

日興スリートップ（隔月分配型）

運用報告書（全体版）

第97期（決算日 2022年11月15日） 第98期（決算日 2023年1月16日） 第99期（決算日 2023年3月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。

「日興スリートップ（隔月分配型）」は、2023年3月15日に第99期の決算を行ないましたので、第97期から第99期の運用状況をまとめてご報告申しあげます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申しあげます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	2006年10月31日から原則無期限です。
運用方針	主として投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）の一部、またはすべてに分散投資を行ない、インカム収益の確保を図るとともに、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	「PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券 「PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券 「PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券 「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC）」投資証券 「グローバル高配当株式マザーファンド」受益証券 上記の投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	第1計算期は収益分配を行ないません。第2計算期以降、毎決算時、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、基準価額水準などを勘案し、上記安定分配相当額のほか、委託者が決定する額を付加して分配を行なう場合があります。

<952567>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近15期の運用実績

決算期	基準価額		騰落率	株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税金配分				
	円	円	%	%	%	百万円
85期(2020年11月16日)	5,633	70	1.5	16.4	81.7	21,570
86期(2021年1月15日)	5,793	70	4.1	19.5	78.5	21,888
87期(2021年3月15日)	5,953	70	4.0	19.4	78.3	22,194
88期(2021年5月17日)	6,051	70	2.8	19.9	78.3	22,254
89期(2021年7月15日)	6,020	70	0.6	20.1	77.7	21,975
90期(2021年9月15日)	5,956	70	0.1	20.1	77.6	21,504
91期(2021年11月15日)	6,062	70	3.0	19.9	77.9	21,680
92期(2022年1月17日)	5,995	70	0.0	20.4	77.9	21,284
93期(2022年3月15日)	5,651	70	△4.6	20.1	77.6	20,058
94期(2022年5月16日)	5,845	70	4.7	17.1	81.1	20,539
95期(2022年7月15日)	5,919	70	2.5	14.2	84.0	20,642
96期(2022年9月15日)	6,080	70	3.9	13.2	84.5	21,079
97期(2022年11月15日)	5,997	70	△0.2	13.1	84.6	20,574
98期(2023年1月16日)	5,712	70	△3.6	13.8	84.4	19,562
99期(2023年3月15日)	5,825	70	3.2	12.6	85.1	19,866

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 複数の投資信託に分散投資を行なうため、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第97期	(期 首) 2022年 9月15日	円 6,080	% -		% 13.2	% 84.5
	9月末	5,831	△4.1		12.8	85.7
	10月末	6,149	1.1		14.5	83.6
	(期 末) 2022年11月15日	6,067	△0.2		13.1	84.6
第98期	(期 首) 2022年11月15日	5,997	-		13.1	84.6
	11月末	5,982	△0.3		13.1	85.3
	12月末	5,790	△3.5		13.5	84.8
	(期 末) 2023年 1月16日	5,782	△3.6		13.8	84.4
第99期	(期 首) 2023年 1月16日	5,712	-		13.8	84.4
	1月末	5,846	2.3		13.7	84.7
	2月末	5,973	4.6		12.7	85.8
	(期 末) 2023年 3月15日	5,895	3.2		12.6	85.1

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

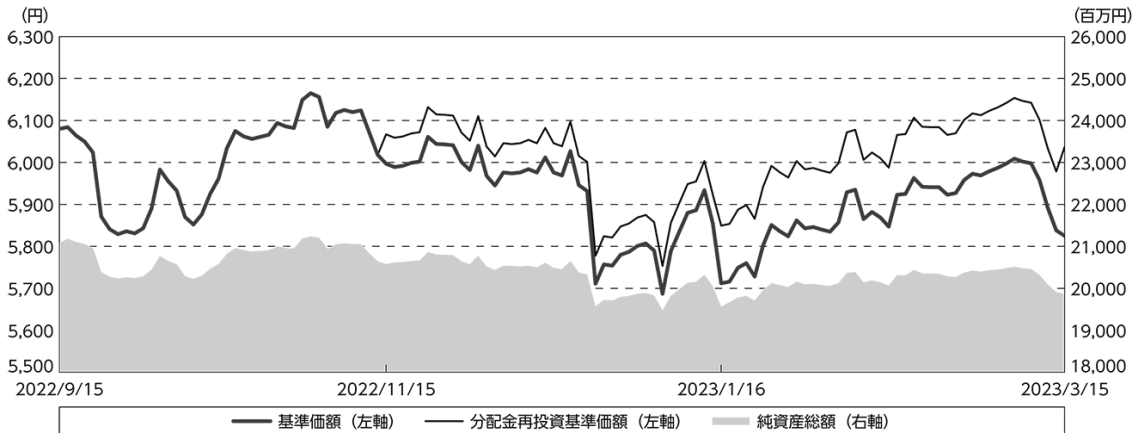
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

○運用経過

（2022年9月16日～2023年3月15日）

作成期間中の基準価額等の推移



第97期首：6,080円

第99期末：5,825円（既払分配金（税込み）：210円）

騰落率：△0.7%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2022年9月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界の債券および株式に幅広く分散投資を行ない、安定した収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間における各投資先ファンドの騰落率は、以下の通りとなりました。

資産	ファンド名	騰落率
高格付債券	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ（JPY）	△3.6%
高利回り債券	PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ（JPY）	0.1%
新興国債券	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ（JPY）	2.6%
世界株式	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC）	0.3%
世界高配当株式	グローバル高配当株式マザーファンド	1.0%

当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・組入債券の利息収入を得たこと。
- ・欧州／米国の高利回り債券などのスプレッド（国債に対する上乗せ金利）が縮小したこと。
- ・主要企業が堅調な業績を示したこと。
- ・インフレ沈静化の兆しを受けて米国の利上げペース鈍化への期待が見られたこと。

<値下がり要因>

- ・根強いインフレに対応するために、中央銀行の利上げが長引き、金利水準も上昇するとの見方が広がったこと。
- ・グローバルに主要先進国の国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと。
- ・利上げの影響で世界的に景気後退に陥るとの懸念が出たこと。
- ・為替市場においてアメリカドル、ユーロ、新興国通貨が全般的に対円で下落したこと。

投資環境

（高格付債券市況）

米国債券市場は、期間の前半、底堅い米国の経済指標や高止まりするインフレ率を受けて、米国連邦準備制度理事会（FRB）が政策金利の見通しを引き上げたことにより、利上げが継続すると観測が強まったことなどから下落しました。一方、期間の半ばには急速な金融引き締めが景気後退に繋がる懸念の高まりや、パウエルFRB議長による利上げペースの減速を示唆する発言を受けて上昇する局面も見られました。しかし、期間末に市場予想を上回るインフレ率や雇用統計の結果を受けて利上げ休止時期が後ろ倒しされるとの見方が強まったことが重しとなり、期間を通じて見ても下落となりました。

欧州債券市場は、期間の前半、欧州中央銀行（ECB）が域内のインフレ上昇ペースが加速したことを受けて0.75%の大幅な利上げを決定したことに加え、英国の財政政策を巡る混乱を背景に英国金利が急上昇した流れが波及し、下落しました。期間の後半には、域内の景況感指数などが低調となったことなどから上昇する局面が見られたものの、コアインフレ率の高止まりを受けてECBが利上げを継続する方針を明確化したことから期間を通じても下落となりました。

（高利回り債券市況）

期間を通じて見ると、高利回り債券市場（現地通貨ベース）は上昇しました。

米国高利回り債券市場では、堅調な米国の企業決算に加えて、消費者物価指数（CPI）伸び率の鈍化を背景にFRBが利上げペースを減速すると期待が高まったことなどを背景に、企業収益の圧迫懸念が和らいだことから、米国高利回り債券市場は上昇しました。

