2029	858,248	0.01
EUR 1,000,000	ING Groep 1% 13/11/2030	944,490	0.01
EUR 6,100,000	ING Groep 1.25% 16/2/2027	5,904,626	0.08
GBP 1,000,000	ING Groep 3% 18/2/2026	1,137,805	0.02
USD 1,968,000	ING Groep 3.869% 28/3/2026	1,894,467	0.02
EUR 1,800,000	ING Groep 4.875% 14/11/2027	1,938,602	0.03
USD 3,300,000	ING Groep 6.75% 16/4/2171*	3,240,504	0.04
EUR 763,000	IPD 3 5.5% 1/12/2025	790,684	0.01
EUR 2,100,000	JDE Peet' s 0% 16/1/2026*	1,976,236	0.03
EUR 2,283,000	JDE Peet' s 0.625% 9/2/2028	2,028,062	0.03
EUR 202,000	Jubilee Place 3.928% 17/1/2059	204,899	0.00
EUR 1,500,000	Koninklijke KPN 2% 8/2/2172	1,504,690	0.02
EUR 62,344	Magoi 2019 3.364% 27/7/2039	65,323	0.00
EUR 31,250	Magoi 2019 3.764% 27/7/2039	32,324	0.00
EUR 31,250	Magoi 2019 4.564% 27/7/2039	32,331	0.00
USD 1,565,000	Metinvest 7.65% 1/10/2027	846,812	0.01
USD 407,000	Metinvest 7.75% 17/10/2029	207,540	0.00

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
オランダ(続き)			
USD 303,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	163,809	0.00
USD 782,000	Metinvest 8.5% 23/4/2026	422,769	0.01
USD 227,000	Mondelez International Netherlands 1.25% 24/9/2026	196,885	0.00
EUR 1,500,000	Naturgy Finance 2.374% 23/2/2172	1,391,725	0.02
EUR 1,000,000	Naturgy Finance 3.375% 24/4/2171*	1,030,464	0.01
USD 2,250,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.4% 1/5/2030	1,941,114	0.02
USD 3,862,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 3.875% 18/6/2026	3,671,314	0.05
USD 1,300,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 4.3% 18/6/2029	1,203,313	0.02
USD 1,485,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 5% 15/1/2033	1,390,988	0.02
EUR 781,200	OCI 3.625% 15/10/2025	812,481	0.01
EUR 858,000	OI European 2.875% 15/2/2025*	883,152	0.01
EUR 220,000	OI European 3.125% 15/11/2024	228,614	0.00
EUR 900,000	Phoenix PIB Dutch Finance 2.375% 5/8/2025*	906,016	0.01
EUR 316,000	Promontoria 264 6.375% 1/3/2027	325,131	0.00
EUR 664,000	Q-Park I 1.5% 1/3/2025*	650,700	0.01
EUR 447,000	Q-Park I 2% 1/3/2027	398,886	0.00
EUR 652,000	Q-Park I 4.716% 1/3/2026*	671,932	0.01
EUR 7,543,000	Repsol International Finance 2.5% 22/3/2171*	6,910,262	0.09
EUR 658,000	Repsol International Finance 3.75% 11/6/2171	651,798	0.01
EUR 2,887,000	Repsol International Finance 4.247% 11/12/2171*	2,753,076	0.04
EUR 1,170,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	1,244,697	0.02
EUR 286,067	Summer BidCo 9% 15/11/2025	239,857	0.00
EUR 1,986,658	Summer BidCo 9% 15/11/2025	1,646,810	0.02
EUR 4,700,000	Telefonica Europe 2.376% 12/5/2171	3,888,293	0.05
EUR 1,000,000	Telefonica Europe 3% 4/12/2171	1,056,844	0.01
EUR 3,400,000	Telefonica Europe 3.875% 22/9/2171	3,355,117	0.04
EUR 5,800,000	Telefonica Europe 4.375% 14/3/2171	6,012,783	0.08
EUR 2,600,000	Telefonica Europe 5.875% 31/3/2171	2,788,034	0.04
EUR 5,000,000	Telefonica Europe 6.135% 2/3/2030	5,114,107	0.07
EUR 1,200,000	TenneT 2.374% 22/10/2171	1,198,583	0.01
EUR 308,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.25% 31/3/2023	327,281	0.00
EUR 300,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.625% 15/10/2028	243,876	0.00
EUR 1,100,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 1.875% 31/3/2027	977,949	0.01
EUR 2,420,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 3.75% 9/5/2027	2,300,448	0.03
EUR 887,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.375% 9/5/2030	795,001	0.01
EUR 4,112,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 4.5% 1/3/2025	4,330,259	0.06
EUR 660,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II 6% 31/1/2025	713,926	0.01
EUR 1,000,000	Thermo Fisher Scientific Finance I 0% 18/11/2025	960,508	0.01
EUR 1,000,000	Trivium Packaging Finance 3.75% 15/8/2026	972,583	0.01
USD 977,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	921,795	0.01
EUR 317,000	Trivium Packaging Finance 6.404% 15/8/2026	332,298	0.01
EUR 1,248,000	United 4% 15/11/2027*	1,050,666	0.01
EUR 476,000	United 4.625% 15/8/2028	404,251	0.00
EUR 2,128,000	United 4.875% 1/7/2024*	2,192,375	0.03
EUR 2,100,000	Universal Music 3% 30/6/2027	2,140,483	0.03
EUR 841,000	Universal Music 3.75% 30/6/2032	861,709	0.01
USD 500,000	UPC Broadband Finco 4.875% 15/7/2031	419,200	0.01
EUR 3,100,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025*	2,941,571	0.04
EUR 8,840,000	Viterra Finance 1% 24/9/2028	7,575,461	0.10
USD 2,307,000	Vivo Energy Investments 5.125% 24/9/2027	2,151,278	0.03
GBP 500,000	Volkswagen Financial Services 1.875% 3/12/2024	570,395	0.01
GBP 400,000	Volkswagen Financial Services 4.25% 9/10/2025	470,033	0.01
GBP 5,000,000	Volkswagen Financial Services 5.5% 7/12/2026*	6,035,480	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 (%)
オランダ(続き)			
EUR 9,800,000	Volkswagen International Finance 3.375% 27/6/2171	10,027,491	0.13
EUR 2,000,000	Volkswagen International Finance 3.748% 28/12/2171	1,859,037	0.02
EUR 1,721,000	VZ Secured Financing 3.5% 15/1/2032	1,434,294	0.02
EUR 3,400,000	Wintershall Dea Finance 0.84% 25/9/2025	3,324,200	0.04
EUR 3,100,000	Wintershall Dea Finance 1.332% 25/9/2028	2,742,351	0.03
EUR 2,000,000	Wintershall Dea Finance 1.823% 25/9/2031	1,656,999	0.02
EUR 9,500,000	Wintershall Dea Finance 2 2.499% 20/7/2171	8,660,153	0.11
EUR 1,100,000	Wintershall Dea Finance 2 3% 20/1/2172	916,169	0.01
EUR 400,000	ZF Europe Finance 2% 23/2/2026	388,305	0.00
EUR 500,000	ZF Europe Finance 2.5% 23/10/2027*	464,520	0.00
EUR 200,000	Ziggo 2.875% 15/1/2030	171,857	0.00
		199,335,395	2.56
ナイジェリア			
USD 1,796,000	Nigeria Government International Bond 7.625% 28/11/2047	1,221,280	0.02
USD 744,000	Nigeria Government International Bond 7.875% 16/2/2032	573,431	0.01
USD 1,198,000	Nigeria Government International Bond 8.375% 24/3/2029	1,022,792	0.01
		2,817,503	0.04
ノルウェー			
EUR 4,054,000	Aker BP 1.125% 12/5/2029	3,523,612	0.04
EUR 1,300,000	Nassa Topco 2.875% 6/4/2024	1,341,595	0.02
		4,865,207	0.06
オマーン			
USD 1,859,000	Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047	1,740,489	0.02
USD 2,231,000	Oman Government International Bond 6.75% 17/1/2048	2,147,337	0.03
USD 744,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	720,300	0.01
		4,608,126	0.06
パナマ			
USD 744,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen 5.125% 11/8/2061	584,831	0.01
EUR 1,084,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	1,026,600	0.01
EUR 3,316,000	Carnival 10.125% 1/2/2026	3,693,343	0.05
USD 4,823,000	Panama Government International Bond 3.16% 23/1/2030	4,145,597	0.05
USD 3,624,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	3,398,669	0.05
		12,849,040	0.17
パラグアイ			
USD 2,142,000	Frigorifico Concepcion 7.7% 21/7/2028	1,586,751	0.02
USD 391,000	Paraguay Government International Bond 4.95% 28/4/2031	368,268	0.00
USD 2,354,000	Paraguay Government International Bond 5.4% 30/3/2050	1,971,398	0.03
USD 1,575,000	Paraguay Government International Bond 5.6% 13/3/2048*	1,353,260	0.02
		5,279,677	0.07
ペルー			
USD 1,975,000	Financiera de Desarrollo 4.75% 15/7/2025*	1,914,224	0.03
USD 2,015,000	InRetail Consumer 3.25% 22/3/2028	1,703,673	0.02
USD 3,490,000	Peruvian Government International Bond 1.862% 1/12/2032*	2,530,023	0.03
USD 1,832,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	1,510,365	0.02
		7,658,285	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 (%)
	フィリピン		
USD 400,000	Philippine Government International Bond 2.65% 10/12/2045	269,500	0.00
	ポーランド		
EUR 3,855,000	Republic of Poland Government International Bond 3.875% 14/2/2033	3,963,910	0.05
EUR 4,545,000	Republic of Poland Government International Bond 4.25% 14/2/2043	4,659,770	0.06
		8,623,680	0.11
	ポルトガル		
EUR 198,543	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.264% 25/1/2035	203,810	0.00
EUR 860,353	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 6.264% 25/1/2035	872,657	0.01
EUR 200,000	Banco Espirito Santo 2.625% 8/5/2017	30,847	0.00
EUR 20,500,000	Banco Espirito Santo 4% 21/1/2019	3,161,863	0.04
EUR 2,000,000	Banco Espirito Santo 4.75% 15/1/2018	308,474	0.01
EUR 3,500,000	EDP - Energias de Portugal 1.7% 20/7/2080	3,367,424	0.04
EUR 180,095	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 4.006% 20/3/2033	191,218	0.00
EUR 900,000	SAGRES Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 1 6.156% 20/3/2033	958,235	0.01
EUR 798,899	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 2 5.233% 23/9/2038	798,351	0.01
EUR 178,076	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 3.379% 28/10/2040	184,174	0.00
EUR 623,267	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 3.979% 28/10/2040	631,834	0.01
EUR 1,745,652	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Volta VII 0.7% 12/2/2024	1,821,387	0.03
		12,530,274	0.16
	プエルトリコ		
USD 590,000	Puerto Rico Sales Tax Financing Sales Tax Revenue 4.75% 1/7/2053	528,865	0.01
	ルーマニア		
EUR 1,963,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031*	1,502,304	0.02
EUR 3,556,000	Romanian Government International Bond 2.125% 7/3/2028	3,202,464	0.04
EUR 2,144,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	1,808,788	0.02
EUR 2,038,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029	1,841,561	0.02
USD 1,964,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	1,906,308	0.03
		10,261,425	0.13
	ロシア連邦		
RUB 352,509,000	Russian Federal Bond - OFZ 6.1% 18/7/2035	281,543	0.00
	サウジアラビア		
USD 1,700,000	Saudi Government International Bond 2.25% 2/2/2033	1,351,827	0.02
USD 129,000	Saudi Government International Bond 3.25% 26/10/2026	122,550	0.00
USD 3,503,000	Saudi Government International Bond 3.45% 2/2/2061	2,425,503	0.03
USD 2,289,000	Saudi Government International Bond 4.5% 17/4/2030	2,242,373	0.03
USD 1,323,000	Saudi Government International Bond 4.75% 18/1/2028	1,311,424	0.02
USD 1,770,000	Saudi Government International Bond 5% 18/1/2053*	1,621,763	0.02
		9,075,440	0.12
	セネガル		
USD 1,166,000	Senegal Government International Bond 6.25% 23/5/2033	966,323	0.01
	シンガポール		
USD 343,000	ABJA Investment 5.45% 24/1/2028*	331,405	0.00
USD 1,074,150	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	947,938	0.01
USD 195,300	Continuum Energy Levanter 4.5% 9/2/2027	172,352	0.00
USD 600,000	DBS 3.3% 27/8/2171	563,145	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 496,260	LLPL Capital 6.875% 4/2/2039	458,358	0.01
SGD 3,750,000	Straits Trading 3.25% 13/2/2028	2,636,414	0.03
USD 200,000	TML 4.35% 9/6/2026	184,064	0.00
		5,293,676	0.06
南アフリカ			
ZAR 14,181,582	Republic of South Africa Government Bond 8% 31/1/2030	693,739	0.01
ZAR 26,372,139	Republic of South Africa Government Bond 8.25% 31/3/2032	1,237,394	0.01
ZAR 13,614,087	Republic of South Africa Government Bond 8.75% 31/1/2044	577,672	0.01
ZAR 75,557,163	Republic of South Africa Government Bond 9% 31/1/2040	3,352,707	0.04
USD 1,618,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029	1,429,907	0.02
USD 2,583,000	Republic of South Africa Government International Bond 5% 12/10/2046	1,769,355	0.02
USD 1,562,000	Republic of South Africa Government International Bond 5.875% 20/4/2032	1,396,037	0.02
		10,456,811	0.13
韓国			
USD 710,000	KDB Life Insurance 7.5% 21/11/2171	656,750	0.01
USD 400,000	Kookmin Bank 4.35% 2/1/2172*	385,521	0.00
USD 360,000	LG Chem 2.375% 7/7/2031	288,000	0.00
USD 538,000	POSCO 5.625% 17/1/2026	539,350	0.01
USD 582,000	POSCO 5.75% 17/1/2028	588,501	0.01
USD 200,000	POSCO 5.875% 17/1/2033*	206,915	0.00
USD 400,000	SK Hynix 6.25% 17/1/2026	399,326	0.01
USD 1,255,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028*	1,235,905	0.02
USD 200,000	SK Hynix 6.375% 17/1/2028	196,957	0.00
USD 250,000	SK Hynix 6.5% 17/1/2033	244,344	0.00
		4,741,569	0.06
スペイン			
USD 2,098,974	AI Candelaria Spain SLU 7.5% 15/12/2028	1,925,809	0.03
EUR 321,703	Autonoria Spain 2021 FT 3.203% 31/1/2039	338,194	0.01
EUR 1,688,943	Autonoria Spain 2021 FT 3.453% 31/1/2039	1,756,743	0.02
EUR 723,833	Autonoria Spain 2021 FT 3.953% 31/1/2039	740,005	0.01
EUR 386,052	Autonoria Spain 2021 FT 5.053% 31/1/2039	392,311	0.01
EUR 160,852	Autonoria Spain 2021 FT 6.303% 31/1/2039	161,858	0.00
EUR 300,000	Autonoria Spain 2022 FT 5.203% 27/1/2040	318,952	0.00
EUR 100,000	Autonoria Spain 2022 FT 6.603% 28/1/2040	106,041	0.00
EUR 500,000	Autonoria Spain 2022 FT 9.403% 29/1/2040	536,565	0.01
EUR 900,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 4.625% 13/1/2031	943,903	0.01
EUR 2,400,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 29/6/2171*	2,508,216	0.03
EUR 200,000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria 6% 15/10/2171	205,321	0.00
EUR 900,000	Banco de Sabadell 2% 17/1/2030	873,304	0.01
EUR 3,900,000	Banco de Sabadell 2.5% 15/4/2031	3,696,596	0.05
EUR 1,000,000	Banco de Sabadell 5.25% 7/2/2029	1,037,586	0.01
EUR 200,000	Banco Santander 2.838% 16/1/2025	213,369	0.00
GBP 2,300,000	Banco Santander 3.125% 6/10/2026	2,602,038	0.03
EUR 4,000,000	Banco Santander 3.625% 27/9/2026	4,182,913	0.05
EUR 2,000,000	Banco Santander 3.75% 16/1/2026	2,102,381	0.03
EUR 2,400,000	Banco Santander 3.875% 16/1/2028	2,503,429	0.03
EUR 1,400,000	Banco Santander 4.125% 11/12/2027	1,215,735	0.02
EUR 3,200,000	Banco Santander 4.375% 14/4/2171	2,969,217	0.04
GBP 3,300,000	Banco Santander 4.75% 30/8/2028	3,869,670	0.05
EUR 1,500,000	CaixaBank 0.75% 9/7/2026*	1,421,281	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スペイン(続き)			
GBP 1,000,000	CaixaBank 3.5% 6/4/2028	1,098,713	0.02
EUR 2,200,000	CaixaBank 6.375% 19/12/2171*	2,331,843	0.03
EUR 600,000	CaixaBank 6.75% 13/9/2171	631,576	0.01
EUR 1,100,000	Cellnex Finance 1% 15/9/2027	978,101	0.01
EUR 1,700,000	Cellnex Finance 2% 15/9/2032	1,357,851	0.02
EUR 4,700,000	Cellnex Telecom 0.75% 20/11/2031	4,049,774	0.05
EUR 1,700,000	Cellnex Telecom 1.75% 23/10/2030*	1,408,601	0.02
EUR 700,000	Cellnex Telecom 1.875% 26/6/2029*	610,708	0.01
EUR 351,000	Food Service Project 5.5% 21/1/2027*	349,049	0.00
EUR 477,887	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 2.997% 21/3/2033	497,570	0.01
EUR 286,732	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 21/3/2033	286,603	0.00
EUR 143,366	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.997% 21/3/2033	147,539	0.00
EUR 1,672,000	Grupo Antolin-Irausa 3.375% 30/4/2026*	1,511,897	0.02
EUR 729,000	Grupo Antolin-Irausa 3.5% 30/4/2028	574,625	0.01
EUR 1,900,000	International Consolidated Airlines 1.125% 18/5/2028	1,661,921	0.02
EUR 1,100,000	International Consolidated Airlines 2.75% 25/3/2025*	1,105,663	0.01
EUR 1,300,000	International Consolidated Airlines 3.75% 25/3/2029	1,130,805	0.01
EUR 515,000	Kaixo Bondco Telecom 5.125% 30/9/2029	475,563	0.01
EUR 3,672,000	Lorca Telecom Bondco 4% 18/9/2027	3,535,994	0.04
EUR 111,854,000	Spain Government Bond 2.55% 31/10/2032	108,757,509	1.40
EUR 9,733,000	Spain Government Bond 2.9% 31/10/2046	8,663,329	0.11
EUR 69,835,000	Spain Government Bond 3.15% 30/4/2033	70,844,860	0.91
EUR 8,423,000	Spain Government Bond 3.45% 30/7/2066	7,771,016	0.10
EUR 4,914,000	Spain Government Bond 3.9% 30/7/2039	5,156,376	0.07
GBP 2,000,000	Telefonica Emisiones 5.375% 2/2/2026	2,430,335	0.03
		263,989,258	3.39
スリランカ			
USD 306,000	Sri Lanka Government International Bond 5.75% 18/4/2023	112,235	0.00
USD 821,000	Sri Lanka Government International Bond 6.35% 28/6/2024	299,761	0.01
USD 677,000	Sri Lanka Government International Bond 6.85% 14/3/2024	247,967	0.00
		659,963	0.01
スウェーデン			
EUR 777,000	Fastighets Balder 2.873% 2/6/2081	644,256	0.01
EUR 3,976,000	Heimstaden Bostad 2.625% 1/5/2171	2,719,011	0.04
EUR 1,000,000	Heimstaden Bostad 3.375% 15/1/2026*	702,258	0.01
EUR 924,451	Intrum 3.125% 15/7/2024	958,524	0.01
EUR 534,000	Intrum 3.5% 15/7/2026	501,594	0.01
EUR 3,062,000	Intrum 4.875% 15/8/2025	3,061,917	0.04
EUR 125,000	Intrum 9.25% 15/3/2028	135,037	0.00
USD 1,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken 5.125% 13/5/2171	934,350	0.01
USD 1,600,000	Svenska Handelsbanken 4.375% 1/3/2172	1,439,424	0.02
USD 200,000	Svenska Handelsbanken 4.75% 1/3/2172	171,662	0.00
GBP 1,000,000	Swedbank 1.375% 8/12/2027	1,049,303	0.01
EUR 7,670,000	Swedbank 4.25% 11/7/2028*	8,059,652	0.10
GBP 3,500,000	Swedbank 7.272% 15/11/2032	4,350,289	0.06
EUR 1,524,000	Verisure 3.25% 15/2/2027	1,402,313	0.02
EUR 1,498,000	Verisure 3.875% 15/7/2026	1,452,475	0.02
EUR 545,000	Verisure 7.125% 1/2/2028	572,128	0.01
EUR 1,993,000	Verisure 7.288% 15/4/2025*	2,121,437	0.03
EUR 287,000	Verisure 9.25% 15/10/2027	323,313	0.00
EUR 874,000	Volvo Car 2.5% 7/10/2027	826,749	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 (%)
スウェーデン(続き)			
EUR 2,220,000	Volvo Treasury 2.625% 20/2/2026	2,278,456	0.03
GBP 2,740,000	Volvo Treasury 4.75% 15/6/2026	3,318,719	0.04
		37,022,867	0.48
スイス			
USD 3,554,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2171	2,935,451	0.04
USD 3,200,000	Credit Suisse 6.25% 18/12/2171*	2,643,062	0.03
USD 200,000	Credit Suisse 7.5% 17/1/2172	175,291	0.00
EUR 4,500,000	UBS 1% 21/3/2025	4,631,999	0.06
USD 7,681,000	UBS 1.008% 30/7/2024	7,536,082	0.10
USD 1,379,000	UBS 2.095% 11/2/2032	1,055,096	0.01
USD 1,300,000	UBS 3.875% 6/2/2026	1,097,369	0.02
EUR 2,690,000	UBS 4.375% 11/1/2031*	2,833,207	0.04
USD 1,836,000	UBS 4.488% 12/5/2026	1,789,436	0.02
USD 2,496,000	UBS 4.703% 5/8/2027	2,413,495	0.03
USD 750,000	UBS 4.988% 5/8/2033	698,257	0.01
USD 200,000	UBS 5.125% 29/7/2171	184,891	0.00
USD 2,100,000	UBS 7% 31/10/2024*	2,097,624	0.03
USD 3,000,000	UBS 7% 31/7/2171*	2,996,606	0.04
USD 800,000	UBS 7% 19/2/2172	797,591	0.01
		33,885,457	0.44
タイ			
USD 690,000	Bangkok Bank Hong Kong 5% 23/3/2171*	655,488	0.01
USD 524,000	Kasikornbank Hong Kong 3.343% 2/10/2031	463,586	0.01
USD 690,000	Krung Thai Bank 4.4% 25/9/2171	621,863	0.01
USD 700,000	Thaioil Treasury Center 3.75% 18/6/2050	442,927	0.01
		2,183,864	0.04
トルコ			
USD 5,428,000	Turkey Government International Bond 4.875% 16/4/2043	3,480,705	0.05
USD 1,200,150	Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 4.2% 15/9/2028	1,063,298	0.01
		4,544,003	0.06
ウクライナ			
USD 4,723,000	Ukraine Government International Bond 7.253% 15/3/2035	826,903	0.01
USD 1,582,000	Ukraine Government International Bond 7.375% 25/9/2034	283,178	0.00
USD 1,116,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2025	235,069	0.00
USD 1,650,000	Ukraine Government International Bond 7.75% 1/9/2026	314,048	0.01
USD 1,620,000	Ukraine Government International Bond 8.994% 1/2/2026	313,802	0.01
		1,973,000	0.03
アラブ首長国連邦			
USD 2,853,000	Emirates NBD Bank 6.125% 20/9/2171*	2,840,996	0.04
英国			
EUR 736,000	Anglo American Capital 1.625% 11/3/2026	728,382	0.01
EUR 3,300,000	Anglo American Capital 4.75% 21/9/2032	3,466,278	0.04
GBP 125,000	Atlas Funding 2021-1 5.562% 25/7/2058	150,567	0.00
GBP 110,000	Atlas Funding 2021-1 6.112% 25/7/2058	132,425	0.00
USD 3,267,231	Avianca Midco 2 9% 1/12/2028	2,713,844	0.04
GBP 1,699,000	Azure Finance NO 2 6.933% 20/7/2030	2,073,450	0.03
EUR 8,777,000	Barclays 0.577% 9/8/2029*	7,412,556	0.10
GBP 1,000,000	Barclays 3% 8/5/2026	1,120,699	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 1,000,000	Barclays 3.25% 12/2/2027	1,105,234	0.01
EUR 3,000,000	Barclays 5.262% 29/1/2034	3,201,167	0.04
USD 1,100,000	Barclays 6.125% 15/12/2171	1,035,709	0.01
GBP 800,000	Barclays 6.375% 15/3/2171	906,783	0.01
GBP 1,600,000	Barclays 7.125% 15/9/2171	1,866,095	0.02
GBP 400,000	Barclays 7.25% 15/6/2171	486,774	0.01
USD 1,550,000	Barclays 7.437% 2/11/2033	1,662,797	0.02
USD 600,000	Barclays 8% 15/9/2171	594,595	0.01
USD 1,600,000	Barclays 8% 15/12/2171*	1,563,520	0.02
GBP 1,510,000	Barclays 8.407% 14/11/2032	1,917,765	0.02
GBP 520,000	Barley Hill NO 2 5.633% 27/8/2058	601,817	0.01
EUR 700,000	BAT International Finance 2.75% 25/3/2025	728,140	0.01
GBP 1,200,000	BAT International Finance 4% 4/9/2026	1,365,869	0.02
EUR 700,000	BCP V Modular Services Finance II 4.75% 30/11/2028	641,296	0.01
GBP 400,000	BCP V Modular Services Finance II 6.125% 30/11/2028	417,997	0.01
GBP 2,698,000	Bellis Acquisition 3.25% 16/2/2026	2,718,924	0.04
GBP 3,328,000	Bellis Acquisition 4.5% 16/2/2026	3,464,624	0.05
GBP 900,000	BG Energy Capital 5% 4/11/2036	1,053,886	0.01
GBP 1,826,000	BG Energy Capital 5.125% 1/12/2025	2,237,439	0.03
EUR 8,800,000	BP Capital Markets 3.25% 22/6/2171	8,668,137	0.11
EUR 7,675,000	British Telecommunications 1.874% 18/8/2080	7,447,958	0.10
USD 1,000,000	British Telecommunications 4.25% 23/11/2081	883,140	0.01
USD 2,200,000	British Telecommunications 4.875% 23/11/2081	1,790,132	0.02
GBP 225,000	Canada Square Funding 2021-2 4.83% 17/6/2058	262,762	0.00
GBP 102,000	Canada Square Funding 2021-2 5.23% 17/6/2058	119,037	0.00
GBP 318,000	Canada Square Funding 6 5.267% 17/1/2059	365,754	0.01
GBP 178,000	Canada Square Funding 6 5.667% 17/1/2059	198,983	0.00
GBP 1,000,000	Canary Wharf Finance II 5.346% 22/10/2037	995,398	0.01
GBP 4,190,000	Canary Wharf Finance II 6.071% 22/10/2037	4,119,855	0.05
EUR 1,071,000	Chanel Ceres 0.5% 31/7/2026	1,004,400	0.01
EUR 2,404,000	Channel Link Enterprises Finance 2.706% 30/6/2050	2,276,359	0.03
GBP 1,850,000	Channel Link Enterprises Finance 3.043% 30/6/2050	1,891,465	0.03
GBP 220,000	CMF 2020-1 4.933% 16/1/2057	265,097	0.00
GBP 105,000	CMF 2020-1 5.183% 16/1/2057	125,569	0.00
GBP 2,097,000	Constellation Automotive Financing 4.875% 15/7/2027	1,842,022	0.02
GBP 1,066,990	Dignity Finance 3.546% 31/12/2034	1,171,642	0.02
GBP 350,000	Dignity Finance 4.696% 31/12/2049	271,098	0.00
GBP 194,608	Dowson 2021-2 4.613% 20/10/2028	236,256	0.00
GBP 400,000	Dowson 2021-2 5.133% 20/10/2028	483,723	0.01
GBP 1,300,000	Dowson 2021-2 5.533% 20/10/2028	1,550,138	0.02
GBP 1,143,000	Dowson 2022-1 6.183% 20/1/2029	1,358,767	0.02
GBP 725,000	Dowson 2022-1 6.633% 20/1/2029	845,447	0.01
GBP 451,000	Dowson 2022-2 7.633% 20/8/2029	552,068	0.01
GBP 245,000	Dowson 2022-2 9.183% 20/8/2029	294,060	0.00
EUR 3,498,000	EC Finance 3% 15/10/2026*	3,402,131	0.04
EUR 2,398,000	eG Global Finance 3.625% 7/2/2024*	2,398,458	0.03
EUR 211,000	eG Global Finance 6.25% 30/10/2025	199,029	0.00
GBP 514,283	Finsbury Square 4.254% 16/12/2067	618,737	0.01
GBP 544,000	Finsbury Square 4.604% 16/12/2067	642,911	0.01
GBP 1,045,000	Finsbury Square 4.854% 16/12/2067	1,213,337	0.02
GBP 882,960	Finsbury Square 2021-2 4.404% 16/12/2071	1,060,870	0.01
GBP 435,000	Finsbury Square 2021-2 4.854% 16/12/2071	516,007	0.01
GBP 371,000	Finsbury Square 2021-2 5.004% 16/12/2071	427,614	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 201,000	Finsbury Square 2021-2 5.304% 16/12/2071	223,943	0.00
USD 2,202,000	Fresnillo 4.25% 2/10/2050	1,706,055	0.02
GBP 116,000	Funding V 5.633% 15/10/2025	137,996	0.00
GBP 736,000	Funding VI 7.033% 15/7/2026	905,447	0.01
GBP 218,000	Gemgarto 2021-1 4.904% 16/12/2067	256,536	0.00
GBP 319,196	Gemgarto 2021-1 8.604% 16/12/2067	387,450	0.01
GBP 1,880,000	Great Hall Mortgages No 1 4.061% 18/6/2039	2,139,429	0.03
GBP 2,509,244	Greene King Finance 3.593% 15/3/2035	2,530,807	0.03
GBP 1,017,654	Greene King Finance 4.064% 15/3/2035	1,049,314	0.01
GBP 300,000	Greene King Finance 5.512% 15/12/2034	278,364	0.00
GBP 300,000	Greene King Finance 5.792% 15/3/2036	281,594	0.00
GBP 741,000	Harben Finance 4.855% 28/9/2055	849,218	0.01
GBP 441,000	Harben Finance 5.205% 28/9/2055	479,334	0.01
GBP 400,000	Heathrow Finance 3.875% 1/3/2027	431,619	0.01
GBP 517,000	Heathrow Finance 4.125% 1/9/2029	532,077	0.01
GBP 500,000	Heathrow Finance 4.75% 1/3/2024	598,295	0.01
GBP 199,992	Hops Hill No 1 5.783% 27/5/2054	239,117	0.00
GBP 99,998	Hops Hill No 1 6.283% 27/5/2054	118,492	0.00
GBP 1,000,000	Hops Hill No2 6.183% 27/11/2054	1,215,415	0.02
GBP 264,000	Hops Hill No2 6.783% 27/11/2054	316,866	0.00
GBP 5,560,000	HSBC 1.75% 24/7/2027	5,918,095	0.08
GBP 2,200,000	HSBC 2.256% 13/11/2026	2,438,849	0.03
USD 800,000	HSBC 3.973% 22/5/2030	715,488	0.01
USD 1,690,000	HSBC 4.95% 31/3/2030	1,615,906	0.02
EUR 1,500,000	HSBC 6.364% 16/11/2032	1,640,472	0.02
GBP 1,800,000	HSBC 8.201% 16/11/2034	2,311,369	0.03
USD 840,000	HSBC Bank 5.401% 19/12/2171	661,164	0.01
GBP 1,300,000	Imperial Brands Finance 5.5% 28/9/2026	1,551,648	0.02
GBP 700,000	Imperial Brands Finance 8.125% 15/3/2024	868,680	0.01
EUR 1,365,000	INEOS Finance 6.625% 15/5/2028*	1,434,556	0.02
EUR 1,287,000	INEOS Quattro Finance 2 2.5% 15/1/2026	1,212,047	0.02
EUR 5,470,000	Informa 2.125% 6/10/2025	5,523,586	0.07
GBP 1,000,000	Informa 3.125% 5/7/2026	1,117,407	0.01
USD 200,000	International Game Technology 6.25% 15/1/2027	196,208	0.00
GBP 790,000	Iron Mountain UK 3.875% 15/11/2025*	909,287	0.01
EUR 990,000	Jaguar Land Rover Automotive 4.5% 15/7/2028*	851,421	0.01
EUR 300,000	Jaguar Land Rover Automotive 6.875% 15/11/2026	303,517	0.00
USD 1,400,000	Jaguar Land Rover Automotive 7.75% 15/10/2025	1,382,500	0.02
GBP 1,154,000	Jerrold Finco 4.875% 15/1/2026*	1,236,501	0.02
GBP 370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 5.814% 12/6/2057	444,003	0.01
GBP 292,179	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 4.484% 20/7/2058	351,772	0.00
GBP 173,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 4.784% 20/7/2058	204,188	0.00
GBP 158,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5.084% 20/7/2058	181,535	0.00
GBP 102,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5.484% 20/7/2058	115,856	0.00
USD 2,016,000	Liquid Telecommunications Financing 5.5% 4/9/2026	1,427,106	0.02
GBP 2,000,000	Lloyds Banking 2.25% 16/10/2024	2,310,344	0.03
EUR 1,075,000	Lloyds Banking 4.5% 11/1/2029*	1,135,867	0.01
USD 1,400,000	Lloyds Banking 7.5% 27/6/2171	1,379,252	0.02
GBP 433,743	London Wall Mortgage Capital 4.695% 15/5/2051	519,967	0.01
GBP 254,843	London Wall Mortgage Capital 4.745% 15/5/2052	306,972	0.00
GBP 1,037,000	Market Bidco Finco 5.5% 4/11/2027	974,008	0.01
GBP 700,000	Marks & Spencer 6% 12/6/2025	838,085	0.01
GBP 1,483,000	Mitchells & Butlers Finance 5.956% 15/6/2036	1,455,415	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	英国(続き)		
GBP 707,204	Mortimer BTL 2021-1 4.36% 23/6/2053	847,901	0.01
GBP 198,000	Mortimer BTL 2021-1 4.76% 23/6/2053	233,160	0.00
GBP 111,000	Mortimer BTL 2021-1 5.11% 23/6/2053	129,272	0.00
GBP 550,000	National Express 4.25% 26/2/2172	598,677	0.01
EUR 500,000	National Grid 0.553% 18/9/2029	420,726	0.00
EUR 3,200,000	National Grid 3.245% 30/3/2034	2,997,995	0.04
GBP 1,900,000	Nationwide Building Society 5.75% 20/12/2171	2,089,250	0.03
GBP 400,000	Nationwide Building Society 5.875% 20/12/2171*	461,522	0.01
EUR 600,000	NatWest 2% 4/3/2025	623,647	0.01
GBP 1,000,000	NatWest 2.875% 19/9/2026	1,132,079	0.01
GBP 1,000,000	NatWest 3.125% 28/3/2027	1,121,724	0.01
GBP 1,000,000	NatWest 3.622% 14/8/2030	1,133,738	0.01
GBP 2,200,000	NatWest 7.416% 6/6/2033	2,720,133	0.04
EUR 2,820,000	NatWest Markets 4.25% 13/1/2028*	2,973,866	0.04
USD 8,097,000	Neptune Energy Bondco 6.625% 15/5/2025	7,882,921	0.10
GBP 775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 5.483% 15/3/2029	928,984	0.01
GBP 595,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 4.833% 15/11/2029	714,328	0.01
GBP 677,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 5.283% 15/11/2029	804,850	0.01
GBP 1,212,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-2 8.933% 15/7/2030	1,484,286	0.02
EUR 605,349	Newgate Funding 2.264% 1/12/2050	587,460	0.01
EUR 11,000,000	NGG Finance 1.625% 5/12/2079	11,009,111	0.14
GBP 1,300,000	NGG Finance 5.625% 18/6/2073	1,542,287	0.02
GBP 1,524,000	Ocado 3.875% 8/10/2026	1,440,693	0.02
EUR 265,691	Paragon Mortgages No 12 3.134% 15/11/2038	256,922	0.00
GBP 2,405,000	Paragon Mortgages No 25 5.015% 15/5/2050	2,920,590	0.04
GBP 2,100,000	Paragon Mortgages No 25 5.365% 15/5/2050	2,541,076	0.03
GBP 2,325,137	Parkmore Point RMBS 2022-1 5.362% 25/7/2045	2,783,283	0.04
GBP 537,174	Pierpont BTL 2021-1 4.46% 22/12/2053	637,451	0.01
GBP 802,000	Pierpont BTL 2021-1 4.91% 22/12/2053	928,813	0.01
GBP 5,218,000	Pinewood Finance 3.25% 30/9/2025	5,849,696	0.08
GBP 421,000	Polaris 2022-1 5.433% 23/10/2059	484,395	0.01
GBP 307,000	Polaris 2022-1 5.933% 23/10/2059	348,739	0.00
GBP 538,000	Polaris 2022-1 7.333% 23/10/2059	617,946	0.01
GBP 115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 5.383% 16/10/2056	138,282	0.00
GBP 100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 5.883% 16/10/2056	118,131	0.00
GBP 1,735,000	Premier Foods Finance 3.5% 15/10/2026	1,890,271	0.02
GBP 1,197,000	Residential Mortgage 32 5.849% 20/6/2070	1,441,490	0.02
EUR 41,363	RMAC No 1 2.24% 12/6/2044	41,014	0.00
EUR 595,956	RMAC No 1 2.26% 12/6/2044	588,005	0.01
GBP 312,654	RMAC No 1 3.833% 12/6/2044	360,317	0.01
GBP 420,000	RMAC NO 2 5.533% 12/6/2046	509,218	0.01
EUR 400,000	Rolls-Royce 1.625% 9/5/2028	349,455	0.00
EUR 442,000	Rolls-Royce 4.625% 16/2/2026	463,415	0.01
USD 200,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	192,277	0.00
GBP 176,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	204,635	0.00
USD 440,000	Royalty Pharma 0.75% 2/9/2023	428,732	0.01
USD 1,725,000	Royalty Pharma 2.2% 2/9/2030	1,351,603	0.02
GBP 535,000	Sage AR Funding No 1 6.095% 17/11/2030	605,935	0.01
GBP 1,400,000	Santander UK 2.92% 8/5/2026	1,588,706	0.02
GBP 1,000,000	Santander UK 3.625% 14/1/2026	1,147,249	0.02
GBP 399,000	Santander UK 6.75% 24/6/2171	469,436	0.01
GBP 800,000	Santander UK 7.098% 16/11/2027	1,000,412	0.01
GBP 369,000	Satus 2021-1 5.133% 17/8/2028	445,465	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 453,000	Satus 2021-1 5.533% 17/8/2028	538,376	0.01
GBP 122,000	Satus 2021-1 5.833% 17/8/2028	142,236	0.00
GBP 247,000	Satus 2021-1 7.133% 17/8/2028	283,865	0.00
USD 3,538,820	SCC Power 4% 17/5/2032	255,882	0.00
USD 6,533,208	SCC Power 8% 31/12/2028	2,335,622	0.04
EUR 1,432,000	Sherwood Financing 4.5% 15/11/2026*	1,333,233	0.02
GBP 624,000	Sherwood Financing 6% 15/11/2026	625,139	0.01
EUR 458,000	Sherwood Financing 7.279% 15/11/2027	461,956	0.01
GBP 2,300,000	SSE 8.375% 20/11/2028	3,190,373	0.04
GBP 535,000	Stanlington No 2 5.314% 12/6/2045	612,957	0.01
GBP 329,000	Stanlington No 2 5.764% 12/6/2045	377,027	0.01
GBP 450,000	Stanlington No 2 6.864% 12/6/2045	501,052	0.01
GBP 3,930,000	Stonegate Pub Financing 2019 8% 13/7/2025*	4,485,105	0.06
GBP 1,671,000	Stonegate Pub Financing 2019 8.25% 31/7/2025*	1,935,484	0.03
EUR 801,000	Synthomer 3.875% 1/7/2025*	791,866	0.01
GBP 832,426	Tesco Property Finance 1 7.623% 13/7/2039	1,122,446	0.01
GBP 2,033,119	Tesco Property Finance 3 5.744% 13/4/2040	2,392,122	0.03
GBP 927,697	Tesco Property Finance 4 5.801% 13/10/2040	1,097,761	0.01
GBP 2,024,000	Thames Water Kemble Finance 4.625% 19/5/2026*	2,195,786	0.03
EUR 1,200,000	Thames Water Utilities Finance 0.875% 31/1/2028	1,080,621	0.01
EUR 7,120,000	Thames Water Utilities Finance 4.375% 18/1/2031	7,417,563	0.10
GBP 307,458	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 4.489% 12/7/2063	370,640	0.01
GBP 157,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 4.739% 12/7/2063	185,532	0.00
GBP 107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5.039% 12/7/2063	123,809	0.00
GBP 145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 6.099% 20/9/2063	175,971	0.00
GBP 115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 7.099% 20/9/2063	141,005	0.00
GBP 364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 5.698% 21/7/2064	439,677	0.01
GBP 252,000	Tower Bridge Funding 2021-1 5.998% 21/7/2064	301,123	0.00
GBP 264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 4.899% 20/12/2063	302,643	0.00
GBP 312,000	Tower Bridge Funding 2023-1 5.628% 20/10/2064	378,824	0.01
GBP 211,000	Tower Bridge Funding 2023-1 6.578% 20/10/2064	255,915	0.00
GBP 237,000	Tower Bridge Funding 2023-1 7.728% 20/10/2064	288,246	0.00
GBP 1,590,000	Turbo Finance 9 5.583% 20/8/2028	1,930,675	0.02
GBP 488,000	Twin Bridges 2018-1 5.733% 12/9/2050	593,455	0.01
GBP 500,000	Twin Bridges 2020-1 5.564% 12/12/2054	609,499	0.01
GBP 390,000	Twin Bridges 2020-1 5.814% 12/12/2054	471,125	0.01
GBP 225,000	Twin Bridges 2020-1 6.564% 12/12/2054	271,598	0.00
GBP 436,000	Twin Bridges 2021-1 5.164% 12/3/2055	510,493	0.01
GBP 220,000	Twin Bridges 2021-1 5.664% 12/3/2055	253,808	0.00
GBP 641,485	Twin Bridges 2021-2 4.224% 12/9/2055	768,438	0.01
GBP 274,000	Twin Bridges 2021-2 4.464% 12/9/2055	321,317	0.00
GBP 435,000	Twin Bridges 2021-2 4.714% 12/9/2055	499,585	0.01
GBP 187,000	Twin Bridges 2021-2 5.064% 12/9/2055	203,618	0.00
GBP 90,135	Twin Bridges 2021-2 6.464% 12/9/2055	108,794	0.00
GBP 830,000	Twin Bridges 2022-1 4.864% 1/12/2055	939,730	0.01
GBP 365,000	Twin Bridges 2022-1 5.264% 1/12/2055	410,951	0.01
GBP 2,791,000	Twin Bridges 2022-2 5.564% 12/6/2055	3,328,880	0.04
GBP 1,736,688	Unique Pub Finance 5.659% 30/6/2027	2,099,630	0.03
GBP 1,097,000	Unique Pub Finance 6.464% 30/3/2032	1,334,738	0.02
GBP 436,109	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	536,683	0.01
USD 1,316,000	Vedanta Resources 6.125% 9/8/2024*	867,362	0.01
USD 3,887,000	Vedanta Resources Finance II 8.95% 11/3/2025	2,638,379	0.03
GBP 1,177,000	Very Funding 6.5% 1/8/2026*	1,144,844	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
英国(続き)			
GBP 1,625,000	Virgin Media Secured Finance 4.25% 15/1/2030*	1,580,713	0.02
GBP 581,000	Virgin Media Secured Finance 5% 15/4/2027	658,156	0.01
GBP 400,000	Virgin Media Secured Finance 5.25% 15/5/2029	420,456	0.01
USD 1,300,000	Virgin Media Secured Finance 5.5% 15/5/2029	1,175,083	0.01
EUR 4,484,000	Vmed O2 UK Financing I 3.25% 31/1/2031*	3,785,816	0.05
GBP 438,000	Vmed O2 UK Financing I 4% 31/1/2029	436,670	0.01
GBP 1,338,000	Vmed O2 UK Financing I 4.5% 15/7/2031	1,277,278	0.02
EUR 1,717,000	Vodafone 2.625% 27/8/2080	1,634,885	0.02
EUR 2,150,000	Vodafone 3% 27/8/2080	1,842,036	0.02
EUR 8,200,000	Vodafone 3.1% 3/1/2079	8,636,465	0.11
EUR 800,000	Vodafone 4.2% 3/10/2078	778,632	0.01
USD 2,200,000	Vodafone 6.25% 3/10/2078	2,142,206	0.03
		308,010,856	3.99
米国			
USD 460,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.142% 10/8/2035	409,999	0.01
USD 1,500,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.142% 10/8/2035	1,270,086	0.02
USD 300,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 4.142% 10/8/2035	271,778	0.00
USD 7,000,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 0.149% 5/6/2037	50,528	0.00
USD 320,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	259,979	0.00
USD 1,708,000	245 Park Avenue Trust 2017-245P 3.657% 5/6/2037	1,272,344	0.02
USD 1,070,000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6.117% 15/9/2034	1,005,787	0.01
USD 4,491,133	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust 6.7% 15/9/2034	4,109,588	0.05
USD 1,500,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	1,381,763	0.02
USD 365,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	342,585	0.00
USD 8,685,000	AbbVie 3.2% 21/11/2029	7,668,437	0.10
USD 776,792	AccessLex Institute 5.258% 25/5/2036	756,100	0.01
USD 2,091,668	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 4.877% 25/5/2037	374,986	0.01
USD 106,205	ACE Home Equity Loan Trust Series 2007-HE4 5.217% 25/5/2037	19,282	0.00
USD 1,297,000	Affinity Gaming 6.875% 15/12/2027	1,152,164	0.01
USD 340,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-1 3.675% 25/1/2045	171,479	0.00
USD 391,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-3 3.543% 25/4/2045	196,363	0.00
USD 273,000	Agate Bay Mortgage Trust 2015-4 3.523% 25/6/2045	116,907	0.00
USD 2,500,000	Air Lease 5.3% 1/2/2028	2,427,005	0.03
USD 35,904	Ajax Mortgage Loan Trust 2017-D 0% 25/12/2057	15,434	0.00
USD 59,280	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-A 0% 25/4/2058	59,102	0.00
USD 38,069	Ajax Mortgage Loan Trust 2018-B 0% 26/2/2057	31,082	0.00
USD 1,789,363	Ajax Mortgage Loan Trust 2019-G 3% 25/9/2059	1,769,639	0.02
USD 12,972,089	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-A 2.375% 25/12/2059	12,834,862	0.17
USD 897,295	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-C 2.25% 27/9/2060	876,516	0.01
USD 4,408,130	Ajax Mortgage Loan Trust 2020-D 2.25% 25/6/2060	4,242,221	0.05
USD 15,172,845	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-C 2.115% 25/1/2061	14,264,103	0.18
USD 29,182,665	Ajax Mortgage Loan Trust 2021-F 1.875% 25/6/2061	26,904,211	0.35
USD 1,678,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	1,418,530	0.02
USD 176,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	165,619	0.00
USD 130,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.875% 15/2/2030	116,729	0.00
USD 489,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	473,819	0.01
USD 1,327,000	Alexandria Real Estate Equities 2.95% 15/3/2034	1,064,283	0.01
USD 900,000	Alexandria Real Estate Equities 4.5% 30/7/2029	857,640	0.01
USD 403,000	Alexandria Real Estate Equities 4.75% 15/4/2035	380,770	0.01
USD 1,933,000	Alexandria Real Estate Equities 5.15% 15/4/2053	1,785,668	0.02
USD 1,043,000	Allegiant Travel 7.25% 15/8/2027	1,023,220	0.01
USD 9,893,000	Allegiant Travel 8.5% 5/2/2024	9,940,338	0.13

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 3,620,379	Alternative Loan Trust 2004-22CB 6.25% 25/10/2034	3,644,283	0.05
USD 2,027,736	Alternative Loan Trust 2005-22T1 4.967% 25/6/2035	1,710,227	0.02
USD 543,817	Alternative Loan Trust 2005-76 3.793% 25/2/2036	487,012	0.01
USD 2,716,339	Alternative Loan Trust 2005-J4 6.642% 25/7/2035	2,616,296	0.03
USD 3,476,121	Alternative Loan Trust 2006-11CB 6.5% 25/5/2036	1,842,104	0.02
USD 939,386	Alternative Loan Trust 2006-15CB 6.5% 25/6/2036	476,716	0.01
USD 1,518,429	Alternative Loan Trust 2006-23CB 5.017% 25/8/2036	338,082	0.00
USD 605,866	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.066% 20/11/2046	438,237	0.01
USD 2,796,959	Alternative Loan Trust 2006-J7 6.25% 25/11/2036	1,531,740	0.02
USD 393,592	Alternative Loan Trust 2006-OA11 4.997% 25/9/2046	341,085	0.00
USD 2,864,110	Alternative Loan Trust 2006-OA14 4.523% 25/11/2046	2,212,941	0.03
USD 3,137,390	Alternative Loan Trust 2006-OA16 5.297% 25/10/2046	2,263,584	0.03
USD 317,795	Alternative Loan Trust 2006-OA8 4.997% 25/7/2046	268,862	0.00
USD 2,459,425	Alternative Loan Trust 2006-OC10 5.077% 25/11/2036	2,094,564	0.03
USD 2,739,617	Alternative Loan Trust 2006-OC7 5.117% 25/7/2046	2,388,169	0.03
USD 3,180,022	Alternative Loan Trust 2007-25 6.5% 25/11/2037	1,602,874	0.02
USD 4,566,517	Alternative Loan Trust 2007-3T1 6% 25/4/2037	2,346,772	0.03
USD 2,683,876	Alternative Loan Trust 2007-9T1 6% 25/5/2037	1,404,016	0.02
USD 3,923	Alternative Loan Trust 2007-OA3 4.977% 25/4/2047	207	0.00
USD 177,005	Alternative Loan Trust 2007-OA8 4.977% 25/6/2047	131,505	0.00
USD 216,155	Alternative Loan Trust 2007-OH2 5.097% 25/8/2047	183,793	0.00
EUR 700,000	Altria 2.2% 15/6/2027	674,551	0.01
USD 4,345,000	Amazon.com 2.1% 12/5/2031	3,555,795	0.05
USD 3,300,000	Amazon.com 4.65% 1/12/2029	3,245,865	0.04
USD 4,690,000	Amazon.com 4.7% 1/12/2032	4,614,918	0.06
USD 671,973	Ambac Assurance 5.1% 7/6/2171	988,641	0.01
USD 750,000	American Express 4.05% 3/5/2029	709,046	0.01
USD 757,018	American Home Mortgage Assets Trust 2006-3 3.733% 25/10/2046	529,855	0.01
USD 1,573,912	American Home Mortgage Assets Trust 2006-4 4.827% 25/10/2046	853,553	0.01
USD 565,586	American Home Mortgage Assets Trust 2007-1 3.493% 25/2/2047	233,492	0.00
USD 1,876,000	American Homes 4 Rent 2014-SFR2 Trust 6.231% 17/10/2036	1,846,589	0.02
USD 4,719,947	American Homes 4 Rent 2015-SFR1 Trust 0% 17/4/2052	47	0.00
USD 1,285,000	American Municipal Power 7.834% 15/2/2041	1,621,957	0.02
EUR 2,750,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	2,497,073	0.03
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	957,689	0.01
EUR 1,600,000	American Tower 0.5% 15/1/2028	1,407,359	0.02
EUR 2,100,000	American Tower 1.95% 22/5/2026*	2,068,755	0.03
USD 750,000	American Tower 2.1% 15/6/2030	591,557	0.01
USD 4,000,000	American Tower 2.3% 15/9/2031	3,089,708	0.04
USD 2,540,000	American Tower 2.7% 15/4/2031	2,049,360	0.03
USD 1,000,000	American Tower 2.75% 15/1/2027	902,312	0.01
USD 1,346,000	American University/The 3.672% 1/4/2049	1,059,875	0.01
USD 2,445,000	American Water Capital 3.45% 1/6/2029	2,213,492	0.03
USD 2,000,000	Amgen 1.65% 15/8/2028	1,671,827	0.02
USD 750,000	Amgen 2% 15/1/2032	576,881	0.01
USD 3,250,000	Amgen 2.3% 25/2/2031	2,623,090	0.03
USD 1,320,000	Amgen 2.45% 21/2/2030	1,104,425	0.01
USD 800,000	Amgen 2.6% 19/8/2026	733,256	0.01
USD 1,000,000	Amgen 3% 22/2/2029	887,285	0.01
USD 6,315,000	Amgen 4.05% 18/8/2029	5,876,419	0.08
GBP 1,000,000	Amgen 5.5% 7/12/2026	1,230,391	0.02
USD 1,375,000	Amkor Technology 6.625% 15/9/2027	1,359,653	0.02
USD 7,450,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 3.5% 1/6/2030	6,773,470	0.09

