

ブラックロック・ラテンアメリカ株式ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式
信託期間	無期限(設定日:2006年4月26日)
決算日	4月1日および10月1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) ラテン・アメリカン・ファンド クラスJ投資証券」および「ブラックロック・グローバル・ファンズ(ルクセンブルグ籍証券投資法人) USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド クラスX投資証券」(以下各々を「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」といいます。)への投資を通じて、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行います。</p> <p>②外貨建資産については、原則為替ヘッジを行いません。</p>
主要運用対象	<p>「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」および「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」に投資します。</p> <p>「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」を主要投資対象ファンドとし、その組入比率を高位に保ちます。</p>
組入制限	<p>①投資信託証券および短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外への直接投資は行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p>
分配方針	<p>年2回の毎決算時(4月1日および10月1日、休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準・市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>

第34期 運用報告書(全体版) (決算日:2023年4月3日)

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問合わせ先

電話番号: 03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

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

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数)MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)		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	期 中 騰落率	期 中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
30期 (2021年4月1日)	7,868	0	30.4	68,567.91	34.0	97.1	1,618
31期 (2021年10月1日)	7,616	0	△ 3.2	68,764.29	0.3	99.9	1,560
32期 (2022年4月1日)	9,813	0	28.8	93,387.96	35.8	98.6	1,877
33期 (2022年10月3日)	9,435	0	△ 3.9	89,716.87	△ 3.9	99.8	1,577
34期 (2023年4月3日)	9,390	0	△ 0.5	90,815.95	1.2	99.3	1,523

(注1) 基準価額は1万円当り。

(注2) 参考指数は、MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)です。2022年6月29日に、当ファンドの主要投資対象ファンドである「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」のベンチマークが「MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス」に変更されたことに伴い、当ファンドの参考指数を「MSCI EMラテン・アメリカ・インデックス(円換算ベース)」より「MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)」に変更しました。このため、参考指数のデータは、2022年6月28日までの期間は「MSCI EMラテン・アメリカ・インデックス(円換算ベース)」の指数値に基づき、2022年6月29日以降は「MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)」の指数値に基づき記載しています。

(注3) 「MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス」および「MSCI EMラテン・アメリカ・インデックス」は、MSCI Inc. が開発、計算した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注4) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

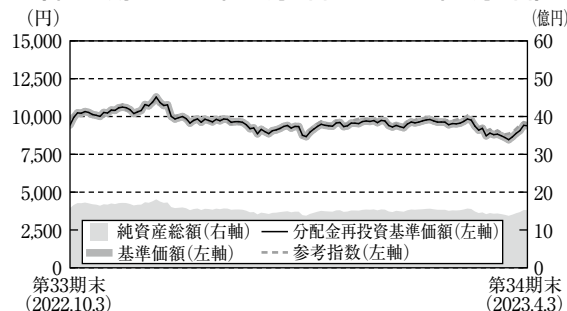
年月日	基準価額		(参考指数)MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)		投資信託証券 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2022年10月3日	9,435	-	89,716.87	-	99.8
10月末	10,400	10.2	99,023.09	10.4	99.8
11月末	9,813	4.0	92,805.61	3.4	99.3
12月末	9,338	△ 1.0	87,836.95	△ 2.1	99.8
2023年1月末	9,673	2.5	93,206.22	3.9	100.1
2月末	9,636	2.1	92,822.31	3.5	99.5
3月末	9,418	△ 0.2	91,501.91	2.0	99.3
(期末)					
2023年4月3日	9,390	△ 0.5	90,815.95	1.2	99.3

(注1) 基準価額は1万円当り。騰落率は期首比。

(注2) 「MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス」は、MSCI Inc. が開発、計算した株価指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

■当期中の基準価額等の推移について

(第34期:2022年10月4日～2023年4月3日)



第 34 期首 : 9,435 円

第 34 期末 : 9,390 円 (既払分配金 0 円)

騰落率 : △ 0.5% (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。
- * 参考指数は、MSCI EM ラテン・アメリカ 10/40 インデックス(円換算ベース)です。
- * 分配金再投資基準価額および参考指数は、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