欧州高利回り債券市場は、天然ガス価格の下落によりエネルギー危機への懸念が後退したことや、購買担当者景気指数（PMI）の改善やCPIの低下を背景に景気悪化懸念が後退したことなどから、期間を通じて見ると上昇しました。

（エマージング債券市況）

期間中の新興国通貨（対円）は下落したものの、新興国債券市場（円ベース）は上昇しました。

新興国債券市場（円ベース）は、期間の初めは、新興国内で追加利上げを実施する国が見られたことなどから下落しました。一方、期間の半ばから期間末にかけて、新興国の中でもインフレが一服し利上げを休止する国が見られたことなどがプラス要因となり、新興国債券市場（円ベース）が回復に転じたことから、期間を通じて見ると上昇となりました。

新興国通貨は、米国のCPIの鈍化やFRBによる利上げ減速などを受けたアメリカドル高の修正を背景に、対アメリカドルで上昇しました。一方、日銀がイールドカーブ（利回り曲線）コントロールの修正を発表するなど日米の金融政策の違いが意識され、円高／アメリカドル安が進んだことから、対円では下落しました。

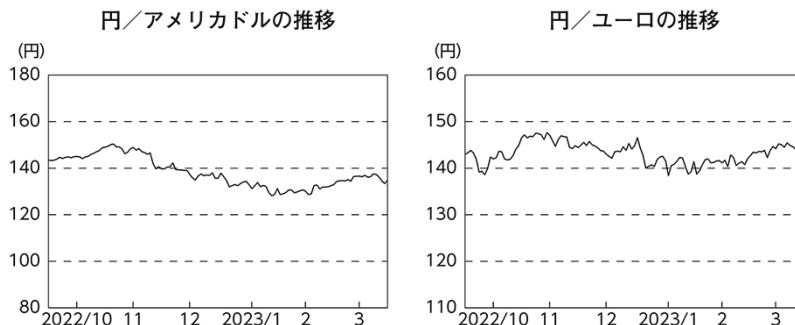
（株式市況）

期間中の世界株式市場は、現地通貨ベースで見てもほぼ横ばいとなりました。

期間の初めは、インフレへの警戒感の広がりや米国の政策金利見通しの引き上げを背景に景気後退懸念が強まったことなどから、上値の重い展開となりました。その後は、インフレ沈静化の兆しが見えてきたことや、それに伴う米国の利上げペースの鈍化観測、米国長期金利の低下などが株価を下支えしました。比較的堅調な企業業績に加え、中国のゼロコロナ政策終了による景気回復期待の高まりも追い風となりましたが、期間末近くでは米国の金融機関の破綻を受けて市場は下落しました。また、米国のインフレ鈍化や日銀の金融政策修正などを受けて期間中に円高／アメリカドル安が進行しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当作成期間における各資産の配分比率は、投資顧問会社である「日興グローバルラップ株式会社」からの投資助言に従い、以下の比率をめどとしました。

資 産	当作成期間初～ 2022年10月4日	2022年10月5日～ 2022年11月2日	2022年11月4日～ 2022年12月2日	2022年12月5日～ 2023年2月2日	2023年2月3日～ 当作成期間末
高格付債券、高利回り債券、新興国債券	79.00%	77.00%	79.30%	77.30%	79.30%
世界株式	7.30%	8.00%	7.20%	7.90%	7.20%
世界高配当株式	13.70%	15.00%	13.50%	14.80%	13.50%

各投資対象資産の値動きや割安度、金融市場における投資家心理の変化などを総合的に考慮した結果、2022年10月5日、11月4日、12月5日、2023年2月3日の4度、資産配分（目標組入比率）を変更しました。2022年10月、12月の変更については、世界株式および世界高配当株式への投資配分を引き上げた一方、債券資産（高格付債券、高利回り債券、新興国債券）への投資配分を引き下げました。2022年11月、2023年2月の変更については、世界株式および世界高配当株式への投資配分を引き下げた一方、債券資産（高格付債券、高利回り債券、新興国債券）への投資配分を引き上げました。

（PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ（JPY））

金利戦略では、主要国の経済動向と金融政策のスタンスに着目しつつ、状況に応じて機動的に国別配分を行ないました。具体的には、デンマークなどの金利リスクを多めとしつつ、米国、ユーロ圏、日本の金利リスクについては期間を通じて少なめとしました。セクター戦略では、米国国債対比で割安となった政府系モーゲージ債への投資を増やしたほか、金融機関の社債や新興国債券の中でもリスクを考慮しても魅力的な利回りを提供する銘柄を厳選し投資を継続しました。通貨配分戦略では、各国の経済状況や利回りの高さなどを考慮し、相対的に投資妙味のある日本円やオーストラリアドル、ノルウェークローネなどの投資比率を多めとしました。

上記の結果、デンマークの金利リスクを多めとしたことなどがマイナスの影響となりましたが、米国や欧州などの金利リスクを少なめとしたことなどがプラスの寄与となり、期間を通じては市場を上回るパフォーマンスとなりました。

（PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ（JPY））

期間中、多くの企業が手元資金の確保に努めてきており、デフォルト（債務不履行）率は当面低位で推移するとみておりました。一方で、欧米の中央銀行が積極的な金融引き締めを進めていることなどをを受けて、企業収益が圧迫される可能性が高まっている点には注視する必要があると考えていました。

上述の見通しの下、当戦略は慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行ないました。具体的には、経済活動の再開以降に個人消費が持ち直していることなどから消費財などへの投資比率を多めとしました。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進むなかで構造的な変化に直面している電力、eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売への投資比率を低く抑えました。消極姿勢とした不動産のパフォーマンスが相対的に軟調となったことなどがプラスに寄与しました。

（PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド）（JPY）

メキシコ（債券）やブラジル（通貨）への積極姿勢などがマイナスに影響した一方、南アフリカ（債券）への積極姿勢やトルコ（通貨）に対する消極姿勢がプラスに寄与しました。

（キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC））

期間中は、「一般消費財・サービス」セクターや「ヘルスケア」セクターの銘柄選択などが相対的なプラス要因となりました。一方、「金融」や「エネルギー」セクターの銘柄選択などはマイナス要因となりました。

（グローバル高配当株式マザーファンド）

ポートフォリオの構成については、国別では配当が魅力的でキャッシュフローの安定した銘柄が多くあると考えている米国（米国上場の他国株式を除く）の組入比率を約60%とし、また欧州（含む英国）は約25%としました。欧州地域は、配当利回り面での魅力度が高いと判断した銘柄を中心に保有しました。

セクター別では、ヘルスケアや金融セクターなどの組入比率を高めにしました。これらのセクターは、企業の財務状況が健全で、堅調なキャッシュフローに支えられ、配当の安定性や成長が見込めるものと判断しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第97期	第98期	第99期
	2022年9月16日～ 2022年11月15日	2022年11月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年3月15日
当期分配金	70	70	70
（対基準価額比率）	1.154%	1.211%	1.187%
当期の収益	63	65	70
当期の収益以外	6	4	—
翌期繰越分配対象額	1,940	1,936	1,941

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

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

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、原則として、「PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券、「PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券、「PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ（JPY）」受益証券、「キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC）」投資証券および「グローバル高配当株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて分散投資を行ないます。

（PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ（JPY））

金利戦略においては、各国中央銀行の動向を踏まえ、ファンド全体でのデュレーション（金利感応度）は市場対比でアンダーウェイトとし、国・地域・年限間の相対価値を重視して投資します（デンマークのオーバーウェイトに対し、日本、米国、ユーロ圏をアンダーウェイト）。また、セクター戦略については社債や資産担保証券の中で、リスクを考慮しても魅力的と考えられる利回りを提供する銘柄に選択的に投資していきます。通貨戦略については、各国の経済状況、利回りの高さなどを考慮し、相対的に投資妙味のある日本円やオーストラリアドル、ノルウェークローネなどのオーバーウェイトを継続します。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ（JPY））