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 2,750,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4.75% 23/1/2029	2,699,335	0.03
USD 7,196,726	APS Resecuritization Trust 2016-1 3.001% 31/7/2057	2,460,540	0.03
USD 977,507	APS Resecuritization Trust 2016-3 7.467% 27/9/2046	987,726	0.01
USD 150,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	138,447	0.00
EUR 841,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 2% 1/9/2028	731,369	0.01
EUR 416,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3% 1/9/2029	333,750	0.01
USD 3,103,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 3.25% 1/9/2028	2,609,632	0.03
USD 225,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 4% 1/9/2029	181,151	0.00
USD 703,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	677,854	0.01
EUR 2,490,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 2.125% 15/8/2026	2,291,855	0.03
GBP 1,840,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 4.75% 15/7/2027	1,748,130	0.02
USD 2,271,000	Ardagh Packaging Finance / Ardagh USA 5.25% 30/4/2025	2,190,730	0.03
USD 10,110,000	AREIT 2022-CRE7 6.806% 17/6/2039	9,998,492	0.13
USD 3,051,808	Argent Mortgage Loan Trust 2005-W1 5.097% 25/5/2035	2,666,590	0.03
USD 2,200,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 6.688% 15/4/2035	2,064,748	0.03
USD 6,712,000	Ashford Hospitality Trust 2018-ASHF 7.688% 15/4/2035	6,263,398	0.08
USD 578,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/8/2029	473,064	0.01
USD 1,520,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 4.625% 1/4/2030	1,224,766	0.02
USD 3,604,000	Ashton Woods USA / Ashton Woods Finance 6.625% 15/1/2028	3,269,457	0.04
USD 2,652,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	2,382,413	0.03
USD 2,965,000	AT&T 2.3% 1/6/2027	2,638,189	0.03
EUR 800,000	AT&T 2.875% 3/2/2025	793,226	0.01
GBP 2,000,000	AT&T 2.9% 4/12/2026	2,244,204	0.03
EUR 1,700,000	AT&T 3.15% 4/9/2036	1,546,477	0.02
USD 8,115,000	AT&T 4.1% 15/2/2028	7,733,655	0.10
GBP 1,000,000	AT&T 5.5% 15/3/2027	1,219,876	0.02
USD 4,207,972	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM 6.788% 15/12/2036	3,869,279	0.05
USD 1,595,000	Autodesk 2.85% 15/1/2030	1,365,175	0.02
USD 699,000	AvalonBay Communities 5% 15/2/2033	692,504	0.01
EUR 1,100,000	Avantor Funding 2.625% 1/11/2025	1,107,968	0.01
USD 1,001,000	Azul Investments 7.25% 15/6/2026	516,341	0.01
USD 1,867,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2015-200P 3.596% 14/4/2033	1,554,280	0.02
USD 5,860,000	Bamll Commercial Mortgage Trust 2016-SS1 0.561% 15/12/2035	77,297	0.00
USD 100,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 5.588% 15/11/2033	95,088	0.00
USD 3,273,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 5.988% 15/11/2033	3,036,467	0.04
USD 3,645,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6.088% 15/11/2032	3,294,858	0.04
USD 1,780,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2017-SCH 6.588% 15/11/2032	1,626,741	0.02
USD 160,000	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 5.938% 15/9/2034	156,155	0.00
USD 2,553,409	BAMLL Commercial Mortgage Trust 2018-DSNY 6.288% 15/9/2034	2,479,778	0.03
USD 939,000	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2015-UBS7 4.339% 15/9/2048	856,008	0.01
USD 222,724	Banc of America Funding 2006-A Trust 4.054% 20/2/2036	200,945	0.00
USD 13,200,882	Banc of America Funding 2014-R2 Trust 0% 26/11/2036	4,811,828	0.06
EUR 2,900,000	Bank of America 0.58% 8/8/2029*	2,509,432	0.03
EUR 2,810,000	Bank of America 0.583% 24/8/2028	2,523,741	0.03
EUR 1,700,000	Bank of America 0.808% 9/5/2026	1,677,227	0.02
EUR 3,800,000	Bank of America 1.381% 9/5/2030*	3,370,105	0.04
USD 341,000	Bank of America 1.658% 11/3/2027	303,160	0.00
USD 750,000	Bank of America 1.922% 24/10/2031	578,775	0.01
USD 2,415,000	Bank of America 2.299% 21/7/2032	1,882,157	0.02
USD 5,000,000	Bank of America 2.496% 13/2/2031	4,106,482	0.05
USD 2,355,000	Bank of America 2.572% 20/10/2032	1,866,842	0.02
USD 750,000	Bank of America 2.592% 29/4/2031	616,797	0.01
USD 2,415,000	Bank of America 2.651% 11/3/2032	1,954,552	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 1,500,000	Bank of America 2.687% 22/4/2032	1,213,867	0.02
USD 4,009,000	Bank of America 3.384% 2/4/2026	3,835,046	0.05
USD 361,000	Bank of America 3.5% 19/4/2026	343,833	0.00
USD 1,881,000	Bank of America 3.705% 24/4/2028	1,747,253	0.02
USD 775,000	Bank of America 3.824% 20/1/2028	727,319	0.01
USD 1,020,000	Bank of America 3.97% 5/3/2029	945,890	0.01
USD 1,020,000	Bank of America 3.974% 7/2/2030	930,839	0.01
USD 3,742,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	3,567,620	0.05
USD 4,720,000	Bank of America 4.827% 22/7/2026	4,644,583	0.06
USD 3,415,995	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2016-UBS10 4.838% 15/7/2049	3,095,644	0.04
USD 9,780,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 0.586% 15/2/2050	204,889	0.00
USD 4,000,000	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3 1.242% 15/2/2050	168,858	0.00
USD 1,700,000	Bank of New York Mellon 2.05% 26/1/2027	1,523,708	0.02
USD 5,750,000	Bank of New York Mellon 3.85% 26/4/2029	5,365,687	0.07
USD 3,047,000	Bank of New York Mellon 4.414% 24/7/2026	2,986,656	0.04
USD 1,500,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.07% 10/2/2022	440,525	0.01
USD 2,380,000	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust 7.33% 10/12/2025	577,021	0.01
USD 2,440,000	Baxter International 2.539% 1/2/2032	1,881,669	0.02
USD 1,725,000	Bay Area Toll Authority 6.918% 1/4/2040	2,053,478	0.03
USD 978,921	Bayview Commercial Asset Trust 2005-3 5.097% 25/11/2035	897,410	0.01
USD 1,716,148	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5.067% 25/1/2036	1,580,859	0.02
USD 41,676	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5.202% 25/1/2036	38,501	0.00
USD 110,143	Bayview Commercial Asset Trust 2005-4 5.292% 25/1/2036	101,083	0.00
USD 148,990	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.157% 25/4/2036	140,116	0.00
USD 428,346	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.217% 25/4/2036	384,192	0.01
USD 103,073	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.247% 25/4/2036	92,282	0.00
USD 563,410	Bayview Commercial Asset Trust 2006-1 5.397% 25/4/2036	505,473	0.01
USD 281,892	Bayview Commercial Asset Trust 2006-2 5.037% 25/7/2036	259,480	0.00
USD 499,259	Bayview Commercial Asset Trust 2006-3 4.992% 25/10/2036	469,666	0.01
USD 2,574,158	Bayview Commercial Asset Trust 2006-4 4.962% 25/12/2036	2,411,261	0.03
USD 2,001,286	Bayview Commercial Asset Trust 2007-1 5.022% 25/3/2037	1,822,682	0.02
USD 2,898,150	Bayview Commercial Asset Trust 2007-2 4.887% 25/7/2037	2,596,646	0.03
USD 4,539,931	Bayview Commercial Asset Trust 2007-4 5.067% 25/9/2037	4,181,497	0.05
USD 1,658,258	Bayview Commercial Asset Trust 2007-6 6.117% 25/12/2037	1,450,408	0.02
USD 1,824,985	Bayview Commercial Asset Trust 2008-2 7.117% 25/4/2038	1,791,159	0.02
USD 5,054,805	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 5.635% 28/5/2039	4,094,392	0.05
USD 1,289,904	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2004-B 5.935% 28/5/2039	916,761	0.01
USD 4,238,205	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-A 5.635% 28/2/2040	3,718,768	0.05
USD 376,237	Bayview Financial Revolving Asset Trust 2005-E 5.635% 28/12/2040	369,864	0.01
USD 8,312,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 7.213% 15/8/2036	8,228,932	0.11
USD 3,451,000	BBCMS 2017-DELC Mortgage Trust 8.213% 15/8/2036	3,378,744	0.04
USD 840,000	BBCMS 2018-CHRS Mortgage Trust 4.267% 5/8/2038	552,471	0.01
USD 877,000	BBCMS 2018-TALL Mortgage Trust 5.31% 15/3/2037	818,512	0.01
USD 11,710,000	BBCMS Trust 2015-SRCH 0.195% 10/8/2035	100,500	0.00
USD 19,372,253	BBCMS Trust 2015-SRCH 0.907% 10/8/2035	592,403	0.01
USD 1,167,499	BCAP 2011-RR5-I Trust 3.825% 28/5/2036	1,112,882	0.01
USD 1,816,171	BCAP Trust 2007-AA4 4.115% 25/6/2047	842,903	0.01
USD 1,627,547	BCMSC Trust 2000-A 7.575% 15/6/2030	228,207	0.00
USD 1,510,989	BCMSC Trust 2000-A 7.83% 15/6/2030	219,018	0.00
USD 1,089,739	BCMSC Trust 2000-A 8.29% 15/6/2030	167,266	0.00
USD 5,980,000	BDS 2022-FL12 6.7% 19/8/2038	5,939,740	0.08
USD 437,090	Bear Stearns ALT-A Trust 2006-6 4.937% 25/11/2036	351,203	0.00
USD 1,753,018	Bear Stearns ALT-A Trust 2007-1 4.937% 25/1/2047	1,387,961	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 52,356	Bear Stearns ARM Trust 2004-5 3.186% 25/7/2034	46,824	0.00
USD 32,098	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2004-HE7 6.342% 25/8/2034	31,605	0.00
USD 1,791,983	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-AC9 6.25% 25/12/2035	1,200,664	0.02
USD 1,914,674	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2005-HE8 6.567% 25/8/2035	1,871,126	0.02
USD 2,616,356	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-AC1 6.25% 25/2/2036	1,729,105	0.02
USD 1,350,964	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE1 4.632% 25/12/2035	1,958,699	0.03
USD 1,707,776	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE7 4.957% 25/9/2036	1,638,666	0.02
USD 720,000	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2006-HE8 5.137% 25/10/2036	598,948	0.01
USD 833,378	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 4.491% 25/3/2037	768,838	0.01
USD 461,589	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 4.646% 25/3/2037	425,006	0.01
USD 932,242	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE2 4.937% 25/3/2037	907,002	0.01
USD 376,352	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 4.368% 25/4/2037	521,513	0.01
USD 5,208,517	Bear Stearns Asset Backed I Trust 2007-HE3 4.368% 25/4/2037	5,168,241	0.07
USD 226,993	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2006-SL1 4.897% 25/8/2036	220,227	0.00
USD 248,520	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR2 4.787% 25/3/2037	225,742	0.00
USD 449,099	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR3 4.757% 25/3/2037	380,402	0.01
USD 304,560	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR4 4.827% 25/6/2037	277,643	0.00
USD 3,142,000	Beazer Homes USA 7.25% 15/10/2029	2,806,861	0.04
EUR 1,000,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	965,541	0.01
USD 2,875,000	Becton Dickinson 1.957% 11/2/2031	2,258,752	0.03
EUR 300,000	Belden 3.875% 15/3/2028	299,068	0.01
USD 2,000,000	Belton Independent School District 4% 15/2/2047	1,944,232	0.03
USD 5,012,995	BHMS 2018-ATLS 5.838% 15/7/2035	4,934,439	0.06
USD 4,161,000	BHMS 2018-ATLS 6.488% 15/7/2035	4,004,893	0.05
USD 464,000	Blue Racer Midstream / Blue Racer Finance 7.625% 15/12/2025	466,832	0.01
EUR 1,100,000	Booking 4% 15/11/2026	1,175,884	0.02
EUR 2,450,000	Booking 4.5% 15/11/2031	2,639,943	0.03
EUR 5,244,000	Boxer Parent 6.5% 2/10/2025	5,575,279	0.07
USD 4,109,000	Boyd Gaming 4.75% 1/12/2027	3,856,132	0.05
USD 5,612,000	Broadcom 2.45% 15/2/2031	4,421,391	0.06
USD 2,250,000	Broadcom 3.419% 15/4/2033	1,809,933	0.02
USD 1,410,000	Broadcom 4% 15/4/2029	1,273,871	0.02
USD 4,210,000	Broadcom 4.15% 15/11/2030	3,781,771	0.05
USD 1,500,000	Broadcom 4.3% 15/11/2032	1,323,812	0.02
USD 82,000	Buckeye Partners 3.95% 1/12/2026	72,457	0.00
USD 941,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	883,116	0.01
USD 1,500,000	Buckeye Partners 4.35% 15/10/2024	1,443,479	0.02
USD 1,584,492	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.454% 10/3/2033	1,473,708	0.02
USD 2,604,935	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.633% 10/3/2033	2,351,716	0.03
USD 13,358,641	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust 3.717% 10/3/2033	11,502,310	0.15
USD 573,000	BXP Trust 2017-CC 3.552% 13/8/2037	454,664	0.01
USD 2,156,000	BXP Trust 2017-CC 3.552% 13/8/2037	1,639,800	0.02
USD 470,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	383,136	0.01
USD 945,000	BXP Trust 2017-GM 3.425% 13/6/2039	740,572	0.01
USD 1,864,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	1,851,508	0.02
USD 414,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	417,985	0.01
USD 3,368,000	Caesars Entertainment 8.125% 1/7/2027	3,396,707	0.04
USD 1,970,000	California Pollution Control Financing Authority 5% 21/11/2045	1,972,381	0.03
USD 1,272,000	California Resources 7.125% 1/2/2026	1,281,922	0.02
USD 1,655,000	California State Public Works Board 8.361% 1/10/2034	2,035,563	0.03
USD 1,299,000	Calpine 5.125% 15/3/2028	1,154,329	0.01
USD 1,980,000	CAMB Commercial Mortgage Trust 2019-LIFE 6.738% 15/12/2037	1,946,403	0.03
USD 490,000	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC1 5.247% 25/1/2036	398,915	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 964,057	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC3 4.767% 25/8/2036	910,814	0.01
USD 345,809	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006-NC4 4.777% 25/10/2036	332,967	0.00
USD 2,655,932	Carrington Mortgage Loan Trust Series 2007-FRE1 4.877% 25/2/2037	2,475,595	0.03
USD 1,198,000	Carrols Restaurant 5.875% 1/7/2029*	900,111	0.01
EUR 1,768,000	Catalent Pharma Solutions 2.375% 1/3/2028	1,654,080	0.02
USD 1,270,000	CDI Escrow Issuer 5.75% 1/4/2030	1,177,804	0.02
USD 65,000	Cedar Fair 5.25% 15/7/2029	59,461	0.00
USD 1,400,000	Centene 4.625% 15/12/2029	1,280,986	0.02
USD 10,347,000	Centennial Resource Production 5.375% 15/1/2026*	9,766,504	0.13
USD 1,448,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	1,397,060	0.02
USD 9,621,000	Century Communities 6.75% 1/6/2027	9,380,513	0.12
USD 5,181,244	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C3 1.701% 10/1/2048	215,765	0.00
USD 5,189,832	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.691% 10/5/2058	103,624	0.00
USD 1,710,609	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C4 4.838% 10/5/2058	1,551,214	0.02
USD 1,462,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2017-C8 4.199% 15/6/2050	1,256,348	0.02
USD 1,825,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.25% 15/1/2029	1,460,764	0.02
USD 2,365,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 2.3% 1/2/2032	1,733,321	0.02
USD 1,784,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	1,636,293	0.02
USD 1,500,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 5.05% 30/3/2029	1,399,227	0.02
USD 9,503,139	Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-S6 6% 25/12/2037	4,328,497	0.06
USD 1,142,000	Cheever Escrow Issuer 7.125% 1/10/2027	1,097,485	0.01
EUR 600,000	Chemours 4% 15/5/2026	585,340	0.01
USD 874,000	Chesapeake Energy 5.5% 1/2/2026	857,547	0.01
USD 2,092,772	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA4 3.753% 25/4/2046	671,120	0.01
USD 362,123	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2006-OA5 5.017% 25/4/2046	335,739	0.00
USD 5,435,709	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2007-15 6.5% 25/9/2037	2,336,928	0.03
USD 68,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	61,957	0.00
USD 82,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	77,979	0.00
USD 1,032,773	Citicorp Mortgage Trust Series 2007-9 6.25% 25/12/2037	859,201	0.01
USD 1,073,029	Citicorp Mortgage Trust Series 2008-2 6.5% 25/6/2038	829,149	0.01
EUR 2,400,000	Citigroup 1.5% 24/7/2026	2,389,764	0.03
GBP 1,524,000	Citigroup 1.75% 23/10/2026	1,640,234	0.02
USD 3,165,000	Citigroup 2.561% 1/5/2032	2,535,962	0.03
USD 5,750,000	Citigroup 2.572% 3/6/2031	4,703,650	0.06
USD 3,165,000	Citigroup 2.666% 29/1/2031	2,625,541	0.03
USD 750,000	Citigroup 3.057% 25/1/2033	612,666	0.01
USD 6,950,000	Citigroup 3.07% 24/2/2028	6,309,576	0.08
USD 1,933,000	Citigroup 3.29% 17/3/2026	1,843,068	0.02
USD 124,000	Citigroup 3.4% 1/5/2026	116,993	0.00
USD 750,000	Citigroup 3.785% 17/3/2033	648,861	0.01
USD 375,000	Citigroup 3.98% 20/3/2030	341,331	0.00
EUR 2,300,000	Citigroup 4.112% 22/9/2033	2,352,440	0.03
USD 3,000,000	Citigroup 4.412% 31/3/2031	2,782,720	0.04
USD 1,500,000	Citigroup 6.27% 17/11/2033	1,565,653	0.02
USD 1,622,121	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 5.088% 11/3/2047	1,585,047	0.02
USD 3,807,859	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL2 4.817% 25/5/2037	2,608,425	0.03
USD 2,416,501	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AHL3 4.787% 25/7/2045	1,654,341	0.02
USD 2,082,362	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-AMC1 4.777% 25/12/2036	1,169,267	0.02
USD 2,791,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2007-WFHE2 5.322% 25/3/2037	2,607,286	0.03
USD 597,000	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-C 4.25% 25/2/2054	537,783	0.01
USD 262,385	CitiMortgage Alternative Loan Trust Series 2007-A6 6% 25/6/2037	226,109	0.00
USD 2,865,000	City of Charlotte NC Airport Revenue 3% 1/7/2046	2,232,504	0.03
USD 1,055,000	City of Riverside CA Electric Revenue 7.605% 1/10/2040	1,295,033	0.02

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 3,015,000	City of Salt Lake City UT Airport Revenue 5% 1/7/2046	3,094,335	0.04
USD 206,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	183,096	0.00
USD 2,000,000	Clorox 3.9% 15/5/2028	1,892,884	0.02
USD 7,715,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	6,712,842	0.09
USD 677,000	Colgate Energy Partners III 5.875% 1/7/2029	607,824	0.01
USD 379,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	375,621	0.00
USD 2,490,000	Colorado Health Facilities Authority 4% 15/11/2046	2,294,185	0.03
USD 321,000	Comcast 1.95% 15/1/2031	256,459	0.00
USD 1,500,000	Comcast 2.35% 15/1/2027	1,357,608	0.02
USD 1,750,000	Comcast 3.3% 1/2/2027	1,641,140	0.02
USD 3,250,000	Comcast 3.4% 1/4/2030	2,927,892	0.04
USD 156,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	145,002	0.00
USD 1,630,000	Comcast 4.15% 15/10/2028	1,555,568	0.02
USD 2,736,000	Comcast 4.65% 15/2/2033	2,632,010	0.03
USD 405,000	Comcast 5.5% 15/11/2032	415,222	0.01
USD 100,000	COMM 2013-300P Mortgage Trust 4.394% 10/8/2030	91,901	0.00
USD 323,283	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust 4.672% 10/2/2047	310,637	0.00
USD 1,265,000	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 4.514% 10/9/2047	1,188,719	0.02
USD 2,691,000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 4.345% 10/8/2048	2,538,788	0.03
USD 4,054,596	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 0.799% 10/8/2048	65,438	0.00
USD 1,024,500	COMM 2015-CCRE25 Mortgage Trust 4.517% 10/8/2048	932,163	0.01
USD 1,316,780	COMM 2015-LC23 Mortgage Trust 3.774% 10/10/2048	1,257,277	0.02
USD 111,320,422	COMM 2016-667M Mortgage Trust 0.039% 10/10/2036	285,893	0.00
USD 1,100,000	COMM 2016-667M Mortgage Trust 3.179% 10/10/2036	861,961	0.01
USD 2,910,275	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust 1.75% 10/5/2051	200,718	0.00
USD 5,105,000	Commercial Metals 4.125% 15/1/2030	4,455,375	0.06
USD 1,857,000	Commercial Metals 4.375% 15/3/2032	1,604,364	0.02
USD 425,000	Commonwealth Financing Authority 4.144% 1/6/2038	385,574	0.01
USD 295,000	Commonwealth of Massachusetts 2.9% 1/9/2049	210,506	0.00
USD 1,880,000	Commonwealth of Massachusetts 5% 1/9/2049	2,025,139	0.03
USD 235,000	Commonwealth of Massachusetts 5.456% 1/12/2039	243,162	0.00
USD 5,223,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	4,864,702	0.06
USD 37,487	Conseco Finance 6.28% 1/9/2030	37,497	0.00
USD 465,238	Conseco Finance 6.63% 1/6/2030	434,420	0.01
USD 209,279	Conseco Finance 6.83% 1/4/2030	203,026	0.00
USD 2,049,303	Conseco Finance 6.98% 1/9/2030	1,841,629	0.02
USD 405,430	Conseco Finance 7.21% 15/1/2029	377,790	0.01
USD 801,948	Conseco Finance 7.5% 1/3/2030	329,034	0.00
USD 701,829	Conseco Finance 7.53% 15/3/2028	701,787	0.01
USD 747,737	Conseco Finance 7.86% 1/3/2030	318,826	0.00
USD 1,776,275	Conseco Finance Securitizations 7.96% 1/5/2031	564,066	0.01
USD 1,191,186	Conseco Finance Securitizations 8.06% 1/9/2029	264,260	0.00
USD 3,232,846	Conseco Finance Securitizations 8.2% 1/5/2031	1,056,841	0.01
USD 1,472,272	Conseco Finance Securitizations 8.31% 1/5/2032	322,503	0.00
USD 415,000	Conservation Fund A Nonprofit 3.474% 15/12/2029	352,766	0.00
USD 850,000	Contra Costa Community College District 6.504% 1/8/2034	943,584	0.01
EUR 2,073,000	Coty 3.875% 15/4/2026*	2,094,465	0.03
EUR 300,000	Coty 4.75% 15/4/2026*	311,063	0.00
USD 1,623,868	Countrywide Asset-Backed Certificates 4.889% 25/5/2037	1,227,339	0.02
USD 4,800,000	Countrywide Asset-Backed Certificates 5.052% 25/11/2036	4,437,671	0.06
USD 850,000	County of Broward FL Airport System Revenue 2.914% 1/10/2032	710,537	0.01
USD 2,090,000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 2.529% 1/10/2030	1,760,837	0.02
USD 835,000	County of Montgomery MD 4% 1/12/2044	801,845	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 1,588,000	Covanta 4.875% 1/12/2029	1,343,193	0.02
USD 2,820	Credit Suisse First Boston Mortgage 4.877% 15/4/2037	2,717	0.00
USD 7,508,433	Credit Suisse Mortgage Capital Certificates 6.5% 27/10/2037	3,113,054	0.04
USD 294,719	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 3.035% 25/12/2036	237,567	0.00
USD 1,465,226	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 4.384% 25/7/2037	988,998	0.01
USD 3,399,361	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.056% 25/9/2036	206,921	0.00
USD 551,037	Credit-Based Asset Servicing and Securitization 6.75% 25/10/2036	523,729	0.01
USD 6,250,000	Crown Castle 2.5% 15/7/2031	5,021,377	0.06
USD 2,040,000	Crown Castle 3.1% 15/11/2029	1,766,805	0.02
USD 1,300,000	Crown Castle 4.3% 15/2/2029	1,219,498	0.02
USD 2,561,000	Crown Castle 5% 11/1/2028	2,518,006	0.03
USD 728,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	703,170	0.01
USD 19,163,000	CSAIL 2017-CX10 Commercial Mortgage Trust 0.174% 15/11/2050	202,539	0.00
USD 2,494,000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust 4.739% 15/8/2051	2,068,961	0.03
USD 563,000	CSC 5.25% 1/6/2024	548,165	0.01
USD 116,659,107	CSMC 2014-USA OA 0.04% 15/9/2037	229,212	0.00
USD 770,000	CSMC 2017-TIME 3.646% 13/11/2039	644,915	0.01
USD 9,060	CSMC Series 2014-11R 3.812% 27/9/2047	9,060	0.00
USD 499,436	CSMC Series 2014-4R 5.919% 27/2/2036	530,448	0.01
USD 1,286,303	CSMC Series 2015-4R 4.114% 27/10/2036	920,176	0.01
USD 790,000	CSMC Trust 2017-PFHP 5.538% 15/12/2030	790,265	0.01
USD 815,000	CVS Health 1.3% 21/8/2027	685,262	0.01
USD 5,037,000	CVS Health 1.75% 21/8/2030	3,921,929	0.05
USD 4,590,000	CVS Health 1.875% 28/2/2031	3,551,777	0.05
USD 500,000	CVS Health 2.875% 1/6/2026	464,453	0.01
USD 815,000	CVS Health 3.625% 1/4/2027	765,526	0.01
USD 2,175,000	CVS Health 3.75% 1/4/2030	1,956,680	0.03
USD 4,008,407	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-16 4.561% 25/4/2036	3,466,125	0.05
USD 2,940,867	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005-17 6.547% 25/5/2036	2,366,260	0.03
USD 17,892	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 4.777% 25/9/2046	17,829	0.00
USD 844,263	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-11 4.877% 25/12/2036	774,463	0.01
USD 6,169,226	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2006-18 5.067% 25/3/2037	2,660,551	0.03
USD 217,561	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-U 4.858% 15/3/2034	209,889	0.00
USD 164,031	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S3 5.785% 25/1/2029	239,185	0.00
USD 82,849	CWHEQ Home Equity Loan Trust Series 2006-S5 6.155% 25/6/2035	98,725	0.00
USD 601,480	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 4.778% 15/5/2035	595,139	0.01
USD 43,309	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust Series 2006-RES 4.778% 15/5/2035	42,432	0.00
USD 152,997	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-B 4.768% 15/5/2035	150,729	0.00
USD 713,009	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-C 4.768% 15/5/2036	684,744	0.01
USD 374,281	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-H 4.738% 15/11/2036	363,653	0.01
USD 650,000	Dallas Fort Worth International Airport 3.144% 1/11/2045	503,284	0.01
USD 417,000	Dana 4.25% 1/9/2030	335,043	0.00
USD 3,655,051	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 5.888% 15/5/2035	3,590,635	0.05
USD 3,207,307	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 6.588% 15/5/2035	3,119,365	0.04
USD 4,389,268	DBJPM 2017-C6 Mortgage Trust 1% 10/6/2050	148,732	0.00
USD 6,941,235	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.53% 10/10/2034	6,188,376	0.08
USD 2,469,265	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.53% 10/10/2034	2,183,757	0.03
USD 1,080,000	DBUBS 2017-BRBK Mortgage Trust 3.53% 10/10/2034	976,057	0.01
USD 3,165,000	Dell International / EMC 5.75% 1/2/2033	3,040,516	0.04
USD 2,747,000	Dell International / EMC 6.02% 15/6/2026	2,775,016	0.04
USD 4,611,036	Deutsche Alt-A Mortgage Loan Trust Series 2007-OA4/DE 4.957% 25/8/2047	3,951,704	0.05
USD 166,507	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.364% 25/7/2036	137,812	0.00
USD 260,854	Deutsche Alt-B Mortgage Loan Trust Series 2006-AB3 6.51% 25/7/2036	215,874	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 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2034	935,130	0.01
USD 900,000	District of Columbia 5% 15/7/2035	930,748	0.01
USD 1,795,000	DocuSign 0% 15/1/2024	1,713,322	0.02
USD 2,150,000	Dollar General 3.5% 3/4/2030	1,916,822	0.02
EUR 4,200,000	Duke Energy 3.1% 15/6/2028	4,194,252	0.05
USD 3,989,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	3,823,835	0.05
USD 4,750,000	Eaton 4.15% 15/3/2033	4,357,706	0.06
USD 4,500,000	Ecolab 2.125% 1/2/2032	3,572,214	0.05
USD 2,000,000	Ecolab 5.25% 15/1/2028	2,016,683	0.03
USD 750,000	Edison International 6.95% 15/11/2029	786,178	0.01
USD 3,426,000	Elevance Health 1.5% 15/3/2026	3,060,730	0.04
USD 4,555,000	Elevance Health 2.55% 15/3/2031	3,762,889	0.05
USD 1,750,000	Elevance Health 2.875% 15/9/2029	1,519,237	0.02
USD 715,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	670,197	0.01
USD 750,000	Elevance Health 4.1% 15/5/2032	685,443	0.01
USD 1,260,000	Elmwood CLO 15 5.993% 22/4/2035	1,253,585	0.02
USD 2,750,000	Elmwood CLO 15 8.323% 22/4/2035	2,626,743	0.03
GBP 791,000	Encore Capital 4.25% 1/6/2028	766,874	0.01
EUR 1,725,000	Encore Capital 4.875% 15/10/2025*	1,714,843	0.02
GBP 600,000	Encore Capital 5.375% 15/2/2026	660,131	0.01
USD 1,862,000	Energy Transfer 4.2% 15/9/2023	1,849,496	0.02
USD 1,500,000	Enterprise Products Operating 2.8% 31/1/2030	1,281,622	0.02
USD 750,000	Enterprise Products Operating 3.125% 31/7/2029	660,268	0.01
USD 900,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2027	875,181	0.01
USD 215,000	EQM Midstream Partners 7.5% 1/6/2030	205,324	0.00
USD 1,700,000	Equinix 2.5% 15/5/2031	1,352,176	0.02
USD 1,595,000	Equinix 2.95% 15/9/2051	988,563	0.01
USD 2,020,000	Equinix 3.2% 18/11/2029	1,757,825	0.02
USD 5,165,000	Equinix 3.9% 15/4/2032	4,543,510	0.06
USD 1,118,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	1,015,455	0.01
USD 165,000	Expedia 2.95% 15/3/2031	132,139	0.00
USD 8,558,108	Fannie Mae Interest Strip 2% 25/1/2052	1,133,717	0.01
USD 11,130,868	Fannie Mae Interest Strip 2% 25/3/2052	1,472,529	0.02
USD 9,419,139	Fannie Mae Interest Strip 3% 25/10/2049	1,499,415	0.02
USD 9,723,330	Fannie Mae Pool 2.5% 1/2/2051	8,294,461	0.11
USD 1,035,255	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	925,788	0.01
USD 1,511,778	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2051	1,337,907	0.02
USD 22,448,634	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2051	19,737,260	0.25
USD 1,496,204	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2051	1,323,441	0.02
USD 42,634,749	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2052	37,471,246	0.48
USD 207,491	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2052	182,533	0.00
USD 7,807,443	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2052	6,862,243	0.09
USD 2,216,199	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2052	1,957,913	0.03
USD 20,013,279	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	17,589,749	0.23
USD 213,465	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2052	187,756	0.00
USD 3,700,914	Fannie Mae Pool 3.5% 1/1/2048	3,454,326	0.04
USD 1,838,606	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	1,690,293	0.02
USD 76,977	Fannie Mae Pool 3.5% 1/2/2050	70,846	0.00
USD 1,343,428	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	1,236,056	0.02
USD 3,439,832	Fannie Mae Pool 3.5% 1/11/2050	3,175,218	0.04
USD 10,716,271	Fannie Mae Pool 3.5% 1/12/2050	9,912,446	0.13
USD 64,518	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2051	59,363	0.00
USD 50,715	Fannie Mae Pool 3.5% 1/6/2051	46,663	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 54,729	Fannie Mae Pool 3.5% 1/7/2051	50,261	0.00
USD 54,447	Fannie Mae Pool 3.5% 1/8/2051	50,009	0.00
USD 13,357,417	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	12,288,412	0.16
USD 6,847,976	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	6,269,012	0.08
USD 3,770,608	Fannie Mae Pool 3.5% 1/3/2052	3,439,577	0.04
USD 10,996,229	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	10,101,886	0.13
USD 6,974,727	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	6,394,140	0.08
USD 6,029,063	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2052	5,546,551	0.07
USD 656,423	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2048	626,463	0.01
USD 747,572	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2048	713,446	0.01
USD 539,467	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2048	514,879	0.01
USD 542,904	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2048	515,956	0.01
USD 1,593,515	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2048	1,517,056	0.02
USD 14,272,194	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2049	13,587,644	0.18
USD 4,433,596	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2050	4,183,672	0.05
USD 234,844	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	222,681	0.00
USD 1,561,081	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2050	1,476,551	0.02
USD 5,971,161	Fannie Mae Pool 4% 1/5/2050	5,683,505	0.07
USD 1,782,651	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2050	1,684,812	0.02
USD 361,808	Fannie Mae Pool 4% 1/11/2050	342,138	0.00
USD 37,087,641	Fannie Mae Pool 4% 1/1/2051	35,173,274	0.45
USD 41,998,207	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2051	39,778,027	0.51
USD 5,345,775	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2051	5,046,389	0.07
USD 20,341,675	Fannie Mae Pool 4% 1/10/2051	19,327,445	0.25
USD 544,964	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2052	520,015	0.01
USD 1,169,190	Fannie Mae REMICS 3% 25/2/2052	150,630	0.00
USD 3,670,310	Fannie Mae REMICS 3.5% 25/1/2051	640,533	0.01
USD 3,224,594	Fannie Mae REMICS 4% 25/5/2050	636,056	0.01
USD 11,109,903	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	2,163,055	0.03
USD 1,967,161	Fannie Mae REMICS 4% 25/11/2050	385,864	0.01
USD 3,224,793	Fannie Mae REMICS 4% 25/6/2051	625,776	0.01
USD 4,359,463	Fannie Mae REMICS 4% 25/8/2051	814,253	0.01
EUR 1,000,000	Fidelity National Information Services 0.625% 3/12/2025	970,652	0.01
EUR 4,200,000	Fidelity National Information Services 1.5% 21/5/2027	4,008,742	0.05
USD 5,500,000	Fifth Third Bancorp 4.772% 28/7/2030	5,269,356	0.07
USD 799,734	First Franklin Mortgage Loan Trust 2004-FFH3 5.667% 25/10/2034	734,539	0.01
USD 1,434,089	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 4.857% 25/10/2036	972,301	0.01
USD 840,987	First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF13 4.937% 25/10/2036	574,024	0.01
USD 5,360,736	First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-FF2 4.757% 25/3/2037	2,919,833	0.04
EUR 769,000	Fiserv 1.625% 1/7/2030	682,416	0.01
USD 850,000	Fiserv 3.5% 1/7/2029	758,437	0.01
USD 245,000	Fiserv 3.8% 1/10/2023	242,674	0.00
USD 7,341,000	Five Point Operating / Five Point Capital 7.875% 15/11/2025	6,648,545	0.09
USD 3,184,461	Flagstar Mortgage Trust 2018-6RR 4.923% 25/10/2048	2,729,514	0.04
USD 1,144,000	Ford Motor 3.25% 12/2/2032	867,724	0.01
USD 2,667,000	Ford Motor 6.1% 19/8/2032	2,502,878	0.03
GBP 2,130,000	Ford Motor Credit 4.535% 6/3/2025	2,488,905	0.03
EUR 2,025,000	Ford Motor Credit 4.867% 3/8/2027	2,103,405	0.03
USD 1,579,000	Ford Motor Credit 5.584% 18/3/2024	1,565,023	0.02
USD 739,000	Forestar 3.85% 15/5/2026	647,148	0.01
USD 5,361,000	Forestar 5% 1/3/2028	4,625,930	0.06
USD 18,607,537	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.805% 25/5/2029	704,139	0.01
USD 30,127,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.892% 25/6/2029	1,440,649	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 6,925,467	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.024% 25/10/2030	408,366	0.01
USD 3,380,000	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 1.364% 25/12/2029	214,979	0.00
USD 586,844	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2050	523,031	0.01
USD 4,879,550	Freddie Mac Pool 3% 1/6/2051	4,318,147	0.06
USD 1,099,216	Freddie Mac Pool 3% 1/7/2051	968,210	0.01
USD 9,384,736	Freddie Mac Pool 3% 1/8/2051	8,239,782	0.11
USD 8,475	Freddie Mac Pool 3% 1/10/2051	7,523	0.00
USD 2,764,459	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	2,462,060	0.03
USD 13,191,994	Freddie Mac Pool 3% 1/11/2051	11,748,757	0.15
USD 5,945,147	Freddie Mac Pool 3% 1/12/2051	5,294,522	0.07
USD 4,926,918	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	4,398,155	0.06
USD 1,667,568	Freddie Mac Pool 3% 1/1/2052	1,466,992	0.02
USD 26,207,888	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	23,393,964	0.30
USD 6,586,724	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	5,819,308	0.08
USD 38,250,630	Freddie Mac Pool 3% 1/2/2052	33,619,628	0.43
USD 67,412	Freddie Mac Pool 3.5% 1/6/2051	61,911	0.00
USD 46,141	Freddie Mac Pool 3.5% 1/8/2051	42,379	0.00
USD 14,262,137	Freddie Mac Pool 4% 1/3/2050	13,640,044	0.18
USD 8,236,738	Freddie Mac Pool 4% 1/5/2050	7,769,676	0.10
USD 1,345,289	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2050	201,348	0.00
USD 7,065,607	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2050	1,143,388	0.01
USD 3,470,992	Freddie Mac REMICS 3% 25/3/2051	555,617	0.01
USD 2,919,795	Freddie Mac REMICS 3% 25/6/2051	473,729	0.01
USD 3,396,294	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	505,262	0.01
USD 1,343,866	Freddie Mac REMICS 3% 25/9/2051	188,202	0.00
USD 2,765,340	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	518,081	0.01
USD 3,661,075	Freddie Mac REMICS 3% 25/10/2051	467,212	0.01
USD 1,807,533	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	321,998	0.00
USD 3,897,086	Freddie Mac REMICS 3% 25/11/2051	590,604	0.01
USD 6,082,844	Freddie Mac REMICS 3% 25/2/2052	922,752	0.01
USD 8,439,918	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/6/2051	1,501,301	0.02
USD 4,038,250	Freddie Mac REMICS 3.5% 25/10/2051	732,712	0.01
USD 1,347,649	Freddie Mac REMICS 4% 25/7/2049	211,413	0.00
USD 1,113,427	Freddie Mac REMICS 4% 25/9/2050	218,325	0.00
USD 5,139,155	Freddie Mac REMICS 4% 25/12/2050	999,342	0.01
USD 1,408,597	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/6/2050	257,362	0.00
USD 1,526,757	Freddie Mac REMICS 4.5% 25/10/2050	324,751	0.00
USD 4,655,448	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 7.884% 25/1/2042	4,314,113	0.06
USD 26,083,744	Freddie Mac Strips 2% 15/6/2052	3,339,937	0.04
USD 1,538,279	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 9.067% 25/3/2030	1,633,662	0.02
USD 401,519	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 12.567% 25/5/2025	406,219	0.01
USD 227,145	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes 16.117% 25/1/2025	233,575	0.00
USD 2,286,000	Freedom Mortgage 8.125% 15/11/2024	2,202,330	0.03
USD 1,532,000	Freedom Mortgage 8.25% 15/4/2025	1,457,621	0.02
USD 2,167,000	Freeport-McMoRan 3.875% 15/3/2023	2,167,650	0.03
USD 1,490,000	Freeport-McMoRan 5.4% 14/11/2034	1,403,141	0.02
USD 782,435	FREMF 2017-KGS1 Mortgage Trust 3.595% 25/10/2027	711,624	0.01
USD 4,972,000	FREMF 2018-KW05 Trust 3.786% 25/4/2028	4,163,922	0.05
USD 83,372,297	FREMF 2019-KW08 Mortgage Trust 0.1% 25/1/2029	344,774	0.00
USD 2,937,893	Fremont Home Loan Trust 2006-3 4.897% 25/2/2037	2,297,347	0.03
USD 2,621,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	2,322,232	0.03
USD 4,000,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	3,729,989	0.05
USD 3,147,000	Frontier Communications 6.75% 1/5/2029	2,656,634	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 3,470,000	Frontier Communications 8.75% 15/5/2030	3,516,498	0.05
USD 4,700,000	Frontier Florida 6.86% 1/2/2028	4,343,327	0.06
USD 1,125,000	Frontier North 6.73% 15/2/2028	1,033,599	0.01
USD 15,753,000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer 7.144% 17/8/2037	15,761,396	0.20
USD 776,000	Full House Resorts 8.25% 15/2/2028	746,109	0.01
USD 2,277,330	GAM Resecuritization Trust 2018-B 5.5% 27/8/2051	2,138,707	0.03
USD 205,000	Garden Spinco 8.625% 20/7/2030	216,788	0.00
USD 2,453,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	2,406,775	0.03
USD 1,755,000	Gen Digital 7.125% 30/9/2030	1,708,089	0.02
EUR 1,000,000	General Mills 0.125% 15/11/2025	964,013	0.01
USD 750,000	General Mills 2.875% 15/4/2030	646,606	0.01
USD 800,000	General Mills 4.2% 17/4/2028	766,396	0.01
USD 3,500,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	3,088,364	0.04
USD 1,000,000	Georgia-Pacific 2.3% 30/4/2030	833,830	0.01
USD 1,950,000	Gilead Sciences 1.65% 1/10/2030	1,537,609	0.02
USD 2,000,000	Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026	1,908,768	0.02
USD 1,145,000	Global Payments 4% 1/6/2023	1,140,758	0.01
USD 2,250,000	GLP Capital / GLP Financing II 3.35% 1/9/2024	2,160,574	0.03
USD 1,086,000	GLP Capital / GLP Financing II 4% 15/1/2031	930,703	0.01
USD 904,000	Golden Entertainment 7.625% 15/4/2026	904,956	0.01
EUR 6,400,000	Goldman Sachs 0.875% 9/5/2029	5,486,403	0.07
USD 3,340,000	Goldman Sachs 1.093% 9/12/2026	2,939,039	0.04
EUR 11,156,000	Goldman Sachs 1.25% 7/2/2029	9,897,829	0.13
USD 1,709,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,505,005	0.02
USD 6,500,000	Goldman Sachs 1.542% 10/9/2027	5,628,032	0.07
USD 1,510,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	1,321,496	0.02
USD 1,500,000	Goldman Sachs 1.992% 27/1/2032	1,149,252	0.01
USD 750,000	Goldman Sachs 2.383% 21/7/2032	586,416	0.01
USD 1,125,000	Goldman Sachs 2.615% 22/4/2032	900,018	0.01
USD 4,250,000	Goldman Sachs 2.65% 21/10/2032	3,370,348	0.04
USD 4,633,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	4,299,129	0.06
GBP 1,000,000	Goldman Sachs 7.25% 10/4/2028	1,306,455	0.02
USD 4,891,678	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-3 2.1% 20/5/2048	3,867,259	0.05
USD 3,551,166	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	2,814,381	0.04
USD 8,588,000	GoTo 5.5% 1/9/2027	4,174,670	0.05
USD 4,201,082	Government National Mortgage Association 0.277% 16/10/2054	51,139	0.00
USD 2,468,505	Government National Mortgage Association 0.524% 16/9/2053	35,035	0.00
USD 6,004,772	Government National Mortgage Association 0.525% 16/3/2055	101,503	0.00
USD 2,872,043	Government National Mortgage Association 0.598% 16/9/2055	64,515	0.00
USD 474,353	Government National Mortgage Association 0.622% 16/10/2056	12,301	0.00
USD 640,478	Government National Mortgage Association 0.686% 16/8/2057	17,798	0.00
USD 2,889,701	Government National Mortgage Association 0.771% 16/12/2057	99,877	0.00
USD 397,705	Government National Mortgage Association 0.909% 16/2/2050	9,332	0.00
USD 3,445,103	Government National Mortgage Association 2.5% 20/9/2050	443,795	0.01
USD 14,905,290	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	1,901,641	0.02
USD 3,015,262	Government National Mortgage Association 2.5% 20/10/2050	378,186	0.00
USD 1,013,238	Government National Mortgage Association 2.5% 20/11/2050	124,807	0.00
USD 3,657,468	Government National Mortgage Association 2.5% 20/12/2050	472,257	0.01
USD 1,635,965	Government National Mortgage Association 3% 20/8/2050	231,486	0.00
USD 1,592,016	Government National Mortgage Association 3% 20/4/2051	225,267	0.00
USD 2,854,653	Government National Mortgage Association 3% 20/6/2051	403,929	0.01
USD 2,168,374	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	280,388	0.00
USD 1,291,873	Government National Mortgage Association 3% 20/12/2051	165,647	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 1,918,693	Government National Mortgage Association 3.5% 20/1/2051	324,563	0.00
USD 2,856,151	Government National Mortgage Association 3.5% 20/10/2051	405,894	0.01
USD 1,397,499	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	195,541	0.00
USD 1,280,991	Government National Mortgage Association 3.5% 20/11/2051	178,619	0.00
USD 2,606,589	Government National Mortgage Association 3.5% 20/12/2051	403,584	0.01
USD 1,943,013	Government National Mortgage Association 4% 20/5/2051	303,443	0.00
USD 1,212,501	Government National Mortgage Association 4% 20/9/2051	193,318	0.00
USD 2,797,807	Government National Mortgage Association 4% 20/12/2051	439,950	0.01
USD 731,000	Grand Canyon University 3.25% 1/10/2023	721,863	0.01
USD 2,102,000	Grand Canyon University 5.125% 1/10/2028	1,928,585	0.02
EUR 316,000	Graphic Packaging International 2.625% 1/2/2029*	293,089	0.00
USD 452,341	Greenpoint Manufactured Housing 8.29% 15/12/2029	448,958	0.01
USD 818,703	GreenPoint Mortgage Funding Trust 2006-AR2 4.793% 25/3/2036	784,449	0.01
USD 440,000	GS Mortgage II 3.475% 10/9/2037	393,226	0.01
USD 25,000,000	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 0.207% 3/5/2032	132,900	0.00
USD 2,452,265	GS Mortgage II Series 2005-ROCK 5.366% 3/5/2032	2,391,970	0.03
USD 110,000	GS Mortgage Trust 2014-GC20 4.529% 10/4/2047	105,199	0.00
USD 730,000	GS Mortgage Trust 2015-590M 3.805% 10/10/2035	631,208	0.01
USD 1,455,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 4.411% 10/7/2048	1,325,157	0.02
USD 2,170,000	GS Mortgage Trust 2017-GPTX 2.856% 10/5/2034	2,038,267	0.03
USD 9,945,604	GSAA Home Equity Trust 2006-5 4.977% 25/3/2036	3,210,862	0.04
USD 422,068	GSAA Home Equity Trust 2007-2 5.917% 25/3/2037	87,117	0.00
USD 910,228	GSAMP Trust 2007-HI 5.017% 25/1/2047	472,411	0.01
USD 2,000,000	GSAMP Trust 2007-HSBC1 7.992% 25/2/2047	1,884,779	0.02
USD 799,272	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP1 4.967% 25/1/2035	672,775	0.01
USD 2,963,716	GSMPs Mortgage Loan Trust 2005-RP2 4.967% 25/3/2035	2,602,329	0.03
USD 762,108	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1 4.967% 25/1/2036	624,757	0.01
USD 1,667,808	GSR Mortgage Loan Trust 2006-7F 6.5% 25/8/2036	610,144	0.01
USD 495,430	GSR Mortgage Loan Trust 2007-1F 5.5% 25/1/2037	610,037	0.01
USD 4,023,832	GSR Mortgage Loan Trust 2007-OA2 2.58% 25/6/2047	2,543,182	0.03
USD 1,734,000	GUSAP III 4.25% 21/1/2030*	1,597,183	0.02
USD 2,377,000	GXO Logistics 2.65% 15/7/2031	1,800,514	0.02
USD 7,000,569	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-12 5.001% 19/12/2036	5,842,315	0.08
USD 379,080	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-4 4.841% 19/7/2047	336,061	0.00
USD 2,800,000	Hays Consolidated Independent School District 4% 15/2/2047	2,651,404	0.03
USD 1,328,000	HCA 3.125% 15/3/2027	1,207,599	0.02
USD 1,400,000	HCA 3.5% 1/9/2030	1,198,406	0.02
USD 1,000,000	HCA 3.625% 15/3/2032	842,535	0.01
USD 4,700,000	HCA 4.5% 15/2/2027	4,499,274	0.06
USD 2,452,000	HCA 5.375% 1/2/2025	2,430,171	0.03
USD 2,045,000	HCA 5.875% 1/2/2029	2,039,496	0.03
USD 1,000,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	869,978	0.01
USD 684,000	Healthpeak Properties Interim 5.25% 15/12/2032	669,766	0.01
USD 6,200,000	Home Depot 1.375% 15/3/2031	4,746,745	0.06
USD 3,000,000	Home Depot 2.95% 15/6/2029	2,673,577	0.03
USD 5,250,000	Home Depot 4.5% 15/9/2032*	5,045,383	0.07
USD 1,190,000	Home Equity Asset Trust 2006-3 5.217% 25/7/2036	1,068,736	0.01
USD 1,483,127	Home Equity Asset Trust 2007-1 4.917% 25/5/2037	1,113,008	0.01
USD 6,687,154	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2006-E 4.787% 25/4/2037	4,707,281	0.06
USD 1,439,240	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 4.807% 25/4/2037	957,803	0.01
USD 7,038,851	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2007-A 4.857% 25/4/2037	4,684,567	0.06
USD 295,093	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series SPMD 2004-A 3.471% 25/7/2034	284,452	0.00
USD 204,000	Horizon Therapeutics USA 5.5% 1/8/2027	207,509	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 2,073,000	Houston Galleria Mall Trust 2015-HGLR 3.982% 5/3/2037	1,830,565	0.02
USD 2,120,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	1,910,135	0.02
USD 2,270,000	Humana 0.65% 3/8/2023	2,226,316	0.03
USD 750,000	Huntington Bancshares 2.55% 4/2/2030	625,473	0.01
USD 1,193,000	Huntington Bancshares 4.443% 4/8/2028	1,138,872	0.01
USD 1,625,000	Huntington National Bank/The 5.65% 10/1/2030	1,633,586	0.02
USD 65,000	iHeartCommunications 4.75% 15/1/2028	54,799	0.00
USD 98,000	iHeartCommunications 5.25% 15/8/2027	85,450	0.00
USD 104,490	iHeartCommunications 6.375% 1/5/2026	98,614	0.00
USD 615,000	Illumina 5.8% 12/12/2025	620,489	0.01
USD 509,280	Impac Secured Assets Trust 2006-3 4.957% 25/11/2036	435,103	0.01
USD 1,210,000	IMT Trust 2017-APTS 3.478% 15/6/2034	1,158,294	0.02
USD 5,620,171	IMT Trust 2017-APTS 3.497% 15/6/2034	5,276,308	0.07
USD 2,669,820	IMT Trust 2017-APTS 3.497% 15/6/2034	2,545,439	0.03
USD 2,000,000	IMT Trust 2017-APTS 3.497% 15/6/2034	1,857,637	0.02
USD 370,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 3.911% 10/7/2035	344,932	0.00
USD 800,000	Independence Plaza Trust 2018-INDP 4.158% 10/7/2035	742,118	0.01
USD 2,450,967	IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust 2007-HOA1 0% 25/7/2047	3,543	0.00
USD 457,895	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR15 4.857% 25/7/2036	417,070	0.01
USD 3,589,264	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2006-AR35 4.977% 25/1/2037	2,938,358	0.04
USD 4,115,914	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-AR19 3.362% 25/9/2037	2,666,559	0.03
USD 489,885	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2007-FLX5 4.857% 25/8/2037	424,026	0.01
USD 1,298,000	Intel 4.875% 10/2/2028	1,278,538	0.02
USD 2,785,000	Intercontinental Exchange 1.85% 15/9/2032	2,094,397	0.03
USD 2,880,000	Intercontinental Exchange 2.1% 15/6/2030	2,343,625	0.03
USD 1,500,000	Intercontinental Exchange 4.35% 15/6/2029	1,447,738	0.02
USD 4,165,000	International Business Machines 1.95% 15/5/2030	3,346,815	0.04
USD 200,000	IQVIA 5% 15/5/2027	190,181	0.00
USD 296,930	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-3 6.53% 25/9/2037	274,964	0.00
USD 101,059	Irwin Home Equity Loan Trust 2006-P1 4.897% 25/12/2036	97,158	0.00
USD 10,195,559	IXIS Real Estate Capital Trust 2007-HE1 4.847% 25/5/2037	2,663,477	0.03
USD 1,455,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-AON 4.128% 5/7/2031	1,289,130	0.02
USD 4,428,722	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-PHH 5.798% 15/6/2035	4,095,118	0.05
USD 1,270,000	JobsOhio Beverage System 3.985% 1/1/2029	1,236,647	0.02
USD 255,000	Johnson & Son 3.35% 30/9/2024	244,981	0.00
USD 193,489	JP Morgan Alternative Loan Trust 2007-A2 3.959% 25/5/2037	160,904	0.00
USD 2,321,741	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2015-JP1 4.725% 15/1/2049	2,126,886	0.03
USD 10,620,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2016-JP3 0.75% 15/8/2049	234,641	0.00
USD 230,345	JP Morgan Madison Avenue Trust Series 2014-1 8.867% 25/11/2024	223,745	0.00
USD 697,263	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CW1 5.022% 25/5/2036	675,626	0.01
USD 4,655,000	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2007-CH1 4.601% 25/11/2036	4,635,604	0.06
USD 1,126,362	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C22 0.798% 15/9/2047	9,262	0.00
USD 845,591	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 0.597% 15/9/2047	5,477	0.00
USD 7,006,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C27 0.5% 15/2/2048	57,987	0.00
USD 1,192,091	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C29 0.565% 15/5/2048	12,008	0.00
USD 1,480,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 4.12% 15/12/2048	1,247,169	0.02
USD 1,198,000	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2016-C1 4.236% 17/3/2049	1,003,163	0.01
USD 4,150,000	JPMDB Commercial Mortgage Trust 2016-C4 0.75% 15/12/2049	92,625	0.00
GBP 2,600,000	JPMorgan Chase 0.991% 28/4/2026	2,874,644	0.04
EUR 1,500,000	JPMorgan Chase 1.09% 11/3/2027	1,449,970	0.02
EUR 2,900,000	JPMorgan Chase 1.638% 18/5/2028	2,762,482	0.04
USD 1,500,000	JPMorgan Chase 1.764% 19/11/2031	1,151,251	0.02
EUR 2,500,000	JPMorgan Chase 1.963% 23/3/2030	2,306,338	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 1,709,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,587,957	0.02
USD 1,664,000	JPMorgan Chase 2.182% 1/6/2028	1,454,962	0.02
USD 1,125,000	JPMorgan Chase 2.739% 15/10/2030	946,162	0.01
USD 750,000	JPMorgan Chase 2.963% 25/1/2033	616,976	0.01
USD 4,610,000	JPMorgan Chase 3.702% 6/5/2030	4,146,873	0.05
USD 5,465,000	JPMorgan Chase 4.08% 26/4/2026	5,315,673	0.07
USD 12,611,000	JPMorgan Chase 4.323% 26/4/2028	12,064,846	0.16
USD 4,143,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	4,038,181	0.05
USD 3,600,000	JPMorgan Chase Bank 0% 28/12/2023	3,441,600	0.05
USD 4,150,000	Keurig Dr Pepper 3.95% 15/4/2029	3,833,434	0.05
USD 5,000,000	KeyCorp Student Loan Trust 2004-A 6.065% 28/7/2042	4,673,882	0.06
USD 5,674,101	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A 6.024% 27/12/2038	5,225,402	0.07
USD 455,000	Kinetik 5.875% 15/6/2030	418,584	0.00
USD 1,875,000	Kraft Heinz Foods 3.75% 1/4/2030	1,708,968	0.02
GBP 609,000	Kraft Heinz Foods 4.125% 1/7/2027	707,875	0.01
USD 1,325,000	Kraft Heinz Foods 4.25% 1/3/2031	1,236,417	0.02
EUR 1,045,000	Kronos International 3.75% 15/9/2025	1,008,062	0.01
USD 1,819,083	Ladder Capital Commercial Mortgage 2013-GCP Mortgage Trust 1.157% 15/2/2036	81,459	0.00
USD 1,000,000	Lear 4.25% 15/5/2029	912,376	0.01
USD 182,785	Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 0% 15/6/2033	164,413	0.00
USD 257,236	Lehman ABS Mortgage Loan Trust 4.707% 25/6/2037	183,519	0.00
USD 758,425	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2006-2 5.067% 25/9/2036	658,814	0.01
USD 114,705	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-1 4.867% 25/3/2037	113,493	0.00
USD 6,294,000	Lehman Brothers Small Balance Commercial Mortgage Trust 2007-3 6.617% 25/10/2037	5,060,181	0.07
USD 946,490	Lehman XS Trust Series 2007-16N 6.517% 25/9/2047	1,180,005	0.02
USD 459,921	Lehman XS Trust Series 2007-20N 6.917% 25/12/2037	455,062	0.01
USD 2,775,000	Leidos 2.95% 15/5/2023	2,759,556	0.03
USD 376,268	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST1 2.5% 15/3/2028	356,646	0.01
USD 442,977	LendingPoint Pass-Through Trust Series 2022-ST2 3.25% 15/4/2028	422,472	0.01
USD 467,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	322,046	0.00
USD 841,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	627,912	0.01
EUR 2,222,000	Liberty Mutual 3.625% 23/5/2059	2,212,521	0.03
USD 4,056,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	2,850,823	0.04
USD 8,836,478	Loanpal Solar Loan 2.47% 20/12/2047	6,626,269	0.09
USD 2,744,330	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-5 4.917% 25/6/2036	1,337,503	0.02
USD 740,033	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-6 4.917% 25/7/2036	305,924	0.00
USD 6,053,459	Long Beach Mortgage Loan Trust 2006-7 4.937% 25/8/2036	2,587,825	0.03
USD 1,850,000	Louisiana Public Facilities Authority 3% 15/5/2047	1,343,549	0.02
USD 2,310,000	Lowe's 1.7% 15/10/2030	1,796,422	0.02
USD 3,250,000	Lowe's 2.625% 1/4/2031	2,661,952	0.03
USD 2,251,000	Lowe's 3.35% 1/4/2027	2,104,144	0.03
USD 750,000	Lowe's 3.75% 1/4/2032	661,654	0.01
USD 1,125,000	Lowe's 4.5% 15/4/2030	1,069,315	0.01
USD 264,367	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2015-3 3.148% 20/4/2048	253,467	0.00
USD 1,931,856	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5 0.794% 10/3/2050	37,481	0.00
USD 750,000	LYB International Finance III 2.25% 1/10/2030	598,098	0.01
USD 1,885,000	Lyford Consolidated Independent School District/TX 4% 15/8/2047	1,784,570	0.02
USD 3,192,000	M/I Homes 4.95% 1/2/2028	2,860,882	0.04
USD 4,008,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.108% 15/8/2034	3,656,455	0.05
USD 3,529,000	MAD Mortgage Trust 2017-330M 4.167% 15/8/2034	3,238,752	0.04
USD 273,515	Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust 2002-A 7.867% 25/3/2032	273,751	0.00
USD 850,000	Marvell Technology 4.2% 22/6/2023	846,018	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 290,000	Massachusetts Housing Finance Agency 4.5% 1/12/2039	286,086	0.00
USD 3,520,000	Massachusetts School Building Authority 2.866% 15/10/2031	2,993,525	0.04
USD 2,545,000	Massachusetts School Building Authority 2.966% 15/10/2032	2,146,608	0.03
USD 1,401,845	Mastr Asset Backed Trust 2007-HE1 4.897% 25/5/2037	1,101,362	0.01
USD 317,196	MASTR Resecuritization Trust 2008-3 2.159% 25/8/2037	198,701	0.00
USD 252,614	Mastr Specialized Loan Trust 4.877% 25/6/2046	239,987	0.00
USD 143,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	138,043	0.00
USD 7,007,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	7,048,552	0.09
USD 2,726,000	Maxar Technologies 7.75% 15/6/2027	2,851,341	0.04
USD 16,762,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	13,886,633	0.18
USD 983,631	Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust Series 2007-OAR2 5.037% 25/4/2037	885,001	0.01
USD 4,498,677	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-2 5.097% 25/5/2037	1,160,606	0.02
USD 4,481,205	Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust Series 2007-H1 8.117% 25/10/2037	4,080,334	0.05
USD 817,263	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2006-RM3 4.797% 25/6/2037	177,282	0.00
USD 147,000	Metropolitan Life Global Funding I 1.875% 11/1/2027	129,837	0.00
USD 33,000	MGM Resorts International 4.625% 1/9/2026	30,736	0.00
USD 357,000	MGM Resorts International 5.5% 15/4/2027	338,668	0.00
USD 32,000	MGM Resorts International 5.75% 15/6/2025	31,418	0.00
USD 2,575,000	Microchip Technology 0.972% 15/2/2024	2,462,055	0.03
USD 445,000	Microchip Technology 2.67% 1/9/2023	438,720	0.01
USD 1,320,000	Microchip Technology 4.333% 1/6/2023	1,316,216	0.02
USD 1,876,000	Midwest Gaming Borrower / Midwest Gaming Finance 4.875% 1/5/2029	1,602,241	0.02
EUR 1,572,000	Moody's 0.95% 25/2/2030	1,374,904	0.02
EUR 1,600,000	Morgan Stanley 0.495% 26/10/2029	1,363,009	0.02
EUR 5,000,000	Morgan Stanley 1.102% 29/4/2033	3,927,023	0.05
USD 360,000	Morgan Stanley 1.512% 20/7/2027	313,890	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley 1.794% 13/2/2032	1,136,743	0.01
USD 5,498,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	4,896,207	0.06
USD 4,250,000	Morgan Stanley 2.699% 22/1/2031	3,541,206	0.05
EUR 8,500,000	Morgan Stanley 2.95% 7/5/2032	8,000,740	0.10
USD 1,200,000	Morgan Stanley 3.622% 1/4/2031	1,059,187	0.01
USD 7,306,000	Morgan Stanley 4.21% 20/4/2028	6,929,242	0.09
USD 375,000	Morgan Stanley 4.431% 23/1/2030	351,930	0.00
USD 4,034,000	Morgan Stanley 5.05% 28/1/2027	3,988,255	0.05
USD 2,200,047	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2005-HE5 5.487% 25/9/2035	1,828,627	0.02
USD 324,124	Morgan Stanley ABS Capital I Trust 2007-SEA1 6.517% 25/2/2047	304,825	0.00
USD 3,654,543	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.179% 15/12/2047	74,498	0.00
USD 10,520,884	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014 C19 1.179% 15/12/2047	200,041	0.00
USD 3,349,202	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C21 0.274% 15/3/2048	19,533	0.00
USD 428,938	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C23 4.139% 15/7/2050	360,310	0.00
USD 1,500,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C24 4.326% 15/5/2048	1,411,646	0.02
USD 209,922	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 4.523% 15/10/2048	191,330	0.00
USD 5,104,909	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 1.308% 15/10/2048	155,231	0.00
USD 362,592	Morgan Stanley Capital I 2017-HR2 2.73% 15/12/2050	245,947	0.00
USD 2,519,058	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 2.152% 15/6/2050	194,894	0.00
USD 1,617,856	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 4.281% 15/6/2050	1,415,286	0.02
USD 2,754,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.276% 11/7/2040	2,127,245	0.03
USD 225,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP 4.276% 11/7/2040	197,725	0.00
USD 690,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 5.488% 15/7/2035	683,231	0.01
USD 1,213,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 5.788% 15/7/2035	1,200,847	0.02
USD 23,000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-SUN 7.138% 15/7/2035	22,714	0.00
USD 720,401	Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 2006-3 4.937% 25/4/2036	518,580	0.01
USD 1,481,776	Morgan Stanley Resecuritization Trust 2013-R7 4.709% 26/12/2046	1,319,647	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 630,775	Morgan Stanley Residential Mortgage Loan Trust 2014-1 5.891% 25/6/2044	574,361	0.01
USD 2,053,578	Mortgage Loan Resecuritization Trust 4.906% 16/4/2036	1,958,719	0.03
USD 1,552,981	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1 4.01% 22/6/2043	1,435,417	0.02
USD 3,858,184	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 4.2% 22/2/2044	3,548,687	0.05
USD 655,236	Mosaic Solar Loan Trust 2018-2-GS 5.97% 22/2/2044	561,388	0.01
USD 4,899,111	Mosaic Solar Loan Trust 2019-1 4.37% 21/12/2043	4,555,768	0.06
USD 921,989	Mosaic Solar Loan Trust 2022-2 4.38% 21/1/2053	859,185	0.01
USD 750,000	Motorola Solutions 4.6% 23/2/2028	722,368	0.01
GBP 440,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 2.55% 5/12/2023	506,617	0.01
EUR 2,543,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 3.325% 24/3/2025*	2,354,014	0.03
USD 4,307,077	MSCG Trust 2018-SELF 6.738% 15/10/2037	4,187,370	0.05
USD 402,103	MSCG Trust 2018-SELF 7.638% 15/10/2037	392,588	0.01
USD 455,689	Multi Security Asset Trust Commercial Mortgage-Backed Pass-Through 4.78% 28/11/2035	306,468	0.00
USD 1,510,643	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 6.5% 25/3/2034	1,285,640	0.02
USD 346,844	NACC Reperforming Loan REMIC Trust 2004-R1 7.5% 25/3/2034	304,252	0.00
EUR 783,000	National Grid North America 1.054% 20/1/2031	649,977	0.01
USD 1,620,000	Nationstar Home Equity Loan Trust 2007-B 5.027% 25/4/2037	1,487,351	0.02
USD 1,680,000	Nationstar Mortgage 5.125% 15/12/2030	1,295,517	0.02
USD 1,832,000	Nationstar Mortgage 5.5% 15/8/2028	1,560,419	0.02
USD 794,000	Nationstar Mortgage 5.75% 15/11/2031	622,159	0.01
USD 648,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	596,834	0.01
USD 332,946	Natixis Commercial Mortgage Trust 2018-FL1 5.538% 15/6/2035	322,333	0.00
USD 2,882,000	Navient Private Education Loan Trust 2014-A 3.5% 15/8/2044	2,660,677	0.03
USD 2,174,000	Navient Private Education Loan Trust 2015-A 3.5% 15/12/2044	1,916,815	0.03
USD 1,200,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,002,175	0.01
USD 2,110,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-I 2.95% 15/4/2069	1,695,636	0.02
EUR 1,600,000	Netflix 4.625% 15/5/2029	1,687,487	0.02
USD 3,946,800	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B 5.337% 25/10/2035	3,834,550	0.05
USD 2,661,794	New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-C 5.292% 25/12/2035	2,056,322	0.03
USD 639,000	New Home 7.25% 15/10/2025	591,784	0.01
USD 1,155,000	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 3% 1/7/2051	833,787	0.01
USD 1,150,000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15/12/2028	1,160,258	0.01
USD 1,515,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.44% 15/6/2043	1,604,213	0.02
USD 435,000	New York City Municipal Water Finance Authority 5.75% 15/6/2041	477,847	0.01
GBP 1,170,000	New York Life Global Funding 4.35% 16/9/2025	1,399,343	0.02
USD 1,115,000	New York State Dormitory Authority 3.19% 15/2/2043	867,531	0.01
USD 1,245,000	New York State Urban Development 3.32% 15/3/2029	1,141,538	0.01
USD 1,480,000	New York State Urban Development 4% 15/3/2038	1,467,893	0.02
USD 2,858,000	Newmont 2.25% 1/10/2030	2,295,839	0.03
USD 3,235,000	Newmont 2.6% 15/7/2032	2,573,006	0.03
USD 1,444,000	Newmont 2.8% 1/10/2029*	1,225,205	0.02
USD 1,224,000	Nexstar Media 4.75% 1/11/2028	1,066,117	0.01
USD 737,000	Nexstar Media 5.625% 15/7/2027	684,706	0.01
USD 1,500,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	1,267,543	0.02
USD 711,000	NextEra Energy Capital 6.051% 1/3/2025	715,680	0.01
USD 5,800,000	NGPL PipeCo 7.768% 15/12/2037	6,242,271	0.08
USD 1,704,000	Nine Energy Service 13% 1/2/2028	1,745,620	0.02
USD 189,804	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2001-R1A 7% 19/2/2030	182,188	0.00
USD 631,539	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2005-AP1 6.046% 25/2/2035	592,523	0.01
USD 448,153	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-AF1 7.134% 25/5/2036	101,384	0.00
USD 74,532	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2006-S5 5.017% 25/10/2036	84,465	0.00
USD 1,400,620	Nomura Asset Acceptance Alternative Loan Trust Series 2007-2 5.037% 25/6/2037	1,241,739	0.02
USD 2,895,000	Northern States Power 2.9% 1/3/2050	1,967,632	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 6,505,000	NVIDIA 2% 15/6/2031	5,227,232	0.07
USD 2,110,000	NVIDIA 2.85% 1/4/2030	1,850,745	0.02
USD 483,367	Oakwood Mortgage Investors 5.26% 15/1/2019	299,537	0.00
USD 401,958	Oakwood Mortgage Investors 6.93% 15/9/2031	232,939	0.00
USD 1,013,041	Oakwood Mortgage Investors 7.475% 15/8/2027	846,574	0.01
USD 28,148,566	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 0.379% 10/5/2039	412,120	0.01
USD 2,232,801	Olympic Tower 2017-OT Mortgage Trust 3.945% 10/5/2039	1,615,069	0.02
EUR 1,287,000	Olympus Water US 3.875% 1/10/2028*	1,176,864	0.01
USD 1,800,000	Oncor Electric Delivery 2.75% 15/5/2030	1,558,480	0.02
USD 2,340,000	Oncor Electric Delivery 5.75% 15/3/2029	2,416,133	0.03
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 0.09% 10/2/2032	23,070	0.00
USD 1,989,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	1,816,674	0.02
USD 3,870,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 4.05% 14/10/2036	3,296,124	0.04
USD 1,270,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 2.76% 14/9/2035	1,093,445	0.01
USD 3,210,000	OneMain Financial Issuance Trust 2020-2 3.45% 14/9/2035	2,708,531	0.04
USD 450,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 2.22% 16/6/2036	368,981	0.01
USD 3,831,000	OneMain Financial Issuance Trust 2021-1 5.136% 16/6/2036	3,742,469	0.05
USD 2,000,000	Option One Mortgage Loan Trust 2005-4 Asset-Backed Certificates Series 2005-4 5.352% 25/11/2035	1,590,734	0.02
USD 1,950,000	Option One Mortgage Loan Trust 2007-CP1 4.827% 25/3/2037	1,544,683	0.02
USD 4,768,299	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	3,866,893	0.05
USD 5,209,954	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1 5.866% 25/1/2037	4,366,351	0.06
USD 1,993,547	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD2 5.82% 25/3/2037	1,754,230	0.02
USD 1,000,000	Oracle 2.3% 25/3/2028	866,156	0.01
USD 1,500,000	Oracle 2.875% 25/3/2031	1,239,211	0.02
USD 1,400,000	Oracle 2.95% 1/4/2030	1,192,427	0.01
USD 763,000	Oracle 4.9% 6/2/2033	716,541	0.01
USD 574,000	Oracle 5.8% 10/11/2025	580,454	0.01
USD 2,115,000	Oracle 6.25% 9/11/2032	2,191,352	0.03
USD 855,528	Oregon School Boards Association 4.759% 30/6/2028	846,386	0.01
USD 1,910,000	Oregon School Boards Association 5.55% 30/6/2028	1,945,038	0.03
EUR 1,200,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 2.875% 30/4/2028	1,095,982	0.01
USD 456,454	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2001-A 7.82% 15/3/2032	414,260	0.01
USD 681,348	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2007-B 5.788% 15/10/2037	704,737	0.01
USD 65,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.625% 15/3/2030	53,285	0.00
USD 85,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	76,314	0.00
USD 1,373,172	Ownit Mortgage Loan Trust Series 2006-2 6.5% 25/1/2037	1,153,717	0.02
USD 72,000	Pacific Gas and Electric 3.25% 16/2/2024	70,641	0.00
USD 1,485,000	Pacific Gas and Electric 3.85% 15/11/2023	1,468,378	0.02
USD 1,500,000	Pacific Gas and Electric 4.95% 8/6/2025	1,469,188	0.02
USD 443,000	Pacific Gas and Electric 5.45% 15/6/2027	431,407	0.01
USD 1,380,000	Pacific Gas and Electric 6.15% 15/1/2033	1,359,249	0.02
USD 3,011,000	Paramount Global 6.375% 30/3/2062	2,596,689	0.03
USD 2,627,000	Park Intermediate / PK Domestic Property / PK Finance Co-Issuer 4.875% 15/5/2029	2,188,766	0.03
USD 3,060,000	Parker-Hannifin 3.25% 14/6/2029	2,713,961	0.04
USD 78,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	74,288	0.00
USD 453,000	Periama 5.95% 19/4/2026	427,401	0.00
USD 34,000	Pitney Bowes 4.625% 15/3/2024*	33,737	0.00
USD 7,020,000	Pitney Bowes 6.875% 15/3/2027*	5,834,076	0.07
USD 1,329,000	PNC Financial Services 5.354% 2/12/2028	1,334,708	0.02
USD 1,020,000	PPG Industries 2.55% 15/6/2030	851,671	0.01
USD 167,474	Prime Mortgage Trust 2006-DR1 5.5% 25/5/2035	145,675	0.00
USD 211,000	Principal Life Global Funding II 1.25% 16/8/2026	182,600	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 (%)
	米国(続き)		
USD 612,000	Prologis 2.25% 15/1/2032	488,645	0.01
USD 1,561,000	Prologis 4.625% 15/1/2033	1,504,017	0.02
EUR 2,100,000	Prologis Euro Finance 0.25% 10/9/2027*	1,870,219	0.02
EUR 1,690,000	Prologis Euro Finance 4.25% 31/1/2043*	1,682,782	0.02
USD 3,125,345	PRPM 2020-4 2.951% 25/10/2025	3,041,622	0.04
USD 597,694	RALI Series 2007-QH9 Trust 4.095% 25/11/2037	516,147	0.01
USD 850,882	RAMP Series 2004-RS7 Trust 4.273% 25/7/2034	692,974	0.01
USD 4,203,000	Rand Parent 8.5% 15/2/2030	4,044,946	0.05
USD 2,732,888	RASC Series 2006-EMX9 Trust 5.097% 25/11/2036	2,188,204	0.03
USD 17,796,697	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL10 7.17% 25/10/2039	17,771,326	0.23
USD 4,381,619	Ready Capital Mortgage Financing 2022-FL9 7.072% 25/6/2037	4,395,418	0.06
USD 1,500,000	Realty Income 3.65% 15/1/2028	1,402,914	0.02
USD 750,000	Realty Income 5.625% 13/10/2032	761,641	0.01
USD 2,635,000	Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	2,609,141	0.03
USD 770,000	Regal Rexnord 6.05% 15/4/2028	753,470	0.01
USD 67,846	Reperforming Loan REMIC Trust 2005-R3 5.017% 25/9/2035	58,913	0.00
USD 951,436	Residential Asset Securitization Trust 2005-A5 5.017% 25/5/2035	640,640	0.01
USD 2,485,006	RFMSI Series 2006-SA2 Trust 4.902% 25/8/2036	1,742,463	0.02
USD 227,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	208,908	0.00
USD 3,244,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	2,783,936	0.04
USD 3,312,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.625% 1/3/2029	2,670,253	0.03
USD 710,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 3.875% 1/3/2031	553,093	0.01
USD 1,070,000	Rutgers The State University of New Jersey 3.27% 1/5/2043	825,590	0.01
USD 947,000	Sabre GLBL 7.375% 1/9/2025	888,939	0.01
USD 3,562,000	Sabre GLBL 9.25% 15/4/2025	3,508,681	0.05
USD 1,206,000	Sabre GLBL 11.25% 15/12/2027	1,202,751	0.02
USD 6,405	SACO I Trust 2006-9 4.917% 25/8/2036	6,399	0.00
USD 2,345,000	San Diego County Water Authority 5% 1/5/2052	2,563,604	0.03
USD 1,800,000	Sanger Independent School District 4% 15/8/2047	1,701,507	0.02
USD 4,395,000	Sasol Financing USA 4.375% 18/9/2026	3,960,302	0.05
USD 1,757,000	Sasol Financing USA 5.5% 18/3/2031	1,481,006	0.02
USD 3,762,000	Sasol Financing USA 5.875% 27/3/2024	3,714,975	0.05
USD 1,499,000	Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028*	1,405,961	0.02
EUR 164,000	SCIL IV / SCIL USA 4.375% 1/11/2026	160,799	0.00
USD 3,649,357	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0% 25/7/2056	596,368	0.01
USD 4,680,251	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3 0.873% 25/7/2056	377,394	0.00
USD 488,517	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1 4.19% 25/5/2057	168,147	0.00
USD 170,000	Securitized Asset Backed Receivables Trust 2006-OP1 5.622% 25/10/2035	122,381	0.00
USD 7,674,000	Select Medical 6.25% 15/8/2026	7,346,090	0.09
USD 1,401,000	Sempra Energy 3.7% 1/4/2029	1,269,587	0.02
USD 1,462,000	Service Properties Trust 4.35% 1/10/2024	1,390,859	0.02
USD 4,904,000	Service Properties Trust 4.5% 15/6/2023	4,905,421	0.06
USD 1,427,000	Service Properties Trust 4.5% 15/3/2025	1,331,667	0.02
USD 395,000	Service Properties Trust 5.5% 15/12/2027	355,068	0.00
USD 2,337,000	Service Properties Trust 7.5% 15/9/2025	2,315,644	0.03
USD 5,997,475	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	5,585,532	0.07
USD 1,257,716	SG Mortgage Trust 2006-FRE2 4.937% 25/7/2036	291,798	0.00
USD 3,150,000	Sherwin-Williams 2.95% 15/8/2029	2,725,457	0.03
EUR 930,000	Silgan 2.25% 1/6/2028	842,145	0.01
USD 395,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	361,329	0.00
USD 217,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	194,719	0.00
USD 1,760,000	Skyworks Solutions 0.9% 1/6/2023	1,737,624	0.02
USD 6,506,380	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 9.338% 15/10/2041	6,984,215	0.09