<ラテンアメリカ株式市場>

当期(2022年10月4日から2023年4月3日まで)、ラテンアメリカ各市場のパフォーマンスはまちまちなものとなりました。経済、株式市場共に高金利と将来の財政政策に対する不透明感による影響を受け、ブラジル市場は特に下落しました。一方、地政学リスクを受けた米国企業の生産拠点の移動の恩恵を受け、メキシコ市場は好調なパフォーマンスとなりました。

<米国債券市場>

当期、米国の短期債利回りは、インフレ鈍化を示す経済指標を背景に、FRB(米連邦準備制度理事会)による利上げ期待の後退により、前期末比で低下しました。

ポートフォリオについて

当期、当ファンドは、主要投資対象である「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」を高位に、「BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド」を低位に組み入れた運用を行いました。

投資先ファンドにおける運用経過は以下の通りです。

<BGF ラテン・アメリカン・ファンド>

パフォーマンスが良好であった銘柄や、想定通りの展開となった投資案件、例えばCorporación Inmobiliaria VestaやGrupo Aeroportuario del Suresteなどについては利益確定の売却を行ったため、メキシコの組入高位は縮小しました。ペルーの金融サービス企業Credicorpの保有を全売却し、よりバリュエーションが魅力的と思われるコロンビアの金融サービス企業Bancolombiaに入れ替えました。業績悪化の見通しと資産の質が悪化する傾向にあるため、金融サービスのITAUを売却しました。一方、鉄道物流企業のRumoを新たに組み入れましたが、同社の業績見通しが良好であることと強い価格決定力を持っているためです。また、ブラジル経済の回復予想からBradescoに追加投資を行いました。

インフレが大きく低下してきていることから、ブラジルの政策金利は13.75%のピークを付けてから低下していくと予想しています。これは最も確信度の高いシナリオの一つであり、直近数ヶ月間でブラジルへの配分比率を引き上げたことで、当期末にブラジルは組入高位となりました。また、アルゼンチンとパナマの非ベンチマーク銘柄を銘柄固有の理由により、継続保有しています。メキシコ、チリ、およびペルーは組入低位となっています。

当主要投資対象ファンドのベンチマークと比較したパフォーマンス要因(運用状況)は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・メキシコのコンビニエンスストア運営企業のFEMSAの保有
- ・メキシコの不動産会社であるFibra UnoとCorporación Inmobiliaria Vestaの、それぞれ組入高位、保有

(主なマイナス要因)

- ・ブラジルのヘルスケア・サービスプロバイダーのHapvidaの組入低位
- ・ブラジルの金融企業であるBanco BradescoとXP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債に投資することで、トータル・リターンを最大化を目指した運用を行いました。

基準価額の主な変動要因

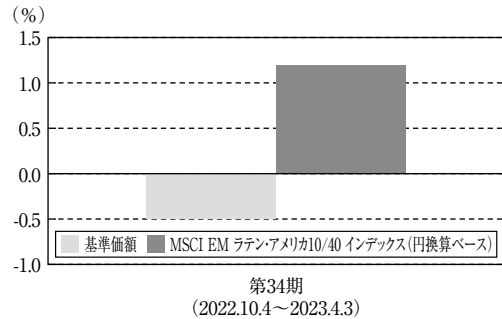
当ファンドの基準価額は、0.5%下落しました。当期「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」が上昇したことがプラス要因となった一方で、「BGF ラテン・アメリカン・ファンド」は米ドル建てであるため、当期為替市場において円高が進行したことは基準価額下落の要因となりました。

■主要投資対象ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
BGF ラテン・アメリカン・ファンド	9.3%

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。下記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

■基準価額と参考指数の対比(期別騰落率)**分配金について**

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期
	2022年10月4日 ～ 2023年4月3日
当期分配金(税込み)	- 円
対基準価額比率	- %
当期の収益	- 円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	1,480

(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 ラテン・アメリカン・ファンド」を高位に組入れる運用を行う方針です。