グローバル・ハイイールド債券市場については、多くの企業が手元資金の確保に努めてきており、デフォルト率は当面低位で推移するとみています。一方で、欧米の中央銀行が積極的な金融引き締めを進めていることなどを受けて景気後退のリスクが高まっていることから、2023年にはデフォルト率は緩やかに上昇するとみています。上述の見通しの下、当戦略は慎重な姿勢を維持しながらも、投資妙味のある業種・銘柄の選別を行なう方針です。具体的には、経済活動の再開以降に個人消費が持ち直していることなどから消費財への投資比率を多めとします。一方、低炭素社会の実現に向けた取り組みがグローバルに進むなかで構造的な変化に直面している電力、eコマース市場の拡大が加速するなか、対面販売への依存度が高い一部の小売への投資比率を低く抑える方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ（JPY））

新興国では、ブラジルをはじめとする一部の国ではFRBに先立って利上げを開始したことに加え、資源価格の上昇が落ち着いてきたことなどからインフレがピークアウトの兆しを見せており、2023年の成長率は2022年からやや持ち直すとの見通しです。また、エマージング債券市場ではスプレッド（利回り格差）が相応に拡大していることや、実質金利が上昇していることなどが今後のパフォーマンスを下支えすると期待されます。一方で、米国などの金融政策の見通しが明確になるまでは投資対象の選別をより慎重に行なう必要があると考えています。

こうした見通しの下、債券の国別選択では、インフレ率がピークを迎え、今後低下が見込まれるメキシコや、資源の産出による恩恵が期待でき、中央銀行の信頼性も高いブラジルなどを積極姿勢とします。通貨については、堅調な商品市況などを背景に投資妙味が高いとみてインドネシアルピアやメキシコペソを積極姿勢とします。一方、中央銀行に対する信頼性が懸念されるトルコリラを消極姿勢とします。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC））

強固な財務体質を持つ企業や、革新的な技術力で高い収益成長が期待できる企業など、中長期的に見て魅力的な銘柄に投資していく方針です。今後も、世界各国の経済および市場動向を注視しながら、長期的な視点と徹底した企業調査による個別銘柄選択に基づいた世界株式運用を継続していく方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

（グローバル高配当株式マザーファンド）

引き続き、配当ならびにキャッシュフローが安定的かつ魅力的と判断する企業への投資に注力する方針です。原則としてファンダメンタル・リサーチによって、長期的な収益力とキャッシュフローを生み出す力を持った企業の発掘に努めていきます。これらの企業の本源的価値と市場価格を比較することで、優れたキャッシュフローを生み出す力を持ち、配当が安定的または成長しているにもかかわらず、株価が割安に放置されていると考えられる銘柄を見極めます。配当水準が高く、中長期的に配当の増加および株価の上昇が見込める企業を厳選し、投資を行なう方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2022年 9 月 16 日～2023年 3 月 15 日）

項 目	第97期～第99期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 43	% 0.727	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(26)	(0.433)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(16)	(0.278)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.016)	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	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 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
（ 株 式 ）	(0)	(0.002)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 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
（ 株 式 ）	(0)	(0.002)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.026	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.017)	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及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 ）	(0)	(0.005)	印刷費用は、法定開示資料の印刷に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	45	0.757	
作成期間の平均基準価額は、5,928円です。			

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

（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

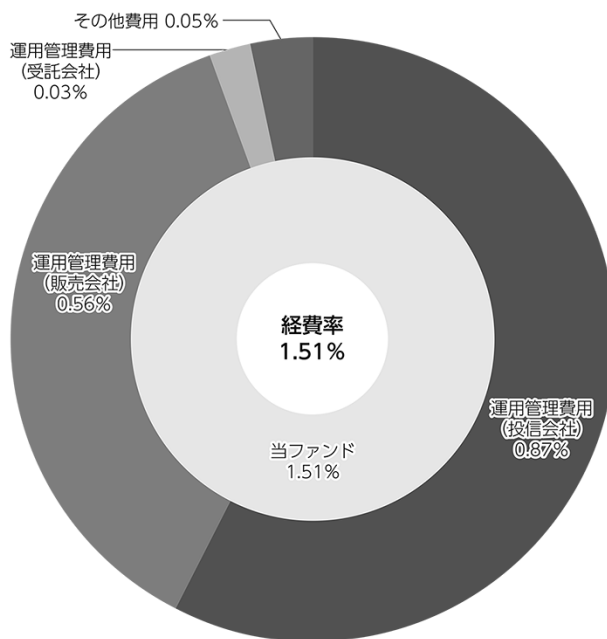
（注）売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.51%です。



(単位:%)

経費率(①+②)	1.51
①当ファンドの費用の比率	1.51
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—

(注) 当ファンドの費用は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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（親投資信託を除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2022年9月16日～2023年3月15日)

投資信託証券

銘柄		第97期～第99期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ (JPY)	184	568,602	178	552,078
	PIMCOグローバルハイールドストラテジーファンドJ (JPY)	168	686,504	164	666,542
	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ (JPY)	308	646,580	300	627,780
	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド (LUX) (クラスC)	37	246,757	58	396,176
合計		698	2,148,444	701	2,242,578

(注) 金額は受け渡し代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄		第97期～第99期			
		設定		解約	
		口数	金額	口数	金額
グローバル高配当株式マザーファンド		138,708	438,633	228,280	757,794

○株式売買比率

(2022年9月16日～2023年3月15日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	第97期～第99期	
	グローバル高配当株式マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	2,236,650千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	2,744,556千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.81	

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月16日～2023年3月15日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2022年9月16日～2023年3月15日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年9月16日～2023年3月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年3月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	第96期末		第99期末			
		口	数	口	数	評 価 額	比 率
			千口		千口	千円	%
PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ (JPY)			1,546		1,552	4,600,960	23.2
PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ (JPY)			1,608		1,612	6,411,540	32.3
PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ (JPY)			2,133		2,141	4,360,735	21.9
キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド (LUX) (クラスC)			231		210	1,415,317	7.1
合	計		5,520		5,516	16,788,553	84.5

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

親投資信託残高

銘	柄	第96期末		第99期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			千口		千口	千円
グローバル高配当株式マザーファンド			895,868		806,296	2,644,088

(注) 親投資信託の2023年3月15日現在の受益権総口数は、809,246千口です。

○投資信託財産の構成

（2023年3月15日現在）

項 目	第99期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	15,373,236	76.3
投資証券	1,415,317	7.0
グローバル高配当株式マザーファンド	2,644,088	13.1
コール・ローン等、その他	722,804	3.6
投資信託財産総額	20,155,445	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) グローバル高配当株式マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（2,664,246千円）の投資信託財産総額（2,682,371千円）に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売相場場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=134.62円、1カナダドル=98.35円、1ユーロ=144.54円、1イギリスポンド=163.67円、1スイスフラン=147.25円、1スウェーデンクローナ=12.88円、1ノルウェークローネ=12.75円、1デンマーククローネ=19.41円、1チェココルナ=6.0795円、1オーストラリアドル=89.97円、1ニュージーランドドル=83.87円、1香港ドル=17.15円、1シンガポールドル=100.02円、1南アフリカランド=7.43円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第97期末	第98期末	第99期末
	2022年11月15日現在	2023年1月16日現在	2023年3月15日現在
	円	円	円
(A) 資産	20,915,093,889	19,979,766,276	20,155,445,430
コール・ローン等	482,236,927	716,983,047	691,451,708
投資信託受益証券(評価額)	15,829,422,668	14,850,499,099	15,373,236,659
投資証券(評価額)	1,482,259,644	1,536,548,534	1,415,317,100
グローバル高配当株式マザーファンド(評価額)	2,822,891,944	2,875,735,596	2,644,088,371
未収入金	298,282,706	—	31,351,592
(B) 負債	340,435,575	417,052,648	288,455,020
未払金	—	125,879,085	—
未払収益分配金	240,159,663	239,726,953	238,756,761
未払解約金	48,826,630	5,345	1,474,687
未払信託報酬	50,939,213	50,578,754	47,042,617
未払利息	822	456	365
その他未払費用	509,247	862,055	1,180,590
(C) 純資産総額(A-B)	20,574,658,314	19,562,713,628	19,866,990,410
元本	34,308,523,337	34,246,707,648	34,108,108,726
次期繰越損益金	△13,733,865,023	△14,683,994,020	△14,241,118,316
(D) 受益権総口数	34,308,523,337口	34,246,707,648口	34,108,108,726口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,997円	5,712円	5,825円