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 1,485,000	SMB Private Education Loan Trust 2014-A 4.5% 15/9/2045	1,271,799	0.02
USD 6,689,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-B 3.5% 17/12/2040	6,331,669	0.08
USD 1,910,000	SMB Private Education Loan Trust 2015-C 3.5% 15/9/2043	1,801,620	0.02
USD 1,800,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 3% 15/8/2045	1,515,878	0.02
USD 3,410,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 2.5% 15/9/2054	2,691,426	0.04
USD 1,290,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PT-A 3.2% 15/9/2054	1,036,047	0.01
USD 3,600,000	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 2.5% 15/9/2054	2,845,505	0.04
USD 8,810,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.99% 15/1/2053	7,639,051	0.10
USD 2,460,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	2,239,267	0.03
USD 1,690,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 3.86% 15/1/2053	1,549,440	0.02
USD 2,886,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	2,584,870	0.03
USD 29,759	Soundview Home Loan Trust 2004-WMC1 5.412% 25/1/2035	27,146	0.00
EUR 6,087,000	Southern 1.875% 15/9/2081	5,173,548	0.06
USD 5,200,000	Southern 3.875% 15/12/2025	5,131,795	0.07
USD 2,235,000	Southern California Edison 2.75% 1/2/2032	1,842,591	0.02
USD 620,000	Southern California Edison 2.85% 1/8/2029	533,963	0.01
USD 955,000	Southern California Edison 5.95% 1/11/2032	989,938	0.01
EUR 1,300,000	Southern Power 1.85% 20/6/2026	1,292,645	0.02
USD 6,489,000	Sprint 7.875% 15/9/2023	6,559,685	0.08
USD 905,625	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/9/2029	895,374	0.01
USD 375,000	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 5.152% 20/9/2029	370,539	0.01
USD 1,155,000	State of California 7.3% 1/10/2039	1,409,078	0.02
USD 630,000	State of California 7.35% 1/11/2039	772,493	0.01
USD 580,000	State of California 7.5% 1/4/2034	702,559	0.01
USD 1,300,000	State of California 7.55% 1/4/2039	1,654,215	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2040	1,712,391	0.02
USD 1,695,000	State of Georgia 4% 1/7/2041	1,704,241	0.02
USD 1,885,000	State of Minnesota 4% 1/9/2038	1,960,347	0.03
USD 3,080,000	State of New York 2.8% 15/2/2032	2,646,269	0.03
USD 955,000	State of Ohio 5% 1/3/2039	1,068,581	0.01
USD 1,070,000	State of Oregon 5.892% 1/6/2027	1,098,996	0.01
USD 2,000,000	State Street 1.684% 18/11/2027	1,767,024	0.02
USD 1,900,000	State Street 2.623% 7/2/2033	1,546,921	0.02
USD 3,000,000	Steel Dynamics 3.25% 15/10/2050	2,001,556	0.03
USD 3,815,000	Steel Dynamics 3.45% 15/4/2030	3,369,620	0.04
USD 297,000	Stem 0.5% 1/12/2028	182,219	0.00
USD 2,333,000	Stillwater Mining 4% 16/11/2026	2,082,202	0.03
USD 783,628	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust 3.42% 25/4/2036	486,150	0.01
USD 621,368	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR2 5.077% 25/2/2036	543,065	0.01
USD 281,644	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5 5.037% 25/5/2046	187,128	0.00
USD 4,481,192	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF3 6% 25/10/2036	2,756,356	0.04
USD 2,409,043	Structured Asset Mortgage Loan Trust Series 2006-RF4 6% 25/10/2036	1,377,965	0.02
EUR 488,000	Stryker 2.625% 30/11/2030	468,826	0.01
USD 500,000	Summer BC Bidco B 5.5% 31/10/2026	428,964	0.01
USD 760,000	Sumter Landing Community Development District 4.172% 1/10/2047	659,889	0.01
USD 2,334,000	Sunoco / Sunoco Finance 4.5% 30/4/2030	2,029,576	0.03
USD 1,210,000	Sunoco / Sunoco Finance 5.875% 15/3/2028	1,162,766	0.01
USD 1,382,000	Talen Energy Supply 6.625% 15/1/2028	1,403,974	0.02
USD 4,233,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	3,893,154	0.05
USD 1,717,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	1,657,094	0.02
USD 424,000	TEGNA 4.625% 15/3/2028	380,010	0.01
USD 8,970,000	Tenet Healthcare 4.25% 1/6/2029	7,870,278	0.10
USD 4,095,000	Tenet Healthcare 4.375% 15/1/2030	3,576,312	0.05

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 255,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	231,535	0.00
USD 196,000	Tenet Healthcare 5.125% 1/11/2027	184,204	0.00
USD 1,852,000	Tenet Healthcare 6.125% 15/6/2030	1,757,400	0.02
USD 196,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	191,104	0.00
USD 235,000	Tennessee Housing Development Agency 3.85% 1/7/2043	230,601	0.00
USD 190,000	Tennessee Housing Development Agency 3.95% 1/1/2049	186,858	0.00
USD 1,700,000	Texas A&M University 2.836% 15/5/2027	1,585,075	0.02
USD 936,800	Thornburg Mortgage Trust 2006-3 2.703% 25/6/2046	634,741	0.01
USD 50,773	Thornburg Mortgage Trust 2007-3 6.892% 25/6/2047	48,651	0.00
USD 2,612,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	2,369,241	0.03
USD 1,000,000	T-Mobile USA 2.05% 15/2/2028	856,872	0.01
USD 1,750,000	T-Mobile USA 2.4% 15/3/2029	1,476,110	0.02
USD 1,500,000	T-Mobile USA 2.7% 15/3/2032	1,210,053	0.02
USD 1,500,000	T-Mobile USA 2.875% 15/2/2031	1,244,124	0.02
USD 5,415,000	T-Mobile USA 3.375% 15/4/2029	4,785,078	0.06
USD 1,125,000	T-Mobile USA 3.5% 15/4/2031	973,602	0.01
USD 1,700,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	1,596,424	0.02
USD 2,790,000	T-Mobile USA 3.875% 15/4/2030	2,523,534	0.03
USD 2,875,000	Tobacco Settlement Financing 6.706% 1/6/2046	2,646,457	0.03
USD 1,650,000	Topaz Solar Farms 5.75% 30/9/2039	1,519,963	0.02
USD 555,000	Toyota Motor Credit 3.05% 22/3/2027	515,500	0.01
USD 1,500,000	Toyota Motor Credit 3.375% 1/4/2030	1,369,384	0.02
USD 3,195,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	2,959,305	0.04
USD 167,000	Tri Pointe Homes 5.7% 15/6/2028	155,788	0.00
USD 850,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.564% 17/5/2037	801,470	0.01
USD 580,000	Tricon American Homes 2018-SFR1 Trust 4.96% 17/5/2037	547,129	0.01
USD 691,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C12 4.788% 15/8/2051	611,370	0.01
EUR 1,381,000	UGI International 2.5% 1/12/2029	1,160,940	0.01
USD 750,000	Union Pacific 3.7% 1/3/2029	699,844	0.01
USD 132,000	United Rentals North America 5.5% 15/5/2027	129,505	0.00
USD 26,040,100	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2026	27,829,336	0.36
USD 6,848,500	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/10/2026	7,006,160	0.09
USD 16,152,700	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15/4/2027	15,830,768	0.20
USD 105,415,900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.5% 15/4/2024*	121,851,509	1.57
USD 107,080,600	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/1/2024*	134,817,776	1.73
USD 35,904,000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15/7/2032	33,709,660	0.43
USD 46,479,100	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/2/2031*	37,647,163	0.48
USD 15,484,500	United States Treasury Note/Bond 1.125% 15/5/2040	9,712,592	0.12
USD 443,874,400	United States Treasury Note/Bond 1.25% 30/11/2026*	395,871,812	5.10
USD 46,464,500	United States Treasury Note/Bond 1.25% 31/12/2026*	41,362,480	0.53
USD 14,306,600	United States Treasury Note/Bond 1.375% 15/11/2031	11,586,949	0.15
USD 8,589,500	United States Treasury Note/Bond 1.625% 15/11/2050*	5,187,924	0.07
USD 20,159,800	United States Treasury Note/Bond 1.75% 15/8/2041*	13,839,781	0.18
USD 19,225,400	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2041*	13,619,994	0.18
USD 7,385,700	United States Treasury Note/Bond 1.875% 15/2/2051	4,753,967	0.06
USD 10,043,200	United States Treasury Note/Bond 2.25% 15/8/2049*	7,113,999	0.09
USD 31,898,500	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/5/2029*	28,774,690	0.37
USD 13,926,000	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/2/2042*	10,621,295	0.14
USD 14,761,300	United States Treasury Note/Bond 2.375% 15/11/2049*	10,752,396	0.14
USD 107,318,600	United States Treasury Note/Bond 2.625% 31/5/2027*	100,250,664	1.29
USD 19,130,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 31/7/2027	17,936,620	0.23
USD 10,379,800	United States Treasury Note/Bond 2.75% 15/8/2032	9,383,177	0.12
USD 382,655,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2032*	350,182,282	4.51

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 264,901,700	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/5/2052*	214,125,427	2.76
USD 567,700	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2048	468,519	0.01
USD 10,804,300	United States Treasury Note/Bond 3% 15/8/2052*	8,965,881	0.12
USD 58,982,700	United States Treasury Note/Bond 3.25% 30/6/2027*	56,487,456	0.73
USD 34,771,300	United States Treasury Note/Bond 3.25% 15/5/2042*	30,483,292	0.39
USD 57,763,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025	56,941,683	0.73
USD 15,457,300	United States Treasury Note/Bond 4% 15/11/2052	15,529,756	0.20
USD 43,600,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 30/9/2024	43,099,281	0.55
USD 4,836,000	United Wholesale Mortgage 5.5% 15/11/2025	4,459,592	0.06
USD 2,010,000	UnitedHealth 2.3% 15/5/2031	1,649,611	0.02
USD 1,600,000	UnitedHealth 3.375% 15/4/2027	1,505,852	0.02
USD 1,942,000	UnitedHealth 3.875% 15/12/2028	1,831,169	0.02
USD 1,500,000	UnitedHealth 4.2% 15/5/2032	1,405,313	0.02
USD 6,900,000	UnitedHealth 5.35% 15/2/2033	7,036,299	0.09
USD 1,575,000	Uniti / Uniti Fiber / CSL Capital 7.875% 15/2/2025	1,606,634	0.02
USD 2,916,000	Uniti / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	2,920,593	0.04
USD 1,095,000	University of California 5.77% 15/5/2043	1,179,400	0.02
USD 1,382,090	US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.95% 15/5/2027	1,310,439	0.02
USD 5,250,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	4,701,774	0.06
USD 3,985,000	US Bancorp 4.548% 22/7/2028	3,878,888	0.05
USD 1,326,000	US Bancorp 5.727% 21/10/2026	1,341,878	0.02
USD 791,457	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 4.24% 25/11/2047	641,659	0.01
USD 132,485	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2017-2 5% 25/11/2047	103,176	0.00
USD 126,950	Velocity Commercial Capital Loan Trust 2018-1 4.26% 25/4/2048	112,900	0.00
GBP 1,000,000	Verizon Communications 1.125% 3/11/2028	978,217	0.01
EUR 3,000,000	Verizon Communications 1.125% 19/9/2035	2,203,432	0.03
EUR 2,500,000	Verizon Communications 1.3% 18/5/2033	2,007,676	0.03
USD 2,815,000	Verizon Communications 1.68% 30/10/2030	2,168,758	0.03
USD 2,600,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	2,243,000	0.03
USD 1,500,000	Verizon Communications 2.355% 15/3/2032	1,174,484	0.02
USD 6,250,000	Verizon Communications 2.55% 21/3/2031	5,090,422	0.07
USD 202,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	185,432	0.00
USD 2,250,000	Verizon Communications 3.15% 22/3/2030	1,965,322	0.03
USD 375,000	Verizon Communications 4.016% 3/12/2029	345,647	0.00
GBP 264,000	Verizon Communications 4.073% 18/6/2024	317,579	0.00
USD 687,000	Verizon Communications 4.125% 16/3/2027	660,061	0.01
EUR 3,066,000	Verizon Communications 4.75% 31/10/2034	3,363,757	0.04
USD 1,505,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	1,307,875	0.02
USD 2,131,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	1,930,810	0.03
USD 1,250,000	VICI Properties 4.95% 15/2/2030	1,167,938	0.02
USD 3,066,000	VICI Properties 5.125% 15/5/2032	2,849,479	0.04
USD 1,121,000	VICI Properties 5.625% 15/5/2052	990,362	0.01
USD 3,625,000	VICI Properties / VICI Note 3.5% 15/2/2025	3,423,827	0.04
USD 2,429,000	VICI Properties / VICI Note 3.75% 15/2/2027	2,202,136	0.03
USD 850,000	VICI Properties / VICI Note 3.875% 15/2/2029	738,642	0.01
USD 2,510,000	VICI Properties / VICI Note 4.125% 15/8/2030	2,165,772	0.03
USD 1,858,000	VICI Properties / VICI Note 4.25% 1/12/2026	1,721,298	0.02
USD 138,000	VICI Properties / VICI Note 4.5% 1/9/2026	128,494	0.00
USD 1,633,000	VICI Properties / VICI Note 4.625% 1/12/2029	1,469,333	0.02
USD 2,695,000	VICI Properties / VICI Note 5.625% 1/5/2024	2,674,089	0.03
USD 207,000	VICI Properties / VICI Note 5.75% 1/2/2027	201,887	0.00
USD 1,000,000	Virginia College Building Authority 1.965% 1/2/2032	786,403	0.01
USD 5,790,000	Vistra Operations 3.55% 15/7/2024	5,557,693	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 1,763,000	Vistra Operations 5% 31/7/2027	1,638,418	0.02
USD 1,750,000	Vistra Operations 5.125% 13/5/2025	1,700,578	0.02
USD 750,000	VMware 2.2% 15/8/2031	566,929	0.01
USD 1,800,000	VMware 4.65% 15/5/2027	1,734,036	0.02
USD 6,080,000	VMware 4.7% 15/5/2030	5,677,961	0.07
USD 13,818,656	Voyager OPTONE Delaware Trust 3.984% 25/2/2038	3,943,905	0.05
USD 3,000,000	Walt Disney 2% 1/9/2029	2,498,496	0.03
USD 4,920,000	Walt Disney 2.65% 13/1/2031	4,179,042	0.05
USD 750,000	Walt Disney 3.8% 22/3/2030	695,927	0.01
USD 4,292,252	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3 Trust 3.793% 25/2/2046	3,751,624	0.05
USD 528,494	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR5 Trust 3.783% 25/6/2046	477,786	0.01
USD 1,658,070	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA5 Trust 3.543% 25/6/2047	1,320,462	0.02
USD 5,500,000	Washington Health Care Facilities Authority 4% 1/10/2045	5,064,615	0.07
USD 758,555	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.167% 25/11/2035	522,576	0.01
USD 310,167	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2005-9 Trust 5.5% 25/11/2035	235,079	0.00
USD 629,722	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-1 Trust 6.5% 25/2/2036	506,107	0.01
USD 2,369,327	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6% 25/4/2036	2,206,465	0.03
USD 205,814	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 6.85% 25/5/2036	170,312	0.00
USD 900,350	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-4 Trust 7% 25/5/2036	745,046	0.01
USD 4,038,308	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-9 Trust 4.287% 25/10/2036	1,303,961	0.02
USD 3,639,868	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE4 Trust 4.977% 25/9/2036	1,125,899	0.02
USD 4,416,717	Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Series 2006-HE5 Trust 3.838% 25/10/2036	3,352,077	0.04
USD 921,000	Weekley Homes / Weekley Finance 4.875% 15/9/2028	783,696	0.01
EUR 4,000,000	Wells Fargo 1.741% 4/5/2030	3,622,213	0.05
USD 1,500,000	Wells Fargo 2.572% 11/2/2031	1,242,962	0.02
GBP 2,400,000	Wells Fargo 3.473% 26/4/2028	2,668,862	0.03
USD 2,602,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028*	2,528,879	0.03
USD 3,290,000	Wells Fargo 4.897% 25/7/2033	3,125,074	0.04
USD 572,513	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 4.224% 15/12/2048	522,289	0.01
USD 2,633,561	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-BNK1 1.249% 15/8/2049	92,641	0.00
USD 448,469	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 4.948% 15/1/2059	416,192	0.01
USD 1,543,418	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 4.981% 15/1/2059	1,371,401	0.02
USD 830,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41 4.188% 15/11/2050	744,096	0.01
USD 960,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C42 4.002% 15/12/2050	859,471	0.01
USD 2,424,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-HSDB 5.673% 13/12/2031	2,411,107	0.03
USD 896,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-1745 3.749% 15/6/2036	777,496	0.01
USD 859,552	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C45 4.727% 15/6/2051	750,458	0.01
USD 941,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C46 4.633% 15/8/2051	861,273	0.01
USD 1,675,000	Welltower 2.05% 15/1/2029	1,369,732	0.02
USD 3,615,000	Welltower 2.75% 15/1/2032	2,875,292	0.04
USD 1,500,000	Welltower OP 4.25% 15/4/2028	1,414,967	0.02
USD 3,270,000	Western Digital 1.5% 1/2/2024	3,144,073	0.04
USD 496,178	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C24 4.204% 15/11/2047	449,989	0.01
USD 1,711,001	WinWater Mortgage Loan Trust 2014-3 3.977% 20/11/2044	1,500,863	0.02
USD 3,949,291	WinWater Mortgage Loan Trust 2015-5 3.756% 20/8/2045	2,328,306	0.03
USD 1,515,000	Wisconsin Health & Educational Facilities Authority 5% 15/11/2035	1,572,028	0.02
EUR 603,000	WMG Acquisition 2.25% 15/8/2031	481,452	0.01
USD 2,250,000	Workday 3.7% 1/4/2029	2,049,124	0.03
USD 2,685,000	WRKCo 3.9% 1/6/2028	2,483,514	0.03
USD 1,053,000	WRKCo 4.9% 15/3/2029	1,007,871	0.01
USD 391,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	364,093	0.00
USD 2,042,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.5% 1/3/2025	1,983,181	0.03
USD 2,416,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	2,153,110	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 2,856,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 7.75% 15/4/2025	2,916,009	0.04
USD 7,845,000	Xerox 5% 15/8/2025	7,308,852	0.09
USD 808,000	XHR 4.875% 1/6/2029	683,099	0.01
USD 699,000	XHR 6.375% 15/8/2025	678,444	0.01
		<u>4,168,228,019</u>	<u>53.65</u>
ウルグアイ			
USD 2,023,000	Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034	2,179,783	0.03
債券合計		<u>6,525,714,361</u>	<u>84.01</u>
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 16,329,000	AT&T 0% 19/12/2023	15,603,230	0.20
USD 2,880,000	AT&T 0% 20/12/2023	2,751,536	0.03
USD 3,680,000	Enel Finance America 0% 6/9/2023	3,564,376	0.05
USD 2,500,000	General Motors Financial 0% 4/4/2023	2,487,203	0.03
USD 2,500,000	General Motors Financial 0% 5/4/2023	2,486,837	0.03
USD 2,840,000	General Motors Financial 0% 13/4/2023	2,821,700	0.04
USD 4,980,000	General Motors Financial 0% 10/8/2023	4,851,367	0.06
USD 6,350,000	General Motors Financial 0% 10/10/2023	6,126,559	0.08
コマーシャル・ペーパー合計		<u>40,692,808</u>	<u>0.52</u>
預託証券			
日本			
USD 1,700,000	Mizuho Corporate Bank (New York Branch) 5.48% 4/1/2024	1,699,552	0.02
米国			
USD 5,390,000	Citibank (New York Branch) 4.06% 1/8/2023	5,364,189	0.07
USD 13,820,000	Citibank (New York Branch) 5% 21/9/2023	13,790,229	0.18
		<u>19,154,418</u>	<u>0.25</u>
預託証券合計		<u>20,853,970</u>	<u>0.27</u>
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		<u>6,747,727,536</u>	<u>86.86</u>

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通/優先株式およびワラント			
米国			
97,804	Fanatics	7,625,778	0.10
112,358	Lessen Series C	1,455,036	0.02
247,879	Versa Networks (Wts 7/10/2032)	689,104	0.01
2,011,152	Versa Networks Series E	5,892,676	0.08
		15,662,594	0.21
普通/優先株式およびワラント合計			
		15,662,594	0.21
債券			
バミューダ			
USD 8,777	DGL2 9.125% 1/4/2024	-	0.00
中国			
EUR 4,326,000	Natra Foods 0% 13/10/2029	4,492,530	0.06
USD 5,628,000	Pioneer Midco 10.5% 18/11/2030	5,529,510	0.07
USD 12,151,000	Sitio Rotalties 0% 21/9/2026	11,954,154	0.15
		21,976,194	0.28
香港			
CNH 917,253	China City Construction International 5.35% 3/7/2017	-	0.00
インド			
USD 116,049	Videocon Industries 2.8% 31/12/2020	-	0.00
アイルランド			
EUR 1,517,000	Capital Four CLO V 0% 8/4/2036	1,613,640	0.02
EUR 1,600,000	Invesco Euro CLO IX 0% 20/4/2036	1,701,928	0.02
		3,315,568	0.04
ジャージー			
USD 270,000	Pikes Peak Clo 12 14.087% 20/4/2036	264,600	0.00
米国			
USD 1,228,685	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 0% 15/8/2030	917,288	0.01
USD 9,669,362	American Airlines Pass Through Trust 3.5% 15/12/2027	8,944,160	0.12
USD 966,625	American Airlines Pass Through Trust 4% 15/12/2025	940,043	0.01
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 8,273,137	Lessen 0% 5/1/2028	7,942,211	0.10
USD 1,480,000	Sun Country 7% 15/12/2023	1,459,724	0.02
USD 1,480,000	Sun Country 4.7% 15/12/2025	1,415,324	0.02
USD 1,905,864	Sun Country 4.84% 15/3/2031	1,846,401	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
		23,465,151	0.30
債券合計			
		49,021,513	0.62
その他の譲渡可能な有価証券合計			
		64,684,107	0.83