投資先ファンドにおける市場見通しおよび今後の運

用方針は以下の通りです。

<BGF ラテン・アメリカン・ファンド>

メキシコのパフォーマンスは相対的に良好です。堅実な財政支出を行う政府によって経済は安定しており、中央銀行は積極的に利上げを行っています。株式市場はこれを反映して年初から上昇しており、当戦略では一部利益確定を行いました。グローバル・サプライチェーンの移転に伴う恩恵を継続的に最も受ける国として、メキシコについては引き続き肯定的な見通しを持っています。ブラジルについては、当戦略の考える投資テーマが今年実現するための条件が整ってきており、組入高位を維持しています。2023年3月に発表された政府の財政フレームワークは、市場予想に比べて平凡なものでしたが、財政見通しに対する不透明性の払拭につながるものであり、中央銀行が利下げを開始するために必要なものです。利下げは、経済と株式市場双方にとって最も重要な支援材料であり、フレームワーク発表により、中央銀行はまもなく利下げが可能になるとみえています。

<BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド>

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

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第34期		項目の概要
	(2022.10.4～2023.4.3)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	95	0.982	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,642円です。
(投信会社)	(47)	(0.483)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(47)	(0.483)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	-	-	売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	-	-	有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	5	0.056	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)	(0)	(0.001)	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)	(5)	(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	100	1.038	

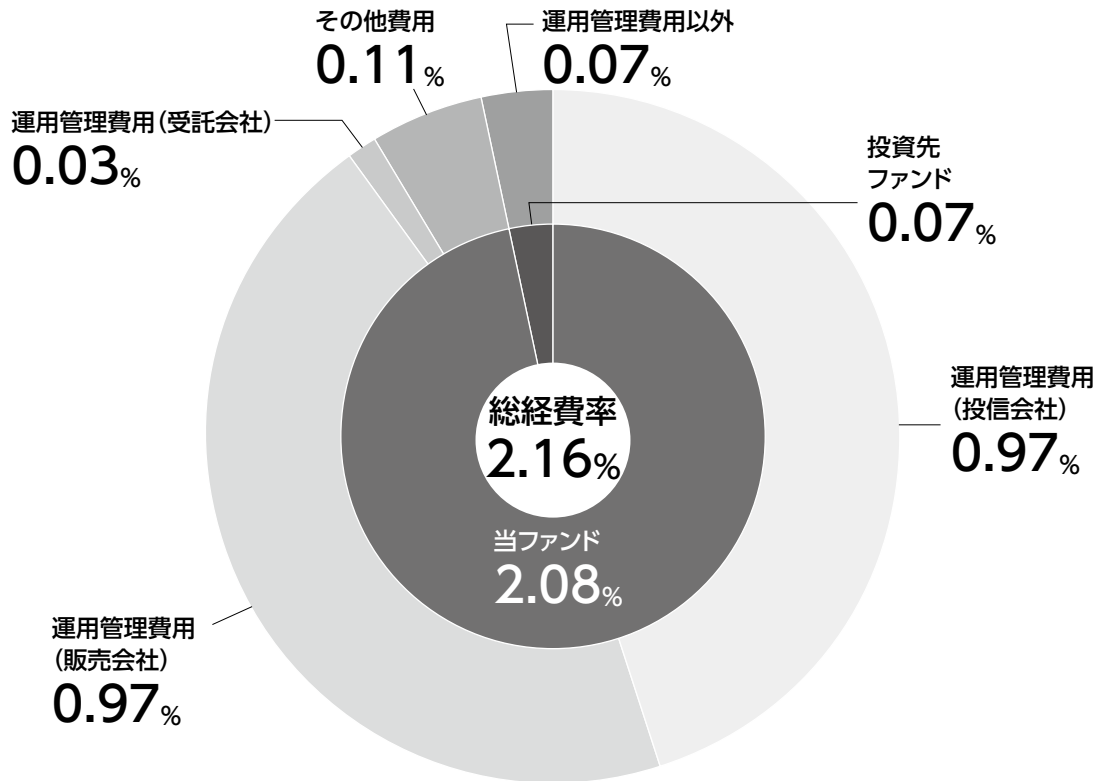
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

■総経費率



※当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は2.16%です。

総経費率(①+②+③)	2.16%
①当ファンドの費用の比率	2.08%
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	0.07%

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

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5)①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2022年10月4日から2023年4月3日まで)

投資信託証券

外国	アメリカ	銘柄	買 付		売 付	
			口数	金額	口数	金額
		BGF ラテン・アメリカン・ファンド(ルクセンブルグ)	千口 4	千米・ドル 336	千口 10	千米・ドル 844