(注) 当ファンドの第97期首元本額は34,671,090,460円、第97～99期中追加設定元本額は628,354,741円、第97～99期中一部解約元本額は1,191,336,475円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第97期0.5997円、第98期0.5712円、第99期0.5825円です。

(注) 2023年3月15日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は14,241,118,316円です。

○損益の状況

項 目	第97期	第98期	第99期
	2022年9月16日～ 2022年11月15日	2022年11月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年3月15日
	円	円	円
(A) 配当等収益	260,547,157	260,481,016	266,843,457
受取配当金	260,576,779	260,514,156	266,850,592
支払利息	△ 29,622	△ 33,140	△ 7,135
(B) 有価証券売買損益	△ 253,093,293	△ 944,059,880	402,167,133
売買益	112,099,842	1,624,540	408,394,975
売買損	△ 365,193,135	△ 945,684,420	△ 6,227,842
(C) 信託報酬等	△ 51,448,460	△ 51,084,398	△ 47,512,905
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 43,994,596	△ 734,663,262	621,497,685
(E) 前期繰越損益金	△ 9,274,800,506	△ 9,478,522,215	△10,348,021,078
(F) 追加信託差損益金	△ 4,174,910,258	△ 4,231,081,590	△ 4,275,838,162
(配当等相当額)	(1,693,684,227)	(1,723,552,022)	(1,746,071,011)
(売買損益相当額)	(△ 5,868,594,485)	(△ 5,954,633,612)	(△ 6,021,909,173)
(G) 計(D+E+F)	△13,493,705,360	△14,444,267,067	△14,002,361,555
(H) 収益分配金	△ 240,159,663	△ 239,726,953	△ 238,756,761
次期繰越損益金(G+H)	△13,733,865,023	△14,683,994,020	△14,241,118,316
追加信託差損益金	△ 4,174,910,258	△ 4,231,081,590	△ 4,275,838,162
(配当等相当額)	(1,693,697,202)	(1,723,581,095)	(1,746,079,042)
(売買損益相当額)	(△ 5,868,607,460)	(△ 5,954,662,685)	(△ 6,021,917,204)
分配準備積立金	4,964,632,671	4,908,733,209	4,877,790,056
繰越損益金	△14,523,587,436	△15,361,645,639	△14,843,070,210

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

(注) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 2022年9月16日～2023年3月15日の期間に、信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要した費用は54,642,848円です。

(注) 分配金の計算過程(2022年9月16日～2023年3月15日)は以下の通りです。

項 目	2022年9月16日～ 2022年11月15日	2022年11月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年3月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	216,878,047円	225,601,731円	257,071,044円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,693,697,202円	1,723,581,095円	1,746,079,042円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	4,987,914,287円	4,922,858,431円	4,859,475,773円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	6,898,489,536円	6,872,041,257円	6,862,625,859円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,010円	2,006円	2,011円
g. 分配金	240,159,663円	239,726,953円	238,756,761円
h. 分配金(1万口当たり)	70円	70円	70円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

	第97期	第98期	第99期
1 万口当たり分配金（税込み）	70円	70円	70円

○お知らせ

約款変更について

2022年9月16日から2023年3月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

種類・項目	PIMCOグローバル債券ストラテジーファンドJ(JPY)	
	バミューダ籍円建外国投資信託	
運用の基本方針		
基本方針	トータルリターンを最大化をめざして運用を行いません。	
主な投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、ファンドの純資産総額の90%以上を、日本を除く3カ国以上の発行体が発行する債券などに投資します。 ・ 投資可能な債券は、以下のものを含みます。 <ul style="list-style-type: none"> ○ 各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ○ 社債 ○ 政府および企業が発行したインフレ連動債 ○ 仕組債 ○ ローンおよびローン・パーティシペーション ○ 譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ○ 現先取引および逆現先取引 ○ 国際機関の債券 など 	
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとし、トータルリターンを最大化をめざします。 ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 原則として投資時において、Baa格(ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含みます。以下同じ。)以上の債券などに投資します。 ・ ポートフォリオの平均格付は、原則としてAa格以上とします。 ・ ファンドの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーション±2年以内で変動させるものとします。 ・ エマージング国の発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の10%まで可能とします。 ・ 1つの発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の5%を限度として投資することができます。ただし、各国政府、その政府の部局、政府系機関、政府系企業が発行し、または保証した債券などは、この限りではありません。また、クレジットリンク債、クレジット・デリバティブなどについては、参照資産を基礎として上記投資割合を算出します。 ・ ファンドは、全体のポートフォリオ運用戦略の一環として、または債券価格の下落を相殺するために、空売りを行なうことができます。 ・ ファンドは、先物取引などの派生商品に投資をすることができます。 ・ 借入れの合計金額が各ファンドの純資産総額の10%を越える借入残高が生じる借入れは行なえないものとします。 ・ 流動性の乏しい証券への投資は、ファンドの純資産総額の15%までとします。 ・ 優先株式などの有価証券に投資を行なう場合があります。 	
収益分配	毎月、利子収入および売買益などから分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	
ファンドに係る費用		
信託報酬など	ありません。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	ありません。	
その他の費用など	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用など。	
その他		
投資顧問会社	バシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
管理会社	バシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
信託期間	無期限(2006年10月31日設定)	
決算日	原則として、毎年6月末日	

●投資明細表(2022年6月30日現在)

<PIMCOグローバル債券ストラテジーファンド>

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 111.1%		
オーストラリア 3.6%		
社債等 0.0%		
Santos Finance Ltd.		
3.649% due 04/29/2031	\$ 100	\$ 85
モーゲージ証券 2.2%		
AFG Trust		
1.589% due 03/10/2053	AUD 686	466
Bluestone Sapphire XXV		
2.094% due 09/21/2053	439	298
Firstmac Mortgage Funding Trust		
2.329% due 12/10/2044	133	92
Firstmac Mortgage Funding Trust No.4		
1.831% due 02/19/2053	727	491
La Trobe Financial Capital Markets Trust		
1.743% due 01/14/2053	575	390
Liberty PRIME		
1.800% due 01/25/2053	612	414
Pepper I-Prime Trust		
1.685% due 07/15/2053	476	323
Pepper Residential Securities Trust No.30		
1.785% due 01/15/2063	573	389
Pepper Residential Securities Trust No.31		
1.688% due 04/23/2063	166	114
RedZed Trust		
1.640% due 06/09/2053	357	242
Resimac Premier		
1.623% due 02/13/2053	683	463
Securitized Australian Mortgage Trust		
1.811% due 02/20/2046	58	39
		3,721
ソブリン債 1.4%		
Australia Government Bond		
3.250% due 04/21/2029	3,300	2,233
South Australian Government Financing Authority		
1.750% due 05/24/2032	100	55
Treasury Corp. of Victoria		
4.250% due 12/20/2032	100	69
		2,357
Total Australia (Cost \$6,955)		6,163
バミューダ 0.1%		
社債等 0.1%		
Bacardi Ltd.		
4.700% due 05/15/2028	\$ 100	99
Total Bermuda (Cost \$98)		99
カナダ 0.4%		
ソブリン債 0.4%		
Province of Ontario		
7.500% due 02/07/2024	CAO 800	660
Total Canada (Cost \$701)		660