その他の譲渡可能な有価証券(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
投資有価証券合計		6,812,411,643	87.68
その他の純資産		956,989,769	12.32
純資産合計(米ドル)		7,769,401,412	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	1,451,581	USD	1,000,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(20,547)
AUD	891,012	USD	619,558	HSBC Bank	15/3/2023	(18,349)
AUD	3,745,000	JPY	335,816,022	Citigroup	15/3/2023	63,585
AUD	998,773	USD	700,000	Standard Chartered Bank	15/3/2023	(26,079)
AUD	710,557	USD	500,000	Commonwealth Bank of Australia	15/3/2023	(20,552)
AUD	4,308,804	USD	2,987,841	Morgan Stanley	15/3/2023	(80,480)
AUD	15,158,226	USD	10,532,035	JP Morgan	15/3/2023	(304,038)
AUD	9,586,687	USD	6,740,274	BNP Paribas	15/3/2023	(271,666)
AUD	2,977,000	USD	2,102,892	Bank of America	14/3/2023	(94,298)
AUD	4,316,000	CAD	4,080,105	Morgan Stanley	14/3/2023	(89,970)
AUD	4,666,000	USD	3,330,085	JP Morgan	14/3/2023	(181,828)
AUD	4,646,000	USD	3,270,759	Citigroup	15/3/2023	(135,875)
AUD	582,220	USD	400,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	(7,147)
AUD	5,462,159	USD	3,800,000	State Street	15/3/2023	(114,414)
AUD	1,172,500	USD	816,266	Bank of America	15/3/2023	(25,122)
AUD	6,808,000	USD	4,789,118	Deutsche Bank	14/3/2023	(195,606)
BRL	149,821,895	USD	27,532,641	Goldman Sachs	15/3/2023	1,135,000
BRL	63,898,306	USD	11,952,545	Bank of America	15/3/2023	274,064
BRL	16,420,134	USD	3,222,000	Goldman Sachs	2/3/2023	(71,653)
BRL	102,671,430	USD	19,936,200	HSBC Bank	15/3/2023	(290,555)
BRL	16,478,606	USD	3,168,000	JP Morgan	2/3/2023	(6,436)
BRL	2,631,019	USD	502,400	Citigroup	15/3/2023	1,032
BRL	12,101,931	USD	2,351,000	BNP Paribas	2/3/2023	(29,138)
BRL	12,320,368	USD	2,351,000	Goldman Sachs	4/4/2023	(2,916)
BRL	8,202,835	USD	1,571,000	Deutsche Bank	4/4/2023	(7,659)
CAD	538,890	USD	400,000	Barclays	15/3/2023	(3,490)
CAD	268,883	USD	200,000	Goldman Sachs	15/3/2023	(2,158)
CAD	1,739,165	USD	1,300,000	JP Morgan	15/3/2023	(20,339)
CAD	536,450	USD	400,000	UBS	15/3/2023	(5,285)
CAD	535,935	USD	400,000	HSBC Bank	15/3/2023	(5,664)
CAD	8,864,716	USD	6,640,000	BNP Paribas	15/3/2023	(117,425)
CAD	1,874,430	USD	1,400,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(20,812)
CAD	804,262	USD	600,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(8,232)
CAD	3,097,091	USD	2,315,000	HSBC Bank	14/3/2023	(36,211)
CAD	2,381,984	USD	1,770,000	Citigroup	15/3/2023	(17,359)
CAD	269,027	USD	200,000	Standard Chartered Bank	15/3/2023	(2,052)
CAD	1,083,090	USD	800,000	State Street	15/3/2023	(3,073)
CAD	10,789,990	EUR	7,496,000	UBS	14/3/2023	(40,540)
CHF	93,131	USD	100,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(286)
CHF	4,951,912	USD	5,405,000	BNP Paribas	15/3/2023	(103,046)
CHF	91,218	USD	100,000	HSBC Bank	15/3/2023	(2,334)
CHF	457,272	USD	500,000	UBS	15/3/2023	(10,404)
CHF	1,386,792	USD	1,500,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(15,178)
CHF	2,475,475	USD	2,700,000	JP Morgan	15/3/2023	(49,537)
CHF	2,211,226	USD	2,400,000	Citigroup	15/3/2023	(32,465)
CHF	2,064,836	NZD	3,474,000	BNP Paribas	15/3/2023	63,816
CHF	2,284,138	USD	2,505,000	Deutsche Bank	15/3/2023	(59,399)
CHF	364,142	USD	400,000	Bank of America	15/3/2023	(10,117)
CHF	185,593	USD	200,000	State Street	15/3/2023	(1,288)
CLP	2,548,722,000	USD	3,174,000	Citigroup	14/3/2023	(107,346)
CLP	7,649,315,100	USD	9,505,000	Toronto-Dominion	14/3/2023	(301,247)
CLP	5,109,782,500	USD	6,312,000	Bank of America	14/3/2023	(163,846)
CNH	17,390,000	USD	2,504,979	JP Morgan	15/3/2023	(599)
CNH	8,695,000	USD	1,254,120	Morgan Stanley	15/3/2023	(1,930)

未決済先渡為替予約 2023年2月28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)
CNH	8,685,000	USD	1,255,149	HSBC Bank	15/3/2023	(4,400)
CNH	200,420,030	USD	29,267,371	Citigroup	15/3/2023	(404,358)
CNH	54,840,000	USD	7,997,200	Deutsche Bank	15/3/2023	(99,548)
CNH	26,950,000	USD	3,984,918	Nomura	15/3/2023	(103,778)
CNH	44,734,862	EUR	6,080,666	JP Morgan	15/3/2023	(31,014)
CNH	28,690,114	USD	4,245,000	BNP Paribas	15/3/2023	(113,262)
COP	328,666,313	USD	67,508	BNP Paribas	15/3/2023	645
COP	15,079,088,880	USD	3,222,000	Barclays	14/3/2023	(94,468)
COP	14,732,442,000	GBP	2,586,000	HSBC Bank	14/3/2023	(84,234)
COP	15,720,524,000	USD	3,158,000	Toronto-Dominion	14/3/2023	102,570
COP	14,320,183,462	USD	2,865,068	BNY Mellon	10/5/2023	70,172
CZK	264,677,160	USD	12,000,000	Morgan Stanley	14/3/2023	(29,860)
EUR	18,396,876	USD	19,711,742	Citigroup	15/3/2023	(126,665)
EUR	77,909,313	USD	83,739,900	Bank of America	15/3/2023	(798,645)
EUR	42,002,241	USD	45,005,195	Goldman Sachs	15/3/2023	(290,148)
EUR	28,975,882	USD	31,495,194	Morgan Stanley	15/3/2023	(647,843)
EUR	56,200,880	USD	60,401,713	Deutsche Bank	15/3/2023	(570,976)
EUR	22,162,721	USD	23,973,495	HSBC Bank	15/3/2023	(379,347)
EUR	19,019,909	USD	20,497,952	State Street	15/3/2023	(249,601)
EUR	29,428,717	USD	31,656,137	JP Morgan	15/3/2023	(326,701)
EUR	6,271,858	NOK	66,570,000	Bank of America	15/3/2023	222,646
EUR	5,718,212	NOK	60,700,000	Barclays	15/3/2023	202,368
EUR	6,450,957	NOK	68,530,000	BNP Paribas	15/3/2023	223,281
EUR	9,440,000	GBP	8,334,331	State Street	15/3/2023	(69,862)
EUR	100,977,636	USD	109,826,868	BNP Paribas	15/3/2023	(2,327,374)
EUR	648,243	USD	700,000	UBS	15/3/2023	(9,889)
EUR	15,741,335	USD	17,052,143	Barclays	15/3/2023	(294,119)
EUR	2,606,000	CNH	18,946,923	UBS	15/3/2023	45,718
EUR	12,942,150	USD	14,077,682	Citibank	15/3/2023	(299,636)
EUR	2,085,000	JPY	288,564,417	JP Morgan	15/3/2023	102,924
EUR	1,737,333	CNH	12,733,608	BNP Paribas	15/3/2023	15,742
EUR	2,633,000	PLN	12,475,586	HSBC Bank	14/3/2023	(12,504)
EUR	2,633,000	PLN	12,474,085	UBS	14/3/2023	(12,165)
EUR	2,244,000	USD	2,439,636	Royal Bank of Canada	14/3/2023	(50,855)
EUR	4,348,000	USD	4,756,768	JP Morgan	13/3/2023	(128,534)
EUR	1,737,333	CNH	12,698,466	JP Morgan	15/3/2023	20,803
EUR	2,763,278	USD	2,969,021	UBS	14/3/2023	(27,458)
EUR	1,675,000	NOK	18,449,287	Citigroup	15/3/2023	(5,567)
EUR	1,199,404	USD	1,288,725	Morgan Stanley	14/3/2023	(11,936)
EUR	496,965	USD	531,799	Bank of America	14/3/2023	(2,770)
EUR	2,952,000	CAD	4,244,400	JP Morgan	14/3/2023	19,502
EUR	1,193,077	USD	1,278,942	BNY Mellon	10/5/2023	(4,677)
EUR	928,065	HUF	360,000,000	JP Morgan	16/3/2023	(21,975)
GBP	251,166	USD	300,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	4,966
GBP	1,553,584	USD	1,900,000	HSBC Bank	15/3/2023	(13,636)
GBP	8,382,937	EUR	9,440,000	State Street	15/3/2023	128,880
GBP	19,331,522	USD	23,326,118	JP Morgan	15/3/2023	146,264
GBP	81,331	USD	100,000	BNP Paribas	15/3/2023	(1,248)
GBP	241,788	USD	300,000	UBS	15/3/2023	(6,421)
GBP	12,523,907	USD	15,173,816	Morgan Stanley	15/3/2023	32,743
GBP	80,857	USD	100,000	Citigroup	15/3/2023	(1,823)
GBP	243,183	USD	300,000	Bank of America	15/3/2023	(4,726)
GBP	166,379	USD	200,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	2,018
GBP	248,759	USD	300,000	Standard Chartered Bank	15/3/2023	2,044

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	7,201,467	USD	8,689,202	Barclays	15/3/2023	54,837
GBP	13,450,000	USD	16,292,926	Goldman Sachs	15/3/2023	38,097
GBP	3,910,000	USD	4,711,054	Morgan Stanley	14/3/2023	36,386
HUF	360,000,000	EUR	909,858	JP Morgan	16/3/2023	41,360
HUF	1,156,263,466	USD	3,172,000	UBS	14/3/2023	74,499
IDR	93,750,000,000	USD	6,015,517	JP Morgan	15/3/2023	130,244
IDR	31,450,000,000	USD	2,015,121	BNP Paribas	15/3/2023	46,577
IDR	58,343,191,818	USD	3,746,986	Barclays	15/3/2023	77,690
IDR	63,310,000,000	USD	4,061,458	UBS	15/3/2023	88,816
IDR	63,310,000,000	USD	4,061,458	Citibank	15/3/2023	88,816
IDR	24,076,565,000	USD	1,588,688	Citibank	17/4/2023	(11,403)
IDR	72,414,286,800	USD	4,834,000	Barclays	14/3/2023	(86,812)
INR	998,375,191	USD	12,001,000	BNP Paribas	15/3/2023	65,984
INR	126,860,000	USD	1,554,466	Citibank	17/4/2023	(24,426)
INR	395,173,040	USD	4,832,000	Bank of America	14/3/2023	(55,388)
JPY	6,583,540,969	USD	48,928,891	Morgan Stanley	15/3/2023	(635,875)
JPY	11,231,368,698	USD	85,749,708	JP Morgan	15/3/2023	(3,362,943)
JPY	357,552,770	USD	2,699,492	UBS	15/3/2023	(76,694)
JPY	3,003,316,095	USD	23,357,728	Deutsche Bank	15/3/2023	(1,327,154)
JPY	1,696,726,352	USD	12,939,447	HSBC Bank	15/3/2023	(493,251)
JPY	7,638,287,720	USD	58,545,178	BNP Paribas	15/3/2023	(2,515,154)
JPY	165,630,000	USD	1,269,018	State Street	15/3/2023	(54,052)
JPY	336,432,075	AUD	3,745,000	Citigroup	15/3/2023	(59,066)
JPY	293,530,000	USD	2,229,534	BNY Mellon	15/3/2023	(76,369)
JPY	221,148,115	USD	1,699,017	Standard Chartered Bank	15/3/2023	(76,802)
JPY	4,597,336,632	USD	35,221,955	Goldman Sachs	15/3/2023	(1,498,575)
JPY	2,251,282,976	USD	17,558,977	Citibank	15/3/2023	(1,044,878)
JPY	288,141,287	EUR	2,085,000	JP Morgan	15/3/2023	(106,028)
JPY	1,339,971,540	USD	10,036,240	Bank of America	15/3/2023	(206,990)
JPY	1,338,937,838	USD	10,317,301	Citigroup	15/3/2023	(495,634)
JPY	263,567,832	NZD	3,140,000	Deutsche Bank	15/3/2023	(7,184)
JPY	943,963,048	USD	7,272,000	BNY Mellon	14/3/2023	(348,672)
JPY	385,712,936	EUR	2,733,000	State Street	14/3/2023	(80,389)
JPY	288,228,191	NZD	3,474,000	JP Morgan	15/3/2023	(32,706)
JPY	280,805,112	NZD	3,355,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(13,614)
JPY	53,575,736	USD	400,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	(7,000)
KRW	5,180,000,000	USD	4,174,390	Barclays	15/3/2023	(252,422)
KRW	1,930,492,662	USD	1,570,000	BNP Paribas	14/3/2023	(108,564)
KRW	8,035,273,400	USD	6,304,000	Citigroup	14/3/2023	(221,078)
MXN	718,564,066	USD	35,658,978	Royal Bank of Canada	15/3/2023	3,451,085
MXN	616,992,156	USD	31,888,745	Citigroup	15/3/2023	1,692,953
MXN	44,169,416	USD	2,210,000	Morgan Stanley	15/3/2023	194,057
MXN	61,985,880	USD	3,276,000	Royal Bank of Canada	14/3/2023	98,450
MXN	94,941,412	GBP	4,060,000	JP Morgan	14/3/2023	238,950
MXN	148,928,688	USD	7,886,000	Bank of America	14/3/2023	241,084
MXN	15,938,084	USD	835,000	HSBC Bank	15/3/2023	32,479
MXN	61,508,378	USD	3,182,000	HSBC Bank	14/3/2023	166,456
MXN	304,910,585	USD	16,294,004	JP Morgan	10/5/2023	124,496
MYSR	17,500,000	USD	4,065,041	Goldman Sachs	15/3/2023	(162,028)
NOK	44,600,000	EUR	4,287,296	RBS	15/3/2023	(240,008)
NOK	152,631,143	USD	15,699,637	Bank of America	15/3/2023	(901,286)
NOK	99,896,324	USD	9,851,000	HSBC Bank	15/3/2023	(169,177)
NOK	87,640,000	EUR	8,293,760	Bank of America	15/3/2023	(332,295)
NOK	68,040,000	EUR	6,485,665	Barclays	15/3/2023	(307,739)

未決済先渡為替予約 2023年2月28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)
NOK	15,120,000	EUR	1,440,209	Morgan Stanley	15/3/2023	(67,268)
NOK	374,808,848	USD	37,239,276	JP Morgan	15/3/2023	(899,689)
NOK	255,438,117	USD	25,792,419	Deutsche Bank	15/3/2023	(1,026,419)
NOK	10,067,409	USD	1,000,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(23,914)
NOK	47,987,404	USD	4,835,833	BNP Paribas	15/3/2023	(183,215)
NOK	18,613,335	USD	1,895,000	UBS	15/3/2023	(90,344)
NOK	38,057,529	USD	3,837,797	Goldman Sachs	15/3/2023	(147,930)
NOK	32,136,844	USD	3,228,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(112,172)
NOK	68,897,875	USD	6,849,666	Citigroup	15/3/2023	(169,674)
NOK	32,823,641	EUR	3,030,000	Goldman Sachs	14/3/2023	(43,255)
NOK	32,097,725	USD	3,222,000	HSBC Bank	14/3/2023	(110,139)
NOK	22,688,645	USD	2,200,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	(223)
NOK	18,144,270	EUR	1,675,000	Citigroup	15/3/2023	(24,006)
NOK	24,409,230	USD	2,373,000	JP Morgan	14/3/2023	(6,535)
NOK	48,821,387	USD	4,719,000	Deutsche Bank	14/3/2023	14,214
NZD	2,198,674	USD	1,400,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(41,190)
NZD	2,523,760	USD	1,600,000	HSBC Bank	15/3/2023	(40,282)
NZD	316,411	USD	200,000	BNP Paribas	15/3/2023	(4,454)
NZD	2,665,791	USD	1,700,000	State Street	15/3/2023	(52,504)
NZD	1,588,850	USD	1,000,000	Morgan Stanley	15/3/2023	(18,069)
NZD	3,474,000	CHF	2,054,878	JP Morgan	15/3/2023	(53,154)
NZD	4,090,676	USD	2,601,656	JP Morgan	15/3/2023	(73,561)
NZD	3,474,000	JPY	289,816,713	BNP Paribas	15/3/2023	21,054
NZD	2,559,628	USD	1,600,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	(18,114)
NZD	635,100	USD	400,000	Standard Chartered Bank	15/3/2023	(7,499)
NZD	7,333,750	JPY	611,233,276	Deutsche Bank	15/3/2023	48,710
NZD	2,516,250	JPY	207,292,449	Bank of America	15/3/2023	34,501
NZD	5,020,000	USD	3,175,700	Goldman Sachs	14/3/2023	(73,276)
SEK	376,309,184	USD	36,311,393	JP Morgan	15/3/2023	(167,085)
SEK	50,170,000	USD	4,813,832	Deutsche Bank	15/3/2023	4,971
SEK	12,641,689	USD	1,200,000	Royal Bank of Canada	15/3/2023	14,228
SEK	25,984,991	USD	2,500,000	HSBC Bank	15/3/2023	(4,155)
SEK	17,827,633	USD	1,700,000	BNP Paribas	15/3/2023	12,335
SEK	17,828,077	USD	1,705,000	Citibank	15/3/2023	7,378
SEK	2,044,729	USD	200,000	UBS	15/3/2023	(3,605)
SEK	42,498,979	USD	4,107,333	Citigroup	15/3/2023	(25,327)
SEK	60,322,455	USD	5,794,309	Bank of America	15/3/2023	(367)
SEK	4,242,304	USD	400,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	7,471
SEK	70,500,000	USD	6,772,562	Goldman Sachs	15/3/2023	(1,072)
SGD	14,460,000	USD	10,675,211	BNP Paribas	15/3/2023	61,472
SGD	14,460,000	USD	10,656,644	Bank of America	15/3/2023	80,039
SGD	5,350,000	USD	4,037,437	Goldman Sachs	15/3/2023	(65,013)
SGD	5,359,307	USD	4,006,000	UBS	14/3/2023	(26,766)
THB	139,000,000	USD	3,978,981	Barclays	15/3/2023	(40,581)
THB	101,317,720	USD	3,106,000	BNY Mellon	14/3/2023	(235,580)
THB	132,400,000	USD	3,963,360	Goldman Sachs	15/3/2023	(211,963)
TWD	25,700,000	USD	847,350	Barclays	15/3/2023	(5,799)
TWD	25,700,000	USD	848,371	JP Morgan	15/3/2023	(6,820)
TWD	121,800,000	USD	4,078,762	BNP Paribas	15/3/2023	(90,398)
USD	3,691,503	TWD	111,400,000	Barclays	15/3/2023	43,688
USD	7,753,821	JPY	1,008,373,970	UBS	15/3/2023	356,977
USD	1,009,208,006	EUR	944,982,986	UBS	15/3/2023	3,191,244
USD	5,020,868	CNH	34,770,000	Morgan Stanley	15/3/2023	13,550
USD	8,882,023	HKD	69,214,000	BNY Mellon	15/3/2023	57,896

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	4,746,939	EUR	4,459,647	Bank of America	14/3/2023	(441)
USD	88,732,676	EUR	82,358,905	JP Morgan	15/3/2023	1,054,444
USD	46,686,165	CNH	323,955,298	Royal Bank of Canada	15/3/2023	32,514
USD	5,687,004	EUR	5,303,553	Royal Bank of Canada	15/3/2023	40,909
USD	174,988,803	EUR	161,864,846	Deutsche Bank	15/3/2023	2,673,215
USD	16,942,485	SEK	172,887,641	BNP Paribas	15/3/2023	336,713
USD	26,293,341	JPY	3,396,955,054	HSBC Bank	15/3/2023	1,375,260
USD	6,189,172	KRW	8,000,000,000	Toronto-Dominion	15/3/2023	132,080
USD	99,673,372	EUR	92,219,370	Bank of America	15/3/2023	1,497,816
USD	92,855,648	EUR	85,798,810	Citigroup	15/3/2023	1,515,335
USD	32,756,548	EUR	30,331,000	Commonwealth Bank of Australia	15/3/2023	466,556
USD	3,994,448	KRW	5,180,000,000	Bank of America	15/3/2023	72,481
USD	2,035,908	TWD	61,800,000	BNP Paribas	15/3/2023	12,255
USD	114,977,605	EUR	106,331,348	BNP Paribas	15/3/2023	1,778,617
USD	45,702,610	NOK	461,122,567	JP Morgan	15/3/2023	994,475
USD	3,901,133	CAD	5,312,950	BNP Paribas	15/3/2023	(8,086)
USD	245,627,664	GBP	201,322,125	Toronto-Dominion	15/3/2023	1,181,844
USD	5,523,569	AUD	8,165,500	Deutsche Bank	15/3/2023	13,906
USD	14,728,294	SGD	19,810,000	UBS	15/3/2023	19,187
USD	10,705,173	SGD	14,460,000	Barclays	15/3/2023	(31,510)
USD	604,633	AUD	901,000	State Street	15/3/2023	(3,316)
USD	22,531,255	JPY	2,994,379,668	Morgan Stanley	15/3/2023	566,233
USD	17,067,732	NOK	171,078,524	Deutsche Bank	15/3/2023	480,816
USD	4,467,870	AUD	6,409,954	Morgan Stanley	15/3/2023	144,220
USD	6,207,866	EUR	5,784,956	HSBC Bank	15/3/2023	49,276
USD	53,724,164	JPY	7,029,473,503	JP Morgan	15/3/2023	2,160,048
USD	369,853	JPY	47,907,005	Barclays	15/3/2023	18,435
USD	26,138,986	SEK	270,543,844	JP Morgan	15/3/2023	153,385
USD	26,793,710	SEK	275,577,960	Deutsche Bank	15/3/2023	324,586
USD	5,885,801	JPY	766,277,568	BNP Paribas	15/3/2023	264,835
USD	600,000	CAD	816,826	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(1,013)
USD	6,340,000	CAD	8,472,878	HSBC Bank	15/3/2023	105,736
USD	2,100,000	CHF	1,931,338	HSBC Bank	15/3/2023	32,140
USD	25,600,196	EUR	23,813,886	Barclays	15/3/2023	248,239
USD	100,000	GBP	82,793	HSBC Bank	15/3/2023	(528)
USD	1,200,000	SEK	12,543,496	HSBC Bank	15/3/2023	(4,796)
USD	7,215,000	NOK	72,433,682	HSBC Bank	15/3/2023	195,737
USD	200,000	AUD	291,539	Standard Chartered Bank	15/3/2023	3,284
USD	500,000	NZD	787,498	Standard Chartered Bank	15/3/2023	13,315
USD	1,400,000	CHF	1,278,421	Standard Chartered Bank	15/3/2023	31,209
USD	37,974,810	EUR	35,029,000	State Street	15/3/2023	683,386
USD	1,571,536	JPY	207,082,516	Royal Bank of Canada	15/3/2023	52,499
USD	3,809,393	ZAR	67,720,810	Citigroup	15/3/2023	125,234
USD	2,485,000	NOK	25,329,069	BNP Paribas	15/3/2023	29,221
USD	1,600,000	NZD	2,490,999	Morgan Stanley	15/3/2023	60,528
USD	10,856,359	GBP	9,012,057	Morgan Stanley	15/3/2023	(86,102)
USD	6,115,000	NOK	62,600,919	Morgan Stanley	15/3/2023	45,528
USD	1,200,000	AUD	1,735,170	HSBC Bank	15/3/2023	29,196
USD	76,199,467	EUR	70,570,949	Morgan Stanley	15/3/2023	1,070,539
USD	12,259,885	IDR	188,082,000,000	Bank of America	15/3/2023	(69,788)
USD	2,687,708	EUR	2,495,333	Citibank	15/3/2023	31,209
USD	1,701,071	NZD	2,671,350	Bank of America	15/3/2023	50,139
USD	300,000	CHF	274,068	BNP Paribas	15/3/2023	6,559
USD	200,000	NZD	312,651	HSBC Bank	15/3/2023	6,777

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	11,718,794	IDR	181,236,000,000	HSBC Bank	15/3/2023	(162,086)
USD	747,044	EUR	694,000	BNY Mellon	15/3/2023	8,221
USD	86,714,932	EUR	80,098,293	Standard Chartered Bank	15/3/2023	1,443,316
USD	9,324,231	GBP	7,673,430	Royal Bank of Canada	15/3/2023	7,134
USD	200,000	NOK	1,996,477	UBS	15/3/2023	6,432
USD	537,280	GBP	442,756	UBS	15/3/2023	(316)
USD	700,000	SEK	7,314,800	UBS	15/3/2023	(2,583)
USD	200,000	AUD	289,151	UBS	15/3/2023	4,895
USD	500,000	NZD	778,130	UBS	15/3/2023	19,104
USD	1,300,000	SEK	13,521,837	Morgan Stanley	15/3/2023	1,234
USD	1,100,000	JPY	141,736,100	Citibank	15/3/2023	60,307
USD	5,902,809	AUD	8,397,866	JP Morgan	15/3/2023	236,356
USD	600,000	NZD	937,686	JP Morgan	15/3/2023	20,497
USD	42,473,949	JPY	5,546,796,230	Bank of America	15/3/2023	1,785,888
USD	1,705,000	SEK	17,676,928	Citibank	15/3/2023	7,140
USD	52,984,323	EUR	48,897,000	RBS	15/3/2023	929,205
USD	3,558,767	AUD	5,123,664	BNP Paribas	15/3/2023	101,579
USD	16,701,036	GBP	13,622,048	State Street	15/3/2023	161,111
USD	3,112,234	JPY	396,560,000	Société Générale	15/3/2023	203,302
USD	800,000	NZD	1,258,854	BNP Paribas	15/3/2023	22,011
USD	55,010,762	JPY	7,091,000,000	Deutsche Bank	15/3/2023	2,995,323
USD	900,000	CHF	816,942	Bank of America	15/3/2023	25,310
USD	8,564,937	GBP	7,152,635	Barclays	15/3/2023	(119,811)
USD	2,970,844	GBP	2,447,658	Commonwealth Bank of Australia	15/3/2023	(1,109)
USD	900,000	SEK	9,223,660	Barclays	15/3/2023	14,072
USD	1,000,000	CAD	1,346,571	Morgan Stanley	15/3/2023	9,205
USD	6,080,000	NOK	60,192,164	Standard Chartered Bank	15/3/2023	248,288
USD	1,580,420	ZAR	27,620,000	Morgan Stanley	17/4/2023	82,102
USD	8,705,778	MXN	162,338,340	Goldman Sachs	15/3/2023	(129,987)
USD	300,000	CHF	274,347	Goldman Sachs	15/3/2023	6,260
USD	1,715,000	ZAR	29,622,337	Citibank	15/3/2023	103,481
USD	41,489,067	GBP	34,501,527	JP Morgan	15/3/2023	(402,773)
USD	4,993,367	GBP	4,023,000	Standard Chartered Bank	15/3/2023	108,630
USD	3,200,000	ZAR	55,435,395	BNP Paribas	15/3/2023	184,194
USD	6,819,445	AUD	9,596,976	Citigroup	15/3/2023	343,895
USD	1,700,000	NZD	2,619,815	Citigroup	15/3/2023	80,918
USD	1,332,596	GBP	1,086,899	Citigroup	15/3/2023	12,881
USD	2,425,227	AUD	3,415,000	Barclays	15/3/2023	120,959
USD	1,836,057	SEK	18,750,000	Goldman Sachs	15/3/2023	35,129
USD	500,000	CHF	457,847	Royal Bank of Canada	15/3/2023	9,789
USD	1,335,000	NOK	13,176,450	Bank of America	15/3/2023	57,477
USD	300,000	CAD	400,940	Citigroup	15/3/2023	4,992
USD	5,070,000	CAD	6,781,624	JP Morgan	15/3/2023	80,144
USD	4,579,704	GBP	3,706,000	HSBC Bank	14/3/2023	79,956
USD	411,000	ZAR	7,174,516	Barclays	14/3/2023	20,654
USD	3,295,967	AUD	4,666,000	Bank of America	14/3/2023	147,711
USD	4,767,802	NZD	7,370,000	HSBC Bank	14/3/2023	213,048
USD	813,000	CAD	1,087,616	Royal Bank of Canada	14/3/2023	12,750
USD	3,222,000	NOK	32,078,148	HSBC Bank	14/3/2023	112,037
USD	2,424,000	SGD	3,183,333	HSBC Bank	14/3/2023	60,406
USD	2,505,000	CHF	2,292,659	UBS	15/3/2023	50,277
USD	4,389,429	THB	147,320,000	Goldman Sachs	15/3/2023	215,292
USD	11,243,000	CLP	9,148,429,100	JP Morgan	14/3/2023	235,494
USD	16,864,332	JPY	2,220,271,315	Citigroup	15/3/2023	577,718

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	4,184,776	MXN	78,786,078	JP Morgan	15/3/2023	(103,400)
USD	600,000	AUD	846,685	Bank of America	15/3/2023	28,700
USD	1,600,000	CAD	2,131,307	Bank of America	15/3/2023	31,804
USD	5,605,000	CHF	5,103,226	JP Morgan	15/3/2023	141,038
USD	3,408,166	NOK	34,292,418	Citigroup	15/3/2023	83,345
USD	11,927,470	MXN	222,927,992	Citigroup	15/3/2023	(206,073)
USD	3,174,000	BRL	16,025,240	Bank of America	2/3/2023	99,418
USD	12,601,297	MXN	239,294,843	Barclays	10/5/2023	(283,998)
USD	3,686,185	THB	124,080,000	Citigroup	15/3/2023	170,525
USD	6,322,000	MXN	118,263,488	HSBC Bank	14/3/2023	(116,149)
USD	3,178,484	NZD	4,964,000	UBS	14/3/2023	110,670
USD	9,039,672	JPY	1,223,015,033	Toronto-Dominion	15/3/2023	68,347
USD	3,256,000	COP	15,636,940,000	Bank of America	14/3/2023	12,766
USD	4,245,000	CNH	28,820,362	JP Morgan	15/3/2023	94,504
USD	11,241,392	JPY	1,495,701,643	Goldman Sachs	15/3/2023	269,797
USD	1,500,000	CHF	1,387,459	Toronto-Dominion	15/3/2023	14,463
USD	1,800,000	CAD	2,423,846	Toronto-Dominion	15/3/2023	16,557
USD	12,068,590	CNH	81,790,000	Citigroup	15/3/2023	289,798
USD	4,073,557	MYR	17,500,000	Barclays	15/3/2023	170,544
USD	7,867,612	EUR	7,297,918	JP Morgan	10/5/2023	73,068
USD	3,196,000	MXN	60,696,514	Citigroup	14/3/2023	(108,260)
USD	6,338,000	ZAR	113,479,790	Citigroup	14/3/2023	163,880
USD	3,168,000	MXN	60,314,938	UBS	14/3/2023	(115,486)
USD	3,168,000	JPY	414,654,450	JP Morgan	14/3/2023	126,792
USD	3,256,000	BRL	17,204,232	BNP Paribas	2/3/2023	(44,782)
USD	200,000	CHF	183,287	Morgan Stanley	15/3/2023	3,757
USD	1,156,970	EUR	1,066,876	Morgan Stanley	14/6/2023	15,216
USD	1,737,333	SEK	18,303,046	Citigroup	15/3/2023	(20,665)
USD	1,602,254	EUR	1,490,000	Royal Bank of Canada	14/6/2023	7,677
USD	2,528,769	SGD	3,360,000	State Street	15/3/2023	33,938
USD	3,170,000	JPY	419,337,110	BNP Paribas	14/3/2023	94,448
USD	50,266,380	MXN	945,787,073	JP Morgan	10/5/2023	(661,356)
USD	4,636,484	EUR	4,305,812	Citigroup	10/5/2023	37,660
USD	7,605,614	COP	36,978,495,491	Bank of America	10/5/2023	26,048
USD	4,792,000	TWD	143,007,656	Bank of America	16/5/2023	98,750
USD	9,760,299	ZAR	176,219,154	State Street	10/5/2023	218,659
USD	3,164,000	KRW	4,061,626,800	Deutsche Bank	14/3/2023	89,238
USD	1,582,000	SGD	2,112,952	Bank of America	14/3/2023	13,153
USD	3,164,000	COP	15,437,156,000	Barclays	14/3/2023	(37,798)
USD	2,373,000	NOK	24,224,636	JP Morgan	14/3/2023	24,431
USD	167,367	TWD	4,993,177	BNP Paribas	21/6/2023	2,750
USD	3,520,000	CLP	2,815,770,410	Bank of America	14/3/2023	132,029
USD	2,790,000	CLP	2,216,543,750	BNP Paribas	14/3/2023	123,027
USD	2,389,095	MXN	45,012,334	Morgan Stanley	10/5/2023	(34,681)
USD	3,158,000	MXN	58,736,606	Goldman Sachs	14/3/2023	(39,564)
USD	4,044,176	IDR	61,520,000,000	BNP Paribas	15/3/2023	11,245
USD	800,000	EUR	749,231	Toronto-Dominion	15/3/2023	2,379
USD	4,820,000	HUF	1,751,604,774	Goldman Sachs	14/3/2023	(98,068)
USD	19,483,583	GBP	16,310,000	Goldman Sachs	15/3/2023	(320,059)
USD	400,000	SEK	4,190,098	Toronto-Dominion	15/3/2023	(2,457)
USD	15,905,517	BRL	83,112,324	Deutsche Bank	15/3/2023	2,406
USD	800,000	SEK	8,310,490	State Street	15/3/2023	1,782
USD	400,000	NOK	4,126,125	State Street	15/3/2023	(48)
USD	300,000	JPY	40,296,990	State Street	15/3/2023	4,405

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 2023年2月28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	4,719,000	NOK	48,807,909	Deutsche Bank	14/3/2023	(12,907)
USD	4,236,056	GBP	3,520,000	Bank of America	15/3/2023	(37,937)
USD	500,000	GBP	415,719	BNP Paribas	15/3/2023	(4,767)
USD	3,134,000	ZAR	57,649,146	JP Morgan	14/3/2023	(2,530)
USD	3,134,000	MXN	58,108,265	JP Morgan	31/3/2023	(18,544)
USD	417,500	MXN	7,695,308	Morgan Stanley	15/3/2023	(1,341)
USD	7,854,207	MXN	144,636,793	Citibank	15/3/2023	(18,096)
USD	6,809,180	NOK	70,400,000	Goldman Sachs	15/3/2023	(16,451)
USD	1,941,111	IDR	29,600,000,000	Goldman Sachs	15/3/2023	689
ZAR	230,205,385	USD	13,006,000	Citigroup	15/3/2023	(482,329)
ZAR	49,904,389	USD	2,900,000	JP Morgan	15/3/2023	(185,093)
ZAR	29,032,034	USD	1,715,000	BNP Paribas	15/3/2023	(135,594)
ZAR	17,100,000	USD	997,963	Bank of America	15/3/2023	(67,686)
ZAR	1,257,153	USD	72,000	BNY Mellon	14/3/2023	(3,602)
ZAR	55,450,414	USD	3,174,000	BNP Paribas	14/3/2023	(157,096)
ZAR	54,900,990	EUR	2,916,000	Bank of America	14/3/2023	(117,128)
ZAR	17,375,500	USD	1,000,000	HSBC Bank	15/3/2023	(54,735)
ZAR	89,168,864	USD	4,879,057	Morgan Stanley	10/5/2023	(50,881)
ZAR	44,440,969	USD	2,426,901	BNP Paribas	10/5/2023	(20,581)
ZAR	57,509,213	USD	3,134,000	Bank of America	14/3/2023	(5,083)
未実現純評価益						13,219,014
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	90,158,880	USD	62,981,916	BNY Mellon	15/3/2023	(2,146,209)
USD	898,878	AUD	1,296,776	BNY Mellon	15/3/2023	23,869
未実現純評価損						(2,122,340)
ヘッジを使用したカナダ・ドル建投資証券クラス						
CAD	1,281,543,863	USD	956,057,675	BNY Mellon	15/3/2023	(13,107,985)
USD	22,321,629	CAD	29,821,375	BNY Mellon	15/3/2023	379,291
未実現純評価損						(12,728,694)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	194,968,623	USD	212,722,840	BNY Mellon	15/3/2023	(3,966,093)
USD	3,197,493	CHF	2,954,322	BNY Mellon	15/3/2023	34,282
未実現純評価損						(3,931,811)
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	27,057	USD	3,996	BNY Mellon	15/3/2023	(99)
USD	46	CNY	316	BNY Mellon	15/3/2023	-
未実現純評価損						(99)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	1,143,636,545	USD	1,233,221,975	BNY Mellon	15/3/2023	(15,708,155)
USD	23,183,986	EUR	21,658,152	BNY Mellon	15/3/2023	126,891
未実現純評価損						(15,581,264)

未決済先渡為替予約 2023年2月28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	283,693,398	USD	344,871,288	BNY Mellon	15/3/2023	(409,990)
USD	3,222,373	GBP	2,676,640	BNY Mellon	15/3/2023	(27,604)
未実現純評価損						(437,594)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	3,005,512	USD	383,754	BNY Mellon	15/3/2023	(579)
USD	4,526	HKD	35,463	BNY Mellon	15/3/2023	5
未実現純評価損						(574)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	52,172,460,782	USD	400,075,373	BNY Mellon	15/3/2023	(17,334,908)
USD	4,719,388	JPY	623,765,583	BNY Mellon	15/3/2023	143,528
未実現純評価損						(17,191,380)
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	96,727,090	USD	21,890,809	BNY Mellon	15/3/2023	(63,979)
USD	375,197	PLN	1,678,151	BNY Mellon	15/3/2023	(3,489)
未実現純評価損						(67,468)
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	9,645,314	USD	930,189	BNY Mellon	15/3/2023	(3,759)
USD	10,409	SEK	108,389	BNY Mellon	15/3/2023	(2)
未実現純評価損						(3,761)
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	106,998,671	USD	80,965,136	BNY Mellon	15/3/2023	(1,517,141)
USD	1,069,727	SGD	1,425,477	BNY Mellon	15/3/2023	11,295
未実現純評価損						(1,505,846)
未実現純評価損合計						(40,351,817)

未決済上場先物取引 2023年2月28日現在

契約数	通貨	契約／摘要	満期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
(678)	EUR	Euro BOBL	2023年3月	1,987,215
497	EUR	Euro Bund	2023年3月	(1,244,753)
(129)	EUR	Euro BUXL	2023年3月	1,677,007
(484)	EUR	Euro Schatz	2023年3月	489,262
(870)	EUR	Euro-BTP	2023年3月	1,921,557
126	EUR	Euro-OAT	2023年3月	(773,856)
(380)	JPY	Nikkei 225 Index	2023年3月	(1,099,879)
265	JPY	TOPIX Index	2023年3月	1,281,133
(162)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年3月	(321,504)
343	AUD	Australian 10 Year Bond	2023年3月	(1,233,033)
(8)	EUR	Dax Index	2023年3月	11,142
(326)	EUR	EURO STOXX 50 Index	2023年3月	(851,748)
66	EUR	EURO STOXX Banks Index	2023年3月	21,404
10	GBP	FTSE 100 Index	2023年3月	38,663
305	USD	MSCI Emerging Markets Index	2023年3月	(1,159,296)
(62)	USD	NASDAQ 100 E-Mini Index	2023年3月	(123,892)
(281)	USD	Russell 2000 E-Mini Index	2023年3月	(1,027,272)
(430)	USD	S&P 500 E-Mini Index	2023年3月	2,925,887
29	KRW	Korean 10 Year Bond	2023年3月	(17,971)
349	KRW	Korean 3 Year Bond	2023年3月	(231,083)
(63)	AUD	90 Day Bank Bill	2023年6月	54,461
(47)	JPY	Japanese 10 Year Bond (OSE)	2023年6月	(47,295)
(373)	EUR	3 Month EURIBOR	2023年6月	90,296
(345)	CAD	Banker' s Acceptance	2023年6月	123,735
(360)	USD	US Long Bond (CBT)	2023年6月	499,480
(6,796)	USD	US Treasury 10 Year Note (CBT)	2023年6月	5,814,557
(7,919)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年6月	5,744,356
400	USD	US Ultra Bond (CBT)	2023年6月	(492,217)
(1)	GBP	Long Gilt	2023年6月	1,625
(1,214)	USD	US Treasury 2 Year Note (CBT)	2023年6月	398,458
(7,307)	USD	US Treasury 5 Year Note (CBT)	2023年6月	2,881,407
(120)	AUD	90 Day Bank Bill	2023年9月	100,241
(373)	EUR	3 Month EURIBOR	2023年9月	201,671
220	USD	3 Month SOFR	2023年9月	(179,338)
638	GBP	3 Month SONIA	2023年9月	(378,365)
120	AUD	90 Day Bank Bill	2024年3月	(116,912)
37	GBP	3 Month SONIA	2024年3月	37,874
63	AUD	90 Day Bank Bill	2024年6月	(77,392)
53	GBP	3 Month SONIA	2024年6月	(152,297)
(16)	USD	3 Month SOFR	2024年9月	14,400
100	GBP	3 Month SONIA	2024年9月	(308,343)
373	EUR	3 Month EURIBOR	2024年12月	(412,244)
(26)	USD	3 Month SOFR	2024年12月	63,125
95	GBP	3 Month SONIA	2024年12月	(282,193)
37	GBP	3 Month SONIA	2025年3月	12,351
合計				<u>15,860,424</u>

スワップ 2023年2月28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 (720,000)	ファンドはthyssenkruppに係るデフォルト・プロテクションを提供し、1%の固定金利を受け取る	Bank of America	20/12/2023	21,363	(863)
CDS	USD 5,940,000	ファンドはCDX.NA.HY.35.V2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	83,940	(204,523)
CDS	EUR (167,547)	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	20/12/2027	1,976	(39,733)
CDS	EUR (312,448)	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	20/12/2027	3,684	(74,096)
CDS	EUR (596,745)	ファンドはUnited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	20/12/2027	6,450	(84,854)
CDS	EUR 1,600,000	ファンドはDeutsche Bankに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(11,173)	90,125
CDS	USD 3,265,216	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.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	20/12/2027	(16,343)	19,826
CDS	EUR 15,260,000	ファンドはITRAXX.EUR.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	20/12/2027	3,265	(146,298)
CDS	USD 3,732,000	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	Bank of America	20/12/2027	(16,137)	25,478
CDS	USD 370,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	4,655	99,739
CDS	EUR 764,000	ファンドはSESに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(9,339)	10,089
CDS	EUR 1,660,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Bank of America	20/12/2027	(60,104)	(16,445)
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	(18,083)	(33,005)
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	(14,705)	29,203
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	(6,660)	12,191
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	Barclays	20/6/2024	(9,370)	9,851
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	(23,130)	(24,633)
CDS	EUR (800,000)	ファンドはTelecom Italiaに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2024	13,897	47,413
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	(27,857)	137
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	(27,866)	137
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	(27,820)	137
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	(27,328)	137
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	(38,245)	192
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	(16,555)	83

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 2023年2月28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 (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	(39,540)	50,017
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	(47,755)	48,588
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	(61,565)	69,071
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	(22,590)	24,453
CDS	EUR (593,333)	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	Barclays	20/12/2025	13,579	(295)
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	1,762	2,620
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	68,223	88,362
CDS	EUR (187,806)	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	Barclays	20/12/2027	1,573	(44,538)
CDS	EUR (100,709)	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	Barclays	20/12/2027	844	(23,883)
CDS	EUR (283,073)	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	Barclays	20/12/2027	2,371	(67,130)
CDS	USD (450,000)	ファンドはNRG Energyに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	837	28,706
CDS	EUR (1,154,000)	ファンドはPicard Bondcoに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Barclays	20/12/2027	(3,056)	(88,718)
CDS	EUR 593,333	ファンドはAltice France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	20/12/2027	(9,411)	38,165
CDS	USD 17,587,998	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	20/12/2027	(180,047)	941,035
CDS	USD 25,193,000	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	20/12/2027	(257,899)	1,347,935
CDS	USD 1,866,000	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	20/12/2027	(10,230)	99,839
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	Barclays	20/12/2027	(102,490)	(21,940)
CDS	USD 8,036,000	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	Barclays	20/12/2027	(33,190)	608,558
CDS	JPY 324,000,000	ファンドはITRAXX.JPN.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	Barclays	20/12/2027	(11,777)	(21,969)
CDS	JPY 635,434,000	ファンドはITRAXX.JPN.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	Barclays	20/12/2027	(21,145)	(43,086)
CDS	JPY 324,000,000	ファンドはITRAXX.JPN.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	Barclays	20/12/2027	(9,028)	(21,969)
CDS	JPY 271,180,000	ファンドはITRAXX.JPN.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	Barclays	20/12/2027	(496)	(18,388)
CDS	USD 4,085,000	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	Barclays	20/12/2027	(64,048)	27,888
CDS	USD 515,000	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	Barclays	20/12/2027	(5,342)	19,226

スワップ 2023年2月28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 240,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2027	4,678	64,695
CDS	EUR 412,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Barclays	20/12/2027	1,223	(4,082)
CDS	EUR (810,000)	ファンドはthyssenkrupp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	20/6/2023	19,094	(148)
CDS	EUR (940,000)	ファンドはthyssenkrupp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	20/6/2023	22,159	(172)
CDS	EUR (577,000)	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	BNP Paribas	20/12/2023	(45,027)	(98,847)
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	(17,386)	(28,918)
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	(10,980)	(19,279)
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	(6,603)	5,866
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	2,757	(6,249)
CDS	USD (818,182)	ファンドはCCO / CCO 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	(88,527)	60,232
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO / CCO 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	(52,859)	36,139
CDS	EUR 4,610,000	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	BNP Paribas	20/12/2027	(56,608)	(67,999)
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	20/12/2027	(21,123)	(11,060)
CDS	USD 2,755,208	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	BNP Paribas	20/12/2027	12,591	208,649
CDS	USD 4,132,812	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	BNP Paribas	20/12/2027	23,491	312,973
CDS	USD 2,660,980	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	BNP Paribas	20/12/2027	13,080	201,513
CDS	EUR 2,500,000	ファンドはCommerzbankに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(207,167)	108,472
CDS	EUR 3,464,774	ファンドはHSBCに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(6,075)	21,694
CDS	EUR 247,191	ファンドはINEOS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	20/12/2027	4,359	(21,189)
CDS	EUR 1,310,000	ファンドはIntesa Sanpaoloに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2027	(33,440)	68,806
CDS	USD 1,554,784	ファンドはITRAXX.ASIA.XJ.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	BNP Paribas	20/12/2027	(15,496)	9,440
CDS	EUR 2,690,241	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	BNP Paribas	20/12/2027	(92,679)	(40,571)
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	(350)	22,115
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	26,387	29,553
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	(5,551)	(16,186)

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 2023年2月28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 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	(8,394)	(24,467)
CDS	EUR 1,891,000	ファンドは Electricite de France に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/6/2025	(10,142)	(18,744)
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	(8,930)	(19,309)
CDS	EUR (82,139)	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	20/12/2027	1,281	(19,479)
CDS	EUR (84,622)	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	20/12/2027	1,319	(20,068)
CDS	USD (250,000)	ファンドは NRG Energy 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	20/12/2027	(73)	15,948
CDS	EUR 5,440,000	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	20/12/2027	(184,162)	(97,531)
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	Citibank	20/12/2027	55,699	389,550
CDS	USD 425,000	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	Citibank	20/12/2027	(1,734)	15,866
CDS	USD 150,000	ファンドは Pitney Bowes に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	989	40,435
CDS	USD 230,000	ファンドは Pitney Bowes に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	(305)	62,000
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	20/12/2027	(13,625)	1,849
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	Citibank	20/12/2027	(23,870)	2,496
CDS	USD 260,000	ファンドは Xerox に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Citibank	20/12/2027	(1,111)	28,081
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	215,388	261,450
CDS	USD (3,052,000)	ファンドは CMBX.NA.15.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	15/11/2064	(45,151)	(636,092)
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	4,101	9,893
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	(31,551)	(11,693)
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	(20,104)	(7,415)
CDS	EUR (2,200,000)	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	113,015	215,995
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	9,434	14,447
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	59,061	41,796
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	88,033	62,695
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	30,849	(23,646)
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	(32,494)	5,114
CDS	USD (384,551)	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	(42,217)	(74,891)

スワップ 2023年2月28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 (1,025,000)	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	Deutsche Bank	20/12/2027	(117)	3,851
CDS	USD 5,640,000	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	Deutsche Bank	20/12/2027	(58,156)	38,504
CDS	EUR 2,306,000	ファンドは SES に係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Deutsche Bank	20/12/2027	(31,960)	30,451
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	(26,537)	4,108
CDS	USD 5,810	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	(2)	(1)
CDS	USD 13,601	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	3	(1)
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	17,111	(24,900)
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	5,629	(1,463)
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	3,495	(834)
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	(6,425)	9,851
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	(33,283)	(41,029)
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	(32,274)	(39,786)
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	(35,355)	(43,516)
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	(40,776)	(44,044)
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	(15,929)	2,590
CDS	USD 500,000	ファンドは Pitney Bowes に係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/6/2025	(58,100)	62,622
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	(15,297)	(2,827)
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	(14,275)	(3,280)
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	(15,012)	(5,006)
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	(14,318)	(5,006)
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	(36,453)	(7,829)
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	(172)	8,094
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	8,723	15,274
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	(2,412)	(81,391)
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	57,405	41,796
CDS	EUR 3,890,000	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	6,650	(52,450)