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は、発行国です。

■主要な売買銘柄(2022年10月4日から2023年4月3日まで)

投資信託証券

買 付			売 付		
銘柄	口数	金額	銘柄	口数	金額
BGF ラテン・アメリカン・ファンド (ルクセンブルグ)	千口 4	千円 45,396	BGF ラテン・アメリカン・ファンド (ルクセンブルグ)	千口 10	千円 121,298

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は、発行国です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2022年10月4日から2023年4月3日まで)

当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2022年10月4日から2023年4月3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 期 末			比 率
	口数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
BGF ラテン・アメリカン・ファンド	千口 135	千米・ドル 11,254	百万円 1,498	% 98.3
BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	7	113	15	1.0
合 計	143	11,367	1,513	99.3

(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) 単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2023年4月3日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 証 券	1,513,633	98.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,281	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,540,914	100.0

(注1) 当期末における外貨建資産(1,513,633千円)の投資信託財産総額(1,540,914千円)に対する比率は、98.2%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。換算レートは、1米・ドル=133.15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

2023年4月3日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,540,914,383 円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,281,223
投 資 証 券 (評 価 額)	1,513,633,160
(B) 負 債	17,146,196
未 払 解 約 金	1,110,150
未 払 信 託 報 酬	15,187,633
そ の 他 未 払 費 用	848,413
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,523,768,187
元 本	1,622,800,446
次 期 繰 越 損 益 金	△ 99,032,259
(D) 受 益 権 総 口 数	1,622,800,446 口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C / D)	9,390 円

(注記事項)

期首元本額

1,671,832,565円

期中追加設定元本額

140,291,207円

期中一部解約元本額

189,323,326円

■損益の状況

自 2022年10月4日 至 2023年4月3日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5 円
受 取 利 息	5
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,787,022
売 買 益	134,381,969
売 買 損	△ 126,594,947
(C) 信 託 報 酬 等	△ 16,057,564
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 8,270,537
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	106,284,748
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 197,046,470
(配 当 等 相 当 額)	(79,962,356)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 277,008,826)
(G) 合 計 (D + E + F)	△ 99,032,259
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△ 99,032,259
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 197,046,470
(配 当 等 相 当 額)	(79,962,356)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 277,008,826)
分 配 準 備 積 立 金	160,340,344
繰 越 損 益 金	△ 62,326,133

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

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

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

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

- (注) 第34期計算期末における、費用控除後の配当等収益(5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)(79,962,356円)、分配準備積立金(160,340,339円)により、分配対象収益は240,302,700円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

<参考情報>

**ブラックロック・グローバル・ファンズ
ラテン・アメリカン・ファンドの運用状況について
(計算期間：2021年9月1日～2022年8月31日)**

ブラックロック・グローバル・ファンズ（ルクセンブルグ籍証券投資法人） ラテン・アメリカン・ファンド（以下BGF ラテン・アメリカン・ファンド）はブラックロック・ラテンアメリカ株式ファンドが投資対象とする外国投資証券で、決算は年1回（毎年8月末日）です。従って、入手可能な直前の計算期間（決算）である2022年8月31日現在の内容をご報告申し上げます。

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

BGF ラテン・アメリカン・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70%以上をラテンアメリカ諸国の株式（同地域において重要な事業展開を行っていると考えられる同地域以外の企業の株式を含みます。）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。
設 定 日	1997年1月8日
存 続 期 間	無期限
主な投資対象	ラテンアメリカ諸国の株式（同地域において重要な事業展開を行っていると考えられる同地域以外の企業の株式を含みます。）を主要投資対象とします。
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	原則として、分配を行いません。
申 込 手 数 料	ありません。
管 理 会 社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー
保 管 会 社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー／エヌ・ブイ

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

損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・ラテンアメリカ株式ファンドは、BGF ラテン・アメリカン・ファンドのクラスJ投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