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ケイマン諸島 2.7%		
資産担保証券 1.9%		
AMMC CLO 20 Ltd.		
1.914% due 04/17/2029	\$ 352	\$ 348
Anchorage Capital CLO 9 Ltd.		
2.184% due 07/15/2032	500	488
Ares XXXIX CLO Ltd.		
2.094% due 04/18/2031	500	488
HERA Commercial Mortgage Ltd.		
2.662% due 02/18/2038	200	197
LoanCore Issuer Ltd.		
2.329% due 01/17/2037	500	486
Mountain View CLO LLC		
2.084% due 01/16/2031	500	490
Nassau Ltd.		
2.194% due 10/15/2029	227	225
Vibrant CLO IV Ltd.		
2.183% due 07/20/2032	500	486
		3,208
社債等 0.8%		
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.		
4.600% due 03/27/2024 (a)	800	803
Sands China Ltd.		
5.125% due 08/08/2025	300	252
5.400% due 08/08/2028	200	154
Tencent Holdings Ltd.		
3.975% due 04/11/2029	200	190
		1,399
Total Cayman Islands (Cost \$4,852)		4,607
チリ 0.5%		
ソブリン債 0.5%		
Chile Government International Bond		
2.450% due 01/31/2031	600	513
2.550% due 01/27/2032	400	341
Total Chile (Cost \$966)		854
中国 3.9%		
ソブリン債 3.9%		
China Development Bank		
3.400% due 01/08/2028	CNY 4,300	656
4.040% due 04/10/2027	3,500	549
4.040% due 07/06/2028	10,600	1,673
China Government International Bond		
2.370% due 01/20/2027	2,600	384
2.850% due 06/04/2027	750	113
3.010% due 05/13/2028	9,300	1,408
3.390% due 03/16/2050	900	135
3.530% due 10/18/2051	700	109
3.720% due 04/12/2051	7,900	1,260
3.810% due 09/14/2050	1,500	242
Total China (Cost \$6,595)		6,529

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
デンマーク 4.1%		
社債等 4.1%		
Jyske Realkredit AJS		
1.000% due 10/01/2050	DKK 2,547	\$ 281
1.500% due 10/01/2050	125	14
1.500% due 10/01/2053	298	34
2.000% due 10/01/2050	8	1
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
1.000% due 10/01/2050	2,752	305
1.500% due 10/01/2050	1,265	144
1.500% due 10/01/2053	398	45
2.000% due 10/01/2050	17	2
2.500% due 10/01/2047	5	1
Nykredit Realkredit AJS		
1.000% due 10/01/2050	3,986	429
1.000% due 10/01/2053	98	11
1.500% due 10/01/2050	389	44
1.500% due 10/01/2053	12,536	1,391
2.000% due 10/01/2050	223	28
3.000% due 10/01/2047	3	1
3.000% due 10/01/2053	21,700	2,851
Realkredit Danmark AJS		
1.000% due 10/01/2050	984	108
1.000% due 10/01/2053	198	21
1.500% due 10/01/2053	10,371	1,142
2.500% due 04/01/2036	27	4
2.500% due 04/01/2047	8	1
Total Denmark (Cost \$8,541)		6,858
フランス 1.3%		
社債等 0.6%		
BNP Paribas S.A.		
2.871% due 04/19/2032	\$ 700	579
5.198% due 01/10/2030	200	200
7.000% due 08/16/2028 (a)(b)	200	190
		969
ソブリン債 0.7%		
France Government Bond		
0.750% due 05/25/2052	EUR 720	478
2.000% due 05/25/2048	864	827
		1,305
Total France (Cost \$3,114)		2,274
ドイツ 0.5%		
社債等 0.5%		
Deutsche Bank AG		
1.750% due 11/19/2030	100	86
3.035% due 05/28/2032 (h)	\$ 400	317
3.547% due 09/18/2031	300	251
3.961% due 11/26/2025	200	194
Total Germany (Cost \$1,003)		848
香港 0.2%		
社債等 0.2%		
Lenovo Group Ltd.		
3.421% due 11/02/2030	200	170
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.		
4.150% due 04/18/2023	200	199

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total Hong Kong (Cost \$410)	\$	369
インドネシア 0.1%		
ソブリン債 0.1%		
Indonesia Government International Bond		
5.125% due 01/15/2045	\$	200
Total Indonesia (Cost \$251)		192
アイルランド 1.8%		
資産担保証券 1.7%		
Accunia European CLO I DAC		
0.950% due 07/15/2030	EUR	90
Aurium CLO IV DAC		
0.730% due 01/18/2031		300
Cairn CLO IV DAC		
0.600% due 04/30/2031		200
Carlisle Euro CLO DAC		
0.890% due 08/15/2032		500
Contego CLO IV DAC		
0.640% due 01/23/2030		100
Harvest CLO XXII DAC		
0.850% due 01/15/2032		200
Invesco Euro CLO I DAC		
0.650% due 07/15/2031		200
Jubilee CLO XI DAC		
0.610% due 04/15/2030		200
OCP Euro CLO DAC		
0.880% due 09/22/2034		500
Palmer Square European Loan Funding DAC		
0.780% due 04/15/2031		554
		2,908
社債等 0.1%		
AerCap Ireland Capital DAC		
2.450% due 10/29/2026	\$	200
Total Ireland (Cost \$3,565)		3,082
イスラエル 0.3%		
ソブリン債 0.3%		
Israel Government International Bond		
2.750% due 07/03/2030		300
3.375% due 01/15/2050		200
Total Israel (Cost \$540)		441
イタリア 0.2%		
社債等 0.2%		
AMCO - Asset Management Co. SpA		
1.500% due 07/17/2023	EUR	100
UniCredit SpA		
5.458% due 06/30/2035	\$	200
		267
ソブリン債 0.0%		
Italy Buoni Poliennali del Tesoro		
2.800% due 03/01/2067	EUR	46
		38

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total Italy (Cost \$381)	\$	305
日本 1.8%		
社債等 1.6%		
East Japan Railway Co.		
0.773% due 09/15/2034	EUR	100
1.104% due 09/15/2039		100
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.		
2.309% due 07/20/2032	\$	400
3.407% due 03/07/2024		150
3.741% due 03/07/2029		200
Nippon Life Insurance Co.		
5.000% due 10/18/2042		400
Nissan Motor Co. Ltd.		
2.652% due 03/17/2026	EUR	100
3.201% due 09/17/2028		100
4.345% due 09/17/2027	\$	300
4.810% due 09/17/2030		400
Nomura Holdings, Inc.		
2.172% due 07/14/2028		400
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
4.436% due 04/02/2024 (a)		300
		2,678
ソブリン債 0.2%		
Japan Government International Bond		
0.700% due 06/20/2051	¥	53,000
Total Japan (Cost \$3,545)		3,021
ルクセンブルク 0.0%		
社債等 0.0%		
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.		
3.125% due 11/17/2030	EUR	200
Total Luxembourg (Cost \$237)		89
マレーシア 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Malaysia Government International Bond		
4.736% due 03/15/2046	MYR	200
4.893% due 06/08/2038		100
Total Malaysia (Cost \$78)		67
多国籍 0.2%		
社債等 0.2%		
Delta Air Lines, Inc.		
4.750% due 10/20/2028	\$	300
Total Multinational (Cost \$332)		284
オランダ 0.4%		
社債等 0.3%		
ING Groep NV		
4.550% due 10/02/2028		200
4.875% due 05/16/2029 (a)(b)		200
JT International Financial Services BV		
3.875% due 09/28/2028		200
		193
		552