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 2023年2月28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 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	(466)	15,393
CDS	USD 11,843,012	ファンドはCDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	138,124	(179,145)
CDS	EUR (748,195)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	(329)	(106,389)
CDS	EUR (1,481,000)	ファンドはUnitedに係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	(14,457)	(210,591)
CDS	EUR 4,620,000	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	20/12/2027	(140,472)	(82,829)
CDS	EUR 3,600,000	ファンドはBNP Paribasに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(11,707)	27,788
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	20/12/2027	(13,071)	(49,027)
CDS	USD 184,845,960	ファンドはCDX.NA.IG.39.V13に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(517,738)	(1,908,403)
CDS	EUR 3,298,907	ファンドはHSBCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(8,171)	20,655
CDS	EUR 1,386,319	ファンドはHSBCに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(3,434)	8,680
CDS	USD 13,091,000	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	20/12/2027	(138,414)	(45,123)
CDS	EUR 4,900,000	ファンドはINGに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(9,464)	55,224
CDS	EUR 26,382,000	ファンドはITRAXX.FINSR.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	Goldman Sachs	20/12/2027	(490,390)	(143,964)
CDS	EUR 19,834,000	ファンドはITRAXX.FINSUB.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	Goldman Sachs	20/12/2027	(87,497)	488,048
CDS	EUR 76,971,445	ファンドはITRAXX.XO.38.V1に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(2,591,367)	(2,778,362)
CDS	USD 3,289,000	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	Goldman Sachs	20/12/2027	(46,206)	22,454
CDS	USD 3,289,000	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	Goldman Sachs	20/12/2027	(50,229)	22,454
CDS	USD 715,000	ファンドはParamount Globalに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(8,281)	26,693
CDS	USD 21,400,795	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	20/12/2027	(101,877)	(89,383)
CDS	USD 250,000	ファンドはPitney Bowesに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	4,838	67,391
CDS	USD 1,825,000	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	20/12/2027	(38,146)	(10,611)
CDS	EUR 1,660,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(53,460)	(16,445)
CDS	USD 6,924,000	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	20/12/2027	(245,394)	1,193,018
CDS	EUR 1,310,000	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	Goldman Sachs	20/12/2027	(30,478)	70,384

スワップ 2023年2月28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 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	(12,241)	23,646
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	(39,042)	(58,137)
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	(36,855)	(54,939)
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	(41,155)	(58,137)
CDS	USD (900,000)	ファンドはCMBX.NA.14.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	16/12/2072	(31,408)	(183,508)
CDS	EUR (240,000)	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	5,956	(14,866)
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	48,545	(29,731)
CDS	EUR (591,000)	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	20/12/2023	46,974	(101,245)
CDS	USD 822,410	ファンドはAnywhere Real Estate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	3,193	1,962
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	(32,376)	(54,576)
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	(30,944)	(24,116)
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	(11,548)	(12,433)
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	(26,335)	(17,455)
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	(96,869)	(62,881)
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	(105,740)	63,193
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	(167,455)	(87,937)
CDS	EUR (1,186,667)	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	JP Morgan	20/12/2025	29,193	(590)
CDS	USD (850,000)	ファンドはCCO / CCO 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	(94,456)	62,575
CDS	USD (490,909)	ファンドはCCO / CCO 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	(54,019)	36,139
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	(21,594)	17,779
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	9,053	14,517
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	8,510	13,646
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	2,412	3,860
CDS	EUR (1,070,000)	ファンドはLadbrokes 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	82,862	(49,325)
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	80,354	(213,276)
CDS	EUR (171,897)	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	20/12/2027	1,913	(40,765)
CDS	USD (1,025,000)	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	JP Morgan	20/12/2027	93	4,906

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 2023年2月28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 (723,255)	ファンドはUnited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	20/12/2027	15,690	(102,843)
CDS	EUR 1,186,667	ファンドはAltice France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	20/12/2027	(25,894)	76,330
CDS	EUR 4,000,000	ファンドはBarclays Bankに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(18,931)	114,088
CDS	EUR 2,500,000	ファンドはBNP Paribasに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(31,074)	19,297
CDS	USD 100,000	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	20/12/2027	(747)	(2,451)
CDS	JPY 254,173,600	ファンドはITRAXX.JPN.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	JP Morgan	20/12/2027	(8,458)	(17,234)
CDS	JPY 381,260,400	ファンドはITRAXX.JPN.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	JP Morgan	20/12/2027	(12,715)	(25,852)
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	JP Morgan	20/12/2027	(29,695)	(8,256)
CDS	EUR 1,650,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(48,971)	(16,346)
CDS	EUR 1,610,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(38,273)	(15,950)
CDS	EUR 1,610,000	ファンドはSolvayに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(41,585)	(15,950)
CDS	EUR 1,129,000	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	JP Morgan	20/12/2027	(18,002)	60,660
CDS	EUR 5,300,000	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	JP Morgan	20/12/2027	(102,753)	284,762
CDS	USD 440,000	ファンドはXeroxに係るデフォルト・ プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	JP Morgan	20/12/2027	(2,024)	47,522
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	(3,846)	(7,010)
CDS	USD 384,551	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	41,029	74,891
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	19,221	6,483
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	(143,139)	119,261
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	(87,247)	72,692
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	41,921	13,659
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	25,552	8,325
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	(755)	2,123
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	(2,631)	(17,222)
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	(43,358)	4,208
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	(62,622)	(14,137)
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	3,554	1,666

スワップ 2023年2月28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 346,223	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(9,565)	(3,272)
CDS	USD 346,223	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(9,565)	(3,272)
CDS	USD 462,554	ファンドはGeneral Electricに係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	20/6/2027	(12,257)	(4,371)
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	(7,524)	(8,624)
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	(12,345)	(14,148)
CDS	EUR (124,635)	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	20/12/2027	1,163	(29,557)
CDS	EUR (232,425)	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	20/12/2027	2,169	(55,119)
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	Morgan Stanley	20/12/2027	(26,285)	(38,667)
CDS	USD 4,531,000	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	20/12/2027	(69,268)	30,933
CDS	USD 3,305,000	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	20/12/2027	(27,897)	22,563
CDS	EUR 1,236,000	ファンドはSolvay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	20/12/2027	2,462	(12,245)
CDS	EUR 824,000	ファンドはSolvay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	20/12/2027	1,642	(8,163)
CDS	USD (2,006,667)	ファンドはCMBX.NA.9.AA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	(82,756)	(116,274)
CDS	USD (598,000)	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	(105,909)	(108,574)
CDS	USD (1,000,000)	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	(69,722)	(181,563)
CDS	USD (3,740,500)	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	(261,024)	(679,135)
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	(18,253)	2,873
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	(33,135)	5,214
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	(41,287)	5,775
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	83,421	117,289
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	65,473	92,052
IFS	EUR 8,105,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.72%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/10/2027	188,522	188,522
IFS	EUR 8,480,000	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、2.55%の固定金利を支払う	Bank of America	16/10/2027	270,627	270,627
IFS	EUR 11,980,000	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、2.7%の固定金利を支払う	Bank of America	16/12/2027	123,000	123,000
IFS	EUR 7,940,000	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、2.27375%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2028	162,418	169,294
IFS	EUR 11,400,000	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、2.3125%の固定金利を支払う	Bank of America	16/1/2028	220,843	221,037

スワップ 2023年2月28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)
IFS	EUR 11,410,000	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、2.295%の固定金利を支払う	Bank of America	17/1/2028	231,193	231,193
IFS	EUR 8,800,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.42%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/10/2032	(360,009)	(360,009)
IFS	EUR 8,260,000	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、2.5475%の固定金利を支払う	Bank of America	16/10/2032	(233,656)	(233,656)
IFS	EUR 11,120,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.50481%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/12/2032	(207,773)	(207,773)
IFS	EUR 7,935,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.29%の固定金利を受け取る	Bank of America	16/1/2033	(215,667)	(233,482)
IFS	EUR 22,810,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.3%の固定金利を受け取る	Bank of America	17/1/2033	(648,938)	(649,134)
IFS	GBP 2,000,000	ファンドはUKRPI + 0bpsのデフォルト・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	(325,605)	(325,605)
IFS	EUR 6,680,000	ファンドはCPTFEMU + 0bpsのデフォルト・プロテクションを提供し、2.693%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	16/8/2032	(161,363)	(161,363)
IFS	GBP 3,395,000	ファンドはUKRPI + 0bpsのデフォルト・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	(455,495)	(455,496)
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MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	3/3/2023	(11,236)	(11,236)
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	1,174,557	1,174,557
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	(1,129,793)	(1,129,793)
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	1,845,483	2,536,693
IRS	MXN 424,328,000	ファンドは11.7%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2024	(10,722)	(10,722)
IRS	USD 854,267,523	ファンドは4.4005%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	13/2/2024	(7,471,255)	(7,471,255)
IRS	USD 427,133,762	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.7505%の固定金利を支払う	Bank of America	13/2/2024	6,296,022	6,296,022
IRS	MXN 253,049,000	ファンドは11.72%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	14/2/2024	(3,861)	(3,861)
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MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	27/2/2024	(1,024,000)	(1,024,000)
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MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	1/3/2024	(1,000,953)	(1,000,953)
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	(9,632,271)	(9,632,271)
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	(14,487,112)	(14,487,112)
IRS	USD 326,657,900	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.61%の固定金利を支払う	Bank of America	8/3/2024	5,459,278	5,554,047
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	18/3/2024	(20,165,944)	(20,165,944)
IRS	USD 94,081,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.61%の固定金利を支払う	Bank of America	19/3/2024	1,619,784	1,632,983
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	120,622	120,622
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	5,309,408	5,309,408
IRS	USD 70,839,300	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	28/6/2024	1,495,892	1,512,745

スワップ 2023年2月28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 410,521,000	ファンドは4.4605%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	12/7/2024	(3,148,675)	(3,148,675)
IRS	USD 64,256,500	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.55%の固定金利を支払う	Bank of America	13/7/2024	1,402,374	1,419,252
IRS	USD 94,577,700	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.57%の固定金利を支払う	Bank of America	16/7/2024	2,068,626	2,067,379
IRS	USD 94,133,300	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	20/7/2024	2,082,380	2,090,174
IRS	USD 124,214,200	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	23/7/2024	2,752,977	2,762,403
IRS	USD 91,336,800	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	12/8/2024	2,104,751	2,096,482
IRS	USD 59,462,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.56%の固定金利を支払う	Bank of America	13/8/2024	1,372,963	1,366,973
IRS	USD 171,433,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.53%の固定金利を支払う	Bank of America	27/8/2024	4,057,694	4,100,193
IRS	GBP 120,074,658	ファンドは4.255%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	6/9/2024	(724,441)	(724,441)
IRS	CNY 145,930,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.455%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	45,996	45,996
IRS	CNY 145,190,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.4625%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	42,684	42,684
IRS	CNY 145,930,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.53%の固定金利を支払う	Bank of America	21/12/2024	14,230	14,230
IRS	BRL 5,584,150	ファンドは13.125%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	7,914	7,914
IRS	BRL 116,287,721	ファンドは13.15%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	174,285	174,285
IRS	BRL 116,035,072	ファンドは13.32%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Bank of America	2/1/2025	238,342	238,342
IRS	JPY 3,865,680,000	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.2724%の固定金利を支払う	Bank of America	6/1/2025	(54,829)	(54,829)
IRS	JPY 2,884,050,000	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.265%の固定金利を支払う	Bank of America	12/1/2025	(37,754)	(37,754)
IRS	USD 5,431,500	ファンドは1.7525%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	17/1/2025	(312,065)	(312,065)
IRS	JPY 1,310,133,939	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.2%の固定金利を支払う	Bank of America	3/2/2025	(4,829)	(4,829)
IRS	JPY 1,310,133,940	ファンドはJPY 1日 TONARの変動金利を受け取り、 0.205%の固定金利を支払う	Bank of America	3/2/2025	(5,754)	(5,754)
IRS	MXN 205,611,898	ファンドは9.8%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	4/2/2025	(190,591)	(190,591)
IRS	MXN 772,497,615	ファンドは9.9%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(641,359)	(641,359)
IRS	MXN 372,215,081	ファンドは9.92%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	5/2/2025	(301,888)	(301,888)
IRS	MXN 869,313,000	ファンドは9.95%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	7/2/2025	(678,656)	(678,656)
IRS	AUD 29,970,000	ファンドはAUD 3ヶ月 BBSWの変動金利を受け取り、 3.8025%の固定金利を支払う	Bank of America	9/2/2025	153,744	153,744
IRS	NZD 33,330,000	ファンドは4.94%の固定金利を受け取り、 NZD 3ヶ月 BBR FRAの変動金利を支払う	Bank of America	10/2/2025	(159,867)	(159,867)
IRS	MXN 84,350,000	ファンドは10.7%の固定金利を受け取り、 MXN 1ヶ月 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Bank of America	12/2/2025	(4,889)	(4,889)

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 2023年2月28日現在(続き)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/損 (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	GBP 18,540,000	ファンドは3.9825%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	16/2/2025	(118,908)	(118,908)
IRS	GBP 348,610,000	ファンドは3.9985%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	16/2/2025	(2,173,554)	(2,173,554)
IRS	USD 233,257,979	ファンドは2.601%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	17/2/2025	(10,144,308)	(10,144,308)
IRS	USD 233,257,979	ファンドは2.701%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	17/2/2025	(9,710,791)	(9,710,791)
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	3,586,557	3,586,557
IRS	GBP 52,050,000	ファンドは4.03%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	19/2/2025	(303,125)	(303,125)
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	193,181	193,181
IRS	THB 682,910,000	ファンドはTHB 3ヶ月BKIBORの変動金利を受け取り、 1.735%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2025	145,891	145,891
IRS	USD 2,879,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.6585%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2025	67,648	67,648
IRS	USD 5,950,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.73449%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2025	131,257	131,257
IRS	ZAR 457,077,000	ファンドは7.2%の固定金利を受け取り、 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America	20/3/2025	(157,521)	(157,521)
IRS	MYR 92,190,000	ファンドは3.5%の固定金利を受け取り、 MYR 3ヶ月KLIB3Mの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2025	(46,005)	(46,005)
IRS	CNY 69,950,000	ファンドは3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、 2.69%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2025	2,189	2,189
IRS	USD 4,527,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.784%の固定金利を支払う	Bank of America	1/8/2025	68,338	68,338
IRS	USD 5,375,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.7105%の固定金利を支払う	Bank of America	7/8/2025	86,785	86,785
IRS	USD 5,375,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.7165%の固定金利を支払う	Bank of America	7/8/2025	86,189	86,189
IRS	USD 5,375,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.837%の固定金利を支払う	Bank of America	7/8/2025	74,210	74,210
IRS	USD 8,060,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.9505%の固定金利を支払う	Bank of America	8/8/2025	93,947	93,947
IRS	USD 8,130,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.024%の固定金利を支払う	Bank of America	8/8/2025	83,713	83,713
IRS	USD 5,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.962%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2025	61,005	61,005
IRS	USD 5,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.026%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2025	54,643	54,643
IRS	USD 5,362,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.088%の固定金利を支払う	Bank of America	11/8/2025	48,057	48,057
IRS	USD 5,365,000	ファンドは4.0815%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	16/8/2025	(47,238)	(47,238)
IRS	USD 2,682,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.2715%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2025	14,178	14,178
IRS	USD 2,682,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.2965%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2025	12,936	12,936
IRS	USD 2,682,500	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.2995%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2025	12,786	12,786
IRS	USD 10,730,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 4.31%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2025	49,059	49,059

スワップ 2023年2月28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 7,025,000	ファンドは4.332%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	17/8/2025	(29,038)	(29,038)
IRS	USD 10,460,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.3145%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2025	46,623	46,623
IRS	USD 5,352,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.3295%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2025	22,372	22,372
IRS	USD 2,676,250	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.363%の固定金利を支払う	Bank of America	17/8/2025	9,528	9,528
IRS	USD 4,605,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.39%の固定金利を支払う	Bank of America	25/8/2025	12,327	12,327
IRS	USD 2,675,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.39841%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	6,341	6,341
IRS	USD 5,352,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.438%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	8,778	8,778
IRS	USD 2,676,250	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 4.5305%の固定金利を支払う	Bank of America	28/8/2025	(179)	(179)
IRS	USD 3,708,500	ファンドは3.8025%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	14/11/2025	(34,634)	(34,634)
IRS	USD 5,485,000	ファンドは3.6665%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	17/11/2025	(64,044)	(64,044)
IRS	USD 415,102,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.891%の固定金利を支払う	Bank of America	5/12/2025	7,256,108	7,256,108
IRS	USD 51,465,000	ファンドは3.75736%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	15/12/2025	(1,072,868)	(1,072,868)
IRS	USD 6,500,000	ファンドは3.24%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	18/12/2025	(116,395)	(116,395)
IRS	USD 54,507,000	ファンドは3.8085%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	19/12/2025	(1,062,510)	(1,062,510)
IRS	USD 982,000	ファンドは3.0985%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	17/1/2026	(18,701)	(18,701)
IRS	USD 2,726,250	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.8495%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2026	10,015	10,015
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	122,173	269,586
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	95,148	201,678
IRSKRW	3,320,429,000	ファンドは3.303%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/3/2026	(32,229)	(32,229)
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	6,601,667	6,803,598
IRSKRW	55,285,114,500	ファンドは3.023%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2026	(834,190)	(834,190)
IRSKRW	32,469,035,500	ファンドは3.05%の固定金利を受け取り、 KRW 3ヶ月KORIBORの変動金利を支払う	Bank of America	21/6/2026	(471,418)	(471,418)
IRS	USD 4,480,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.378%の固定金利を支払う	Bank of America	16/8/2026	23,073	23,073
IRS	USD 4,590,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.53656%の固定金利を支払う	Bank of America	23/8/2026	9,425	9,425
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	174,146	174,146
IRS	USD 2,920,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.6615%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2026	(1,196)	(1,196)
IRS	USD 2,920,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.667%の固定金利を支払う	Bank of America	29/8/2026	(1,482)	(1,482)

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 2023年2月28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 868,000	ファンドは3.0505%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	19/11/2026	(7,621)	(7,621)
IRS	USD 2,400,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.1655%の固定金利を支払う	Bank of America	19/2/2027	12,070	12,070
IRS	USD 4,590,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.321%の固定金利を支払う	Bank of America	19/2/2027	10,608	10,608
IRS	USD 116,466,427	ファンドは1.549%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	7/3/2027	(11,304,554)	(11,304,554)
IRS	USD 1,174,000	ファンドは1.35%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	26/5/2027	(45,722)	(126,500)
IRS	USD 8,320,000	ファンドは1.2145%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	1/8/2027	(320,669)	(965,696)
IRS	USD 116,003,796	ファンドは2.9095%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	6/10/2027	(5,687,306)	(5,687,306)
IRS	MXN 190,277,000	ファンドは8.42%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	20/1/2028	(333,423)	(333,423)
IRS	GBP 143,664,300	ファンドは3.18%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	10/2/2028	(491,878)	(491,878)
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	17,687	17,687
IRS	CNY 59,470,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.7975%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	62,949	62,949
IRS	CNY 59,350,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.956%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	(232)	(232)
IRS	PLN 13,207,000	ファンドはPLN 6ヶ月 WIBORの変動金利を受け取り、 5.67%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	35,950	35,950
IRS	PLN 41,069,000	ファンドはPLN 6ヶ月 WIBORの変動金利を受け取り、 5.92%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	14,851	14,851
IRS	PLN 12,346,000	ファンドはPLN 6ヶ月 WIBORの変動金利を受け取り、 5.99%の固定金利を支払う	Bank of America	15/3/2028	(3,695)	(3,695)
IRS	CNY 56,980,000	ファンドは3ヶ月 CNRRの変動金利を受け取り、 2.9375%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2028	26,607	26,607
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	225,499	225,499
IRS	USD 64,027,800	ファンドはUSD 1日 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	3,162,074	3,339,700
IRS	USD 935,000	ファンドはUSD 1日 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	32,667	32,667
IRS	USD 424,500	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 3.353%の固定金利を支払う	Bank of America	13/11/2029	546	546
IRS	USD 4,639,500	ファンドは3.32%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	5/12/2029	(144,337)	(144,336)
IRS	USD 2,950,000	ファンドはUSD 1日 SOFRの変動金利を受け取り、 2.8845%の固定金利を支払う	Bank of America	13/1/2030	58,216	58,216
IRS	USD 1,600,000	ファンドは3.105%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	19/2/2030	(15,642)	(15,642)
IRS	USD 1,850,000	ファンドは3.251%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	19/2/2030	(6,829)	(6,829)
IRS	USD 1,900,000	ファンドは3.31054%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	25/2/2030	(2,085)	(2,085)
IRS	USD 1,200,000	ファンドは3.339%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	3/3/2030	240	240
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	(3,387,154)	(3,387,154)

スワップ 2023年2月28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	3,338,355	3,338,355
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	(2,687,682)	(2,687,682)
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	2,631,424	2,631,424
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	226	407
IRS	EUR 41,523,251	ファンドは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	10,593,246	10,593,246
IRS	USD 6,964,000	ファンドはUSD 1日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	458,435	1,168,261
IRS	USD 126,206,600	ファンドは2.85%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	14/10/2031	(7,310,312)	(8,227,204)
IRS	USD 67,115,000	ファンドは2.86%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	19/11/2031	(3,917,396)	(4,349,654)
IRS	USD 142,421,500	ファンドは2.85%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	28/1/2032	(8,395,248)	(9,429,001)
IRS	USD 3,815,000	ファンドはUSD 1日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	617,037	617,037
IRS	USD 6,587,000	ファンドはUSD 1日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	1,034,769	1,034,769
IRS	USD 4,490,000	ファンドはUSD 1日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	605,578	605,578
IRS	USD 3,750,548	ファンドはUSD 1日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	495,540	495,540
IRS	USD 7,483,000	ファンドはUSD 1日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	921,446	921,446
IRS	USD 4,449,352	ファンドはUSD 1日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	541,650	541,650
IRS	USD 5,301,448	ファンドはUSD 1日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	590,463	590,463
IRS	USD 4,493,000	ファンドはUSD 1日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	484,418	484,418
IRS	USD 10,222,322	ファンドはUSD 1日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	1,071,237	1,071,237
IRS	USD 4,500,000	ファンドはUSD 1日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	451,887	451,887
IRS	USD 4,502,000	ファンドはUSD 1日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	451,244	451,244
IRS	USD 4,567,000	ファンドはUSD 1日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	408,975	408,975
IRS	USD 5,373,819	ファンドはUSD 1日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	467,827	467,827
IRS	USD 3,863,000	ファンドはUSD 1日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	327,316	327,316
IRS	USD 3,866,000	ファンドはUSD 1日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	317,404	317,404
IRS	USD 4,605,000	ファンドはUSD 1日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	353,455	353,455
IRS	USD 7,618,000	ファンドは2.513%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	28/4/2032	(707,994)	(707,994)
IRS	USD 3,050,000	ファンドはUSD 1日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	234,340	234,340

スワップ 2023年2月28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 13,950,000	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	900,313	3,442,973
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	514,060	514,060
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	(491,271)	(491,271)
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	5,564,889	5,578,104
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	1,042,239	1,042,239
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	(615,321)	(615,321)
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	403,235	403,235
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	452,116	452,116
IRS	USD 24,565,000	ファンドは2.767%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	9/6/2032	(1,819,008)	(1,819,008)
IRS	USD 5,970,050	ファンドはUSD 1H 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	438,537	438,537
IRS	USD 5,952,826	ファンドはUSD 1H 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	409,925	409,925
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1H 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	315,427	315,427
IRS	USD 5,210,700	ファンドはUSD 1H 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	313,209	313,209
IRS	USD 3,675,000	ファンドはUSD 1H 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	162,073	162,073
IRS	USD 14,784,000	ファンドはUSD 1H 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	746,339	746,339
IRS	USD 7,457,888	ファンドは2.981%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	21/6/2032	(429,687)	(429,687)
IRS	USD 7,373,000	ファンドは2.769%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	5/7/2032	(547,301)	(547,301)
IRS	USD 6,144,167	ファンドは2.818%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	5/7/2032	(432,667)	(432,667)
IRS	USD 5,925,920	ファンドは2.696%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	6/7/2032	(473,538)	(473,538)
IRS	USD 4,057,349	ファンドは2.6095%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	7/7/2032	(351,579)	(351,579)
IRS	USD 2,941,500	ファンドは2.6715%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	8/7/2032	(240,741)	(240,741)
IRS	USD 3,489,271	ファンドはUSD 1H 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	225,837	225,837
IRS	EUR 8,974,000	ファンドは2.4425%の固定金利を受け取り、6ヶ月EU RIBORの変動金利を支払う	Bank of America	14/7/2032	(251,652)	(251,652)
IRS	USD 7,211,000	ファンドは2.58638%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	26/7/2032	(639,986)	(639,986)
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	(1,791,380)	(1,791,380)
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	553,980	553,980
IRS	USD 4,760,500	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	(116,258)	(116,258)

スワップ 2023年2月28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 45,961,000	ファンドは2.926%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	1/9/2032	(2,874,582)	(2,874,582)
IRS	USD 7,277,057	ファンドはUSD 1日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	458,580	458,580
IRS	USD 7,472,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.928%の固定金利を支払う	Bank of America	2/9/2032	466,218	466,218
IRS	USD 7,472,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 2.9828%の固定金利を支払う	Bank of America	2/9/2032	433,914	433,914
IRS	USD 4,480,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.0722%の固定金利を支払う	Bank of America	9/9/2032	228,735	228,735
IRS	USD 6,134,171	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.46385%の固定金利を支払う	Bank of America	30/9/2032	123,035	123,035
IRS	USD 9,201,300	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.5575%の固定金利を支払う	Bank of America	3/10/2032	115,975	115,975
IRS	USD 50,468,327	ファンドは3.4665%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	4/10/2032	(1,001,219)	(1,001,219)
IRS	USD 4,417,000	ファンドは3.472%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	4/10/2032	(85,695)	(85,695)
IRS	USD 2,937,000	ファンドは3.4025%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	5/10/2032	(73,209)	(73,209)
IRS	USD 23,973,778	ファンドは3.415%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	5/10/2032	(573,751)	(573,751)
IRS	USD 7,287,303	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.6145%の固定金利を支払う	Bank of America	12/10/2032	58,513	58,513
IRS	USD 1,460,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.6411%の固定金利を支払う	Bank of America	14/10/2032	8,612	8,612
IRS	USD 10,248,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.836%の固定金利を支払う	Bank of America	21/10/2032	(99,448)	(99,448)
IRS	USD 6,940,289	ファンドは3.822%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	27/10/2032	59,993	59,993
IRS	USD 53,540,807	ファンドは3.04%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	28/10/2032	(2,885,342)	(2,885,342)
IRS	USD 689,500	ファンドは3.512%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	28/10/2032	5,406	5,406
IRS	USD 54,305,155	ファンドは2.868%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	2/11/2032	(3,675,993)	(3,675,993)
IRS	USD 54,182,125	ファンドは2.908%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	4/11/2032	(3,495,024)	(3,495,024)
IRS	USD 4,123,000	ファンドは3.5455%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	14/11/2032	(55,191)	(55,191)
IRS	USD 87,128,964	ファンドは2.8905%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	15/11/2032	(5,750,459)	(5,750,459)
IRS	USD 7,432,000	ファンドは3.64%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	15/11/2032	(27,802)	(5,104)
IRS	USD 2,749,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.801%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2032	(19,627)	(19,627)
IRS	USD 7,382,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、 3.8095%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2032	(57,745)	(57,745)
IRS	USD 4,347,000	ファンドは3.4621%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	18/11/2032	(87,272)	(87,272)
IRS	USD 4,340,000	ファンドは3.4055%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	21/11/2032	(106,853)	(106,853)
IRS	USD 53,201,779	ファンドは3.191%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	28/11/2032	(2,229,037)	(2,229,037)

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 2023年2月28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 7,069,000	ファンドは3.228%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	5/12/2032	(275,176)	(275,176)
IRS	USD 1,411,000	ファンドは3.2%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	6/12/2032	(58,113)	(58,113)
IRS	USD 7,069,000	ファンドは3.178%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	12/12/2032	(303,839)	(303,839)
IRS	USD 4,065,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.2795%の固定金利を支払う	Bank of America	13/12/2032	141,346	141,346
IRS	USD 6,839,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.35375%の固定金利を支払う	Bank of America	22/12/2032	196,676	196,676
IRS	USD 940,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.1905%の固定金利を支払う	Bank of America	26/1/2033	39,537	39,537
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	307,925	307,925
IRS	USD 1,222,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.1875%の固定金利を支払う	Bank of America	7/2/2033	51,746	51,746
IRS	USD 788,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.1975%の固定金利を支払う	Bank of America	7/2/2033	32,709	32,709
IRS	USD 1,222,500	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	7/2/2033	46,636	46,636
IRS	USD 1,855,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.3395%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2033	55,406	55,406
IRS	USD 1,225,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.3445%の固定金利を支払う	Bank of America	8/2/2033	36,087	36,087
IRS	AUD 6,960,000	ファンドは4.15%の固定金利を受け取り、 AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America	9/2/2033	(127,715)	(127,715)
IRS	USD 3,314,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.343%の固定金利を支払う	Bank of America	9/2/2033	98,026	98,026
IRS	NZD 7,710,000	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、 4.2525%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2033	164,495	164,495
IRS	USD 3,293,752	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.352%の固定金利を支払う	Bank of America	13/2/2033	94,981	94,981
IRS	USD 4,117,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.4495%の固定金利を支払う	Bank of America	13/2/2033	85,775	85,775
IRS	USD 1,876,888	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.1%の固定金利を支払う	Bank of America	14/2/2033	15,342	15,342
IRS	USD 2,023,618	ファンドはUSD 1H 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	14/2/2033	14,629	14,629
IRS	USD 1,280,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.4405%の固定金利を支払う	Bank of America	14/2/2033	27,608	27,608
IRS	USD 1,245,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.4455%の固定金利を支払う	Bank of America	14/2/2033	26,342	26,342
IRS	EUR 1,806,802	ファンドは2.6845%の固定金利を受け取り、 1H EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America	15/2/2033	(17,167)	(17,167)
IRS	USD 3,294,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.4465%の固定金利を支払う	Bank of America	15/2/2033	69,415	69,415
IRS	USD 1,230,000	ファンドは3.405%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	16/2/2033	(30,108)	(30,108)
IRS	USD 615,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.493%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2033	10,608	10,608
IRS	USD 1,230,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.5%の固定金利を支払う	Bank of America	16/2/2033	20,510	20,510
IRS	USD 4,348,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.4795%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2033	79,812	79,812

スワップ 2023年2月28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 1,230,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.48%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2033	22,527	22,527
IRS	USD 615,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.4905%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2033	10,733	10,733
IRS	USD 4,536,000	ファンドは3.581%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	22/2/2033	(45,290)	(45,290)
IRS	USD 42,753,000	ファンドは3.618%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	22/2/2033	(296,747)	(296,747)
IRS	USD 650,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6015%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2033	5,394	5,394
IRS	USD 1,250,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.608%の固定金利を支払う	Bank of America	22/2/2033	9,704	9,704
IRS	USD 6,588,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6045%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2033	52,995	52,995
IRS	USD 1,100,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6545%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2033	4,323	4,323
IRS	USD 615,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.656%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2033	2,341	2,341
IRS	USD 615,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.67%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2033	1,633	1,633
IRS	USD 615,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.679%の固定金利を支払う	Bank of America	23/2/2033	1,177	1,177
IRS	USD 2,016,043	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.259%の固定金利を支払う	Bank of America	24/2/2033	4,425	4,425
IRS	USD 1,232,500	ファンドは3.5905%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	27/2/2033	(11,299)	(11,299)
IRS	USD 1,232,500	ファンドは3.592%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	27/2/2033	(11,146)	(11,146)
IRS	USD 1,230,000	ファンドは3.5945%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	27/2/2033	(10,870)	(10,870)
IRS	USD 645,000	ファンドは3.603%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	27/2/2033	(5,249)	(5,249)
IRS	USD 1,065,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.666%の固定金利を支払う	Bank of America	27/2/2033	3,139	3,139
IRS	USD 620,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6275%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2033	3,792	3,792
IRS	USD 1,235,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6635%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2033	3,890	3,890
IRS	USD 617,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.6675%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2033	1,742	1,742
IRS	USD 770,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.67983%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2033	1,390	1,390
IRS	USD 617,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.695%の固定金利を支払う	Bank of America	28/2/2033	343	343
IRS	USD 618,750	ファンドは3.6395%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	1/3/2033	(3,154)	(3,154)
IRS	USD 11,355,000	ファンドは3.33%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	25/5/2033	(307,126)	(307,126)
IRSKRW	18,331,853,400	ファンドはKRW 3ヶ月 KORIBORの変動金利を受け取り、2.97%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2033	640,342	640,342
IRSKRW	10,766,326,600	ファンドはKRW 3ヶ月 KORIBORの変動金利を受け取り、2.973%の固定金利を支払う	Bank of America	21/6/2033	374,053	374,053
IRS	USD 25,362,638	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、3.23%の固定金利を支払う	Bank of America	9/8/2033	790,745	790,745

スワップ 2023年2月28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 535,000	ファンドは3%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	5/9/2033	(25,827)	(25,827)
IRS	USD 1,310,000	ファンドは3.88%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	26/10/2033	33,472	33,472
IRS	USD 2,020,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.2285%の固定金利を支払う	Bank of America	27/12/2033	47,497	47,497
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	428,165	428,165
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	698,844	698,844
IRS	USD 4,255,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.165%の固定金利を支払う	Bank of America	30/5/2034	92,573	92,573
IRS	USD 1,827,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.235%の固定金利を支払う	Bank of America	30/5/2034	29,669	29,669
IRS	USD 484,500	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.1545%の固定金利を支払う	Bank of America	8/10/2034	8,894	8,894
IRS	USD 2,660,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.83%の固定金利を支払う	Bank of America	30/10/2034	114,928	114,928
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	423,873	1,279,036
IRS	USD 625,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.2885%の固定金利を支払う	Bank of America	19/2/2035	3,602	3,602
IRS	USD 700,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.354%の固定金利を支払う	Bank of America	25/2/2035	440	440
IRS	USD 7,267,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.83%の固定金利を支払う	Bank of America	10/12/2035	282,931	282,931
IRS	USD 7,995,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.12%の固定金利を支払う	Bank of America	8/1/2036	136,454	136,454
IRS	USD 8,880,000	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	22/1/2036	276,935	276,935
IRS	USD 7,840,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.165%の固定金利を支払う	Bank of America	19/2/2036	106,037	106,037
IRS	USD 850,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.35%の固定金利を支払う	Bank of America	24/2/2036	247	(222)
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	(111,805)	(111,805)
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	(599,628)	(599,628)
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	445,295	1,856,236
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	711,518	696,063
IRS	EUR 1,370,000	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、 2.7395%の固定金利を支払う	Bank of America	4/11/2042	76,570	76,570
IRS	USD 7,281,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.77%の固定金利を支払う	Bank of America	15/11/2048	113,473	(486,066)
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	149,966	173,227
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	91,264	220,926
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	(379,048)	(1,140,568)
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	1,989,498	1,714,057

スワップ 2023年2月28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 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	3,659,859	3,151,159
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	2,059,189	1,808,766
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	1,154,205	1,013,211
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	1,188,535	1,043,354
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	(461,905)	(1,247,447)
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	665,561	426,294
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	2,510,689	1,592,075
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	410,402	260,246
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	(156,495)	(412,108)
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	5,605,699	3,536,386
IRS	JPY 19,611,570	ファンドはJPY 1H 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	10,878	10,878
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1H 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	9,860	9,860
IRS	JPY 16,172,460	ファンドはJPY 1H 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	11,592	11,592
IRS	JPY 49,810,000	ファンドはJPY 1H 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	17,644	17,644
IRS	JPY 37,745,000	ファンドは1.10625%の固定金利を受け取り、 JPY 1H TONARの変動金利を支払う	Bank of America	12/9/2052	(5,295)	(5,295)
IRS	JPY 37,745,000	ファンドは1.13%の固定金利を受け取り、 JPY 1H TONARの変動金利を支払う	Bank of America	12/9/2052	(3,640)	(3,640)
IRS	USD 833,269	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.3705%の固定金利を支払う	Bank of America	3/2/2053	4,250	4,250
IRS	USD 775,774	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.3645%の固定金利を支払う	Bank of America	9/2/2053	4,108	4,108
IRS	USD 1,020,755	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.466%の固定金利を支払う	Bank of America	10/2/2053	818	818
IRS	USD 1,020,755	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 2.4055%の固定金利を支払う	Bank of America	17/2/2053	3,463	3,463
IRS	USD 930,000	ファンドは2.7735%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	21/2/2053	(132,084)	(90,000)
IRS	USD 535,000	ファンドはUSD 1H SOFRの変動金利を受け取り、 3.188%の固定金利を支払う	Bank of America	27/2/2053	10,668	10,668
IRS	USD 335,000	ファンドは3.2593%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	28/2/2053	(2,250)	(2,250)
IRS	EUR 990,000	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、 2.2705%の固定金利を支払う	Bank of America	4/3/2053	100,827	100,827
IRS	USD 2,710,000	ファンドはUSD 1H 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	300,066	1,303,708
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	118,697	118,697
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	(12,759)	(32,522)

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 2023年2月28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	NZD 39,775,000	ファンドは4.697%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	(134,901)	(134,901)
IRS	AUD 34,470,000	ファンドはAUD 3ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、4.0425%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/12/2024	61,228	61,228
IRS	JPY 3,901,950,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.23%の固定金利を支払う	BNP Paribas	11/1/2025	(32,326)	(32,326)
IRS	JPY 6,371,000,000	ファンドはJPY 1日TONARの変動金利を受け取り、0.235%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/1/2025	(56,506)	(56,506)
IRS	EUR 39,330,000	ファンドは3.27%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	20/2/2025	(144,617)	(143,468)
IRS	CHF 37,900,000	ファンドはCHF 1日SARONの変動金利を受け取り、1.708%の固定金利を支払う	BNP Paribas	20/2/2025	87,199	90,821
IRS	USD 84,750,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、4.42%の固定金利を支払う	BNP Paribas	28/2/2025	59,399	58,919
IRS	NZD 16,965,000	ファンドは4.97%の固定金利を受け取り、NZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2025	(77,073)	(77,073)
IRS	USD 19,800,000	ファンドは3.6%の固定金利を受け取り、USD 1日SOFRの変動金利を支払う	BNP Paribas	1/12/2025	(348,243)	(241,209)
IRS	USD 19,800,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.47%の固定金利を支払う	BNP Paribas	1/12/2025	294,600	294,600
IRS	MXN 279,950,277	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTHIE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	889,376	889,376
IRS	GBP 10,840,000	ファンドは3.09%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/2/2027	(72,584)	(71,655)
IRS	GBP 46,910,000	ファンドは3.514%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	17/2/2027	(348,535)	(348,535)
IRS	USD 56,580,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.193%の固定金利を支払う	BNP Paribas	19/2/2027	257,349	257,349
IRS	GBP 37,610,000	ファンドは3.2%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	26/1/2028	(137,232)	(124,471)
IRS	GBP 74,760,000	ファンドは2.92%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	2/2/2028	(452,918)	(452,918)
IRS	GBP 86,780,000	ファンドは2.81702%の固定金利を受け取り、GBP 1日SONIAの変動金利を支払う	BNP Paribas	3/2/2028	(555,115)	(614,211)
IRS	USD 149,920,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.231%の固定金利を支払う	BNP Paribas	26/2/2028	(23,701)	(23,701)
IRS	USD 37,380,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.24%の固定金利を支払う	BNP Paribas	26/2/2028	(8,233)	(8,723)
IRS	EUR 4,750,000	ファンドは2.41%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	27/1/2033	(99,930)	(99,930)
IRS	EUR 17,980,000	ファンドは2.618%の固定金利を受け取り、1日EURIBORの変動金利を支払う	BNP Paribas	9/2/2033	(225,879)	(220,886)
IRS	USD 20,390,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.01946%の固定金利を支払う	BNP Paribas	9/2/2033	211,833	228,513
IRS	USD 5,190,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.2565%の固定金利を支払う	BNP Paribas	28/2/2033	11,945	11,945
IRS	NZD 3,985,000	ファンドはNZD 3ヶ月BBR FRAの変動金利を受け取り、4.23%の固定金利を支払う	BNP Paribas	15/3/2033	89,634	89,634
IRS	EUR 5,411,900	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.72691%の固定金利を支払う	BNP Paribas	4/11/2042	295,489	313,035
IRS	EUR 2,048,200	ファンドは6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.263%の固定金利を支払う	BNP Paribas	4/3/2053	211,830	211,830
IRS	BRL 43,422,000	ファンドは13.965%の固定金利を受け取り、BRL 1日BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2024	43,450	43,450

スワップ 2023年2月28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	BRL 39,887,611	ファンドは13.98%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Citibank	2/1/2024	40,070	40,070
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	(157,807)	(157,807)
IRS	BRL 51,696,000	ファンドは12.845%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	25,532	25,532
IRS	BRL 78,371,542	ファンドは12.85%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	32,206	32,206
IRS	BRL 31,919,188	ファンドは13.22%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	55,069	55,069
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 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Citibank	24/3/2026	(1,529,249)	(1,529,249)
IRS	BRL 44,653,683	ファンドは14.485%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Goldman Sachs	2/1/2024	89,008	89,008
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 MXIBTIIEの変動金利を支払う	Goldman Sachs	14/4/2027	(1,506,129)	(1,506,129)
IRS	EUR 31,939,000	ファンドは2.34%の固定金利を受け取り、 1日EURIBORの変動金利を支払う	Goldman Sachs	19/1/2033	(765,606)	(765,606)
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	(116,771)	(116,771)
IRS	BRL 60,676,416	ファンドは13.18%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	96,736	96,736
IRS	BRL 22,685,139	ファンドは12.755%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	5,064	5,064
IRS	BRL 232,775,572	ファンドは12.7825%の固定金利を受け取り、 BRL 1日 BROISの変動金利を支払う	Morgan Stanley	2/1/2025	74,024	74,024
IRS	MXN 144,525,723	ファンドはMXN 1ヶ月MXIBTIIE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	476,312	476,312
TRS	USD 16,086,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/3/2023	(129,725)	(157,406)
TRS	USD 2,542,000	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Barclays	20/3/2023	(20,500)	(24,874)
TRS	USD 11,827,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Market iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	Barclays	20/3/2023	(95,378)	(115,731)
TRS	USD 34,999,049	ファンドはMarket iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	BNP Paribas	20/3/2023	60,169	2,175
TRS	USD 2,517	ファンドはS5INDU Performance Shell + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 37bpsを支払う	Citibank	9/3/2023	24,913	24,913
TRS	USD (5,000)	ファンドはUSD 1H SOFR - 25bpsを受け取り、 Pitney Bowes + 0bpsを支払う	Citibank	13/6/2023	(3,100)	(3,100)
TRS	EUR 3,200,000	ファンドは3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、 iBoxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2023	(49,670)	(47,660)
TRS	EUR 4,395,000	ファンドは3ヶ月EURIBOR + 0bpsを受け取り、 iBoxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2023	68,751	75,227
TRS	EUR 2,770,000	ファンドはiBoxx Euro Liquid High Yield + 0bpsを 受け取り、3ヶ月EURIBOR + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2023	(58,844)	(57,045)
TRS	USD 19,605,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Market iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	Goldman Sachs	20/3/2023	176,949	243,200
TRS	USD 19,800	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、 USD 1H SOFR + 65bpsを支払う	JP Morgan	17/3/2023	(425,552)	(425,552)
TRS	USD 75,091	ファンドはJPM EMBIG DIV CORE + 0bpsを受け取り、 USD 1H SOFR + 77bpsを支払う	JP Morgan	17/3/2023	(678,977)	(678,977)
TRS	USD 10,242,500	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2023	228,527	266,783

スワップ 2023年2月28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 10,242,500	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2023	204,191	242,447
TRS	USD 23,690,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Market iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2023	516,511	569,924
TRS	USD 8,135,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 Market iBoxx US Dollar Liquid High + 0bpsを支払う	JP Morgan	20/3/2023	52,156	82,540
TRS	USD 21,210,151	ファンドはiBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを 受け取り、USD 1H SOFR + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2023	(748,440)	(784,563)
TRS	USD 19,805,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2023	822,431	867,084
TRS	USD 15,840,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2023	689,833	725,547
TRS	USD 10,295,000	ファンドはUSD 1H SOFR + 0bpsを受け取り、 iBoxx US Dollar Liquid Investment + 0bpsを支払う	Morgan Stanley	20/3/2023	470,348	494,606
合計					(47,833,161)	(42,734,497)

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 2023年2月28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)
2,960,000	コール	OTC AUD/NZD	Bank of America	AUD 1.09	13/3/2023	(17,786)	11,860
6,488,000	コール	OTC USD/CLP	Bank of America	USD 840	16/3/2023	(89,573)	81,106
5,998,000	プット	OTC EUR/COP	Bank of America	EUR 4.950	23/3/2023	(127,924)	27,511
1,060,000	プット	OTC USD/BRL	Bank of America	USD 4.65	23/3/2023	(147,897)	3,365
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(125,400)	-
2,090,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 105	28/3/2023	(125,400)	-
7,400,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.068	30/3/2023	(10,156)	17,273
233,000	プット	OTC GBP/USD	Bank of America	GBP 1.15	31/3/2023	(28,957)	20,290
6,050,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 118	7/4/2023	(7,667)	53
12,100,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 128	7/4/2023	(138,005)	21,231
1,490,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 110	19/4/2023	(107,103)	1,965
74,960,000	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.13	21/4/2023	(307,490)	29,394
598,000	プット	OTC EUR/CAD	Bank of America	EUR 1.4	26/4/2023	(16,607)	58,970
81,100,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 123.25	6/6/2023	(948,144)	272,330
53,060,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 126.7	16/6/2023	(282,816)	374,651
12,100,000	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 129	4/8/2023	(33,360)	148,987
21,253,929	コール	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.1	2/3/2023	(232,297)	-
6,512,000	コール	OTC USD/CLP	Barclays	USD 820	11/4/2023	61,786	224,716
6,328,000	コール	OTC USD/CNH	Barclays	USD 6.95	13/4/2023	22,702	50,924
2,112,000	コール	OTC EUR/USD	BNP Paribas	EUR 1.1	2/3/2023	(18,118)	-
20,450,000	コール	OTC USD/JPY	BNP Paribas	USD 155	16/3/2023	(288,179)	-
655,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	7/3/2023	(51,090)	-
655,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 130	7/3/2023	(95,327)	1,285
19,029,613	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 134	8/3/2023	(129,436)	22,611
29,834,000	プット	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.048	9/3/2023	(120,210)	33,267
6,512,000	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17.5	9/3/2023	(87,298)	1,265
11,168,000	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 137	10/3/2023	(117,963)	70,776
2,960,000	コール	OTC AUD/NZD	Citibank	AUD 1.06	13/3/2023	30,118	58,037
8,349,000	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 6.95	27/4/2023	22,544	74,662
656,000	プット	OTC USD/JPY	Citibank	USD 125	7/9/2023	10,596	114,900
16,291,070	プット	OTC USD/MXN	Deutsche Bank	USD 18.5	7/3/2023	101,909	193,221
74,990,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.1	14/3/2023	(488,081)	13,429
46,270,000	コール	OTC EUR/USD	Deutsche Bank	EUR 1.11	5/5/2023	(138,150)	102,469
6,328,000	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 5.1	12/5/2023	(26,704)	104,507
2,517,313	プット	OTC USD/JPY	Deutsche Bank	USD 132.3	26/5/2023	(48,622)	35,708
20,726,653	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.85	21/3/2023	374,746	590,988
6,510,000	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 17	23/3/2023	(118,157)	2,102
3,339,598	プット	OTC USD/BRL	Goldman Sachs	USD 5	28/3/2023	(6,500)	6,858
8,400,200	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 127	11/5/2023	(76,923)	36,219
1,210,000	コール	OTC EUR/CNH	Goldman Sachs	USD 7.25	11/8/2023	16,596	131,546
510,000	プット	OTC EUR/CNH	HSBC Bank	EUR 7	8/3/2023	(61,214)	-
54,350,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	7/3/2023	(175,211)	628
74,960,000	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	7/3/2023	(252,712)	867
19,001,883	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.075	9/3/2023	(241,220)	34,070
7,246,000	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.087	9/3/2023	115,457	169,912
17,492,000	プット	OTC GBP/USD	JP Morgan	GBP 1.18	31/3/2023	(63,469)	63,072
29,290,000	プット	OTC EUR/NOK	JP Morgan	EUR 10.45	4/4/2023	(16,227)	21,196
1,775,038	プット	OTC GBP/USD	JP Morgan	GBP 1	11/5/2023	(199,973)	13
59,065,000	プット	OTC CNH/JPY	JP Morgan	CNH 18.2	17/5/2023	(73,530)	34,646
10,080,000	コール	OTC EUR/CNH	JP Morgan	EUR 7.7	17/5/2023	(74,861)	22,681
14,916,000	コール	OTC EUR/USD	Morgan Stanley	EUR 1.1	9/3/2023	(38,125)	544
15,405,000	プット	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.685	16/3/2023	68,386	206,750
34,961,000	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.05	22/3/2023	(50,940)	123,747
16,695,000	プット	OTC NZD/JPY	UBS	NZD 81	30/3/2023	(105,830)	37,546

買建オプション 2023年2月28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)
2,277,000	コール	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 218,872	14/7/2023	22,014	159,446
2,005	コール	EURO STOXX 50 Index	Citibank	EUR 4,100	21/4/2023	(73,775)	37,026
755	コール	S&P 500 Index	Citibank	USD 4,100	15/9/2023	(10,333)	58,146
3,793,482	コール	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 226,71	14/7/2023	(50,584)	196,320
1,519,518	コール	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 227,596	14/7/2023	(29,833)	75,933
34	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,900	3/3/2023	(7,972)	20,570
651	コール	3 Month SOFR	Exchange Traded	USD 97,125	10/3/2023	(412,005)	4,069
61	プット	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 25,000	10/3/2023	(107,807)	1,786
1,654	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95,375	10/3/2023	1,236,745	1,426,575
305	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.5	10/3/2023	(50,212)	1,906
1,450	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 395	10/3/2023	(371,532)	562,600
170	コール	Capital One Financial	Exchange Traded	USD 115	17/3/2023	(28,608)	20,400
250	プット	Carnival	Exchange Traded	USD 6	17/3/2023	(9,555)	250
242	プット	Caterpillar	Exchange Traded	USD 200	17/3/2023	(20,649)	2,662
34	コール	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 500	17/3/2023	(21,285)	23,205
30	コール	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 490	17/3/2023	(1,905)	33,525
183	プット	Dax Index	Exchange Traded	EUR 13,000	17/3/2023	(130,468)	6,472
258	プット	Dax Index	Exchange Traded	EUR 14,400	17/3/2023	(141,007)	45,968
506	プット	Dufry	Exchange Traded	CHF 32	17/3/2023	(135,816)	5,409
195	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,950	17/3/2023	(42,157)	18,046
195	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,150	17/3/2023	(78,908)	68,449
400	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 8.35	17/3/2023	(10,269)	400
125	プット	Hudson Pacific Properties	Exchange Traded	USD 7.5	17/3/2023	(2,313)	2,188
72	コール	Humana	Exchange Traded	USD 540	17/3/2023	(56,500)	8,460
169	コール	Nike	Exchange Traded	USD 130	17/3/2023	(52,350)	2,873
125	プット	Office Properties Income Trust	Exchange Traded	USD 12.5	17/3/2023	(6,116)	1,250
341	コール	Pioneer Natural Resources	Exchange Traded	USD 220	17/3/2023	(2,634)	17,050
20	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,950	17/3/2023	(21,372)	106,000
198	コール	Schlumberger	Exchange Traded	USD 60	17/3/2023	(46,870)	5,049
208	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 415	17/3/2023	(20,851)	17,888
410	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 348	17/3/2023	(85,645)	7,175
926	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 385	17/3/2023	(443,275)	265,299
124	コール	Unitedhealth	Exchange Traded	USD 520	17/3/2023	(95,384)	5,332
125	プット	Vertiv	Exchange Traded	USD 10	17/3/2023	(1,208)	4,063
2,065	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 21	22/3/2023	(140,893)	335,562
1,248	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 393	24/3/2023	123,715	821,184
155	コール	US Long Bond (CBT)	Exchange Traded	USD 127	24/3/2023	(34,588)	118,672
20	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 113	24/3/2023	(500)	5,469
20	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 111	24/3/2023	(968)	16,250
240	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 111.5	24/3/2023	70,876	262,500
552	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 109	24/3/2023	(54,293)	43,125
208	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 107	24/3/2023	17,553	141,375
366	プット	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 107	24/3/2023	74,350	254,484
36	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,800	31/3/2023	(28,998)	118,620
1,035	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95.25	14/4/2023	185,389	368,719
611	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.25	14/4/2023	(62,401)	3,819
611	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.75	14/4/2023	(131,139)	3,819
103	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 95	21/4/2023	(28,467)	9,167
414	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 85	21/4/2023	(100,297)	118,818
400	プット	Ally Financial	Exchange Traded	USD 25	21/4/2023	(487)	18,000
125	プット	Brandywine Realty Trust	Exchange Traded	USD 5	21/4/2023	(2,027)	1,250
145	コール	Constellation Brands	Exchange Traded	USD 240	21/4/2023	(38,384)	37,337
242	コール	EOG Resources	Exchange Traded	USD 157	21/4/2023	(217,127)	968
207	コール	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,400	21/4/2023	(894)	80,588