	BGF ラテン・アメリカン・ファンド 米ドル
期首純資産	882,654,961
収益	
預金利息	6,630
債券利息、源泉徴収税控除後	32,356
スワップ利息	-
短期金融商品預け入れによる利息	-
集団投資スキームによる収益、源泉徴収税控除後	40,938
配当金、源泉徴収税控除後	72,730,211
有価証券貸付による収益	27,992
投資運用報酬リベート	-
その他の払戻し	-
収益合計	72,838,127
費用	
スワップ利息	-
年間サービス費用	2,036,893
ローン・コミットメント・フィー	5,869
保管および預託報酬	281,062
販売報酬	176,778
税金	404,834
投資運用報酬	13,844,683
費用合計	16,750,119
純利益	56,088,008
以下に係る実現純評価益／(損)：	
投資有価証券	(57,395,852)
事後通告証券契約	-
上場先物取引	-
スワップ取引	-
先渡為替予約	(1,759,420)
その他の取引に係る外国通貨	682,465
当期実現純評価損	(58,472,807)
以下に係る未実現評価益／(損)の純変動額：	
投資有価証券	(114,437,848)
事後通告証券契約	-
上場先物取引	-
スワップ取引	-
先渡為替予約	(47,323)
その他の取引に係る外国通貨	(22,018)
当期末実現評価益／(損)の純変動	(114,507,189)
運用成績による純資産の減少	(116,891,988)
資本の変動	
投資証券発行による正味受取額	537,540,419
投資証券買戻しによる正味支払額	(467,845,089)
資本の変動による純資産の増加(減少)	69,695,330
配当金宣言額	(225,134)
期末純資産	835,233,169

BGF ラテン・アメリカン・ファンド

投資有価証券明細表 2022年8月31日現在

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
ファンド			
	アイルランド		
9	BlackRock ICS US Dollar Liquid Environmentally Aware Fund	902	0.00
ファンド合計		902	0.00
普通/優先株式			
	バミューダ		
143,123	Credicorp	18,534,428	2.22
	ブラジル		
10,596,992	Ambev	31,731,325	3.80
555,987	Arezzo Industria e Comercio	10,004,025	1.20
13,542,929	B3 - Brasil Bolsa Balcao	31,866,458	3.82
12,070,747	Banco Bradesco	45,204,947	5.41
4,638,890	Banco BTG Pactual	23,425,753	2.81
1,007,171	BB Seguridade Participacoes	5,529,695	0.66
3,652,921	Bradespar	15,666,326	1.88
5,179,399	CCR	13,948,132	1.67
2,664,462	Gerdau	12,116,855	1.45
19,472,594	Hapvida Participacoes e Investimentos	27,649,358	3.31
9,272,124	Itau Unibanco	47,102,390	5.64
1,918,499	Localiza Rent a Car	22,897,253	2.74
2,735,970	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios	13,060,445	1.56
2,546,345	Neoenergia	8,175,648	0.98
3,576,254	Petro Rio	18,405,028	2.20
2,477,803	Petroleo Brasileiro	34,986,578	4.19
3,456,321	Petroleo Brasileiro*	43,757,024	5.24
1,411,901	Rede D' Or Sao Luiz	9,142,862	1.09
5,147,080	Sendas Distribuidora	18,315,739	2.19
2,608,017	Suzano	22,818,476	2.73
2,851,746	Vale	35,675,343	4.27
4,861,210	Vibra Energia	17,843,165	2.14
		509,322,825	60.98
	ケイマン諸島		
419,984	Afya	5,518,589	0.66
502,786	XP*	9,854,606	1.18
		15,373,195	1.84
	チリ		
897,022	Banco Santander Chile*	14,397,203	1.72
81,597	Sociedad Quimica y Minera de Chile	8,273,936	0.99
		22,671,139	2.71
	コロンビア		
214,572	Bancolombia	6,151,779	0.73
107,755	Bancolombia	899,255	0.11
		7,051,034	0.84
	ルクセンブルグ		
43,232	Globant*	9,144,865	1.10
387,565	Tenaris	10,549,519	1.26
		19,694,384	2.36
	メキシコ		
1,520,813	America Movil	26,568,603	3.18
5,009,370	Cemex	19,436,355	2.33