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
モーゲージ証券 0.1%		
Dutch Property Finance BV		
0.235% due 07/28/2058	EUR	95
	\$	98
Total Netherlands (Cost \$708)		650
ノルウェー 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Norway Government Bond		
1.750% due 03/13/2025	NOK	600
		59
Total Norway (Cost \$74)		59
ペルー 0.2%		
ソブリン債 0.2%		
Peru Government International Bond		
5.940% due 02/12/2029	PEN	700
6.350% due 08/12/2028		100
6.950% due 09/12/2031		400
Total Peru (Cost \$407)		293
カタール 0.3%		
社債等 0.2%		
Qatar Energy		
3.125% due 07/12/2041	\$	300
		236
ソブリン債 0.1%		
Qatar Government International Bond		
4.625% due 06/02/2046		200
		199
Total Qatar (Cost \$560)		435
ルーマニア 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Romania Government International Bond		
3.875% due 10/29/2035	EUR	100
		78
Total Romania (Cost \$110)		78
サウジアラビア 0.5%		
社債等 0.2%		
Saudi Arabian Oil Co.		
2.250% due 11/24/2030	\$	400
		341
ソブリン債 0.3%		
Saudi Government International Bond		
3.625% due 03/04/2028		300
4.500% due 10/26/2046		200
		297
		183
		480
Total Saudi Arabia (Cost \$917)		821
シンガポール 1.1%		
社債等 0.1%		
BOC Aviation Ltd.		
3.500% due 01/31/2023		200
		200
ソブリン債 1.0%		
Singapore Government Bond		
1.625% due 07/01/2031	SGD	900
2.875% due 07/01/2029		1,400
		1,005
		1,584

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total Singapore (Cost \$1,962)	\$	1,784
韓国 1.5%		
ソブリン債 1.5%		
Korea Treasury Bond		
1.250% due 03/10/2026	KRW 936,000	665
2.125% due 06/10/2027	1,070,300	770
2.375% due 12/10/2027	270,000	196
2.625% due 06/10/2028	1,220,400	892
5.500% due 12/10/2029	69,400	60
Total South Korea (Cost \$3,073)		2,583
スペイン 1.1%		
ソブリン債 1.1%		
Spain Government Bond		
1.250% due 10/31/2030	EUR 190	184
1.450% due 04/30/2029	780	787
1.450% due 10/31/2071	397	233
3.450% due 07/30/2066	530	577
Total Spain (Cost \$2,438)		1,781
国際機関 0.2%		
ソブリン債 0.2%		
European Investment Bank		
0.500% due 07/21/2023	AUD 300	200
0.500% due 08/10/2023	200	133
Total Supranational (Cost \$423)		333
スイス 1.5%		
社債等 1.5%		
Credit Suisse AG		
6.500% due 08/08/2023 (a)	\$ 1,300	1,303
Credit Suisse Group AG		
4.194% due 04/01/2031	500	443
UBS AG		
7.625% due 08/17/2022 (a)	550	552
UBS Group AG		
2.659% due 08/15/2023	300	300
Total Switzerland (Cost \$2,735)		2,598
タイ 0.1%		
ソブリン債 0.1%		
Thailand Government Bond		
1.585% due 12/17/2035	THB 11,200	257
Total Thailand (Cost \$310)		257
アラブ首長国連邦 0.3%		
社債等 0.1%		
DAE Sukuk (DIFC) Ltd.		
3.750% due 02/15/2026	\$ 200	190
ソブリン債 0.2%		
Abu Dhabi Government International Bond		
3.875% due 04/16/2050	400	358

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total United Arab Emirates (Cost \$659)	\$	546
英国 7.3%		
社債等 2.3%		
Barclays Bank PLC		
7.625% due 11/21/2022 (a)	\$ 400	404
Barclays PLC		
3.650% due 03/16/2025	400	392
7.125% due 06/15/2025 (a)(b)	GBP 200	234
7.750% due 09/15/2023 (a)(b)	\$ 200	197
HSBC Holdings PLC		
1.750% due 07/24/2027	GBP 200	218
2.804% due 05/24/2032	\$ 200	164
4.750% due 07/04/2029 (a)(b)	EUR 200	176
5.250% due 09/16/2022 (a)(b)	200	207
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	200	207
6.000% due 05/22/2027 (a)(b)	\$ 200	180
Imperial Brands Finance PLC		
3.500% due 07/26/2026	300	281
NatWest Group PLC		
4.445% due 05/08/2030	300	283
5.076% due 01/27/2030	200	196
Standard Chartered PLC		
1.456% due 01/14/2027	400	353
7.750% due 04/02/2023 (a)(b)	200	198
Weir Group PLC		
2.200% due 05/13/2026	300	264
		3,954
モーゲージ証券 2.0%		
Avon Finance No.2 PLC		
2.014% due 09/20/2048	GBP 448	542
Canada Square Funding PLC		
2.024% due 06/17/2058	91	109
Eurotail PLC		
0.000% due 12/15/2044	EUR 300	307
Finsbury Square PLC		
1.565% due 12/16/2071	GBP 486	581
Hawksmoor Mortgages		
1.703% due 05/25/2053	162	197
Lanebrook Mortgage Transaction PLC		
1.111% due 07/20/2058	98	116
London Wall Mortgage Capital PLC		
1.351% due 05/15/2051	177	212
Pierpont BTL PLC		
1.582% due 12/22/2053	195	232
Polaris PLC		
1.730% due 12/23/2058	94	113
Towd Point Mortgage Funding Auburn 14 PLC		
1.883% due 05/20/2045	423	512
Towd Point Mortgage Funding Granite4 PLC		
1.605% due 10/20/2051	49	59
Tower Bridge Funding PLC		
1.763% due 11/20/2063	94	113
Trinity Square PLC		
1.300% due 07/15/2059	161	194
Twin Bridges PLC		
1.893% due 03/12/2055	92	109
		3,396

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ソブリン債 3.0%		
United Kingdom Gilt		
1.250% due 07/22/2027	GBP 2,600	\$ 3,057
4.250% due 12/07/2040	1,347	2,020
		5,077
Total United Kingdom (Cost \$14,465)		12,427
米国 40.6%		
資産担保証券 1.8%		
Credit Acceptance Auto Loan Trust		
1.370% due 07/16/2029	\$ 700	690
Landmark Funding Trust		
2.000% due 04/20/2032	700	602
Mariner Finance Issuance Trust		
2.100% due 11/20/2036	700	618
Navient Private Education Refi Loan Trust		
2.120% due 01/15/2069	60	56
Navient Student Loan Trust		
2.774% due 03/25/2066	531	524
SMB Private Education Loan Trust		
1.600% due 09/15/2054	587	535
		3,025
社債等 8.2%		
AbbVie, Inc.		
3.200% due 11/21/2029	300	276
AES Corp.		
2.450% due 01/15/2031	200	161
Amgen, Inc.		
3.350% due 02/22/2032	300	275
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.		
5.550% due 01/23/2049	100	102
AT&T, Inc.		
2.250% due 02/01/2032	50	41
3.550% due 09/15/2055	118	89
Aviation Capital Group LLC		
4.125% due 08/01/2025	100	95
5.500% due 12/15/2024	100	99
Bank of America Corp.		
2.687% due 04/22/2032	300	252
3.384% due 04/02/2026	400	388
3.419% due 12/20/2028	415	387
4.571% due 04/27/2033	500	467
Black Hills Corp.		
2.500% due 06/15/2030	100	84
Boeing Co.		
2.750% due 02/01/2026	50	47
3.600% due 05/01/2034	100	80
3.625% due 02/01/2031	50	43
Boston Scientific Corp.		
2.650% due 06/01/2030	300	262
British Airways 2018-1 Class A Pass-Through Trust		
4.125% due 09/20/2031	76	69
Broadcom, Inc.		
2.450% due 02/15/2031	50	40
3.419% due 04/15/2033	100	83
3.469% due 04/15/2034	300	245
4.150% due 04/15/2032	300	271
4.300% due 11/15/2032	48	44