買建オプション 2023年2月28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)
26	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,900	21/4/2023	(4,607)	7,799
233	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,100	21/4/2023	(62,654)	150,565
110	プット	FedEx	Exchange Traded	USD 175	21/4/2023	(1,526)	26,015
500	プット	Ford Motor	Exchange Traded	USD 11	21/4/2023	1,885	12,500
500	プット	Owl Rock Capital	Exchange Traded	USD 10	21/4/2023	(12,293)	6,250
467	プット	PulteGroup	Exchange Traded	USD 50	21/4/2023	(83,928)	52,537
41	コール	Rockwell Automation	Exchange Traded	USD 290	21/4/2023	21,024	67,855
365	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 5	21/4/2023	(578)	12,228
208	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 370	21/4/2023	959	69,784
412	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 111	21/4/2023	(190,532)	19,312
1,036	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 96	12/5/2023	(322,691)	233,100
200	プット	Caterpillar	Exchange Traded	USD 175	19/5/2023	(8,546)	11,900
206	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 120	19/5/2023	(49,178)	40,891
208	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	19/5/2023	(32,444)	103,480
227	コール	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 119.5	26/5/2023	(82,452)	17,734
60	プット	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 106.5	26/5/2023	13,032	51,094
43	プット	FedEx	Exchange Traded	USD 165	16/6/2023	(443)	12,750
147	コール	Intel	Exchange Traded	USD 42.5	16/6/2023	(5,529)	515
500	コール	Intel	Exchange Traded	USD 40	16/6/2023	(17,365)	2,250
182	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 12.5	16/6/2023	2,961	12,285
125	コール	Lions Gate Entertainment	Exchange Traded	USD 10	16/6/2023	17,107	23,437
182	プット	Sabre	Exchange Traded	USD 5	16/6/2023	(722)	10,101
85	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 96.375	16/6/2023	159,713	207,187
173	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.25	15/9/2023	(155,876)	21,625
362	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95.75	15/9/2023	87,416	341,637
622	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.25	15/3/2024	263,025	863,025
824	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.75	15/3/2024	1,199,748	1,807,650
合計						(6,030,325)	13,811,170

売建オプション 2023年2月28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)
(74,960,000)	コール	OTC EUR/USD	Bank of America	EUR 1.1	7/3/2023	545,300	(867)
(2,960,000)	コール	OTC AUD/NZD	Bank of America	AUD 1.06	13/3/2023	21,161	(58,037)
(4,866,000)	プット	OTC USD/CLP	Bank of America	USD 810	16/3/2023	64,411	(26,734)
(2,998,000)	コール	OTC EUR/COP	Bank of America	EUR 5,200	23/3/2023	10,098	(44,767)
(7,496,000)	プット	OTC EUR/COP	Bank of America	EUR 4,750	23/3/2023	72,952	(4,648)
(18,150,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 123	7/4/2023	64,795	-
(81,100,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 121.31	6/6/2023	766,539	(166,598)
(53,060,000)	プット	OTC USD/JPY	Bank of America	USD 124.7	16/6/2023	225,112	(269,407)
(21,253,929)	プット	OTC EUR/USD	Barclays	EUR 1.035	2/3/2023	109,917	(2)
(8,140,000)	コール	OTC USD/CLP	Barclays	USD 880	11/4/2023	(18,258)	(81,587)
(6,512,000)	プット	OTC USD/CLP	Barclays	USD 750	11/4/2023	30,184	(5,371)
(6,328,000)	コール	OTC USD/CNH	Barclays	USD 7.1	13/4/2023	(6,986)	(16,668)
(14,916,000)	コール	OTC EUR/USD	Citibank	EUR 1.1	9/3/2023	94,528	(544)
(11,394,000)	プット	OTC USD/ZAR	Citibank	USD 17	9/3/2023	49,915	(48)
(11,168,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 142	10/3/2023	69,377	(1,652)
(2,960,000)	コール	OTC AUD/NZD	Citibank	AUD 1.09	13/3/2023	(3,575)	(11,860)
(10,240,000)	コール	OTC USD/JPY	Citibank	USD 155	16/3/2023	187,904	-
(29,290,000)	プット	OTC EUR/NOK	Citibank	EUR 10.45	4/4/2023	86,852	(21,196)
(10,019,000)	コール	OTC USD/CNH	Citibank	USD 7.1	27/4/2023	(10,647)	(34,038)
(4,280,000)	プット	OTC AUD/USD	Deutsche Bank	AUD 0.685	16/3/2023	(16,826)	(57,442)
(9,492,000)	プット	OTC USD/BRL	Deutsche Bank	USD 4.9	12/5/2023	24,324	(63,857)
(20,726,653)	プット	OTC USD/MXN	Goldman Sachs	USD 18.25	21/3/2023	(94,337)	(144,765)
(3,256,000)	コール	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 18	23/3/2023	(54,271)	(92,558)
(9,766,000)	プット	OTC USD/ZAR	Goldman Sachs	USD 16.45	23/3/2023	72,171	(251)
(8,400,200)	プット	OTC USD/JPY	Goldman Sachs	USD 123	11/5/2023	42,982	(13,299)
(2,112,000)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	2/3/2023	12,716	-
(12,667,883)	コール	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.1	9/3/2023	67,306	(462)
(8,694,000)	プット	OTC EUR/USD	JP Morgan	EUR 1.07	9/3/2023	(53,717)	(80,174)
(17,492,000)	プット	OTC GBP/USD	JP Morgan	GBP 1.15	31/3/2023	26,591	(13,269)
(4,280,000)	コール	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.7	16/3/2023	51,850	(2,441)
(21,395,000)	プット	OTC AUD/USD	Morgan Stanley	AUD 0.665	16/3/2023	12,868	(71,758)
(34,961,000)	プット	OTC EUR/USD	UBS	EUR 1.03	22/3/2023	22,272	(28,011)
(4,175,000)	コール	OTC NZD/JPY	UBS	NZD 85	30/3/2023	22,764	(22,162)
(25,045,000)	プット	OTC NZD/JPY	UBS	NZD 78	30/3/2023	85,182	(14,841)
(2,277,000)	プット	TOPIX Banks Index	BNP Paribas	JPY 175.098	14/7/2023	62,715	(44,868)
(3,793,482)	プット	TOPIX Banks Index	Goldman Sachs	JPY 181.37	14/7/2023	104,903	(106,303)
(1,519,518)	プット	TOPIX Banks Index	JP Morgan	JPY 182.077	14/7/2023	54,146	(44,241)
(61)	プット	Nikkei 225 Index	Exchange Traded	JPY 24,000	10/3/2023	69,873	(893)
(2,687)	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95.125	10/3/2023	(806,961)	(1,058,006)
(2,175)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 380	10/3/2023	272,461	(148,987)
(170)	プット	Capital One Financial	Exchange Traded	USD 95	17/3/2023	24,853	(4,250)
(242)	プット	Caterpillar	Exchange Traded	USD 160	17/3/2023	1,688	(968)
(34)	プット	Costco Wholesale	Exchange Traded	USD 450	17/3/2023	19,653	(9,197)
(390)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,050	17/3/2023	117,618	(68,864)
(72)	コール	Humana	Exchange Traded	USD 570	17/3/2023	7,219	(2,700)
(169)	プット	Nike	Exchange Traded	USD 115	17/3/2023	6,274	(27,547)
(14)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,750	17/3/2023	16,832	(13,580)
(36)	プット	S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 3,800	17/3/2023	31,255	(55,440)
(198)	コール	Schlumberger	Exchange Traded	USD 65	17/3/2023	18,568	(792)
(198)	プット	Schlumberger	Exchange Traded	USD 55	17/3/2023	2,233	(38,907)
(1,064)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	17/3/2023	265,767	(40,964)
(70)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 355	17/3/2023	3,242	(1,820)
(1,064)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 375	17/3/2023	440,975	(127,148)
(124)	コール	Unitedhealth	Exchange Traded	USD 560	17/3/2023	11,007	(1,116)

売建オプション 2023年2月28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)
(4,130)	プット	CBOE SPX Volatility Index	Exchange Traded	USD 19	22/3/2023	98,174	(218,890)
(1,664)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 378	24/3/2023	(58,624)	(434,304)
(360)	プット	US Treasury 10 Year Note	Exchange Traded	USD 110	24/3/2023	(25,872)	(143,438)
(366)	コール	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 108	24/3/2023	92,942	(77,203)
(611)	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 95.375	14/4/2023	29,249	(3,819)
(611)	コール	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 96.25	14/4/2023	55,980	(3,819)
(517)	コール	Advanced Micro Devices	Exchange Traded	USD 110	21/4/2023	41,377	(8,014)
(53)	コール	Constellation Brands	Exchange Traded	USD 260	21/4/2023	3,380	(1,590)
(145)	プット	Constellation Brands	Exchange Traded	USD 200	21/4/2023	15,695	(24,288)
(242)	コール	EOG Resources	Exchange Traded	USD 177	21/4/2023	88,638	(3,025)
(242)	プット	EOG Resources	Exchange Traded	USD 112	21/4/2023	(6,589)	(119,790)
(125)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 3,800	21/4/2023	(1,121)	(26,393)
(341)	プット	EURO STOXX 50 Index	Exchange Traded	EUR 4,000	21/4/2023	73,539	(149,261)
(110)	プット	FedEx	Exchange Traded	USD 150	21/4/2023	720	(5,830)
(467)	プット	PulteGroup	Exchange Traded	USD 40	21/4/2023	12,375	(10,508)
(208)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 350	21/4/2023	504	(27,768)
(663)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 372	21/4/2023	51,767	(248,625)
(257)	プット	US Treasury 5 Year Note (CBT)	Exchange Traded	USD 109	21/4/2023	(431,066)	(594,312)
(1,036)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 96.5	12/5/2023	122,423	(64,750)
(518)	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95.25	12/5/2023	(117,653)	(246,050)
(200)	プット	Caterpillar	Exchange Traded	USD 140	19/5/2023	454	(2,300)
(206)	コール	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 140	19/5/2023	10,252	(5,356)
(206)	プット	ConocoPhillips	Exchange Traded	USD 90	19/5/2023	(5,610)	(40,788)
(208)	プット	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 375	19/5/2023	269	(130,728)
(43)	プット	FedEx	Exchange Traded	USD 140	16/6/2023	(135)	(4,408)
(85)	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 95.875	16/6/2023	(104,849)	(123,781)
(173)	コール	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 97.75	15/9/2023	100,379	(8,650)
(362)	プット	SOFR 1 Year Mid Cap Index	Exchange Traded	USD 94.75	15/9/2023	(23,447)	(76,925)
(161)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 420	15/12/2023	53,861	(337,697)
(124)	コール	SPDR S&P 500 ETF Trust	Exchange Traded	USD 460	15/12/2023	65,643	(65,162)
(1,858)	プット	SOFR 3 Month Index	Exchange Traded	USD 94.75	15/3/2024	(973,345)	(1,451,562)
合計						<u>2,475,085</u>	<u>(7,804,939)</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)

買建スワップション 2023年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD 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、USD 3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	(1,752,931)	-
USD 2,255,000	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 HSOFRR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	31,838	124,093
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、USD 1日SOFRの変動金利を29/4/2039より毎年支払う。	JP Morgan	27/4/2038	(139,920)	100,878
USD 2,777,500	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 HSOFRR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	34,915	152,863
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、USD 1日SOFRの変動金利を24/2/2040より毎年支払う。	JP Morgan	22/2/2039	(163,692)	120,046
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	(227,244)	29,265
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 HSOFRR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	871,825	1,748,597
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	(85,451)	13,549
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	344,420	719,055
GBP 229,114,058	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	4,545,404	6,046,215
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	72,396	1,034,808
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	(194,310)	211,113

買建スワップション 2023年2月28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 10,193,500	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	(249,293)	359,776
EUR 315,429,398	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6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	7,893,417	9,567,642
USD 6,840,000	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3.415%の固定金利を2/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/10/2025より毎年支払う。	Barclays	30/9/2024	(63,987)	167,205
USD 6,840,000	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3.415%の固定金利を2/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/10/2025より毎年支払う。	Barclays	30/9/2024	(62,283)	168,909
USD 9,295,000	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27/10/2028より毎年受け取り、3.9%の固定金利を27/4/2028より半年毎に支払う。	Bank of America	25/10/2027	(81,117)	222,422
USD 13,335,000	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2.25%の固定金利を8/7/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を8/1/2027より毎年支払う。	Bank of America	6/1/2026	(126,578)	221,465
USD 15,355,000	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2.125%の固定金利を22/7/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/1/2027より毎年支払う。	Bank of America	20/1/2026	(144,123)	224,397
USD 5,000,000	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 39.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Barclays	19/4/2023	(6,252)	18,673
USD 5,945,000	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3.18%の固定金利を21/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を21/8/2024より毎年支払う。	Bank of America	17/8/2023	(59,435)	231,275
USD 5,945,000	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21/8/2024より毎年受け取り、3.18%の固定金利を21/2/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	17/8/2023	18,627	309,337
EUR 73,584,875	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.38.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Barclays	19/4/2023	(11,129)	203,503
USD 50,109,750	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3.05%の固定金利を26/4/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/10/2024より毎年支払う。	Citibank	24/10/2023	(365,081)	565,099

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 2023年2月28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 50,109,750	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26/10/2024より毎年受け取り、4.55%の固定金利を26/4/2024より半年毎に支払う。	Citibank	24/10/2023	(915,042)	363,257
USD 15,212,544	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.85%の固定金利を16/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年支払う。	Citibank	14/11/2023	(208,347)	418,964
USD 7,000,000	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 39.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Deutsche Bank	15/3/2023	(12,440)	19,340
USD 14,785,000	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2.15%の固定金利を19/8/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を19/2/2027より毎年支払う。	Deutsche Bank	17/2/2026	(34,638)	227,056
USD 18,500,000	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.IG 39.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に受け取り、1%の固定金利を支払う。	Goldman Sachs	19/4/2023	(19,085)	9,128
USD 41,473,496	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.85%の固定金利を9/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/8/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	7/8/2023	(301,976)	168,775
USD 122,648,814	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3.1%の固定金利を24/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を21/8/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	22/8/2023	-	613,244
USD 20,221,990	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9/11/2024より毎年受け取り、4.82%の固定金利を9/5/2024より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	(205,535)	105,496
USD 20,221,990	ファンドは、コール・オプションを購入して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは2.82%の固定金利を9/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/11/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	(74,816)	154,076
USD 13,590,000	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3.38%の固定金利を2/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/10/2025より毎年支払う。	Goldman Sachs	30/9/2024	(103,244)	345,226
USD 13,590,000	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3.38%の固定金利を2/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を2/10/2025より毎年支払う。	Goldman Sachs	30/9/2024	(126,591)	321,880
USD 10,405,000	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3.086%の固定金利を26/6/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/12/2025より毎年支払う。	Goldman Sachs	23/12/2024	(202,848)	320,524

買建スワップション 2023年2月28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 10,405,000	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26/12/2025より毎年受け取り、3.086%の固定金利を26/6/2025より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	23/12/2024	43,314	566,686
USD 9,295,000	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27/10/2028より毎年受け取り、4.1%の固定金利を27/4/2028より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	25/10/2027	(79,922)	200,140
USD 6,500,000	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 39.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	JP Morgan	15/3/2023	(23,952)	3,868
USD 41,721,866	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5/4/2024より毎年受け取り、3.8%の固定金利を5/10/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	3/4/2023	(28,339)	376,363
USD 50,109,751	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2.9%の固定金利を1/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を1/11/2024より毎年支払う。	JP Morgan	30/10/2023	(486,801)	431,627
USD 50,109,751	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1/11/2024より毎年受け取り、4.4%の固定金利を1/5/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/10/2023	(576,861)	459,384
USD 13,335,000	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%の固定金利を10/6/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/12/2026より毎年支払う。	JP Morgan	8/12/2025	(211,678)	163,036
EUR 11,580,000	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.38.V1の変動金利を20/3/2023より四半期毎に受け取り、5%の固定金利を支払う。	Morgan Stanley	15/3/2023	(14,480)	84,071
EUR 39,300,000	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EURIBORの変動金利を19/2/2025より毎年受け取り、2.2%の固定金利を19/2/2026より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	17/2/2025	(38,923)	162,783
USD 22,000,000	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24/7/2024より毎年受け取り、4.5%の固定金利を24/1/2024より毎年支払う。	UBS	20/7/2023	127,226	171,226
合計				6,585,038	28,246,335

売建スワップション 2023年2月28日現在

想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
USD (4,115,000)	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18/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/3/2024より毎年支払う。	Bank of America	28/3/2023	59,373	(14,286)
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	(328,158)	(762,154)
USD (6,850,000)	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3/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を3/8/2024より毎年支払う。	Bank of America	1/8/2023	(205,346)	(335,046)
USD (6,850,000)	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3/8/2024より毎年受け取り、2.83%の固定金利を3/2/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	1/8/2023	82,194	(24,775)
USD (29,400,000)	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17/8/2024より毎年受け取り、3.1%の固定金利を17/8/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	15/8/2023	143,363	(241,850)
USD (29,400,000)	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3.7%の固定金利を17/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/8/2024より毎年支払う。	Bank of America	15/8/2023	(174,604)	(645,614)
USD (5,387,500)	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2.855%の固定金利を5/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を5/9/2024より毎年支払う。	Bank of America	31/8/2023	174,281	(27,885)
USD (5,387,500)	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5/9/2024より毎年受け取り、2.855%の固定金利を5/3/2024より半年毎に支払う。	Bank of America	31/8/2023	(155,420)	(357,586)
USD (13,105,000)	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30/10/2025より毎年受け取り、3.575%の固定金利を30/4/2025より半年毎に支払う。	Bank of America	28/10/2024	223,547	(463,876)
USD (13,105,000)	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3.575%の固定金利を30/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/10/2025より毎年支払う。	Bank of America	28/10/2024	49,917	(637,506)
USD (18,495,000)	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30/10/2025より毎年受け取り、3.625%の固定金利を30/4/2025より半年毎に支払う。	Bank of America	28/10/2024	43,492	(220,062)
USD (18,495,000)	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3.625%の固定金利を30/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を30/10/2025より毎年支払う。	Bank of America	28/10/2024	56,995	(206,559)
USD (13,335,000)	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4.25%の固定金利を8/7/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を8/1/2027より毎年支払う。	Bank of America	6/1/2026	367	(354,344)

売建スワップション 2023年2月28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 (15,355,000)	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4.125%の固定金利を22/7/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/1/2027より毎年支払う。	Bank of America	20/1/2026	(92,292)	(447,672)
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	45,912	(64,708)
GBP (8,777,500)	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4.2%の固定金利を17/7/2024より半年毎に受け取り、GBP SONIAの変動金利を14/7/2024より毎年支払う。	Barclays	17/7/2023	(60,729)	(110,538)
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	105,536	(1,603)
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	(733,352)	(3,429,302)
USD (20,500,000)	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3.45%の固定金利を6/8/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/2/2025より毎年支払う。	Barclays	2/2/2024	(204,599)	(338,259)
USD (3,616,875)	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22/2/2025より毎年受け取り、3.3475%の固定金利を22/8/2024より半年毎に支払う。	Barclays	20/2/2024	24,773	(97,839)
USD (3,616,875)	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3.3475%の固定金利を22/8/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を22/2/2025より毎年支払う。	Barclays	20/2/2024	(21,127)	(143,739)
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	(45,236)	(307,294)
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	156,475	(105,583)
USD (26,788,000)	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3.01%の固定金利を4/8/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/2/2027より毎年支払う。	Barclays	2/2/2026	325,919	(971,960)
USD (26,788,000)	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USD SOFRの変動金利を4/2/2027より毎年受け取り、2.972%の固定金利を4/8/2026より半年毎に支払う。	Barclays	2/2/2026	353,863	(938,658)
USD (26,788,000)	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2.972%の固定金利を4/8/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/2/2027より毎年支払う。	Barclays	2/2/2026	(430,307)	(1,722,828)

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 2023年2月28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 (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	29,653	(45,806)
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	(12,619)	(97,243)
USD (21,205,000)	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18/9/2024より毎年受け取り、3.0925%の固定金利を18/3/2024より半年毎に支払う。	BNP Paribas	14/9/2023	612,270	(210,484)
USD (21,205,000)	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3.0925%の固定金利を18/3/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/9/2024より毎年支払う。	BNP Paribas	14/9/2023	(264,639)	(1,087,393)
USD (18,670,000)	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28/10/2025より毎年受け取り、2.65%の固定金利を28/4/2025より半年毎に支払う。	BNP Paribas	24/10/2024	111,163	(94,074)
USD (18,670,000)	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2.65%の固定金利を28/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/10/2025より毎年支払う。	BNP Paribas	24/10/2024	(189,067)	(401,078)
USD (4,196,000)	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3.339%の固定金利を26/8/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を26/2/2026より毎年支払う。	BNP Paribas	24/2/2025	(1,847)	(189,828)
USD (4,196,000)	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26/2/2026より毎年受け取り、3.339%の固定金利を26/8/2025より半年毎に支払う。	BNP Paribas	24/2/2025	11,735	(176,246)
USD (26,788,000)	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3.01%の固定金利を4/8/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を4/2/2027より毎年支払う。	BNP Paribas	2/2/2026	(382,794)	(1,680,673)
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	148,067	(810,879)
GBP (4,500,661)	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4.7%の固定金利を14/6/2024より半年毎に受け取り、GBP SONIAの変動金利を14/6/2024より毎年支払う。	Citibank	14/6/2023	857	(26,914)
GBP (3,579,719)	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4.7%の固定金利を14/6/2024より半年毎に受け取り、GBP SONIAの変動金利を14/6/2024より毎年支払う。	Citibank	14/6/2023	682	(21,407)
USD (200,439,002)	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26/10/2024より毎年受け取り、3.09%の固定金利を26/4/2024より半年毎に支払う。	Citibank	24/10/2023	625,630	(284,072)

売建スワップション 2023年2月28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 (121,700,361)	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4.75%の固定金利を16/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年支払う。	Citibank	14/11/2023	(160,601)	(575,230)
USD (152,125,451)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を16/11/2024より毎年受け取り、2.75%の固定金利を16/5/2024より半年毎に支払う。	Citibank	14/11/2023	368,723	(162,650)
USD (218,790,000)	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3.9%の固定金利を5/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を5/12/2024より毎年支払う。	Citibank	1/12/2023	(1,300,146)	(2,678,523)
USD (218,790,000)	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19/1/2025より毎年受け取り、2.75%の固定金利を19/7/2024より半年毎に支払う。	Citibank	17/1/2024	856,911	(390,192)
USD (7,000,000)	ファンドは、ブット・オプションを売却してクレジット・デフォルト・スワップを締結している。行使された場合、ファンドは5%の固定金利を受け取り、CDX.NA.HY 39.V1の変動金利を20/12/2022より四半期毎に支払う。	Deutsche Bank	15/3/2023	2,809	(2,091)
USD (16,725,000)	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4%の固定金利を10/11/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/5/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	8/5/2023	(103,948)	(164,994)
USD (17,695,000)	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3.023%の固定金利を18/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年支払う。	Deutsche Bank	14/12/2023	(271,676)	(976,822)
USD (17,695,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年受け取り、3.023%の固定金利を18/6/2024より半年毎に支払う。	Deutsche Bank	14/12/2023	468,036	(237,110)
USD (14,785,000)	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4.15%の固定金利を19/8/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を19/2/2027より毎年支払う。	Deutsche Bank	17/2/2026	(72,076)	(429,134)
USD (434,496,685)	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USD 1日SOFRの変動金利を10/3/2024より毎年受け取り、4.03%の固定金利を10/9/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	8/3/2023	(6,065,306)	(7,345,788)
USD (87,276,570)	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3.27%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	(2,484,693)	(3,216,071)
GBP (458,228,116)	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3.22%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	(6,616,411)	(8,117,222)
EUR (630,858,796)	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1.75%の固定金利を4/5/2024より毎年受け取り、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	(12,657,527)	(14,286,677)

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 2023年2月28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 (94,451,000)	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16/6/2024より毎年受け取り、2.5%の固定金利を16/12/2023より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	14/6/2023	493,499	(31,840)
USD (94,451,000)	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3.9%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。	Goldman Sachs	14/6/2023	(686,793)	(1,219,305)
USD (51,841,870)	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9/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/8/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	7/8/2023	(510,011)	(1,033,956)
USD (61,324,406)	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24/2/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を24/8/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	22/8/2023	-	(230,203)
USD (122,648,814)	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2.7%の固定金利を24/2/2024より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を24/8/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	22/8/2023	-	(331,152)
USD (50,110,000)	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9/11/2024より毎年受け取り、3.75%の固定金利を9/5/2024より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	114,594	(196,840)
USD (50,110,000)	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4.75%の固定金利を9/5/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/11/2024より毎年支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	73,750	(237,683)
USD (80,887,960)	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9/11/2024より毎年受け取り、3.26%の固定金利を9/5/2024より半年毎に支払う。	Goldman Sachs	7/11/2023	138,243	(165,632)
USD (79,517,327)	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1/6/2024より毎年受け取り、2.8%の固定金利を1/12/2023より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/5/2023	415,090	(42,135)
USD (80,311,793)	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12/12/2023より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を12/6/2024より毎年支払う。	JP Morgan	8/6/2023	(318,793)	(850,859)
USD (41,721,866)	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3.85%の固定金利を6/1/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を6/7/2024より毎年支払う。	JP Morgan	3/7/2023	(23,554)	(628,521)
USD (200,439,003)	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1/11/2024より毎年受け取り、2.95%の固定金利を1/5/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	30/10/2023	636,097	(246,989)
USD (21,190,000)	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17/1/2025より毎年受け取り、3.107%の固定金利を17/7/2024より半年毎に支払う。	JP Morgan	12/1/2024	129,902	(57,629)

売建スワップション 2023年2月28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 (21,190,000)	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3.107%の固定金利を17/7/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を17/1/2025より毎年支払う。	JP Morgan	12/1/2024	(275,128)	(462,660)
USD (11,130,000)	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 SOFRの変動金利を28/10/2025より毎年受け取り、3.5%の固定金利を28/4/2025より半年毎に支払う。	JP Morgan	24/10/2024	(63,290)	(119,383)
USD (11,130,000)	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3.5%の固定金利を28/4/2025より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を28/10/2025より毎年支払う。	JP Morgan	24/10/2024	89,040	(136,102)
USD (13,335,000)	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10/6/2026より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を10/12/2026より毎年支払う。	JP Morgan	8/12/2025	(54,209)	(416,281)
USD (432,055,000)	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4.5%の固定金利を9/9/2023より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を9/3/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	7/3/2023	(3,080,077)	(3,607,184)
EUR (23,160,000)	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.38.V1の変動金利を20/3/2023より四半期毎に支払う。	Morgan Stanley	15/3/2023	44,480	(54,817)
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	606,360	-
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	1,047,349	-
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	(993,052)	(1,660,766)
USD (196,281,851)	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1/6/2024より毎年受け取り、3.3%の固定金利を1/12/2023より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	30/5/2023	489,635	(30,512)
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	(981,336)	(3,936,854)
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	114,620	(1,431)

売建スワップション 2023年2月28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 (26,051,000)	ファンドは、コール・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドはUSD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年受け取り、2.4%の固定金利を18/6/2024より半年毎に支払う。	Morgan Stanley	14/12/2023	372,258	(101,871)
USD (26,051,000)	ファンドは、プット・オプションを売却して金利スワップを締結している。行使された場合、ファンドは3.6%の固定金利を18/6/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を18/12/2024より毎年支払う。	Morgan Stanley	14/12/2023	(243,722)	(751,716)
USD (16,785,000)	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1.99%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	(642,069)	(1,960,527)
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	181,042	(4,645)
USD (5,510,000)	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2.715%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	(248,819)	(434,506)
USD (22,000,000)	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5%の固定金利を24/1/2024より毎年受け取り、USD SOFRの変動金利を24/7/2024より毎年支払う。	UBS	20/7/2023	(74,294)	(88,594)
USD (21,115,000)	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9/2/2025より毎年受け取り、3.445%の固定金利を9/8/2024より半年毎に支払う。	UBS	7/2/2024	93,112	(96,923)
USD (21,115,000)	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3.445%の固定金利を9/8/2024より半年毎に受け取り、USD SOFRの変動金利を9/2/2025より毎年支払う。	UBS	7/2/2024	(158,821)	(348,856)
合計				(31,266,874)	(76,166,499)

差金決済取引 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価損 (米ドル)
15,499	ベルギー Telenet	Bank of America	(9,232)
			(9,232)
(77,400)	香港 Link REIT	Bank of America	21,694
(30,340)	Link REIT	Bank of America	(28,604)
			(6,910)
417,353	イタリア Telecom Italia	Bank of America	5,816
			5,816
(13,570)	オランダ Heineken	Bank of America	(18,394)
			(18,394)
(10,750)	米国 Southern	Bank of America	12,477
			12,477
合計			(16,243)

事後通告証券契約 2023年2月28日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
T B A			
	米国		
USD (9,045,800)	Fannie Mae or Freddie Mac 2.5% TBA	(7,649,354)	(0.10)
USD (102,432,300)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(89,916,353)	(1.16)
USD (98,600,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 3% TBA	(86,644,750)	(1.11)
USD 364,383,162	Fannie Mae or Freddie Mac 3.5% TBA	330,990,863	4.26
USD (308,455,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 4% TBA	(288,718,701)	(3.72)
USD 281,620,705	Fannie Mae or Freddie Mac 4.5% TBA	270,289,873	3.48
USD (3,600,000)	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	(3,527,902)	(0.05)
USD 3,600,000	Fannie Mae or Freddie Mac 5% TBA	3,527,902	0.05
USD 138,471,000	Fannie Mae or Freddie Mac 6% TBA	139,898,982	1.80
T B A 合計		268,250,560	3.45

<参考情報>

ブラックロック・グローバル・ファンズ
USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドの運用状況について
(計算期間: 2022年9月1日～2023年2月28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、入手可能な最新のデータである半期末時点(2023年2月28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。

2022年9月1日から2023年2月28日までの期間(未監査)

BGF USダラー・ショート・ デュレーション・ボンド・ファンド	
米ドル	
期首純資産	1,582,256,819
収益	
預金利息	675,119
債券利息、源泉徴収税控除後	27,952,517
スワップ利息	15,419
差金決済契約に係る受取利息	-
短期金融商品預け入れによる利息	645,779
配当金、源泉徴収税控除後	-
有価証券貸付による収益	63,766
その他の払戻し	258
収益合計	29,352,858
費用	
スワップ利息	203,499
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	528,079
ローン・コミットメント・フィー	4,937
保管および預託報酬	97,526
販売報酬	326,537
税金	342,267
投資運用報酬	3,987,022
費用合計	5,489,867
純利益	23,862,991
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(40,118,433)
事後通告証券契約	(1,329)
差金決済取引	-
上場先物取引	(5,213,751)
オプション／スワップシジョン契約	-
スワップ取引	526,081
先渡為替予約	11,973,382
その他の取引に係る外国通貨	(363,930)
当期実現純評価損	(33,197,980)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	31,592,723
事後通告証券契約	(5,652)
差金決済取引	-
上場先物取引	(928,608)
オプション／スワップシジョン契約	-
スワップ取引	(105,853)
先渡為替予約	(13,287,914)
その他の取引に係る外国通貨	68,141
当期末実現評価益／(損)の純変動	17,332,837
運用成績による純資産の(減少)／増加	7,997,848
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	374,692,831
投資証券買戻しによる正味支払額	(295,280,878)
資本の変動による純資産の(減少)／増加	79,411,953
配当金宣言額	(2,208,608)
期末純資産	1,667,458,012

BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド
 投資有価証券明細表 2023年2月28日現在(未監査)

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
オーストラリア			
USD 1,904,000	Australia & New Zealand Banking 5.088% 8/12/2025	1,897,348	0.11
USD 379,000	National Australia Bank 4.944% 12/1/2028	377,024	0.02
		<u>2,274,372</u>	<u>0.13</u>
オーストリア			
USD 235,000	Klabn Austria 3.2% 12/1/2031	188,000	0.01
バーレーン			
USD 200,000	Bahrain Government International Bond 7.375% 14/5/2030	207,250	0.01
ベルギー			
EUR 1,400,000	KBC 0.5% 3/12/2029	1,365,618	0.08
バミューダ諸島			
USD 200,000	Geopark 5.5% 17/1/2027	169,191	0.01
USD 15,000	NCL 8.375% 1/2/2028	15,314	0.00
USD 24,000	Weatherford International 6.5% 15/9/2028	23,485	0.00
USD 2,000	Weatherford International 11% 1/12/2024	2,058	0.00
		<u>210,048</u>	<u>0.01</u>
カナダ			
USD 125,000	1011778 BC ULC / New Red Finance 4.375% 15/1/2028	112,028	0.01
USD 87,000	Air Canada 3.875% 15/8/2026	78,440	0.01
USD 877,000	Bank of Montreal 4.25% 14/9/2024	861,931	0.05
USD 3,040,000	Bank of Montreal 5.2% 12/12/2024	3,032,576	0.18
USD 2,600,000	Bank of Nova Scotia/The 4.85% 1/2/2030	2,513,548	0.15
USD 2,235,000	Bank of Nova Scotia/The 5.25% 6/12/2024	2,228,921	0.14
USD 94,000	Bombardier 6% 15/2/2028	87,862	0.00
USD 146,000	Bombardier 7.125% 15/6/2026	143,247	0.01
USD 42,000	Bombardier 7.5% 1/2/2029	41,358	0.00
USD 55,000	Bombardier 7.875% 15/4/2027	54,756	0.00
USD 70,000	Brookfield Residential Properties / Brookfield Residential US 5% 15/6/2029	54,667	0.00
USD 428,000	Canadian Pacific Railway 1.75% 2/12/2026	378,304	0.02
USD 371,000	Clarios Global / Clarios US Finance 6.25% 15/5/2026	364,010	0.02
USD 5,030,000	CPPIB Capital 0.5% 16/9/2024	4,677,620	0.28
USD 2,460,000	Enbridge 2.5% 14/2/2025	2,321,131	0.14
USD 26,000	Enerflex 9% 15/10/2027	25,501	0.00
USD 47,000	Garda World Security 4.625% 15/2/2027	41,684	0.01
USD 36,000	Garda World Security 7.75% 15/2/2028	35,367	0.00
USD 44,000	GFL Environmental 3.5% 1/9/2028	38,458	0.00
USD 104,000	GFL Environmental 4% 1/8/2028	90,569	0.01
USD 61,000	GFL Environmental 5.125% 15/12/2026	58,447	0.01
USD 5,000	Masonite International 5.375% 1/2/2028	4,678	0.00
USD 43,000	New Gold 7.5% 15/7/2027	37,034	0.00
USD 25,000	NOVA Chemicals 4.875% 1/6/2024	24,528	0.00
USD 3,975,000	OMERS Finance Trust 1.1% 26/3/2026	3,539,545	0.21
USD 33,000	Parkland 5.875% 15/7/2027	31,016	0.00
USD 2,000	Precision Drilling 6.875% 15/1/2029	1,820	0.00
USD 398,000	Rogers Communications 2.9% 15/11/2026	363,023	0.02
USD 3,587,000	Rogers Communications 3.2% 15/3/2027	3,293,305	0.20
USD 1,969,000	Royal Bank of Canada 6% 1/11/2027	2,023,952	0.12
EUR 730,000	Toronto-Dominion Bank/The 0.375% 25/4/2024	747,040	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 (%)
カナダ(続き)			
USD 3,043,000	Toronto-Dominion Bank/The 5.156% 10/1/2028	3,026,477	0.18
USD 58,000	Videotron 5.125% 15/4/2027	54,287	0.00
		30,387,130	1.82
ケイマン諸島			
USD 650,000	Allegro CLO IIS 6.965% 21/10/2028	637,844	0.04
USD 2,000,000	Allegro CLO IV 6.342% 15/1/2030	1,984,075	0.12
USD 550,000	Allegro CLO XI 6.648% 19/1/2033	539,774	0.03
USD 3,250,000	Apidos CLO XXIX 6.368% 25/7/2030	3,188,113	0.19
USD 385,000	Arabian Centres Sukuk II 5.625% 7/10/2026	355,163	0.02
USD 1,450,000	ASSURANT CLO 5.848% 20/4/2031	1,435,124	0.09
USD 3,500,000	Bean Creek CLO 5.828% 20/4/2031	3,461,879	0.21
USD 520,000	Benefit Street Partners CLO V-B 5.898% 20/4/2031	515,746	0.03
USD 500,000	Canyon CLO 2018-1 5.862% 15/7/2031	495,809	0.03
USD 1,750,000	Carbone Clo 5.948% 20/1/2031	1,737,451	0.10
USD 2,333,392	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 5.932% 15/7/2031	2,313,077	0.14
USD 1,250,000	CARLYLE US CLO 2018- 4 6.878% 20/1/2031	1,207,443	0.07
USD 947,126	CIFC Funding 2017-V 5.972% 16/11/2030	940,849	0.06
USD 250,000	CIFC Funding 2018-V 5.982% 15/1/2032	247,626	0.01
USD 7,000,000	CIFC Funding 2019-I 5.908% 20/4/2032	6,925,876	0.42
USD 938,462	Clear Creek CLO 6.008% 20/10/2030	930,560	0.06
USD 5,854,038	Deer Creek Clo 2017-1 5.988% 20/10/2030	5,802,750	0.35
USD 222,000	Fantasia 0% 9/1/2023	31,635	0.00
USD 200,000	Fantasia 11.875% 1/6/2023	28,500	0.00
USD 2,150,000	Galaxy XXII CLO 5.992% 16/4/2034	2,122,588	0.13
USD 2,500,000	Goldentree Loan Management US Clo 3 6.108% 20/4/2030	2,469,345	0.15
USD 500,000	Goldentree Loan Management US CLO 5 5.878% 20/10/2032	494,025	0.03
USD 1,000,000	Goldentree Loan Opportunities XI 5.865% 18/1/2031	993,687	0.06
USD 200,000	Grupo Aval 4.375% 4/2/2030	150,398	0.01
USD 60,000	Hawaiian Brand Intellectual Property / HawaiianMiles Loyalty 5.75% 20/1/2026	55,691	0.00
USD 1,091,279	ICG US CLO 2015-1 5.938% 19/10/2028	1,086,149	0.07
USD 400,000	LCM Loan Income Fund I Income Note Issuer 5.872% 16/7/2031	397,036	0.02
USD 250,000	MAF Sukuk 4.638% 14/5/2029	245,118	0.02
USD 250,000	Marble Point CLO XXII 6.668% 25/7/2034	239,180	0.01
USD 246,574	Milos CLO 5.878% 20/10/2030	244,887	0.01
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 25 6.145% 18/10/2029	483,040	0.03
USD 4,870,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 26 5.715% 18/10/2030	4,827,564	0.29
USD 500,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 5.928% 19/10/2031	495,972	0.03
USD 300,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 6.498% 19/10/2031	296,094	0.02
USD 850,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 33 5.872% 16/10/2033	839,249	0.05
USD 750,000	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 6.389% 20/1/2035	735,812	0.04
USD 520,000	OCP CLO 2017-14 6.065% 20/11/2030	517,003	0.03
USD 8,600,000	Peace Park CLO 5.938% 20/10/2034	8,473,423	0.51
USD 3,920,000	Pikes Peak CLO 1 5.996% 24/7/2031	3,893,857	0.23
USD 4,408,828	Regatta VIII Funding 6.042% 17/10/2030	4,384,763	0.26
USD 1,000,000	Regatta VIII Funding 6.492% 17/10/2030	986,563	0.06
USD 250,000	Regatta X Funding 6.242% 17/1/2031	245,826	0.01
USD 1,750,000	Regatta XVI Funding 6.842% 15/1/2033	1,731,571	0.10
USD 275,000	Rockford Tower CLO 2017-3 5.998% 20/10/2030	273,454	0.02
USD 525,000	RR 19 5.932% 15/10/2035	516,234	0.03
USD 2,500,000	RR 3 5.882% 15/1/2030	2,484,198	0.15
USD 17,000	Spirit Loyalty Cayman / Spirit IP Cayman 8% 20/9/2025	17,089	0.00
USD 1,000,000	Symphony CLO XXIII 6.392% 15/1/2034	984,484	0.06
USD 1,000,000	TICP CLO V 2016-1 6.542% 17/7/2031	977,513	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 (%)
ケイマン諸島(続き)			
USD 68,000	Transocean 8.75% 15/2/2030	69,120	0.00
USD 21,000	Transocean Titan Financing 8.375% 1/2/2028	21,454	0.00
USD 900,000	Trinitas CLO XVIII 5.978% 20/1/2035	882,925	0.05
		75,414,606	4.51
チリ			
USD 200,000	Chile Government International Bond 3.24% 6/2/2028	185,392	0.01
USD 235,000	Colbun 3.15% 19/1/2032	194,813	0.01
USD 202,000	Nacional del Cobre de Chile 3.625% 1/8/2027	189,204	0.01
		569,409	0.03
コロンビア			
USD 311,000	Colombia Government International Bond 3.875% 25/4/2027	276,377	0.02
USD 269,000	Colombia Government International Bond 8% 20/4/2033	266,078	0.01
USD 164,000	Ecopetrol 4.625% 2/11/2031	122,385	0.01
USD 195,000	Ecopetrol 5.375% 26/6/2026	185,640	0.01
USD 90,000	Ecopetrol 5.875% 28/5/2045	59,962	0.00
USD 127,000	Ecopetrol 8.875% 13/1/2033	124,555	0.01
USD 311,000	Promigas / Gases del Pacifico 3.75% 16/10/2029	241,886	0.01
		1,276,883	0.07
デンマーク			
USD 3,160,000	Danske Bank 0.976% 10/9/2025	2,917,358	0.17
USD 470,000	Danske Bank 1.621% 11/9/2026	421,685	0.03
USD 330,000	Danske Bank 4.298% 1/4/2028	310,718	0.02
		3,649,761	0.22
ドミニカ共和国			
USD 250,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	232,186	0.01
USD 254,000	Dominican Republic International Bond 5.5% 22/2/2029	235,901	0.02
USD 150,000	Dominican Republic International Bond 7.05% 3/2/2031	150,258	0.01
		618,345	0.04
フィンランド			
EUR 905,000	CRH Finland Services 0.875% 5/11/2023	944,839	0.06
フランス			
USD 326,000	Altice France 8.125% 1/2/2027	302,658	0.02
EUR 200,000	Arkema 0.125% 14/10/2026	187,734	0.01
EUR 300,000	Banque Federative du Credit Mutuel 0.75% 8/6/2026	286,797	0.02
EUR 500,000	BPCE 0.625% 28/4/2025	494,910	0.03
USD 925,000	BPCE 2.045% 19/10/2027	805,072	0.05
USD 282,000	BPCE 3.25% 11/1/2028	254,565	0.01
EUR 500,000	Capgemini 0.625% 23/6/2025	494,884	0.03
EUR 113,351	FCT Autonoria 2019 3.253% 25/9/2035	120,373	0.01
EUR 113,180	FCT Autonoria 2019 5.103% 25/9/2035	118,696	0.00
EUR 592,789	FCT Noria 2021 3.103% 25/10/2049	622,929	0.04
EUR 370,493	FCT Noria 2021 3.503% 25/10/2049	385,673	0.02
EUR 518,690	FCT Noria 2021 3.903% 25/10/2049	534,107	0.03
EUR 300,000	FCT Pixel 2021 4.443% 25/2/2038	307,888	0.02
EUR 1,271,072	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 3.393% 27/8/2061	1,360,930	0.08
EUR 1,000,000	Harmony French Home Loans FCT 2020-2 4.043% 27/8/2061	1,055,155	0.06
EUR 400,000	Harmony French Home Loans FCT 2021-1 3.643% 27/5/2061	413,812	0.03
USD 362,000	Iliad 6.5% 15/10/2026	338,752	0.02
EUR 800,000	Pernod Ricard 0% 24/10/2023	831,719	0.05
EUR 400,000	PSA Banque France 0% 22/1/2025*	394,443	0.02
EUR 600,000	Schneider Electric 0.25% 9/9/2024	606,259	0.04
		9,917,356	0.59

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			
EUR 600,000	BASF 0.101% 5/6/2023	633,293	0.04
EUR 600,000	Bayer 0.05% 12/1/2025	593,415	0.04
EUR 200,000	Commerzbank 0.75% 24/3/2026	196,307	0.01
EUR 290,000	Covestro 0.875% 3/2/2026*	283,393	0.02
EUR 600,000	Deutsche Bank 1% 19/11/2025	602,482	0.04
USD 1,310,000	Deutsche Bank 1.447% 1/4/2025	1,237,593	0.07
EUR 800,000	Deutsche Bank 1.875% 23/2/2028	751,401	0.04
EUR 210,000	E.ON 0.875% 8/1/2025	212,132	0.01
EUR 289,920	Red & Black Auto Germany 8 UG 3.152% 15/9/2030	306,630	0.02
EUR 386,561	Red & Black Auto Germany 8 UG 3.352% 15/9/2030	403,132	0.02
EUR 1,100,000	Volkswagen Bank 1.875% 31/1/2024	1,147,230	0.07
EUR 600,000	Volkswagen Bank 2.5% 31/7/2026	601,061	0.03
EUR 520,000	Volkswagen Financial Services 0.875% 31/1/2028	465,368	0.03
EUR 330,000	Volkswagen Leasing 0.375% 20/7/2026	307,599	0.02
EUR 700,000	ZF Finance 3% 21/9/2025	702,624	0.04
		8,443,660	0.50
グアテマラ			
USD 200,000	Guatemala Government Bond 3.7% 7/10/2033	164,194	0.01
USD 64,000	Guatemala Government Bond 5.25% 10/8/2029	61,499	0.01
USD 210,000	Guatemala Government Bond 5.375% 24/4/2032	200,566	0.01
		426,259	0.03
ハンガリー			
USD 200,000	Hungary Government International Bond 5.25% 16/6/2029*	195,625	0.01
アイルランド			
USD 2,200,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.45% 29/10/2026	1,938,669	0.11
USD 1,700,000	AerCap Ireland Capital / AerCap Global Aviation Trust 2.875% 14/8/2024	1,616,704	0.10
GBP799,701	Agora UK 2021 5.052% 22/7/2031	925,498	0.06
GBP784,347	Atom Mortgage 5.752% 22/7/2031	859,184	0.05
EUR 525,000	ESB Finance 3.494% 12/1/2024	557,138	0.03
EUR 561,000	Fresenius Finance Ireland 0% 1/10/2025	536,652	0.03
GBP734,956	Frost CMBS 2021-1 5.296% 20/11/2033	876,696	0.05
EUR 1,050,696	Haus European Loan Conduit No 39 3.118% 28/7/2051	1,062,470	0.06
EUR 796,770	Haus European Loan Conduit No 39 3.568% 28/7/2051	761,635	0.05
EUR 636,816	Haus European Loan Conduit No 39 3.868% 28/7/2051	582,650	0.04
EUR 988,396	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 3.432% 17/8/2033	1,011,865	0.06
EUR 906,253	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.082% 17/8/2033	894,579	0.05
EUR 320,085	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 4.582% 17/8/2033	307,740	0.02
EUR 1,000,794	Last Mile PE 2021 3.582% 17/8/2031	1,041,089	0.06
EUR 1,316,724	Last Mile PE 2021 3.732% 17/8/2031	1,335,223	0.08
EUR 678,857	Last Mile PE 2021 3.882% 17/8/2031	682,255	0.04
EUR 918,807	Last Mile PE 2021 4.282% 17/8/2031	908,502	0.06
USD 264,000	LCPR Senior Secured Financing 6.75% 15/10/2027	244,626	0.01
EUR 2,001,394	Pearl Finance 2020 4.082% 17/11/2032	2,105,708	0.13
EUR 1,128,144	Pearl Finance 2020 4.582% 17/11/2032	1,155,718	0.07
EUR 1,354,717	Pearl Finance 2020 5.182% 17/11/2032	1,392,024	0.08
USD 1,070,317	Prodigy Finance CM2021-1 5.867% 25/7/2051	1,035,593	0.06
EUR 455,900	River Green Finance 2020 3.443% 22/1/2032	461,108	0.03
EUR 237,650	River Green Finance 2020 3.793% 22/1/2032	240,328	0.01
EUR 469,435	SCF Rahoituspalvelut IX 3.383% 25/10/2030	495,610	0.03
USD 2,850,000	SMBC Aviation Capital Finance 1.9% 15/10/2026	2,453,325	0.15
USD 605,000	SMBC Aviation Capital Finance 2.3% 15/6/2028	498,467	0.03
GBP798,138	Taurus 2021-1 UK 4.795% 17/5/2031	940,095	0.06