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

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
メキシコ(続き)			
13,691,613	Fibra Uno Administracion de	13,922,515	1.67
555,095	Fomento Economico Mexicano	35,559,386	4.26
41,194	Grupo Aeroportuario del Pacifico	5,947,178	0.71
577,954	Grupo Aeroportuario del Pacifico	8,325,285	1.00
366,194	Grupo Aeroportuario del Sureste	7,853,367	0.94
31,464	Grupo Aeroportuario del Sureste	6,760,670	0.81
7,112,454	Grupo Financiero Banorte	42,724,090	5.12
3,625,840	Grupo Mexico	13,571,712	1.62
4,803,534	Inmobiliaria Vesta	8,885,103	1.06
6,449,786	Wal-Mart de Mexico	21,464,082	2.57
		211,018,346	25.27
パナマ			
156,441	Copa	11,288,783	1.35
普通/優先株式合計		814,954,134	97.57
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		814,955,036	97.57

その他の譲渡可能な有価証券

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
債券			
	ブラジル		
BRL 163,880	Lupatech 6.5% 15/4/2018	-	0.00
債券合計		-	0.00
その他の譲渡可能な有価証券合計		-	0.00
投資有価証券合計		814,955,036	97.57
その他の純資産		20,278,133	2.43
純資産合計(米ドル)		835,233,169	100.00

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

ブラックロック・ラテンアメリカ株式ファンド

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益／(損) (米ドル)
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	5,937,259	USD	4,145,067	BNY Mellon	15/9/2022	(75,062)
USD	350,919	AUD	507,038	BNY Mellon	15/9/2022	3,342
未実現純評価損						(71,720)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	279,065	USD	292,359	BNY Mellon	15/9/2022	(7,101)
USD	16,001	CHF	15,375	BNY Mellon	15/9/2022	284
未実現純評価損						(6,817)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	206,216	USD	210,585	BNY Mellon	15/9/2022	(4,092)
USD	11,503	EUR	11,452	BNY Mellon	15/9/2022	35
未実現純評価損						(4,057)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
USD	43,568	GBP	36,720	BNY Mellon	15/9/2022	932
GBP	306,171	USD	370,104	BNY Mellon	15/9/2022	(14,593)
未実現純評価損						(13,661)
ヘッジを使用した香港ドル建投資証券クラス						
HKD	1,220,628	USD	155,657	BNY Mellon	15/9/2022	(90)
USD	9,317	HKD	73,073	BNY Mellon	15/9/2022	4
未実現純評価損						(86)
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	20,928,160	USD	4,338,316	BNY Mellon	15/9/2022	81,935
USD	178,536	PLN	851,636	BNY Mellon	15/9/2022	(1,335)
未実現純評価益						80,600
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	3,708,971	USD	2,690,738	BNY Mellon	15/9/2022	(36,243)
USD	161,876	SGD	225,372	BNY Mellon	15/9/2022	579
未実現純評価損						(35,664)
未実現純評価損合計(米ドル建の基礎となるエクスポージャー - 12,923,648米ドル)						(51,405)

<参考情報>

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

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

投資対象ファンドの概要は以下の通りです。

BGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンド	
形 態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および 投資 態 度	純資産総額の80%以上を投資適格債に投資し、トータル・リターンを最大化することを目指します。純資産総額の70%以上をデュレーションが5年未満の米ドル建て投資適格債に投資し、ファンドの平均デュレーションは3年以下を原則とします。 通貨エクスポージャーについては柔軟に運用します。
設 定 日	2002年10月31日
存 続 期 間	無期限
主 な 投 資 対 象	主として米ドル建ての投資適格債に投資します。
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	原則として、分配を行いません。
申 込 手 数 料	ありません。
管 理 会 社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク
保 管 会 社	ザ・バンク・オブ・ニューヨーク・メロン・エス・エー/エヌ・ブイ

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

■損益および純資産変動計算書

※ブラックロック・ラテンアメリカ株式ファンドはBGF USダラー・ショート・デュレーション・ボンド・ファンドのクラスX投資証券に投資しておりますが、以下の内容は全てのクラスを合算しております。

2021年9月1日から2022年8月31日までの期間

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

* 当証券のすべてまたは一部は貸付有価証券を表す。

未決済先渡為替予約 2022年8月31日現在

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

未決済上場先物取引 2022年8月31日現在

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

スワップ 2022年8月31日現在

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

CDS: クレジット・デフォルト・スワップ

IRS: 金利スワップ

事後通告証券契約 2022年8月31日現在

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