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust		
1.754% due 05/25/2037 (c)	\$ 332	\$ 264
Sequoia Mortgage Trust		
2.602% due 04/20/2035	7	7
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
2.064% due 05/25/2037	29	26
2.513% due 04/25/2034	17	16
2.543% due 02/25/2034	14	14
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
2.044% due 05/25/2036	47	38
2.295% due 03/19/2034	8	8
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
2.562% due 04/25/2035	6	6
2.244% due 01/25/2045	7	7
2.368% due 03/25/2033	65	63
2.462% due 03/25/2034	44	44
3.220% due 06/25/2033	8	8
		3,057
地方債 0.2%		
Illinois, Electric Agency Revenue Bonds, Series 2009		
6.832% due 02/01/2035	200	229
仕組債 0.2%		
JPMorgan Structured Products BV		
6.375% due 04/19/2032 IDR 5,922,000		376
米国政府機関債 14.0%		
Fannie Mae		
2.281% due 02/01/2036	\$ 21	21
4.000% due 12/01/2025	11	12
4.000% due 02/01/2026	25	25
4.000% due 06/01/2048	37	37
4.000% due 09/01/2048	66	66
4.500% due 06/01/2038	49	50
6.000% due 12/01/2037	7	8
Fannie Mae, TBA (d)		
3.000% due 08/01/2052	8,800	8,190
3.500% due 08/01/2052	8,200	7,879
4.000% due 08/01/2052	6,900	6,794
Freddie Mac		
6.000% due 12/01/2033	81	84
6.000% due 04/15/2036	92	100
Ginnie Mae		
3.000% due 04/20/2047	169	162
3.500% due 01/20/2048	187	183
5.000% due 02/15/2039	84	89
		23,700
米国財務省証券 14.4%		
Treasury Inflation Protected Securities		
0.750% due 02/15/2045 (e)(k)	333	299
U.S. Treasury Bonds		
1.625% due 11/15/2050	1,132	797
1.875% due 02/15/2041	6,150	4,826
1.875% due 11/15/2051	600	450
2.000% due 11/15/2041	300	238
2.250% due 02/15/2052	300	247
2.375% due 02/15/2042	1,800	1,527
2.500% due 02/15/2045	134	114
2.875% due 05/15/2043	1	1
2.875% due 05/15/2052	400	378
3.625% due 08/15/2043	221	228
4.375% due 05/15/2041	237	271

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
U.S. Treasury Notes		
0.375% due 04/30/2025	\$ 50	46
2.750% due 08/31/2023	7,000	6,985
2.750% due 02/28/2025	8,000	7,945
		24,352
Total United States		68,658
(Cost \$73,384)		
短期金融商品 34.2%		
レボ契約 (i) 10.0%		16,918
定期預金 0.6%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
0.250% due 07/01/2022 AUD	36	25
0.250% due 07/01/2022 NZD	148	92
1.060% due 07/01/2022 \$	3	3
Bank of Nova Scotia		
0.560% due 07/04/2022 CAD	190	148
1.060% due 07/01/2022 \$	5	5
BNP Paribas Bank		
1.200% due 07/01/2022 CHF	26	27
0.780% due 07/01/2022 EUR	106	111
0.730% due 07/01/2022 DKK	4	1
0.370% due 07/04/2022 HKD	7	1
0.520% due 07/01/2022 GBP	3	4
Brown Brothers Harriman & Co.		
0.360% due 07/01/2022 ¥	3	0
0.005% due 07/01/2022 SEK	3	0
0.070% due 07/01/2022 NOK	3	0
Citibank N.A.		
1.060% due 07/01/2022 \$	18	18
DBS Bank Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	16	16
HSBC Bank PLC		
0.780% due 07/01/2022 EUR	37	39
0.520% due 07/01/2022 GBP	43	52
JPMorgan Chase Bank N.A.		
1.060% due 07/01/2022 \$	37	37
MUFG Bank Ltd.		
0.360% due 07/01/2022 ¥	2,627	19
Royal Bank of Canada		
1.060% due 07/01/2022 \$	2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
0.780% due 07/01/2022 EUR	102	107
0.360% due 07/01/2022 ¥	2,231	16
1.060% due 07/01/2022 \$	16	16
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
0.780% due 07/01/2022 EUR	12	12
0.360% due 07/01/2022 ¥	10,254	75
0.520% due 07/01/2022 GBP	5	6
1.060% due 07/01/2022 \$	35	35
The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd.		
0.370% due 07/04/2022 HKD	252	32
0.650% due 07/01/2022 SGD	224	161
		1,060
日本短期国債 18.3%		
0.184% due 09/26/2022 (f) ¥	310,000	2,283
0.147% due 09/20/2022 (g)	530,000	3,903
0.138% due 08/08/2022 (f)	250,000	1,840

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
0.122% due 08/15/2022 (f) ¥	170,000	1,252
0.121% due 08/22/2022 (f)	280,000	2,061
0.119% due 08/01/2022 (f)	170,000	1,251
0.115% due 07/25/2022 (g)	220,000	1,620
0.106% due 08/29/2022 (g)	1,100,000	8,099
0.098% due 07/11/2022 (f)	160,000	1,178
0.094% due 09/12/2022 (f)	690,000	5,080
0.082% due 07/04/2022 (f)	320,000	2,355
		30,922
米国短期国債 (f) 5.3%		
0.634% due 07/19/2022 \$	4,000	3,998
0.652% due 07/05/2022	3,000	3,000
0.737% due 07/12/2022	1,900	1,899
		8,897
Total Short-Term Instruments		57,797
(Cost \$59,501)		
Total Investments in Securities 111.0%		\$ 187,842
(Cost \$203,890)		
Financial Derivative		
Instruments (j)(l) 0.7%		1,170
(Cost or Premiums, net \$(97))		
Other Assets and Liabilities, net (11.7%)		(19,776)
Net Assets 100.0%		\$ 169,236

投資明細表に対する注記：

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

- (a) 偶発転換社債
 (b) 永久債(記載の日付は次回の契約上の償還日)である。
 (c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
 (d) 発行日前取引証券
 (e) 当有価証券の元本金額は、インフレの状況にあわせて調整される。
 (f) クーポンは最終利回りである。
 (g) クーポンは加重平均最終利回りである。

(h) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価値の 対純資産比率
Citigroup, Inc.	2.572%	06/03/2031	06/09/2022	\$ 428	\$ 421	0.25%
Deutsche Bank AG	3.035%	05/28/2032	07/27/2021	414	317	0.19%
Oracle Corp.	3.950%	03/25/2051	07/27/2021	111	74	0.04%
Oracle Corp.	4.100%	03/25/2061	04/15/2021	89	57	0.03%
Total Restricted Securities				\$ 1,042	\$ 869	0.51%

借入およびその他の金融取引

(i) レポ契約：

取引相手	貸付金利	決済日	満期日	額面金額	担保	受入担保 (公正価値)	レポ契約 (公正価値)	レポ契約に係る 未収金 ⁽¹⁾
BPS	(0.560%)	06/10/2022	09/08/2022	EUR 4,800	Belgium Government Bond 2.150% due 06/22/2066			
SAL	1.480%	06/30/2022	07/01/2022	\$ 11,900	U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0.750% due 07/15/2028 U.S. Treasury Notes 3.000% due 06/30/2024	\$ (5,029) (12,137)	\$ 5,018 11,900	\$ 5,011 11,901
Total Repurchase Agreements						\$ (17,166)	\$ 16,918	\$ 16,912