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	アイルランド(続き)		
GBP321,638	Taurus 2021-1 UK 5.595% 17/5/2031	364,966	0.02
GBP262,075	Taurus 2021-1 UK 6.545% 17/5/2031	296,350	0.02
GBP479,655	Taurus 2021-4 UK 4.895% 17/8/2031	569,538	0.03
GBP286,310	Taurus 2021-4 UK 6.045% 17/8/2031	322,241	0.02
EUR 1,476,664	Vita Scientia 2022-1 3.998% 27/2/2033	1,506,809	0.09
		29,981,055	1.79
	マン島		
USD 209,000	AngloGold Ashanti 3.75% 1/10/2030	178,546	0.01
	イスラエル		
USD 215,170	Leviathan Bond 5.75% 30/6/2023*	214,363	0.01
	イタリア		
EUR 440,000	ACEA 0% 28/9/2025	421,318	0.02
EUR 910,000	ASTM 1% 25/11/2026	846,665	0.05
EUR 1,010,718	Autoflorence 2 3.096% 24/12/2044	1,075,565	0.06
EUR 548,675	Autoflorence 2 3.146% 24/12/2044	568,665	0.03
EUR 373,605	Autoflorence 2 3.546% 24/12/2044	379,504	0.02
EUR 200,339	Autoflorence 2 4.746% 24/12/2044	205,314	0.01
EUR 143,000	Brignole 2021 2.799% 24/7/2036	149,470	0.01
EUR 100,000	Brignole 2021 3.599% 24/7/2036	102,647	0.01
EUR 979,765	Cassia 2022-1 5.154% 22/5/2034	998,931	0.06
EUR 468,531	Cassia 2022-1 6.154% 22/5/2034	451,032	0.03
EUR 270,000	FCA Bank 0% 16/4/2024	274,044	0.02
EUR 180,000	FCA Bank 0.125% 16/11/2023	186,783	0.01
EUR 620,000	FCA Bank 0.5% 18/9/2023	648,978	0.04
EUR 329,678	Progetto Quinto 2.664% 27/10/2036	348,591	0.02
EUR 599,000	Red & Black Auto Italy 5.279% 28/12/2031	607,418	0.04
EUR 320,000	Snam 0% 15/8/2025	309,380	0.02
USD 310,000	Telecom Italia 5.303% 30/5/2024	302,080	0.02
		7,876,385	0.47
	日本		
EUR 621,000	Asahi 0.01% 19/4/2024	631,460	0.04
EUR 290,000	Asahi 0.155% 23/10/2024	289,454	0.02
USD 310,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.08% 19/4/2028*	293,811	0.02
USD 5,510,000	Mitsubishi UFJ Financial 4.788% 18/7/2025	5,437,270	0.33
USD 1,525,000	Mitsubishi UFJ Financial 5.719% 20/2/2026	1,522,335	0.09
EUR 1,045,000	Mizuho Financial 0.523% 10/6/2024	1,064,512	0.06
USD 505,000	Mizuho Financial 1.234% 22/5/2027	437,350	0.03
USD 200,000	Mizuho Financial 4.018% 5/3/2028	187,922	0.01
EUR 185,000	Nissan Motor 2.652% 17/3/2026	184,457	0.01
USD 2,671,000	Nissan Motor 3.043% 15/9/2023	2,625,611	0.16
USD 1,700,000	Nissan Motor 4.345% 17/9/2027	1,547,372	0.09
USD 300,000	Nomura 1.851% 16/7/2025	273,637	0.02
USD 200,000	Nomura 2.648% 16/1/2025	189,222	0.01
USD 200,000	Nomura 5.709% 9/1/2026	199,453	0.01
USD 910,000	NTT Finance 4.372% 27/7/2027	886,594	0.05
USD 2,409,000	Sumitomo Mitsui Financial 5.464% 13/1/2026	2,404,921	0.14
		18,175,381	1.09
	ジャージー		
USD 1,342,000	Aptiv / Aptiv 2.396% 18/2/2025	1,265,098	0.08
EUR 1,230,000	Heathrow Funding 1.5% 12/10/2027	1,218,263	0.07
		2,483,361	0.15

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 (%)
リベリア			
USD 80,000	Royal Caribbean Cruises 5.5% 31/8/2026	72,491	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 7.25% 15/1/2030	30,039	0.00
USD 30,000	Royal Caribbean Cruises 8.25% 15/1/2029	31,082	0.00
USD 16,000	Royal Caribbean Cruises 9.25% 15/1/2029	16,986	0.00
USD 31,000	Royal Caribbean Cruises 11.625% 15/8/2027	32,965	0.00
		183,563	0.00
ルクセンブルグ			
USD 200,000	Allied Universal Holdco /Allied Universal Finance /Atlas Luxco 4 4.625% 1/6/2028	166,505	0.01
USD 365,000	Altice Financing 5% 15/1/2028	303,735	0.02
EUR 460,000	Becton Dickinson Euro Finance 1.208% 4/6/2026	447,048	0.03
EUR 1,897,000	BL Consumer Credit 2021 3.153% 25/9/2038	2,023,523	0.12
EUR 528,000	BL Consumer Credit 2021 3.503% 25/9/2038	552,905	0.03
EUR 681,000	BL Consumer Credit 2021 4.053% 25/9/2038	702,456	0.04
EUR 355,000	BL Consumer Credit 2021 5.253% 25/9/2038	360,493	0.02
USD 62,000	Camelot Finance 4.5% 1/11/2026	56,915	0.00
USD 200,000	EIG Pearl 4.387% 30/11/2046	152,925	0.01
EUR 700,000	FACT Master 3.356% 20/7/2028	736,887	0.05
EUR 767,175	Germany Compartment Consumer 2020-1 3.525% 14/11/2034	812,513	0.05
EUR 409,160	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.125% 14/11/2034	429,119	0.03
EUR 306,870	Germany Compartment Consumer 2020-1 4.875% 14/11/2034	320,460	0.02
USD 200,000	Herens Holdco 4.75% 15/5/2028	164,206	0.01
EUR 405,000	Holcim Finance Luxembourg 0.125% 19/7/2027*	367,902	0.02
EUR 635,000	Medtronic Global 0.375% 7/3/2023	675,192	0.04
EUR 1,515,000	SIG Combibloc PurchaseCo 1.875% 18/6/2023*	1,600,595	0.10
EUR 270,000	SIG Combibloc PurchaseCo 2.125% 18/6/2025	271,595	0.02
USD 200,000	Telenet Finance Luxembourg Notes 5.5% 1/3/2028	188,450	0.01
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0% 14/6/2024	503,967	0.03
EUR 500,000	Traton Finance Luxembourg 0.125% 10/11/2024	496,700	0.03
EUR 200,000	Traton Finance Luxembourg 4.125% 22/11/2025	211,224	0.01
		11,545,315	0.70
モーリシャス			
USD 250,000	India Green Energy 5.375% 29/4/2024*	243,125	0.02
メキシコ			
USD 200,000	BBVA Bancomer 5.125% 18/1/2033	180,394	0.01
USD 221,000	Comision Federal de Electricidad 4.688% 15/5/2029	198,197	0.01
USD 200,000	Comision Federal de Electricidad 4.875% 15/1/2024	198,057	0.01
USD 200,000	Grupo KUO 5.75% 7/7/2027	184,276	0.01
USD 350,000	Mexico City Airport Trust 4.25% 31/10/2026	327,778	0.02
USD 380,000	Mexico Government International Bond 4.125% 21/1/2026	370,880	0.02
USD 200,000	Mexico Government International Bond 4.75% 27/4/2032	186,581	0.01
USD 160,000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/1/2031	122,653	0.01
USD 77,000	Petroleos Mexicanos 6.7% 16/2/2032	61,600	0.00
USD 127,000	Petroleos Mexicanos 6.875% 4/8/2026	121,158	0.01
USD 129,000	Petroleos Mexicanos 8.75% 2/6/2029	122,047	0.01
USD 200,000	Trust Fibra Uno 5.25% 30/1/2026	191,454	0.01
		2,265,075	0.13
モロッコ			
USD 316,000	Morocco Government International Bond 3% 15/12/2032	240,950	0.02
オランダ			
EUR 701,000	American Medical Systems Europe 1.375% 8/3/2028*	660,473	0.04
EUR 600,000	Bayer Capital 1.5% 26/6/2026	588,365	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 (%)
オランダ(続き)			
EUR 890,000	BMW Finance 0% 14/4/2023	943,365	0.06
EUR 490,000	Conti-Gummi Finance 1.125% 25/9/2024	500,102	0.03
EUR 1,115,000	Digital Dutch Finco 0.625% 15/7/2025	1,072,190	0.06
EUR 503,386	Domi 2021-1 2.676% 15/6/2053	531,157	0.03
EUR 1,642,521	Domi 2022-1 3.138% 15/4/2054	1,737,248	0.10
EUR 696,719	Dutch Property Finance 2020-2 3.258% 28/1/2058	739,353	0.04
EUR 290,000	Dutch Property Finance 2020-2 3.818% 28/1/2058	303,450	0.02
EUR 1,980,898	Dutch Property Finance 2021-1 3.118% 28/7/2058	2,102,192	0.13
EUR 740,000	Dutch Property Finance 2021-1 3.568% 28/7/2058	771,082	0.05
EUR 993,816	Dutch Property Finance 2021-2 3.168% 28/4/2059	1,049,457	0.06
EUR 820,000	Dutch Property Finance 2021-2 3.268% 28/4/2059	846,508	0.05
EUR 504,000	Dutch Property Finance 2021-2 3.518% 28/4/2059	508,724	0.03
EUR 1,155,000	Enel Finance International 0% 17/6/2024	1,168,557	0.07
EUR 230,000	GSK Consumer Healthcare Capital NL 1.25% 29/3/2026	224,736	0.01
EUR 500,000	ING Groep 0.1% 3/9/2025	498,463	0.03
EUR 800,000	ING Groep 1% 20/9/2023	840,161	0.05
USD 900,000	ING Groep 1.726% 1/4/2027	798,660	0.05
EUR 929,400	Jubilee Place 3.178% 17/1/2059	983,812	0.06
EUR 407,000	Jubilee Place 3.428% 17/1/2059	416,801	0.03
EUR 201,000	Jubilee Place 3.928% 17/1/2059	203,884	0.01
EUR 340,322	Jubilee Place 2020-1 3.328% 17/10/2057	362,361	0.02
EUR 574,595	Jubilee Place 2021-1 3.158% 17/7/2058	608,174	0.04
EUR 700,000	Louis Dreyfus Finance 2.375% 27/11/2025	703,909	0.04
EUR 93,516	Magoi 2019 3.364% 27/7/2039	97,985	0.01
EUR 450,000	Mercedes-Benz International Finance 0.25% 6/11/2023	468,462	0.03
USD 742,000	NXP / NXP Funding / NXP USA 2.7% 1/5/2025	695,952	0.04
EUR 200,000	Redexis Gas Finance 1.875% 28/5/2025	202,511	0.01
USD 80,000	Sensata Technologies 4% 15/4/2029	70,310	0.00
USD 47,000	Sensata Technologies 5% 1/10/2025	45,773	0.00
EUR 935,000	Siemens Financieringsmaatschappij 0.375% 6/9/2023	979,894	0.06
EUR 665,000	Stellantis 3.375% 7/7/2023	707,456	0.04
USD 27,000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III 3.15% 1/10/2026	23,664	0.00
EUR 410,000	Toyota Motor Finance Netherlands 0% 27/10/2025	394,790	0.02
USD 311,000	Trivium Packaging Finance 5.5% 15/8/2026	293,427	0.02
EUR 720,000	Viterra Finance 0.375% 24/9/2025	683,204	0.04
USD 194,000	Ziggo Bond 6% 15/1/2027	179,639	0.01
		24,006,251	1.43
オマーン			
USD 240,000	Oman Government International Bond 6.5% 8/3/2047	224,700	0.01
USD 267,000	OQ SAOC 5.125% 6/5/2028	258,495	0.02
		483,195	0.03
パナマ			
USD 250,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior 2.375% 14/9/2025	230,344	0.01
USD 295,000	Banco Nacional de Panama 2.5% 11/8/2030	236,173	0.02
USD 30,000	Carnival 4% 1/8/2028	25,514	0.00
USD 110,000	Carnival 5.75% 1/3/2027	90,166	0.01
USD 33,000	Carnival 6% 1/5/2029	25,565	0.00
USD 5,000	Carnival 7.625% 1/3/2026	4,511	0.00
USD 71,000	Carnival 10.5% 1/2/2026	73,553	0.01
USD 248,000	Panama Government International Bond 2.252% 29/9/2032	184,599	0.01
USD 238,000	Panama Government International Bond 3.875% 17/3/2028	223,202	0.02
		1,093,627	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 (%)
パラグアイ			
USD 319,000	Paraguay Government International Bond 4.95% 28/4/2031	300,454	0.02
USD 332,000	Paraguay Government International Bond 5% 15/4/2026*	323,923	0.02
		624,377	0.04
ペルー			
USD 341,000	Peruvian Government International Bond 2.392% 23/1/2026	317,657	0.02
USD 116,000	Peruvian Government International Bond 2.783% 23/1/2031	95,634	0.01
USD 200,000	SAN Miguel Industrias Pet / NG PET R&P Latin America 3.5% 2/8/2028	166,018	0.01
		579,309	0.04
フィリピン			
USD 200,000	Philippine Government International Bond 3.75% 14/1/2029	188,250	0.01
ポルトガル			
EUR 198,543	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 4.264% 25/1/2035	203,810	0.01
EUR 860,353	Ares Lusitani-STC / Pelican Finance 2 6.264% 25/1/2035	872,658	0.05
EUR 710,133	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Ulisses Finance No. 2 5.233% 23/9/2038	709,645	0.04
EUR 1,335,571	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 3.129% 28/10/2040	1,411,136	0.09
EUR 178,076	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 3.379% 28/10/2040	184,174	0.01
EUR 623,267	TAGUS - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA/Viriato Finance No 1 3.979% 28/10/2040	631,834	0.04
		4,013,257	0.24
ルーマニア			
EUR 161,000	Romanian Government International Bond 2.124% 16/7/2031	123,215	0.01
EUR 69,000	Romanian Government International Bond 2.5% 8/2/2030	58,212	0.00
EUR 66,000	Romanian Government International Bond 2.875% 11/3/2029	59,638	0.00
USD 254,000	Romanian Government International Bond 5.25% 25/11/2027	246,539	0.02
		487,604	0.03
サウジアラビア			
USD 865,000	Saudi Arabian Oil 2.875% 16/4/2024	841,213	0.05
USD 200,000	Saudi Government International Bond 5.5% 25/10/2032	208,500	0.01
		1,049,713	0.06
南アフリカ			
USD 200,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.3% 12/10/2028	178,000	0.01
USD 213,000	Republic of South Africa Government International Bond 4.85% 30/9/2029	188,239	0.01
		366,239	0.02
スペイン			
EUR 777,228	Autonomia Spain 2021 FT 3.053% 31/1/2039	828,821	0.05
EUR 643,407	Autonomia Spain 2021 FT 3.203% 31/1/2039	676,388	0.04
EUR 160,852	Autonomia Spain 2021 FT 3.953% 31/1/2039	164,445	0.01
EUR 386,052	Autonomia Spain 2021 FT 5.053% 31/1/2039	392,311	0.02
EUR 160,852	Autonomia Spain 2021 FT 6.303% 31/1/2039	161,858	0.01
EUR 500,000	Banco de Sabadell 0.625% 7/11/2025	501,263	0.03
EUR 200,000	Banco de Sabadell 1.125% 11/3/2027	192,637	0.01
USD 800,000	Banco Santander 2.746% 28/5/2025	749,600	0.05
USD 200,000	Banco Santander 5.147% 18/8/2025	197,542	0.01
EUR 500,000	Cellnex Finance 2.25% 12/4/2026	491,687	0.03
EUR 334,521	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 2.747% 21/3/2033	356,371	0.02
EUR 286,732	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 2.997% 21/3/2033	298,542	0.02
EUR 238,943	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.5% 21/3/2033	238,836	0.02
EUR 143,366	FT Santander Consumer Spain Auto 2020-1 3.997% 21/3/2033	147,539	0.01
		5,397,840	0.33
スウェーデン			
USD 1,600,000	Svenska Handelsbanken 1.418% 11/6/2027	1,405,650	0.08
USD 1,975,000	Swedbank 5.337% 20/9/2027	1,948,016	0.12
		3,353,666	0.20

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
スイス			
EUR 715,000	UBS 0.25% 29/1/2026	705,979	0.04
EUR 875,000	UBS 0.75% 21/4/2023	929,867	0.06
USD 3,220,000	UBS 1.494% 10/8/2027*	2,785,803	0.17
		4,421,649	0.27
英国			
USD 200,000	Antofagasta 2.375% 14/10/2030	158,606	0.01
USD 104,000	AstraZeneca 0.7% 8/4/2026	91,127	0.01
GBP497,698	Atlas Funding 2021-1 4.762% 25/7/2058	604,153	0.04
GBP100,000	Atlas Funding 2021-1 5.362% 25/7/2058	120,910	0.01
GBP100,000	Atlas Funding 2021-1 5.562% 25/7/2058	120,454	0.01
GBP100,000	Atlas Funding 2021-1 6.112% 25/7/2058	120,386	0.01
GBP1,699,000	Azure Finance NO 2 6.933% 20/7/2030	2,073,450	0.12
USD 235,000	Barclays 3.932% 7/5/2025	228,749	0.01
USD 899,000	Barclays 4.375% 12/1/2026	868,403	0.05
USD 2,135,000	Barclays 5.501% 9/8/2028	2,086,281	0.12
GBP202,000	Barley Hill NO 2 5.333% 27/8/2058	238,238	0.01
GBP115,000	Barley Hill NO 2 5.633% 27/8/2058	133,094	0.01
EUR 545,000	BAT International Finance 0.875% 13/10/2023*	568,847	0.03
USD 125,000	BP Capital Markets 3.279% 19/9/2027	116,321	0.01
GBP730,360	Brants Bridge 2022-1 4.814% 12/12/2064	884,286	0.05
GBP1,418,286	Brass No 10 4.143% 16/4/2069	1,716,860	0.10
GBP348,000	Canada Square Funding 2021-2 4.83% 17/6/2058	406,406	0.02
GBP102,000	Canada Square Funding 2021-2 5.23% 17/6/2058	119,037	0.01
GBP1,238,565	Canada Square Funding 6 4.667% 17/1/2059	1,492,593	0.09
GBP431,000	Canada Square Funding 6 5.117% 17/1/2059	500,720	0.03
GBP318,000	Canada Square Funding 6 5.267% 17/1/2059	365,754	0.02
GBP178,000	Canada Square Funding 6 5.667% 17/1/2059	198,983	0.01
GBP388,991	CMF 2020-1 4.533% 16/1/2057	472,333	0.03
GBP220,000	CMF 2020-1 4.933% 16/1/2057	265,097	0.02
GBP105,000	CMF 2020-1 5.183% 16/1/2057	125,569	0.01
GBP340,563	Dowson 2021-2 4.613% 20/10/2028	413,448	0.03
GBP700,000	Dowson 2021-2 5.133% 20/10/2028	846,515	0.05
GBP800,000	Dowson 2021-2 5.533% 20/10/2028	953,931	0.06
GBP331,000	Dowson 2022-1 5.683% 20/1/2029	401,987	0.02
GBP172,000	Dowson 2022-1 6.183% 20/1/2029	204,469	0.01
GBP100,000	Dowson 2022-1 6.633% 20/1/2029	116,613	0.01
GBP577,000	Economic Master Issuer 4.233% 25/6/2073	696,164	0.04
GBP144,500	Economic Master Issuer 2020-1 4.403% 25/6/2072	175,611	0.01
USD 200,000	eG Global Finance 6.75% 7/2/2025	178,740	0.01
GBP410,426	Elvet Mortgages 2020-1 4.521% 22/3/2065	501,392	0.03
GBP711,797	Elvet Mortgages 2021-1 4.222% 22/10/2063	861,146	0.05
GBP856,269	Finsbury Square 4.254% 16/12/2067	1,030,182	0.06
GBP828,000	Finsbury Square 4.604% 16/12/2067	978,548	0.06
GBP1,045,000	Finsbury Square 4.854% 16/12/2067	1,213,337	0.07
GBP241,335	Finsbury Square 2020-1 4.404% 16/3/2070	292,976	0.02
GBP224,959	Finsbury Square 2020-1 4.954% 16/3/2070	272,235	0.02
GBP139,889	Finsbury Square 2020-2 4.904% 16/6/2070	170,075	0.01
GBP1,501,217	Finsbury Square 2021-2 4.404% 16/12/2071	1,803,701	0.11
GBP730,000	Finsbury Square 2021-2 4.854% 16/12/2071	865,943	0.05
GBP371,000	Finsbury Square 2021-2 5.004% 16/12/2071	427,614	0.03
GBP201,000	Finsbury Square 2021-2 5.304% 16/12/2071	223,943	0.01
GBP580,000	Funding V 4.683% 15/10/2025	703,780	0.04
GBP424,000	Funding V 5.133% 15/10/2025	510,036	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)		
GBP115,000	Funding V 5.633% 15/10/2025	136,807	0.01
GBP210,000	Funding VI 7.033% 15/7/2026	258,348	0.02
GBP951,478	Gemgarto 2021-1 4.194% 16/12/2067	1,147,479	0.07
GBP668,000	Gemgarto 2021-1 4.704% 16/12/2067	800,415	0.05
GBP218,000	Gemgarto 2021-1 4.904% 16/12/2067	256,536	0.01
GBP319,196	Gemgarto 2021-1 8.604% 16/12/2067	387,450	0.02
GBP1,309,000	Harben Finance 4.605% 28/9/2055	1,510,260	0.09
GBP730,000	Harben Finance 4.855% 28/9/2055	836,611	0.05
GBP441,000	Harben Finance 5.205% 28/9/2055	479,334	0.03
GBP573,572	Hops Hill No 1 4.883% 27/5/2054	695,041	0.04
GBP124,993	Hops Hill No 1 5.533% 27/5/2054	150,796	0.01
GBP199,992	Hops Hill No 1 5.783% 27/5/2054	239,117	0.01
GBP99,998	Hops Hill No 1 6.283% 27/5/2054	118,492	0.01
USD 788,000	HSBC 2.251% 22/11/2027	691,668	0.04
USD 200,000	HSBC 2.999% 10/3/2026	189,080	0.01
USD 1,091,000	HSBC 4.041% 13/3/2028	1,018,882	0.06
USD 256,000	HSBC 4.583% 19/6/2029	240,093	0.01
USD 264,000	HSBC 5.21% 11/8/2028	257,822	0.02
USD 1,471,000	HSBC 7.39% 3/11/2028	1,554,571	0.10
EUR 709,000	Informa 1.5% 5/7/2023	748,699	0.04
EUR 2,255,000	Informa 2.125% 6/10/2025	2,277,091	0.14
GBP2,119,005	Jupiter Mortgage NO 1 4.634% 20/7/2060	2,561,971	0.15
GBP201,000	Lanark Master Issuer 4.515% 22/12/2069	244,607	0.01
GBP1,246,866	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 4.664% 12/6/2057	1,514,902	0.09
GBP630,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 5.414% 12/6/2057	759,566	0.04
GBP370,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2020-1 5.814% 12/6/2057	444,003	0.03
GBP483,186	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 4.484% 20/7/2058	581,737	0.03
GBP266,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 4.784% 20/7/2058	313,953	0.02
GBP159,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5.084% 20/7/2058	182,684	0.01
GBP103,000	Lanebrook Mortgage Transaction 2021-1 5.484% 20/7/2058	116,992	0.01
USD 1,600,000	Lloyds Banking 5.871% 6/3/2029	1,597,604	0.10
GBP355,669	London Wall Mortgage Capital 4.695% 15/5/2051	426,373	0.02
GBP420,193	London Wall Mortgage Capital 4.745% 15/5/2052	506,145	0.03
USD 2,935,000	LSEGA Financing 1.375% 6/4/2026	2,577,384	0.15
GBP305,000	Mortimer BTL 2021-1 4.76% 23/6/2053	359,161	0.02
GBP108,000	Mortimer BTL 2021-1 5.11% 23/6/2053	125,778	0.01
EUR 600,000	National Grid Electricity Transmission 0.19% 20/1/2025	595,235	0.04
USD 1,780,000	NatWest 2.359% 22/5/2024	1,764,780	0.11
EUR 900,000	NatWest Markets 0.125% 18/6/2026	836,514	0.05
USD 290,000	NatWest Markets 1.6% 29/9/2026	251,372	0.01
GBP954,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 4.903% 15/3/2029	1,151,904	0.07
GBP775,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-1 5.483% 15/3/2029	928,984	0.06
GBP735,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 4.833% 15/11/2029	882,406	0.05
GBP404,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2021-3 5.283% 15/11/2029	480,295	0.03
GBP1,156,000	Newday Funding Master Issuer - Series 2022-1 5.233% 15/4/2030	1,392,884	0.08
GBP1,569,006	Oat Hill NO 2 4.783% 27/5/2046	1,900,419	0.11
GBP27,287	Orbita Funding 2020-1 4.513% 17/3/2027	33,170	0.00
GBP911,343	Pierpont BTL 2021-1 4.46% 22/12/2053	1,081,468	0.06
GBP1,355,000	Pierpont BTL 2021-1 4.91% 22/12/2053	1,569,254	0.09
GBP1,260,000	Polaris 2022-1 5.283% 23/10/2059	1,486,610	0.09
GBP421,000	Polaris 2022-1 5.433% 23/10/2059	484,395	0.03
GBP307,000	Polaris 2022-1 5.933% 23/10/2059	348,739	0.02
GBP538,000	Polaris 2022-1 7.333% 23/10/2059	617,946	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 (%)
	英国(続き)		
GBP1,755,334	Precise Mortgage Funding 2019-1B 4.764% 12/12/2055	2,133,677	0.13
GBP115,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 5.383% 16/10/2056	138,282	0.01
GBP100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 5.633% 16/10/2056	118,729	0.01
GBP100,000	Precise Mortgage Funding 2020-1B 5.883% 16/10/2056	118,131	0.01
GBP693,844	Residential Mortgage 32 4.899% 20/6/2070	844,168	0.05
GBP525,000	Residential Mortgage 32 5.849% 20/6/2070	632,233	0.04
GBP312,654	RMAC No 1 3.833% 12/6/2044	360,317	0.02
USD 322,000	Rolls-Royce 5.75% 15/10/2027	309,567	0.02
GBP905,000	Sage AR Funding No 1 5.195% 17/11/2030	1,065,622	0.06
GBP385,000	Sage AR Funding No 1 5.895% 17/11/2030	449,826	0.03
GBP535,000	Sage AR Funding No 1 6.095% 17/11/2030	605,935	0.04
GBP307,430	Satus 2021-1 4.633% 17/8/2028	373,156	0.02
GBP605,000	Satus 2021-1 5.133% 17/8/2028	730,370	0.04
GBP743,000	Satus 2021-1 5.533% 17/8/2028	883,032	0.05
GBP122,000	Satus 2021-1 5.833% 17/8/2028	142,236	0.01
GBP247,000	Satus 2021-1 7.133% 17/8/2028	283,865	0.02
GBP5,884,114	Silk Road Finance Number Six 4.51% 21/9/2067	7,154,589	0.43
GBP916,000	Silverstone Master Issuer 4.138% 21/1/2070	1,105,310	0.07
GBP1,047,000	Silverstone Master Issuer 4.318% 21/1/2070	1,271,515	0.08
GBP120,000	Stanlington No 2 5.314% 12/6/2045	137,486	0.01
GBP110,000	Stanlington No 2 5.764% 12/6/2045	126,058	0.01
GBP303,000	Stanlington No 2 6.864% 12/6/2045	337,375	0.02
GBP399,444	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 4.489% 12/7/2063	481,528	0.03
GBP156,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 4.739% 12/7/2063	184,350	0.01
GBP107,000	Together Asset Backed Securitisation 2021-1st1 5.039% 12/7/2063	123,809	0.01
GBP494,361	Tower Bridge Funding 2020-1 5.019% 20/9/2063	602,959	0.04
GBP1,060,000	Tower Bridge Funding 2020-1 5.749% 20/9/2063	1,291,806	0.08
GBP145,000	Tower Bridge Funding 2020-1 6.099% 20/9/2063	175,971	0.01
GBP115,000	Tower Bridge Funding 2020-1 7.099% 20/9/2063	141,005	0.01
GBP1,479,347	Tower Bridge Funding 2021-1 4.748% 21/7/2064	1,794,368	0.11
GBP381,999	Tower Bridge Funding 2021-1 5.348% 21/7/2064	461,414	0.03
GBP364,999	Tower Bridge Funding 2021-1 5.698% 21/7/2064	439,677	0.03
GBP253,000	Tower Bridge Funding 2021-1 5.998% 21/7/2064	302,318	0.02
GBP252,999	Tower Bridge Funding 2021-2 5.046% 20/11/2063	301,521	0.02
GBP139,999	Tower Bridge Funding 2021-2 5.446% 20/11/2063	165,161	0.01
GBP169,999	Tower Bridge Funding 2021-2 5.746% 20/11/2063	192,133	0.01
GBP698,954	Tower Bridge Funding 2022-1 4.369% 20/12/2063	841,404	0.05
GBP293,000	Tower Bridge Funding 2022-1 4.649% 20/12/2063	344,024	0.02
GBP264,000	Tower Bridge Funding 2022-1 4.899% 20/12/2063	302,643	0.02
GBP408,718	Turbo Finance 9 4.763% 20/8/2028	497,368	0.03
GBP1,590,000	Turbo Finance 9 5.583% 20/8/2028	1,930,675	0.12
GBP608,453	Twin Bridges 2020-1 4.814% 12/12/2054	742,327	0.04
GBP1,145,000	Twin Bridges 2020-1 5.564% 12/12/2054	1,395,753	0.08
GBP390,000	Twin Bridges 2020-1 5.814% 12/12/2054	471,125	0.03
GBP225,000	Twin Bridges 2020-1 6.564% 12/12/2054	271,598	0.02
GBP2,476,923	Twin Bridges 2021-1 4.414% 12/3/2055	2,990,479	0.18
GBP436,000	Twin Bridges 2021-1 5.164% 12/3/2055	510,493	0.03
GBP220,000	Twin Bridges 2021-1 5.664% 12/3/2055	253,808	0.01
GBP1,054,597	Twin Bridges 2021-2 4.224% 12/9/2055	1,263,307	0.08
GBP443,000	Twin Bridges 2021-2 4.464% 12/9/2055	519,501	0.03
GBP338,000	Twin Bridges 2021-2 4.714% 12/9/2055	388,183	0.02
GBP188,000	Twin Bridges 2021-2 5.064% 12/9/2055	204,707	0.01
GBP90,135	Twin Bridges 2021-2 6.464% 12/9/2055	108,794	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)			
GBP1,454,380	Twin Bridges 2022-1 4.334% 1/12/2055	1,741,043	0.10
GBP891,000	Twin Bridges 2022-1 4.564% 1/12/2055	1,034,806	0.06
GBP723,000	Twin Bridges 2022-1 4.864% 1/12/2055	818,584	0.05
GBP365,000	Twin Bridges 2022-1 5.264% 1/12/2055	410,951	0.02
GBP478,656	Unique Pub Finance 7.395% 28/3/2024	589,042	0.04
EUR 530,000	Virgin Money UK 0.375% 27/5/2024	558,036	0.03
EUR 314,000	WPP Finance 2013 3% 20/11/2023	332,447	0.02
		114,533,467	6.87
米国			
USD 5,673,000	1211 Avenue of the Americas Trust 2015-1211 3.901% 10/8/2035	5,336,615	0.32
USD 2,145,000	225 Liberty Street Trust 2016-225L 3.597% 10/2/2036	1,967,784	0.12
USD 5,662,000	7-Eleven 0.8% 10/2/2024	5,410,028	0.33
USD 1,165,000	7-Eleven 0.95% 10/2/2026	1,026,962	0.06
EUR 320,000	AbbVie 1.25% 1/6/2024	329,166	0.02
EUR 1,305,000	AbbVie 1.5% 15/11/2023	1,367,535	0.08
USD 704,000	AbbVie 2.95% 21/11/2026	648,508	0.04
USD 1,521,000	AbbVie 3.2% 14/5/2026	1,427,594	0.09
USD 5,000	Acadia Healthcare 5% 15/4/2029	4,535	0.00
USD 200,000	Acuris Finance US / Acuris Finance 5% 1/5/2028	159,638	0.01
USD 117,000	AdaptHealth 6.125% 1/8/2028	109,722	0.01
USD 49,000	ADT Security 4.125% 15/6/2023	48,743	0.00
USD 112,000	Advanced Drainage Systems 5% 30/9/2027	104,082	0.01
USD 129,000	Aethon United BR / Aethon United Finance 8.25% 15/2/2026	123,683	0.01
USD 1,185,000	Air Lease 1.875% 15/8/2026	1,033,773	0.06
USD 53,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 3.5% 15/3/2029	44,805	0.00
USD 30,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 4.625% 15/1/2027	28,230	0.00
USD 68,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 5.875% 15/2/2028	65,889	0.00
USD 15,000	Albertsons / Safeway / New Albertsons / Albertsons 6.5% 15/2/2028	14,904	0.00
USD 1,905,000	Alexander Funding Trust 1.841% 15/11/2023	1,840,941	0.11
USD 22,000	Alliant Travel 7.25% 15/8/2027	21,583	0.00
USD 262,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 4.25% 15/10/2027	231,499	0.01
USD 68,000	Alliant Intermediate / Alliant Co-Issuer 6.75% 15/4/2028	66,538	0.00
USD 204,000	Allied Universal Holdco / Allied Universal Finance 6.625% 15/7/2026	193,515	0.01
USD 47,000	AMC Networks 4.75% 1/8/2025	44,159	0.00
USD 209,000	American Airlines 11.75% 15/7/2025	228,837	0.01
USD 46,357	American Airlines Aadvantage Loyalty IP 5.5% 20/4/2026	45,176	0.00
USD 3,914,000	American Express 2.55% 4/3/2027	3,538,772	0.21
EUR 700,000	American International 1.875% 21/6/2027	675,160	0.04
EUR 1,400,000	American Tower 0.4% 15/2/2027	1,271,237	0.08
EUR 1,050,000	American Tower 0.45% 15/1/2027	957,689	0.06
USD 304,000	American Tower 1.3% 15/9/2025	273,237	0.02
USD 500,000	American Tower 1.45% 15/9/2026	435,108	0.03
USD 1,053,000	American Tower 1.6% 15/4/2026	936,190	0.06
USD 122,000	American Tower 3.65% 15/3/2027	113,721	0.01
USD 649,000	American Tower 4.4% 15/2/2026	629,744	0.04
USD 162,000	Amgen 2.2% 21/2/2027	145,037	0.01
USD 5,045,000	Amgen 5.15% 2/3/2028	5,016,746	0.30
USD 42,000	AmWINS 4.875% 30/6/2029	35,737	0.00
USD 24,000	ANGI 3.875% 15/8/2028	18,059	0.00
USD 3,306,000	Anheuser-Busch InBev Worldwide 4% 13/4/2028	3,150,184	0.19
USD 173,000	Antero Midstream Partners / Antero Midstream Finance 7.875% 15/5/2026	174,998	0.01
USD 79,000	Antero Resources 7.625% 1/2/2029	79,800	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 2,041,000	Aon / Aon Global 2.85% 28/5/2027	1,853,019	0.11
USD 44,000	APX 6.75% 15/2/2027	42,297	0.00
USD 39,000	Aramark Services 5% 1/4/2025	37,869	0.00
USD 46,000	Aramark Services 5% 1/2/2028	42,457	0.00
USD 55,000	Aramark Services 6.375% 1/5/2025	54,761	0.00
USD 123,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.25% 1/4/2028	116,065	0.01
USD 59,000	Archrock Partners / Archrock Partners Finance 6.875% 1/4/2027	57,213	0.00
USD 108,000	Arconic 6.125% 15/2/2028	101,808	0.01
USD 58,000	Arcosa 4.375% 15/4/2029	50,724	0.00
USD 200,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA / Ardagh Metal Packaging Finance 6% 15/6/2027	192,846	0.01
USD 80,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 5.875% 30/6/2029	69,283	0.00
USD 5,000	Ascent Resources Utica / ARU Finance 9% 1/11/2027	6,108	0.00
USD 100,000	Astrazeneca Finance 1.2% 28/5/2026	88,628	0.01
EUR 845,000	AT&T 1.05% 5/9/2023	887,672	0.05
USD 3,399,000	AT&T 1.7% 25/3/2026	3,053,477	0.18
USD 43,000	ATI 5.875% 1/12/2027	41,000	0.00
USD 149,000	Avantor Funding 4.625% 15/7/2028	137,236	0.01
USD 1,380,000	Aviation Capital 1.95% 30/1/2026	1,217,870	0.07
USD 1,665,000	Aviation Capital 1.95% 20/9/2026	1,430,235	0.09
USD 299,000	Axalta Coating Systems 3.375% 15/2/2029	248,646	0.02
USD 3,054,000	Ball 5.25% 1/7/2025	3,000,073	0.18
USD 10,963	Banc of America Mortgage 2003-J Trust 3.794% 25/11/2033	9,757	0.00
USD 1,446,000	Bank of America 0.523% 14/6/2024	1,422,798	0.09
USD 4,950,000	Bank of America 1.197% 24/10/2026	4,409,735	0.27
USD 2,694,000	Bank of America 1.319% 19/6/2026	2,444,026	0.15
USD 3,067,000	Bank of America 1.53% 6/12/2025	2,849,059	0.17
USD 4,365,000	Bank of America 1.843% 4/2/2025	4,208,525	0.25
USD 1,575,000	Bank of America 2.015% 13/2/2026	1,465,954	0.09
USD 365,000	Bank of America 2.456% 22/10/2025	346,237	0.02
USD 600,000	Bank of America 4.376% 27/4/2028	572,040	0.03
USD 2,588,000	Bank of America 6.204% 10/11/2028	2,657,166	0.16
USD 9,472,000	BAT Capital 3.222% 15/8/2024	9,132,163	0.55
USD 9,000	Beacon Roofing Supply 4.125% 15/5/2029	7,709	0.00
EUR 510,000	Becton Dickinson 0.034% 13/8/2025	492,426	0.03
EUR 310,000	Becton Dickinson 1.401% 24/5/2023	328,472	0.02
USD 136,000	Big River Steel / BRS Finance 6.625% 31/1/2029	132,652	0.01
USD 74,000	Black Knight InfoServ 3.625% 1/9/2028	64,657	0.00
USD 157,000	Block 2.75% 1/6/2026	140,110	0.01
USD 620,000	Boeing 2.196% 4/2/2026	562,469	0.03
USD 990,000	Boeing 3.1% 1/5/2026	921,478	0.06
EUR 840,000	Booking 0.1% 8/3/2025	827,960	0.05
USD 81,000	Booz Allen Hamilton 3.875% 1/9/2028	71,904	0.01
USD 101,000	Boston Properties 6.75% 1/12/2027	104,805	0.01
USD 212,000	Boxer Parent 7.125% 2/10/2025	210,083	0.01
USD 45,000	Boyer USA 4.75% 15/5/2029	40,081	0.00
USD 139,000	BP Capital Markets America 3.017% 16/1/2027	129,047	0.01
USD 187,000	Broadcom 1.95% 15/2/2028	158,126	0.01
USD 1,885,000	Broadcom 3.15% 15/11/2025	1,774,359	0.11
USD 174,000	Broadcom 3.459% 15/9/2026	162,461	0.01
USD 103,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.5% 15/1/2028	93,956	0.01
USD 2,596,000	Broadcom / Broadcom Cayman Finance 3.875% 15/1/2027	2,445,978	0.15
USD 46,000	Brookfield Property REIT / BPR Cumulus / BPR Nimbus / GGSJ Sellco 4.5% 1/4/2027	39,267	0.00
USD 15,000	Buckeye Partners 4.125% 1/3/2025	14,077	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 70,000	Buckeye Partners 4.5% 1/3/2028	61,485	0.00
USD 82,000	BWX Technologies 4.125% 30/6/2028	73,512	0.01
USD 1,130,000	BX Trust 2018-BILT 6.358% 15/5/2030	1,106,163	0.07
USD 230,000	Caesars Entertainment 6.25% 1/7/2025	228,459	0.01
USD 125,000	Caesars Entertainment 7% 15/2/2030	126,203	0.01
USD 53,000	Caesars Resort Collection / CRC Finco 5.75% 1/7/2025	52,968	0.00
USD 28,000	Callon Petroleum 6.375% 1/7/2026	26,645	0.00
USD 87,000	Callon Petroleum 8% 1/8/2028	84,906	0.01
USD 85,000	Calpine 4.625% 1/2/2029	71,849	0.01
USD 73,000	Calpine 5.25% 1/6/2026	69,988	0.00
USD 34,000	Camelot Return Merger Sub 8.75% 1/8/2028	32,338	0.00
USD 163,000	Capital One Financial 4.927% 10/5/2028	157,514	0.01
USD 3,000,000	Capital One Financial 5.054% 6/12/2024	2,978,025	0.18
USD 167,000	Carnival Bermuda 10.375% 1/5/2028	178,586	0.01
USD 7,000	Carpenter Technology 6.375% 15/7/2028	6,714	0.00
USD 79,000	Catalent Pharma Solutions 3.125% 15/2/2029	68,408	0.00
USD 298,000	CCO / CCO Capital 5.125% 1/5/2027	276,276	0.02
USD 150,000	CCO / CCO Capital 5.375% 1/6/2029	133,874	0.01
USD 90,000	CCO / CCO Capital 6.375% 1/9/2029	84,094	0.01
USD 2,147,356	CD 2016-CD1 Mortgage Trust 2.622% 10/8/2049	2,034,381	0.12
USD 30,000	CD&R Smokey Buyer 6.75% 15/7/2025	26,250	0.00
USD 39,000	Cedar Fair / Canada's Wonderland / Magnum Management / Millennium Op 5.5% 1/5/2025	38,560	0.00
USD 262,000	Centene 2.45% 15/7/2028	219,977	0.01
USD 85,000	Centennial Resource Production 6.875% 1/4/2027	82,010	0.01
USD 60,000	Central Garden & Pet 5.125% 1/2/2028	55,857	0.00
USD 70,000	Central Parent / CDK Global 7.25% 15/6/2029	68,406	0.00
USD 3,180,000	CFCRE Commercial Mortgage Trust 2016-C6 3.217% 10/11/2049	2,933,895	0.18
USD 33,000	Charles River Laboratories International 4.25% 1/5/2028	29,803	0.00
USD 1,450,000	Charles Schwab 2.45% 3/3/2027	1,313,726	0.08
USD 628,000	Charles Schwab 3.2% 2/3/2027	586,281	0.04
USD 358,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 3.75% 15/2/2028	322,629	0.02
USD 1,421,000	Charter Communications Operating / Charter Communications Operating Capital 4.2% 15/3/2028	1,303,348	0.08
USD 196,000	Cheniere Energy Partners 4.5% 1/10/2029	177,058	0.01
USD 105,000	Chesapeake Energy 6.75% 15/4/2029	101,719	0.01
USD 121,404	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-HYB8 3.624% 20/12/2035	110,043	0.01
USD 98,000	Chobani / Chobani Finance 4.625% 15/11/2028	85,593	0.01
USD 12,000	CHS/Community Health Systems 5.625% 15/3/2027	10,560	0.00
USD 35,000	CHS/Community Health Systems 6% 15/1/2029	30,374	0.00
EUR 340,000	Chubb INA 0.3% 15/12/2024	337,485	0.02
USD 51,000	Churchill Downs 4.75% 15/1/2028	46,468	0.00
USD 124,000	Churchill Downs 5.5% 1/4/2027	117,920	0.01
USD 81,000	Cigna 4.125% 15/11/2025	78,748	0.01
USD 67,000	CITGO Petroleum 7% 15/6/2025	66,069	0.00
USD 1,340,000	Citigroup 0.981% 1/5/2025	1,264,382	0.08
USD 6,254,000	Citigroup 1.462% 9/6/2027	5,467,266	0.33
USD 566,000	Citigroup 2.014% 25/1/2026	528,066	0.03
USD 1,792,000	Citigroup 4.14% 24/5/2025	1,758,946	0.11
USD 446,000	Citigroup 5.61% 29/9/2026	446,086	0.03
USD 2,735,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P 3.251% 10/5/2035	2,608,506	0.16
USD 557,399	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC19 3.552% 11/3/2047	551,991	0.03
USD 3,380,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC21 3.855% 10/5/2047	3,301,271	0.20
USD 4,800,000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 3.137% 10/2/2048	4,582,982	0.27
USD 5,519,653	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29 2.935% 10/4/2048	5,219,497	0.31

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 2,442,946	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P4 2.779% 10/7/2049	2,337,008	0.14
USD 187,000	Clarivate Science 3.875% 1/7/2028	161,436	0.01
USD 76,000	Clean Harbors 4.875% 15/7/2027	71,706	0.01
USD 297,000	Clear Channel Outdoor 5.125% 15/8/2027	263,978	0.02
USD 62,000	Clearway Energy Operating 4.75% 15/3/2028	56,943	0.00
USD 251,000	Cloud Software 6.5% 31/3/2029	218,396	0.01
USD 87,000	Clydesdale Acquisition 6.625% 15/4/2029	83,118	0.01
USD 11,000	CNX Resources 6% 15/1/2029	10,044	0.00
USD 166,000	Colgate Energy Partners III 7.75% 15/2/2026	164,520	0.01
USD 1,495,000	Comcast 2.35% 15/1/2027	1,353,083	0.08
USD 118,000	Comcast 3.15% 15/2/2028	108,249	0.01
USD 126,000	Comcast 3.3% 1/2/2027	118,162	0.01
USD 120,000	Comcast 3.3% 1/4/2027	112,389	0.01
USD 3,186,000	Comcast 3.55% 1/5/2028	2,961,387	0.18
USD 2,916,000	Comcast 4.15% 15/10/2028	2,782,844	0.17
USD 933,000	Comcast 5.35% 15/11/2027	944,717	0.06
USD 6,440,000	COMM 2013-CCRE10 Mortgage Trust 4.21% 10/8/2046	6,420,251	0.39
USD 800,000	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust 3.871% 10/6/2046	760,041	0.05
USD 2,269,207	COMM 2013-CCRE9 Mortgage Trust 4.267% 10/7/2045	2,264,446	0.14
USD 33,018	COMM 2013-SFS Mortgage Trust 1.873% 12/4/2035	32,856	0.00
USD 3,000,000	COMM 2014-277P Mortgage Trust 3.611% 10/8/2049	2,843,975	0.17
USD 4,250,000	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust 3.828% 15/7/2047	4,124,998	0.25
USD 4,934,137	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust 3.528% 10/12/2047	4,761,839	0.29
USD 5,000,000	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust 4.006% 10/4/2047	4,891,460	0.29
USD 567,849	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust 3.367% 10/6/2047	561,973	0.03
USD 710,415	COMM 2014-UBS5 Mortgage Trust 3.548% 10/9/2047	700,087	0.04
USD 560,000	COMM 2015-3BP Mortgage Trust 3.178% 10/2/2035	523,913	0.03
USD 7,942,654	COMM 2015-CCRE23 Mortgage Trust 0.862% 10/5/2048	113,788	0.01
USD 1,166,732	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust 3.445% 10/8/2048	1,139,038	0.07
USD 4,470,674	COMM 2015-LC21 Mortgage Trust 3.445% 10/7/2048	4,251,503	0.26
USD 80,000	CommScope 6% 1/3/2026	77,185	0.00
USD 29,000	CommScope Technologies 6% 15/6/2025	27,869	0.00
USD 113,000	Comstock Resources 6.75% 1/3/2029	104,171	0.01
USD 242,000	Connect Finco / Connect US Finco 6.75% 1/10/2026	225,399	0.01
USD 27,000	Consensus Cloud Solutions 6.5% 15/10/2028	23,532	0.00
USD 59,000	Consolidated Communications 6.5% 1/10/2028	46,167	0.00
USD 51,000	CoreLogic 4.5% 1/5/2028	38,755	0.00
USD 4,000	Coty /HFC Prestige Products /HFC Prestige International US 4.75% 15/1/2029	3,608	0.00
USD 165,000	Crescent Energy Finance 7.25% 1/5/2026	154,089	0.01
USD 31,000	Crescent Energy Finance 9.25% 15/2/2028	30,129	0.00
USD 23,000	Crestwood Midstream Partners / Crestwood Midstream Finance 6% 1/2/2029	21,014	0.00
USD 47,000	Crocs 4.25% 15/3/2029	40,349	0.00
USD 89,000	CrowdStrike 3% 15/2/2029	74,769	0.01
USD 82,000	Crown Americas / Crown Americas Capital VI 4.75% 1/2/2026	78,741	0.01
USD 887,000	Crown Castle 4.45% 15/2/2026	861,223	0.05
USD 1,420,000	Crown Castle International 1.05% 15/7/2026	1,228,578	0.07
USD 8,000	CrownRock / CrownRock Finance 5% 1/5/2029	7,187	0.00
USD 203,000	CrownRock / CrownRock Finance 5.625% 15/10/2025	196,076	0.01
USD 1,645,000	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust 3.505% 15/4/2050	1,570,577	0.09
USD 70,000	CSC 5.25% 1/6/2024	68,155	0.00
USD 200,000	CSC 5.375% 1/2/2028	166,000	0.01
USD 149,000	Cushman & Wakefield US Borrower 6.75% 15/5/2028	139,719	0.01
USD 2,367,000	CVS Health 4.3% 25/3/2028	2,258,531	0.14

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 (%)
米国(続き)			
EUR 375,000	Danaher 1.7% 30/3/2024	391,040	0.02
USD 64,000	Darling Ingredients 5.25% 15/4/2027	61,672	0.00
USD 2,238,719	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust 5.391% 15/5/2035	2,223,417	0.13
USD 1,500,000	DBJPM 2016-C3 Mortgage Trust 2.632% 10/8/2049	1,375,380	0.08
USD 2,076,000	DBWF 2018-GLKS Mortgage Trust 5.728% 19/12/2030	2,054,774	0.12
USD 1,810,000	Dell International / EMC 4% 15/7/2024	1,773,162	0.11
EUR 1,000,000	Digital Euro Finco 2.5% 16/1/2026	996,429	0.06
USD 69,000	Directv Financing / Directv Financing Co-Obligor 5.875% 15/8/2027	61,857	0.00
USD 187,000	DISH DBS 5.25% 1/12/2026	156,130	0.01
USD 62,000	DISH Network 11.75% 15/11/2027	62,860	0.00
USD 694,000	DR Horton 1.3% 15/10/2026	597,987	0.04
USD 126,000	DR Horton 1.4% 15/10/2027	105,133	0.01
USD 94,000	DT Midstream 4.125% 15/6/2029	80,712	0.01
USD 1,282,000	Duke Energy 5% 8/12/2025	1,274,078	0.08
USD 13,000	Dycom Industries 4.5% 15/4/2029	11,301	0.00
USD 39,000	Earthstone Energy 8% 15/4/2027	37,385	0.00
USD 3,605,000	Edison International 4.7% 15/8/2025	3,512,262	0.21
USD 203,000	Element Solutions 3.875% 1/9/2028	175,325	0.01
USD 3,850,000	Elevance Health 3.65% 1/12/2027	3,608,753	0.22
USD 661,000	Elevance Health 5.35% 15/10/2025	661,500	0.04
USD 75,000	Enact 6.5% 15/8/2025	73,581	0.00
USD 850,000	Energy Transfer 2.9% 15/5/2025	802,595	0.05
USD 438,000	Energy Transfer 4.5% 15/4/2024	432,202	0.03
USD 4,400,000	Energy Transfer 5.875% 15/1/2024	4,406,609	0.26
USD 62,000	EnLink Midstream 5.375% 1/6/2029	57,869	0.00
USD 35,000	EnLink Midstream 5.625% 15/1/2028	33,373	0.00
USD 118,000	EnLink Midstream Partners 4.85% 15/7/2026	111,992	0.01
USD 75,000	EnPro Industries 5.75% 15/10/2026	71,652	0.00
USD 21,000	Entegris 3.625% 1/5/2029	17,257	0.00
USD 154,000	Entegris Escrow 4.75% 15/4/2029	139,754	0.01
USD 136,000	Enterprise Products Operating 5.05% 10/1/2026	135,627	0.01
USD 47,000	EQM Midstream Partners 6% 1/7/2025	45,409	0.00
USD 116,000	EQM Midstream Partners 6.5% 1/7/2027	109,512	0.01
USD 543,000	Equinix 1.25% 15/7/2025	491,493	0.03
USD 2,633,000	Equinix 1.45% 15/5/2026	2,321,407	0.14
USD 1,063,000	Equinix 1.55% 15/3/2028	882,752	0.05
USD 800,000	Equinix 1.8% 15/7/2027	685,605	0.04
USD 275,000	Equinix 2.9% 18/11/2026	250,683	0.02
USD 2,340,000	Eversource Energy 2.9% 1/3/2027	2,139,186	0.13
USD 276,000	Eversource Energy 4.6% 1/7/2027	269,172	0.02
USD 740,000	Exelon 2.75% 15/3/2027	672,126	0.04
USD 1,710,000	Exelon 5.15% 15/3/2028	1,692,511	0.10
USD 31,000	Fair Isaac 4% 15/6/2028	27,987	0.00
USD 4,199,786	Fannie Mae Pool 2.5% 1/6/2035	3,832,794	0.23
USD 17,811	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2027	17,142	0.00
USD 26,883	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2028	25,605	0.00
USD 322,295	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2030	303,810	0.02
USD 125,367	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2030	118,042	0.01
USD 32,942	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2030	31,060	0.00
USD 19,649	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	18,528	0.00
USD 11,266	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2030	10,625	0.00
USD 41,092	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	38,741	0.00
USD 334,320	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	315,236	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 47,757	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	45,026	0.00
USD 11,521	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2030	10,861	0.00
USD 8,877	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2030	8,348	0.00
USD 227,326	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	214,325	0.01
USD 364,896	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2030	344,004	0.02
USD 39,763	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	37,496	0.00
USD 13,995	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2031	13,192	0.00
USD 25,658	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	24,194	0.00
USD 244,783	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2031	230,790	0.01
USD 271,415	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	255,748	0.02
USD 20,781	Fannie Mae Pool 3% 1/4/2031	19,550	0.00
USD 36,575	Fannie Mae Pool 3% 1/5/2031	34,489	0.00
USD 33,666	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	31,735	0.00
USD 50,993	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2031	48,076	0.00
USD 252,780	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	239,099	0.01
USD 12,618	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2031	11,894	0.00
USD 29,054	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2031	27,393	0.00
USD 424,386	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2031	399,518	0.02
USD 286,870	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2031	268,952	0.02
USD 79,670	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2031	75,112	0.00
USD 35,372	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	33,349	0.00
USD 241,248	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2032	227,123	0.01
USD 100,733	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2032	94,431	0.01
USD 160,603	Fannie Mae Pool 3% 1/3/2032	151,411	0.01
USD 360,525	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	339,850	0.02
USD 456,473	Fannie Mae Pool 3% 1/6/2032	429,719	0.03
USD 18,941	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	17,832	0.00
USD 8,038	Fannie Mae Pool 3% 1/7/2032	7,567	0.00
USD 11,222	Fannie Mae Pool 3% 1/8/2032	10,565	0.00
USD 201,044	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2032	189,257	0.01
USD 225,588	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	211,248	0.01
USD 335,068	Fannie Mae Pool 3% 1/11/2032	315,404	0.02
USD 37,131	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	34,887	0.00
USD 18,074	Fannie Mae Pool 3% 1/12/2032	17,013	0.00
USD 10,879	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	10,240	0.00
USD 57,591	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	53,854	0.00
USD 129,346	Fannie Mae Pool 3% 1/1/2033	121,768	0.01
USD 33,750	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	31,767	0.00
USD 203,834	Fannie Mae Pool 3% 1/2/2033	191,878	0.01
USD 23,735	Fannie Mae Pool 3% 1/10/2033	22,216	0.00
USD 814,715	Fannie Mae Pool 3% 1/9/2035	749,392	0.04
USD 341,936	Fannie Mae Pool 3.125% 1/9/2044	335,887	0.02
USD 339,533	Fannie Mae Pool 3.403% 1/9/2042	344,939	0.02
USD 86,528	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	82,612	0.00
USD 528,904	Fannie Mae Pool 3.5% 1/4/2034	507,186	0.03
USD 810,053	Fannie Mae Pool 4% 1/4/2033	795,216	0.05
USD 644,240	Fannie Mae Pool 4% 1/6/2033	631,559	0.04
USD 271,206	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	265,876	0.02
USD 4,638,176	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2033	4,546,821	0.27
USD 345,420	Fannie Mae Pool 4% 1/2/2034	338,342	0.02
USD 22,773	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	22,307	0.00
USD 180,567	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	176,379	0.01
USD 177,527	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2034	173,440	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 237,506	Fannie Mae Pool 4% 1/7/2037	227,405	0.01
USD 289,101	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2037	276,803	0.02
USD 198,078	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2038	189,651	0.01
USD 2,940,386	Fannie Mae Pool 4% 1/9/2043	2,820,273	0.17
USD 3,927,221	Fannie Mae Pool 4% 1/12/2044	3,792,258	0.23
USD 9,602,296	Fannie Mae Pool 4% 1/3/2048	9,210,030	0.55
USD 613,796	Fannie Mae Pool 4.5% 1/8/2037	604,787	0.04
USD 2,509,318	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,474,669	0.15
USD 322,022	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	317,886	0.02
USD 966,512	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	954,134	0.06
USD 2,312,533	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	2,279,318	0.14
USD 477,956	Fannie Mae Pool 4.5% 1/10/2037	472,325	0.03
USD 611,773	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2037	604,307	0.04
USD 624,571	Fannie Mae Pool 4.5% 1/3/2047	611,321	0.04
USD 1,939,965	Fannie Mae Pool 4.5% 1/5/2047	1,896,743	0.11
USD 257,303	Fannie Mae Pool 4.5% 1/7/2047	252,345	0.02
USD 2,129,395	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2047	2,090,809	0.13
USD 342,521	Fannie Mae Pool 4.5% 1/6/2048	342,020	0.02
USD 1,072,898	Fannie Mae Pool 4.5% 1/11/2048	1,063,749	0.06
USD 3,281,471	Fannie Mae Pool 4.5% 1/2/2049	3,266,934	0.20
USD 911,691	Fannie Mae Pool 4.5% 1/4/2049	914,931	0.05
USD 318	Fannie Mae Pool 5% 1/7/2025	314	0.00
USD 485,320	Fannie Mae Pool 5% 1/10/2037	487,529	0.03
USD 2,504,914	Fannie Mae Pool 5% 1/6/2039	2,518,411	0.15
USD 7,782,273	Fannie Mae REMICS 5.284% 25/9/2052	7,697,998	0.46
USD 14,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding 0.71% 1/4/2025	12,824,729	0.77
USD 16,000,000	Federal National Mortgage Association 0.55% 19/8/2025	14,408,927	0.86
USD 61,000	Fertitta Entertainment / Fertitta Entertainment Finance 4.625% 15/1/2029	52,362	0.00
USD 2,700,000	Fidelity National Information Services 4.5% 15/7/2025	2,638,337	0.16
USD 1,146,000	First-Citizens Bank & Trust 3.929% 19/6/2044	1,139,208	0.07
USD 113,000	FirstEnergy 4.15% 15/7/2027	105,457	0.01
USD 250,000	Fiserv 3.2% 1/7/2026	232,931	0.01
USD 2,200,000	Fiserv 5.45% 2/3/2028	2,192,666	0.13
USD 615,000	Ford Motor Credit 2.7% 10/8/2026	537,525	0.03
USD 387,000	Ford Motor Credit 2.9% 16/2/2028	322,683	0.02
USD 1,826,000	Ford Motor Credit 3.37% 17/11/2023	1,789,911	0.11
USD 6,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 5.5% 1/5/2028	5,390	0.00
USD 63,000	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 6.5% 1/10/2025	61,734	0.00
USD 452,967	Freddie Mac Gold Pool 3% 1/2/2036	416,650	0.03
USD 900,658	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	884,015	0.05
USD 1,073,425	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/2/2034	1,053,726	0.06
USD 968,236	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/3/2034	950,477	0.06
USD 49,449	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/11/2036	47,371	0.00
USD 645,141	Freddie Mac Gold Pool 4% 1/6/2037	617,932	0.04
USD 211,428	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/7/2047	208,569	0.01
USD 6,406,900	Freddie Mac Gold Pool 4.5% 1/3/2049	6,417,674	0.38
USD 99,271,711	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates 0.694% 25/9/2024	838,876	0.05
USD 1,482,542	Freddie Mac Non Gold Pool 3.219% 1/5/2045	1,432,663	0.09
USD 503,569	Freddie Mac Pool 4.5% 1/10/2037	496,542	0.03
USD 523,510	Freddie Mac Pool 4.5% 1/1/2050	518,116	0.03
USD 4,712,448	Freddie Mac REMICS 1.5% 15/4/2044	4,455,626	0.27
USD 778,128	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2044	696,722	0.04
USD 2,197,149	Freddie Mac REMICS 2% 25/6/2045	1,945,743	0.12

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 1,373,341	Freddie Mac REMICS 3% 15/8/2043	1,250,230	0.08
USD 659,557	Freddie Mac REMICS 3% 15/1/2044	635,060	0.04
USD 1,528,144	Freddie Mac REMICS 3% 15/9/2046	1,427,833	0.09
USD 990,981	Freddie Mac REMICS 3% 25/7/2049	880,307	0.05
USD 1,194,496	Freddie Mac REMICS 4% 15/12/2043	1,139,392	0.07
USD 27,542	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/9/2041	27,256	0.00
USD 71,207	Freddie Mac REMICS 4.5% 15/11/2041	70,089	0.00
USD 465,000	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust 3.622% 25/7/2046	462,434	0.03
USD 62,000	Frontier Communications 5% 1/5/2028	54,933	0.00
USD 102,000	Frontier Communications 5.875% 15/10/2027	95,115	0.01
USD 46,000	Gartner 4.5% 1/7/2028	42,189	0.00
USD 25,000	Gates Global / Gates 6.25% 15/1/2026	24,452	0.00
USD 22,000	GCI 4.75% 15/10/2028	18,885	0.00
USD 3,443,000	GE HealthCare Technologies 5.6% 15/11/2025	3,447,645	0.21
USD 51,000	Gen Digital 6.75% 30/9/2027	50,039	0.00
EUR 360,000	General Mills 0.45% 15/1/2026	347,599	0.02
USD 297,000	General Mills 5.241% 18/11/2025	295,303	0.02
USD 266,000	General Motors 6.125% 1/10/2025	269,409	0.02
EUR 1,500,000	General Motors Financial 0.85% 26/2/2026	1,438,438	0.09
USD 176,000	General Motors Financial 1.25% 8/1/2026	155,548	0.01
USD 534,000	General Motors Financial 2.35% 26/2/2027	471,196	0.03
USD 772,000	General Motors Financial 4% 15/1/2025	748,217	0.05
USD 793,000	General Motors Financial 6% 9/1/2028	796,779	0.05
USD 2,615,000	General Motors Financial 6.05% 10/10/2025	2,636,186	0.16
USD 6,000	Genesis Energy / Genesis Energy Finance 7.75% 1/2/2028	5,731	0.00
USD 4,200,000	Gilead Sciences 3.65% 1/3/2026	4,008,412	0.24
USD 47,000	Global Net Lease / Global Net Lease Operating Partnership 3.75% 15/12/2027	38,190	0.00
USD 4,969,000	Global Payments 1.2% 1/3/2026	4,341,100	0.27
USD 1,058,000	Global Payments 2.15% 15/1/2027	927,557	0.06
USD 281,000	Global Payments 4.95% 15/8/2027	271,721	0.02
USD 15,000	Go Daddy Operating / GD Finance 3.5% 1/3/2029	12,588	0.00
USD 96,000	Go Daddy Operating / GD Finance 5.25% 1/12/2027	91,260	0.01
USD 1,030,000	Goldman Sachs 0.657% 10/9/2024	1,001,386	0.06
USD 1,621,000	Goldman Sachs 1.431% 9/3/2027	1,427,509	0.09
USD 826,000	Goldman Sachs 1.948% 21/10/2027	722,885	0.05
USD 2,787,000	Goldman Sachs 2.64% 24/2/2028	2,489,389	0.15
USD 1,065,000	Goldman Sachs 3.615% 15/3/2028	988,252	0.06
USD 683,639	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4 1.93% 20/7/2048	522,143	0.03
USD 581,657	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-5 2.31% 20/10/2048	460,976	0.03
USD 30,000	Goodyear Tire & Rubber 9.5% 31/5/2025	30,945	0.00
USD 3,381,293	Government National Mortgage Association 0.64% 16/2/2053	53,664	0.00
USD 1,640,029	Government National Mortgage Association 3% 20/7/2045	1,561,294	0.09
USD 743,030	Government National Mortgage Association 3% 20/3/2047	681,927	0.04
USD 33,000	Graham 5.75% 1/6/2026	32,267	0.00
USD 56,000	Graphic Packaging International 3.5% 15/3/2028	49,184	0.00
USD 1,497,083	GS Mortgage Trust 2011-GC5 5.154% 10/8/2044	1,474,891	0.09
USD 366,468	GS Mortgage Trust 2013-GC16 3.813% 10/11/2046	364,386	0.02
USD 3,495,242	GS Mortgage Trust 2014-GC18 4.074% 10/1/2047	3,425,427	0.21
USD 2,960,000	GS Mortgage Trust 2014-GC24 3.931% 10/9/2047	2,869,422	0.17
USD 2,330,000	GS Mortgage Trust 2015-GC32 3.764% 10/7/2048	2,218,527	0.13
USD 1,968,859	GS Mortgage Trust 2016-GS3 2.777% 10/10/2049	1,879,358	0.11
USD 8,000	Gulfport Energy 8% 17/5/2026	7,840	0.00
USD 4,000	GYP III 4.625% 1/5/2029	3,443	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 35,000	HAT I / HAT II 3.375% 15/6/2026	30,223	0.00
USD 1,324,000	HCA 5.25% 15/4/2025	1,309,066	0.08
USD 3,128,000	HCA 5.375% 1/2/2025	3,100,153	0.19
USD 593,000	HCA 5.375% 1/9/2026	583,440	0.04
USD 2,467,000	HCA 5.875% 15/2/2026	2,463,445	0.15
USD 60,000	HealthEquity 4.5% 1/10/2029	52,316	0.00
USD 820,000	Healthpeak Properties 1.35% 1/2/2027	713,382	0.04
USD 31,000	Herc 5.5% 15/7/2027	29,292	0.00
USD 33,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 5.75% 1/2/2029	29,893	0.00
USD 15,000	Hilcorp Energy I / Hilcorp Finance 6.25% 1/11/2028	13,951	0.00
USD 20,000	Hilton Domestic Operating 3.75% 1/5/2029	17,351	0.00
USD 25,000	Hilton Domestic Operating 5.375% 1/5/2025	24,735	0.00
USD 82,000	Hilton Worldwide Finance / Hilton Worldwide Finance 4.875% 1/4/2027	78,166	0.01
USD 153,000	Home Depot 2.8% 14/9/2027	140,712	0.01
USD 176,000	Home Depot 2.875% 15/4/2027	163,399	0.01
USD 36,000	Home Point Capital 5% 1/2/2026	25,212	0.00
USD 55,000	Howard Hughes 5.375% 1/8/2028	49,555	0.00
USD 121,000	HP 4.75% 15/1/2028	116,260	0.01
USD 2,471,000	Hyundai Capital America 1.65% 17/9/2026	2,155,590	0.13
USD 298,000	Hyundai Capital America 1.8% 10/1/2028	249,399	0.02
USD 122,000	Hyundai Capital America 2% 15/6/2028	101,452	0.01
USD 320,000	Hyundai Capital America 2.375% 15/10/2027*	278,965	0.02
USD 10,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.375% 1/2/2029	8,643	0.00
USD 21,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 4.75% 15/9/2024	20,424	0.00
USD 51,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 5.25% 15/5/2027	47,601	0.00
USD 33,000	Icahn Enterprises / Icahn Enterprises Finance 6.25% 15/5/2026	32,100	0.00
EUR 1,045,000	Illinois Tool Works 0.25% 5/12/2024	1,045,150	0.06
USD 82,000	Imola Merger 4.75% 15/5/2029	69,360	0.00
USD 3,145,000	Intel 4.875% 10/2/2028	3,097,845	0.19
USD 2,079,000	Intercontinental Exchange 3.75% 21/9/2028	1,958,457	0.12
USD 493,000	International Business Machines 3.45% 19/2/2026	469,516	0.03
USD 497,000	International Business Machines 4.5% 6/2/2026	486,706	0.03
USD 308,000	IQVIA 5% 15/5/2027	292,879	0.02
USD 79,000	Iron Mountain 5% 15/7/2028	71,621	0.00
USD 3,780,000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2018-BCON 3.735% 5/1/2031	3,774,519	0.23
USD 1,700,000	John Deere Capital 0.7% 15/1/2026	1,505,799	0.09
USD 4,720,000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Trust 2013-C16 4.166% 15/12/2046	4,662,427	0.28
USD 1,182,674	JP Morgan Mortgage Trust 2014-2 3% 25/6/2029	1,127,234	0.07
USD 615,238	JP Morgan Mortgage Trust 2016-2 5.905% 25/6/2046	567,079	0.03
USD 740,100	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2013-C17 3.705% 15/1/2047	734,452	0.04
USD 1,177,078	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C23 3.657% 15/9/2047	1,155,985	0.07
USD 346,471	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2014-C26 3.288% 15/1/2048	338,642	0.02
USD 1,277,472	JPMBB Commercial Mortgage Trust 2015-C33 3.504% 15/12/2048	1,216,296	0.07
USD 2,737,000	JPMorgan Chase 0.824% 1/6/2025	2,566,941	0.15
USD 3,900,000	JPMorgan Chase 1.045% 19/11/2026	3,454,616	0.21
EUR 420,000	JPMorgan Chase 1.5% 27/1/2025	429,054	0.03
USD 328,000	JPMorgan Chase 1.561% 10/12/2025	304,875	0.02
USD 1,850,000	JPMorgan Chase 1.578% 22/4/2027	1,634,582	0.10
USD 1,234,000	JPMorgan Chase 2.083% 22/4/2026	1,146,600	0.07
USD 1,581,000	JPMorgan Chase 3.782% 1/2/2028	1,484,375	0.09
USD 2,330,000	JPMorgan Chase 4.851% 25/7/2028	2,271,050	0.14
USD 109,000	Kaiser Aluminum 4.625% 1/3/2028	93,700	0.01
USD 250,000	KeyBank NA/Cleveland OH 4.15% 8/8/2025	243,761	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 46,000	Korn Ferry 4.625% 15/12/2027	42,621	0.00
USD 162,000	Kraft Heinz Foods 3% 1/6/2026	150,702	0.01
USD 35,000	LABL 5.875% 1/11/2028	30,420	0.00
USD 48,000	Ladder Capital Finance / Ladder Capital Finance 4.25% 1/2/2027	40,863	0.00
USD 2,071,000	Lam Research 3.75% 15/3/2026	1,993,583	0.12
USD 993,000	Lam Research 3.8% 15/3/2025	966,367	0.06
USD 81,000	Lamb Weston 4.875% 15/5/2028	76,423	0.01
USD 16,000	Legacy LifePoint Health 4.375% 15/2/2027	13,470	0.00
USD 20,000	Legends Hospitality / Legends Hospitality Co-Issuer 5% 1/2/2026	18,245	0.00
USD 46,000	Level 3 Financing 3.4% 1/3/2027	38,768	0.00
USD 3,000	Level 3 Financing 3.625% 15/1/2029	1,939	0.00
USD 28,000	Level 3 Financing 3.875% 15/11/2029	21,452	0.00
USD 50,000	Level 3 Financing 4.25% 1/7/2028	34,480	0.00
USD 37,000	Level 3 Financing 4.625% 15/9/2027	27,625	0.00
USD 50,000	Life Time 5.75% 15/1/2026	47,581	0.00
USD 31,000	Lindblad Expeditions 6.75% 15/2/2027	29,324	0.00
USD 61,000	Lions Gate Capital 5.5% 15/4/2029	42,875	0.00
USD 21,000	Live Nation Entertainment 3.75% 15/1/2028	18,357	0.00
USD 41,000	Live Nation Entertainment 4.75% 15/10/2027	36,787	0.00
USD 110,000	Live Nation Entertainment 6.5% 15/5/2027	108,126	0.01
USD 120,000	Lowe's 2.5% 15/4/2026	110,900	0.01
USD 169,000	Lowe's 3.35% 1/4/2027	157,974	0.01
USD 288,000	Lowe's 4.4% 8/9/2025	282,711	0.02
USD 102,000	Lumen Technologies 4% 15/2/2027	78,221	0.01
USD 24,000	Lumen Technologies 4.5% 15/1/2029	12,597	0.00
USD 980,000	LYB International Finance III 1.25% 1/10/2025	877,383	0.05
USD 7,000	Magnolia Oil & Gas Operating / Magnolia Oil & Gas Finance 6% 1/8/2026	6,710	0.00
USD 201,000	MassMutual Global Funding II 2.8% 21/3/2025	191,419	0.01
USD 56,000	Matador Resources 5.875% 15/9/2026	54,059	0.00
USD 103,000	Match II 4.625% 1/6/2028	91,615	0.01
USD 288,000	Mauser Packaging Solutions 7.875% 15/8/2026	289,708	0.02
USD 114,000	Medline Borrower 3.875% 1/4/2029	94,444	0.01
USD 92,000	Meritage Homes 5.125% 6/6/2027	87,505	0.01
USD 2,700,000	Met Tower Global Funding 3.7% 13/6/2025	2,594,908	0.16
USD 587,000	Metropolitan Life Global Funding I 5% 6/1/2026	584,893	0.04
USD 126,000	MGM Resorts International 6% 15/3/2023	126,113	0.01
USD 48,000	MicroStrategy 6.125% 15/6/2028	39,897	0.00
USD 108,900	Mileage Plus / Mileage Plus Intellectual Property Assets 6.5% 20/6/2027	108,737	0.01
EUR 700,000	MMS USA 0.625% 13/6/2025	687,167	0.04
USD 83,000	Molina Healthcare 4.375% 15/6/2028	74,671	0.00
USD 2,275,000	Morgan Stanley 0.731% 5/4/2024	2,263,408	0.14
USD 200,000	Morgan Stanley 0.79% 30/5/2025	187,354	0.01
USD 2,755,000	Morgan Stanley 2.475% 21/1/2028	2,453,447	0.15
USD 4,545,000	Morgan Stanley 5.008% 25/1/2024	4,543,652	0.27
USD 2,500,000	Morgan Stanley 6.296% 18/10/2028	2,567,990	0.15
USD 1,311,140	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C10 5.601% 15/7/2046	1,310,402	0.08
USD 1,480,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2013-C13 4.039% 15/11/2046	1,459,360	0.09
USD 1,455,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C15 4.051% 15/4/2047	1,433,540	0.09
USD 964,359	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18 3.621% 15/10/2047	950,488	0.06
USD 6,616,709	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C20 3.249% 15/2/2048	6,317,586	0.38
USD 2,625,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.372% 15/10/2048	2,492,929	0.15
USD 4,189,500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C25 3.635% 15/10/2048	3,983,606	0.24
USD 7,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C26 3.252% 15/10/2048	6,703,434	0.40

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 2,315,178	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30 2.729% 15/9/2049	2,218,453	0.13
USD 3,000,000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C31 3.102% 15/11/2049	2,760,747	0.17
USD 193,000	MPLX 1.75% 1/3/2026	172,586	0.01
USD 296,000	MPLX 4.875% 1/6/2025	291,642	0.02
USD 21,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 4.625% 1/8/2029	15,777	0.00
USD 29,000	MPT Operating Partnership / MPT Finance 5.25% 1/8/2026	25,817	0.00
USD 21,000	Mueller Water Products 4% 15/6/2029	18,388	0.00
USD 68,000	Nabors Industries 7.375% 15/5/2027	66,130	0.00
EUR 380,000	National Grid North America 0.41% 20/1/2026	364,844	0.02
USD 2,180,000	National Rural Utilities Cooperative Finance 4.8% 15/3/2028	2,142,796	0.13
USD 46,000	Nationstar Mortgage 6% 15/1/2027	42,368	0.00
USD 45,000	Navient 6.75% 15/6/2026	43,457	0.00
USD 2,000,000	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 3.16% 15/11/2068	1,670,292	0.10
USD 454,843	Navient Private Education Loan Trust 2020-A 5.488% 15/11/2068	446,482	0.03
USD 317,722	Navient Private Education Refi Loan Trust 2019-D 3.01% 15/12/2059	292,141	0.02
USD 236,080	Navient Student Loan Trust 2018-EA 4% 15/12/2059	229,263	0.01
USD 76,000	NCR 5% 1/10/2028	66,013	0.00
USD 32,000	Neptune Bidco US 9.29% 15/4/2029	30,279	0.00
USD 2,500,000	Netflix 4.375% 15/11/2026	2,401,318	0.14
USD 149,000	New Fortress Energy 6.5% 30/9/2026	135,391	0.01
USD 87,000	New Fortress Energy 6.75% 15/9/2025	80,890	0.01
USD 330,710	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3 3.25% 25/9/2056	299,761	0.02
USD 1,641,254	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1 4% 25/12/2057	1,548,290	0.09
USD 2,000,000	Newell Brands 4.45% 1/4/2026	1,892,500	0.11
USD 175,000	NextEra Energy Capital 1.875% 15/1/2027	153,963	0.01
USD 274,000	NextEra Energy Capital 1.9% 15/6/2028	231,538	0.01
USD 229,000	NextEra Energy Capital 3.55% 1/5/2027	213,463	0.01
USD 125,000	NextEra Energy Capital 4.625% 15/7/2027	121,363	0.01
USD 27,000	NextEra Energy Operating Partners 4.25% 15/7/2024	26,153	0.00
USD 185,000	NFP 4.875% 15/8/2028	162,034	0.01
USD 51,000	NGL Energy Operating / NGL Energy Finance 7.5% 1/2/2026	48,644	0.00
USD 2,327,000	Nissan Motor Acceptance 1.85% 16/9/2026	1,970,818	0.12
USD 1,584,000	Norfolk Southern 3.8% 1/8/2028	1,477,098	0.09
USD 104,000	Northern Oil and Gas 8.125% 1/3/2028	101,011	0.01
USD 70,000	Northwest Fiber / Northwest Fiber Finance Sub 4.75% 30/4/2027	61,112	0.00
USD 232,000	Novelis 3.25% 15/11/2026	204,177	0.01
USD 418,000	NRG Energy 3.75% 15/6/2024	404,633	0.03
USD 51,000	NRG Energy 5.25% 15/6/2029	45,224	0.00
USD 8,000	NRG Energy 5.75% 15/1/2028	7,524	0.00
USD 62,000	NuStar Logistics 5.75% 1/10/2025	59,752	0.00
USD 25,000	Occidental Petroleum 5.875% 1/9/2025	24,965	0.00
USD 250,000	Occidental Petroleum 8.5% 15/7/2027	268,330	0.02
USD 740,000	ONE Gas 1.1% 11/3/2024	707,213	0.04
USD 83,000	OneMain Finance 6.625% 15/1/2028	77,363	0.01
USD 3,000	OneMain Finance 6.875% 15/3/2025	2,936	0.00
USD 29,000	OneMain Finance 7.125% 15/3/2026	28,232	0.00
USD 987,000	OneMain Financial Issuance Trust 2019-2 3.14% 14/10/2036	901,487	0.05
USD 4,243,000	Oracle 1.65% 25/3/2026	3,788,162	0.23
USD 2,410,000	Oracle 3.25% 15/11/2027	2,201,976	0.13
USD 232,000	Oracle 5.8% 10/11/2025	234,609	0.01
USD 285,000	Organon / Organon Foreign Debt Co-Issuer 4.125% 30/4/2028	251,112	0.02
USD 19,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 4.25% 15/1/2029	15,645	0.00
USD 103,000	Outfront Media Capital / Outfront Media Capital 5% 15/8/2027	92,474	0.01

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 4,000	OWL Rock Core Income 3.125% 23/9/2026	3,459	0.00
USD 45,000	OWL Rock Core Income 7.75% 16/9/2027	44,889	0.00
USD 953,000	Pacific Gas and Electric 3.45% 1/7/2025	895,487	0.05
USD 575,000	Parker-Hannifin 2.7% 14/6/2024	554,647	0.03
USD 64,000	Pattern Energy Operations / Pattern Energy Operations 4.5% 15/8/2028	57,198	0.00
USD 27,000	PDC Energy 5.75% 15/5/2026	25,715	0.00
USD 535,000	PeaceHealth Obligated 1.375% 15/11/2025	478,445	0.03
USD 34,000	Penske Automotive 3.5% 1/9/2025	31,834	0.00
USD 606,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.2% 15/11/2025	536,227	0.04
USD 1,285,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 1.7% 15/6/2026	1,125,213	0.07
USD 359,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4% 15/7/2025	343,468	0.02
USD 166,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.4% 1/7/2027	158,435	0.01
USD 200,000	Penske Truck Leasing / PTL Finance 4.45% 29/1/2026	192,218	0.01
USD 43,000	Performance Food 5.5% 15/10/2027	40,961	0.00
USD 150,000	Philip Morris International 0.875% 1/5/2026	131,291	0.01
USD 129,000	Philip Morris International 2.75% 25/2/2026	120,161	0.01
USD 133,000	Philip Morris International 5% 17/11/2025	132,195	0.01
USD 93,000	Picasso Finance Sub 6.125% 15/6/2025	91,295	0.01
USD 1,676,000	Pioneer Natural Resources 1.125% 15/1/2026	1,491,114	0.09
USD 77,000	Post 5.625% 15/1/2028	74,003	0.00
USD 200,000	PRA Health Sciences 2.875% 15/7/2026	178,214	0.01
USD 42,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.25% 15/4/2024	41,312	0.00
USD 36,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 5.75% 15/4/2026	34,827	0.00
USD 38,000	Prime Security Services Borrower / Prime Finance 6.25% 15/1/2028	35,304	0.00
USD 39,000	PTC 3.625% 15/2/2025	37,086	0.00
USD 195,000	PulteGroup 5% 15/1/2027	191,587	0.01
USD 66,000	Radiate Holdco / Radiate Finance 4.5% 15/9/2026	49,451	0.00
USD 40,000	Raptor Acquisition / Raptor Co-Issuer 4.875% 1/11/2026	37,060	0.00
USD 177,000	Realty Income 2.2% 15/6/2028	152,690	0.01
USD 175,000	Realty Income 3.4% 15/1/2028	161,855	0.01
USD 10,000	Regal Rexnord 6.05% 15/2/2026	9,902	0.00
USD 45,000	Regal Rexnord 6.05% 15/4/2028	44,034	0.00
USD 57,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.5% 15/2/2029	49,714	0.00
USD 39,000	RHP Hotel Properties / RHP Finance 4.75% 15/10/2027	35,892	0.00
USD 82,000	RLJ Lodging Trust 3.75% 1/7/2026	73,817	0.00
USD 63,000	Rocket Mortgage / Rocket Mortgage Co-Issuer 2.875% 15/10/2026	54,066	0.00
USD 16,000	Rockies Express Pipeline 4.95% 15/7/2029	13,942	0.00
USD 207,000	Ryder System 1.75% 1/9/2026	182,729	0.01
USD 2,043,000	Ryder System 2.85% 1/3/2027	1,852,443	0.11
USD 198,000	Ryder System 2.9% 1/12/2026	179,797	0.01
USD 141,000	Ryder System 4.3% 15/6/2027	134,895	0.01
USD 1,702,000	Sabine Pass Liquefaction 5.75% 15/5/2024	1,701,954	0.10
USD 45,000	Sabre GBLB 7.375% 1/9/2025	42,241	0.00
USD 38,000	Sabre GBLB 9.25% 15/4/2025	37,431	0.00
USD 13,000	Sabre GBLB 11.25% 15/12/2027	12,965	0.00
USD 120,000	Santander USA 3.5% 7/6/2024	116,860	0.01
USD 200,000	Sasol Financing USA 6.5% 27/9/2028	187,586	0.01
USD 59,000	SBA Communications 3.125% 1/2/2029	48,435	0.00
USD 61,000	SBA Communications 3.875% 15/2/2027	55,414	0.00
USD 1,315,000	Sealed Air 5.125% 1/12/2024	1,292,837	0.08
USD 106,000	Sealed Air 5.5% 15/9/2025	104,410	0.01
USD 14,000	Sealed Air 6.125% 1/2/2028	13,770	0.00
USD 1,752,935	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3 3.5% 25/8/2057	1,660,498	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 2,897,268	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2019-4 3% 25/2/2059	2,682,710	0.16
USD 1,282,000	Sempra Energy 3.3% 1/4/2025	1,226,768	0.07
USD 128,163	Sequoia Mortgage Trust 2017-CH1 3.5% 25/8/2047	118,319	0.01
USD 743,050	Sesac Finance 5.216% 25/7/2049	692,013	0.04
USD 552,000	Sherwin-Williams 4.25% 8/8/2025	537,306	0.03
USD 59,000	Shift4 Payments / Shift4 Payments Finance Sub 4.625% 1/11/2026	54,444	0.00
USD 160,000	Simon Property 3.3% 15/1/2026	151,722	0.01
USD 376,000	Simon Property 3.5% 1/9/2025	360,079	0.02
USD 56,000	Sinclair Television 5.125% 15/2/2027	49,191	0.00
USD 20,000	Sirius XM Radio 3.125% 1/9/2026	17,648	0.00
USD 96,000	Sirius XM Radio 4% 15/7/2028	81,905	0.01
USD 50,000	Sirius XM Radio 5% 1/8/2027	45,738	0.00
USD 4,000	Sirius XM Radio 5.5% 1/7/2029	3,589	0.00
USD 36,000	Six Flags Theme Parks 7% 1/7/2025	36,316	0.00
USD 26,000	SLM 3.125% 2/11/2026	22,458	0.00
USD 5,014,605	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-A 5.079% 15/12/2038	4,824,296	0.29
USD 3,481,846	SLM Private Credit Student Loan Trust 2005-B 5.099% 15/6/2039	3,329,548	0.20
USD 3,522,941	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-A 5.059% 15/6/2039	3,320,935	0.20
USD 1,884,680	SLM Private Credit Student Loan Trust 2006-B 5.039% 15/12/2039	1,768,314	0.11
USD 970,293	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A 5.009% 16/12/2041	928,777	0.06
USD 3,869,981	SLM Private Education Loan Trust 2010-C 9.338% 15/10/2041	4,154,197	0.25
USD 839,498	SLM Student Loan Trust 2013-4 5.167% 25/6/2043	816,909	0.05
USD 19,000	SM Energy 6.5% 15/7/2028	17,562	0.00
USD 3,000	SM Energy 6.625% 15/1/2027	2,840	0.00
USD 40,000	SM Energy 6.75% 15/9/2026	38,504	0.00
USD 1,465,966	SMB Private Education Loan Trust 2017-A 5.488% 15/9/2034	1,458,293	0.09
USD 812,650	SMB Private Education Loan Trust 2017-B 5.338% 15/10/2035	804,781	0.05
USD 235,980	SMB Private Education Loan Trust 2019-A 3.44% 15/7/2036	224,826	0.01
USD 450,416	SMB Private Education Loan Trust 2020-A 5.418% 15/9/2037	440,584	0.03
USD 4,193,204	SMB Private Education Loan Trust 2020-PTB 1.6% 15/9/2054	3,733,001	0.22
USD 950,000	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 2.31% 15/1/2053	851,526	0.05
USD 1,468,992	SMB Private Education Loan Trust 2021-A 5.318% 15/1/2053	1,434,138	0.09
USD 2,683,462	SMB Private Education Loan Trust 2021-C 1.39% 15/1/2053	2,349,412	0.14
USD 4,884,216	SMB Private Education Loan Trust 2022-B 5.851% 16/2/2055	4,876,460	0.29
USD 2,104,100	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 4.48% 16/5/2050	2,025,670	0.12
USD 2,022,667	SMB Private Education Loan Trust 2022-C 6.251% 16/5/2050	2,031,232	0.12
USD 10,567,911	SMB Private Education Loan Trust 2022-D 6.201% 15/10/2058	10,588,466	0.64
USD 69,005	SoFi Professional Loan Program 2016-D 2.34% 25/4/2033	67,662	0.00
USD 914,332	SoFi Professional Loan Program 2017-D 2.65% 25/9/2040	873,151	0.05
USD 836,185	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F 2.84% 25/1/2041	804,516	0.05
USD 1,451,632	Sofi Professional Loan Program 2018-B Trust 3.34% 25/8/2047	1,402,294	0.08
USD 1,383,229	Sofi Professional Loan Program 2018-C Trust 3.59% 25/1/2048	1,329,640	0.08
USD 1,304,242	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust 3.6% 25/2/2048	1,252,785	0.08
USD 1,515,000	Sonoco Products 2.25% 1/2/2027	1,356,923	0.08
USD 219,000	Sotheby's 7.375% 15/10/2027	206,797	0.01
USD 27,447	Soundview Home Loan Trust 2003-2 5.917% 25/11/2033	27,032	0.00
USD 4,291,000	Southern 4.475% 1/8/2024	4,211,178	0.25
USD 23,000	Specialty Building Products / SBP Finance 6.375% 30/9/2026	21,015	0.00
USD 878,000	Spectra Energy Partners 3.5% 15/3/2025	841,458	0.05
USD 6,000	Spirit AeroSystems 7.5% 15/4/2025	6,000	0.00
USD 53,000	Spirit AeroSystems 9.375% 30/11/2029	56,246	0.00
USD 73,000	Sprint 7.625% 1/3/2026	75,968	0.00
USD 165,000	Sprint Capital 6.875% 15/11/2028	172,590	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 1,673,437	Sprint Spectrum / Sprint Spectrum II / Sprint Spectrum III 4.738% 20/9/2029	1,654,495	0.10
USD 154,000	SRM Escrow Issuer 6% 1/11/2028	135,741	0.01
USD 139,000	SRS Distribution 4.625% 1/7/2028	121,744	0.01
USD 126,000	SS&C Technologies 5.5% 30/9/2027	118,725	0.01
USD 31,000	Standard Industries 4.75% 15/1/2028	27,932	0.00
USD 175,000	Standard Industries 5% 15/2/2027	161,906	0.01
USD 57,000	Staples 7.5% 15/4/2026	50,794	0.00
USD 23,000	Starwood Property Trust 4.375% 15/1/2027	19,981	0.00
USD 23,000	Starwood Property Trust 5.5% 1/11/2023	22,812	0.00
USD 105,000	State Street 3.55% 18/8/2025	101,278	0.01
USD 296,000	State Street 5.751% 4/11/2026	300,133	0.02
USD 46,000	Station Casinos 4.5% 15/2/2028	40,447	0.00
USD 38,000	Stevens 6.125% 1/10/2026	38,588	0.00
USD 200,000	Stillwater Mining 4% 16/11/2026	178,500	0.01
USD 37,000	Synaptics 4% 15/6/2029	30,724	0.00
USD 724,000	Synchrony Financial 4.5% 23/7/2025	696,765	0.04
USD 1,873,000	Synchrony Financial 4.875% 13/6/2025	1,819,721	0.11
USD 13,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 5.5% 15/1/2028	11,672	0.00
USD 9,000	Tallgrass Energy Partners / Tallgrass Energy Finance 6% 1/3/2027	8,336	0.00
USD 132,000	Tap Rock Resources 7% 1/10/2026	121,402	0.01
USD 23,000	Taylor Morrison Communities 5.875% 15/6/2027	22,198	0.00
USD 101,000	TCI Communications 7.125% 15/2/2028	109,743	0.01
USD 4,000	TEGNA 4.75% 15/3/2026	3,807	0.00
USD 72,000	Teleflex 4.25% 1/6/2028	65,047	0.00
USD 71,000	Tempur Sealy International 4% 15/4/2029	60,883	0.00
USD 56,000	Tenet Healthcare 4.625% 1/9/2024	55,323	0.00
USD 80,000	Tenet Healthcare 4.625% 15/6/2028	72,638	0.00
USD 42,000	Tenet Healthcare 4.875% 1/1/2026	40,118	0.00
USD 31,000	Tenet Healthcare 6.25% 1/2/2027	30,226	0.00
USD 1,258,165	Texas Electric Market Stabilization Funding N 4.265% 1/8/2036	1,181,923	0.07
USD 1,175,000	Texas Instruments 4.6% 15/2/2028	1,165,511	0.07
EUR 565,000	Thermo Fisher Scientific 2% 15/4/2025	579,208	0.04
USD 272,000	TK Elevator US Newco 5.25% 15/7/2027	246,720	0.02
USD 136,000	T-Mobile USA 1.5% 15/2/2026	121,657	0.01
USD 1,021,000	T-Mobile USA 2.25% 15/2/2026	928,533	0.06
USD 902,000	T-Mobile USA 2.625% 15/4/2026	827,865	0.05
USD 4,466,000	T-Mobile USA 3.75% 15/4/2027	4,193,899	0.25
USD 81,000	T-Mobile USA 4.95% 15/3/2028	79,424	0.01
USD 66,000	Tri Pointe Homes 5.25% 1/6/2027	61,131	0.00
USD 59,000	Triumph 8.875% 1/6/2024	61,717	0.00
USD 40,000	TTMT Escrow Issuer 8.625% 30/9/2027	40,549	0.00
USD 76,000	Twilio 3.625% 15/3/2029	63,808	0.00
USD 21,000	Uber Technologies 4.5% 15/8/2029	18,594	0.00
USD 229,000	Uber Technologies 6.25% 15/1/2028	225,308	0.01
USD 66,000	Uber Technologies 7.5% 15/9/2027	66,643	0.00
USD 40,000	Uber Technologies 8% 1/11/2026	40,859	0.00
USD 3,191,957	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 3.225% 15/8/2050	2,920,558	0.18
USD 4,151,000	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C5 3.212% 15/11/2050	3,833,714	0.23
USD 101,000	United Airlines 4.625% 15/4/2029	89,864	0.01
USD 920,531	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust 5.875% 15/4/2029	915,158	0.06
USD 159,170	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust 4.875% 15/7/2027	154,395	0.01
USD 7,000	United Natural Foods 6.75% 15/10/2028	6,636	0.00
USD 94,000,000	United States Treasury Bill 0.00% 30/11/2023	90,607,600	5.43

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 42,000,000	United States Treasury Bill 0% 25/1/2024	40,177,346	2.41
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 0% 22/2/2024	47,621,123	2.86
USD 88,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.75% 31/12/2023*	84,882,199	5.09
USD 50,000,000	United States Treasury Note/Bond 0.875% 31/1/2024*	48,101,763	2.88
USD 65,905,000	United States Treasury Note/Bond 1.5% 29/2/2024*	63,585,958	3.81
USD 24,575,000	United States Treasury Note/Bond 2.875% 15/6/2025	23,605,440	1.42
USD 45,200,000	United States Treasury Note/Bond 3.5% 15/9/2025*	43,982,602	2.64
USD 80,465,000	United States Treasury Note/Bond 3.875% 15/1/2026*	79,006,572	4.74
USD 36,645,000	United States Treasury Note/Bond 4% 15/12/2025*	36,123,954	2.17
USD 34,110,000	United States Treasury Note/Bond 4.25% 15/10/2025	33,798,879	2.03
USD 551,000	UnitedHealth 3.45% 15/1/2027	521,425	0.03
USD 52,000	Uniti / Uniti Finance / CSL Capital 10.5% 15/2/2028	52,082	0.00
USD 64,000	Univision Communications 6.625% 1/6/2027	60,879	0.00
USD 634,000	US Bancorp 2.215% 27/1/2028	567,795	0.03
USD 1,408,000	US Bancorp 4.653% 1/2/2029	1,365,938	0.08
USD 53,000	US Foods 6.25% 15/4/2025	52,925	0.00
USD 172,000	USA Compression Partners / USA Compression Finance 6.875% 1/4/2026	165,727	0.01
USD 51,000	Vail Resorts 6.25% 15/5/2025	50,914	0.00
USD 473,000	Venture Global Calcasieu Pass 3.875% 15/8/2029	407,388	0.03
USD 355,000	VeriSign 5.25% 1/4/2025	354,823	0.02
USD 64,000	Veritas US / Veritas Bermuda 7.5% 1/9/2025	49,445	0.00
USD 1,260,000	Verizon Communications 2.1% 22/3/2028	1,086,993	0.07
USD 150,000	Verizon Communications 2.625% 15/8/2026	137,697	0.01
USD 86,000	Vertiv 4.125% 15/11/2028	74,736	0.01
USD 30,000	Viasat 5.625% 15/4/2027	27,182	0.00
USD 1,626,000	VICI Properties 4.375% 15/5/2025	1,565,669	0.09
USD 1,487,000	Virginia Electric and Power 3.75% 15/5/2027	1,410,178	0.09
USD 90,000	Vistra Operations 5.625% 15/2/2027	85,551	0.01
USD 858,000	VMware 1% 15/8/2024	801,407	0.05
USD 2,566,000	VMware 1.4% 15/8/2026	2,215,754	0.13
USD 5,780,000	VMware 3.9% 21/8/2027	5,389,569	0.32
USD 1,372,000	Volkswagen of America Finance 3.35% 13/5/2025	1,315,350	0.08
USD 52,000	Wabash National 4.5% 15/10/2028	45,282	0.00
USD 2,800,000	WEC Energy 4.75% 9/1/2026	2,755,872	0.17
USD 3,639,000	Wells Fargo 3.526% 24/3/2028	3,372,081	0.20
USD 627,000	Wells Fargo 4.808% 25/7/2028	609,380	0.04
USD 943,177	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2014-LC16 3.477% 15/8/2050	928,615	0.06
USD 1,579,000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 3.148% 15/5/2048	1,498,168	0.09
USD 121,000	WESCO Distribution 7.125% 15/6/2025	122,285	0.01
USD 4,000	WESCO Distribution 7.25% 15/6/2028	4,057	0.00
USD 66,000	Western Midstream Operating 4.65% 1/7/2026	62,771	0.00
USD 109,000	Western Midstream Operating 4.75% 15/8/2028	100,944	0.01
USD 1,126,991	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 3.393% 15/8/2047	1,113,516	0.07
USD 22,000	William Carter 5.625% 15/3/2027	21,171	0.00
USD 310,000	Williams 4.3% 4/3/2024	306,148	0.02
USD 684,000	Workday 3.5% 1/4/2027	638,234	0.04
USD 154,000	WR Grace 4.875% 15/6/2027	141,488	0.01
USD 52,000	Wynn Las Vegas / Wynn Las Vegas Capital 5.25% 15/5/2027	48,422	0.00
USD 60,000	Wynn Resorts Finance / Wynn Resorts Capital 5.125% 1/10/2029	53,471	0.00
USD 13,000	XPO Escrow Sub 7.5% 15/11/2027	13,284	0.00
USD 411,000	Zayo 4% 1/3/2027	316,881	0.02
USD 82,000	ZoomInfo Technologies / ZoomInfo Finance 3.875% 1/2/2029	68,320	0.00
		1,245,391,918	74.73

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 (%)
ウルグアイ			
USD 25,328	Uruguay Government International Bond 4.375% 23/1/2031	24,720	0.00
USD 187,290	Uruguay Government International Bond 5.75% 28/10/2034	201,805	0.01
債券合計		226,525	0.01
		1,615,693,167	96.90
コマーシャル・ペーパー			
米国			
USD 2,000,000	Enel Finance America 0% 9/8/2023	1,946,482	0.12
USD 6,000,000	Enel Finance America 0% 1/9/2023	5,816,790	0.35
USD 1,700,000	General Motors Financial 0% 13/4/2023	1,689,046	0.10
USD 5,590,000	HSBC USA 0% 14/6/2023	5,508,255	0.33
USD 3,000,000	HSBC USA 0% 23/8/2023	2,924,008	0.17
コマーシャル・ペーパー合計		17,884,581	1.07
預託証券			
米国			
USD 7,000,000	Citibank(New York Branch) 5% 21/9/2023	6,984,920	0.42
預託証券合計		6,984,920	0.42
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		1,640,562,668	98.39
投資有価証券合計		1,640,562,668	98.39
その他の純資産		26,895,344	1.61
純資産合計(米ドル)		1,667,458,012	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2023年2月28日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
EUR	2,866,000	USD	3,061,559	RBS	15/3/2023	(10,452)
EUR	2,776,000	USD	2,983,995	Bank of America	15/3/2023	(28,701)
GBP	1,609,000	USD	1,970,831	Toronto-Dominion	15/3/2023	(17,179)
GBP	2,712,000	USD	3,263,311	BNY Mellon	15/3/2023	29,606
USD	118,260	EUR	111,590	Royal Bank of Canada	15/3/2023	(537)
USD	128,594	EUR	120,161	JP Morgan	15/3/2023	671
USD	101,735,879	GBP	83,460,000	HSBC Bank	15/3/2023	398,541
USD	119,031,691	EUR	111,595,000	Morgan Stanley	15/3/2023	229,086
USD	758,637	GBP	611,322	State Street	15/3/2023	16,369
未実現純評価益						617,404
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	196,951,399	USD	212,186,178	BNY Mellon	15/3/2023	(2,512,159)
USD	2,370,441	EUR	2,223,533	BNY Mellon	15/3/2023	3,291
未実現純評価損						(2,508,868)
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	8,230,697	USD	6,228,235	BNY Mellon	15/3/2023	(116,828)
USD	177,903	SGD	238,226	BNY Mellon	15/3/2023	1,018
未実現純評価損						(115,810)
未実現純評価損合計						(2,007,274)

未決済上場先物取引 2023年2月28日現在

契約数	通貨	契約/摘要	満期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
(234)	EUR	Euro BOBL	2023年3月	1,132,527
(2)	EUR	Euro Bund	2023年3月	19,232
(53)	EUR	Euro Schatz	2023年3月	99,222
(30)	JPY	Japanese 10 Year Bond(OSE)	2023年3月	144,887
(61)	USD	US Long Bond(CBT)	2023年6月	149,438
(10)	USD	US Treasury 10 Year Note(CBT)	2023年6月	4,531
(111)	USD	US Ultra 10 Year Note	2023年6月	55,359
(31)	USD	US Ultra Bond(CBT)	2023年6月	16,225
3,135	USD	US Treasury 2 Year Note(CBT)	2023年6月	(2,797,940)
(1,325)	USD	US Treasury 5 Year Note(CBT)	2023年6月	530,430
合計				(646,089)

スワップ 2023年2月28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 3,950,000	ファンドはCDX.NA.HY.39.V1に係るデフォルト・プロテクションを提供し、5%の固定金利を受け取る	Goldman Sachs	20/12/2027	(68,524)	(59,750)
CDS	USD 26,290,000	ファンドはCDX.NA.IG.39.V13に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、1%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	20/12/2027	(152,863)	(271,426)
IRS	USD 35,755,000	ファンドは4.35%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	31/12/2024	(383,833)	(380,694)
IRS	USD 35,755,000	ファンドはUSD 1日SOFRの変動金利を受け取り、3.59%の固定金利を支払う	Bank of America	31/5/2027	734,934	734,822
合計					129,714	22,952

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