売建有価証券：

取引相手	種別	クーポン	満期日	元本金額	手取金	売建に係る 未払金
BOS	Fannie Mae, TBA	2.000%	08/01/2052	\$ 5,840	\$ (5,064)	\$ (5,065)
BOS	Fannie Mae, TBA	2.500%	08/01/2052	520	(467)	(467)
Total Short Sales (3.3%)					\$ (5,531)	\$ (5,532)

借入およびその他の金融取引契約

以下は、2022年6月30日現在の借入およびその他の金融取引、ならびに差し入れた(受領した)担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

取引相手	レポ契約 に係る 未収金	リバース・レポ 契約に係る 未払金	セール・バイバック 取引に係る 未払金	売建に係る 未払金	借入および その他の 金融取引合計	差入(受入) 担保	ネット・ エクスポージャー ⁽²⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
BPS	\$ 5,011	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 5,011	\$ (5,150)	\$ (139)
SAL	11,901	0	0	0	11,901	(12,137)	(236)
Master Securities Forward Transactions Agreement							
BOS	0	0	0	(5,532)	(5,532)	0	(5,532)
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 16,912	\$ 0	\$ 0	\$ (5,532)			

(1) 未収利息を含む。

(2) ネット・エクスポージャーはデフォルト発生時の取引相手に対する未収金/未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引から発生するエクスポージャーは、同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。

2022年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は\$423で、加重平均金利は0.034%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(j) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

詳細	種類	期月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Australia Government 3-Year Bond September Futures	Short	09/2022	104	\$ (6)	\$ 0	\$ (35)
Australia Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	21	(6)	11	0
Canada Government 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	22	(67)	11	0
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	Long	09/2022	15	(1)	31	0
Euro-BTP 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	32	(90)	98	0
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Short	09/2022	42	179	0	(158)
Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures	Long	09/2022	4	(57)	29	0
Euro-OAT 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	1	(2)	3	0
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	Long	09/2022	63	(23)	42	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2022	4	4	0	(2)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2022	6	4	0	(3)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	29	(17)	20	0
U.S. Treasury 20-Year Bond September Futures	Short	09/2022	1	1	0	(1)
U.S. Treasury Ultra 10-Year Note September Futures	Long	09/2022	17	(20)	16	0
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	Long	09/2022	5	(18)	5	0
United Kingdom Treasury 10-Year Gilt September Futures	Long	09/2022	7	(35)	16	0
Total Futures Contracts				\$ (154)	\$ 282	\$ (199)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2022年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
AT&T, Inc.	1.000%	06/20/2026	1.142%	\$ 200	\$ (11)	\$ (5)	\$ 0	\$ 0
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	2.445%	300	(17)	(16)	0	0
British Telecommunications PLC	1.000%	12/20/2028	1.799%	EUR 100	(5)	(3)	0	(1)
					\$ (23)	\$ (24)	\$ 0	\$ (1)

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

指数／トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本 ⁽³⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.IG-37 Index	1.000%	12/20/2031	\$ 1,080	\$ (23)	\$ (19)	\$ 0	\$ 0
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2027	7,800	0	(92)	0	(2)
CDX.IG-38 Index	1.000%	06/20/2032	4,100	(106)	(54)	0	(1)
iTraxx Europe Series 37 Index	1.000%	06/20/2027	EUR 1,000	(9)	(11)	0	(3)
				\$ (138)	\$ (176)	\$ 0	\$ (6)

金利スワップ

変動金利 支払／受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	0.900%	03/10/2024	CAD 600	\$ (20)	\$ (20)	\$ 1	\$ 0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	1.000%	06/16/2026	1,200	(86)	(47)	2	0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	1.900%	12/18/2029	3,350	(286)	(293)	12	0
Pay	3-Month Canadian Bank Bill	2.200%	12/18/2049	550	(107)	(97)	3	0
Receive	3-Month Canadian Bank Bill	1.750%	06/17/2050	20	(5)	(6)	0	0
Pay ⁽⁵⁾	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	4.000%	06/14/2024	NZD 10,600	(18)	(1)	8	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	1.250%	12/15/2024	6,900	(285)	(214)	11	0
Pay	3-Month FRA New Zealand Bank Bill	3.750%	06/15/2027	1,000	(8)	(2)	3	0
Receive	3-Month SEK-STIBOR	0.750%	03/21/2023	SEK 2,000	1	4	0	0
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.500%	06/21/2024	\$ 2,400	81	154	0	(2)
Receive	3-Month USD-LIBOR	1.665%	01/12/2029	1,900	(146)	(146)	13	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.131%	01/11/2032	AUD 400	(42)	(42)	1	0
Pay	6-Month Australian Bank Bill	2.100%	01/18/2032	1,200	(129)	(103)	4	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.500%	12/15/2026	EUR 460	(24)	(40)	6	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	04/12/2027	1,050	(54)	(42)	13	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.650%	05/11/2027	800	(43)	(35)	11	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金		
							資産	負債	
Pay ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	(0.250%)	09/21/2027	EUR 10,100	\$ (1,099)	\$ (415)	\$ 133	\$ 0	
Pay ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	0.250%	09/21/2032	9,170	(1,763)	(372)	147	0	
Pay ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	0.500%	09/21/2052	800	(284)	(4)	21	0	
Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.500%	03/16/2027	CNY 23,100	(12)	(31)	4	0	
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.143%	02/19/2031	¥ 30,000	6	6	0	(1)	
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.200%	12/15/2041	10,000	9	6	0	0	
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.500%	03/15/2042	90,000	45	20	0	(2)	
Receive	Bank of Japan Uncollateralised Overnight Call Rate	0.800%	06/15/2052	90,000	43	39	0	(3)	
Pay	IBMEXID	5.970%	05/06/2030	MXN 2,800	(23)	(20)	0	0	
Receive ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	1.320%	12/21/2023	\$ 10,500	202	113	0	(14)	
Receive ⁽⁵⁾	Secured Overnight Financing Rate	1.050%	12/15/2024	5,400	205	97	0	(15)	
Pay	Secured Overnight Financing Rate	1.000%	06/15/2029	800	(90)	(17)	5	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	1.655%	05/04/2032	200	(19)	(19)	2	0	
Receive	Secured Overnight Financing Rate	2.365%	06/23/2032	1,500	(56)	(56)	13	0	
Pay	Singapore Overnight Index Average	3.000%	06/15/2027	SGD 7,700	77	50	0	(23)	
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.010%	02/07/2023	GBP 3,100	(59)	(59)	1	0	
Pay ⁽⁵⁾	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.750%	09/21/2032	900	(158)	6	0	0	
Pay	Swiss Overnight Rate Average	(0.500%)	09/15/2026	CHF 2,800	(185)	(162)	40	0	
						\$ (4,332)	\$ (1,748)	\$ 454	\$ (60)
Total Swap Agreements						\$ (4,493)	\$ (1,948)	\$ 454	\$ (67)

金融デリバティブ商品: 上場または中央清算要約

以下は、2022年6月30日現在の市場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

(k) 2022年6月30日現在、合計市場価格\$20の債券証券と\$2,537の現金が上場および中央清算金融デリバティブ商品の担保として差し入れられている。

	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債			
	市場価格		変動証拠金資産		市場価格		変動証拠金負債	
	買建オプション	先物	スワップ契約	合計	売建オプション	先物	スワップ契約	合計
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 282	\$ 454	\$ 736	\$ 0	\$ (199)	\$ (67)	\$ (266)

- (1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるからしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受け、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい現金決済を現金もしくは有価証券の形で支払う。
- (2) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を終結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
- (3) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
- (4) クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済/売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
- (5) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。

(l) 金融デリバティブ商品: 店頭

外国為替先渡契約:

取引相手	決済月	引渡通貨		受取通貨		未実現評価(損)益	
		資産	負債	資産	負債		
AZD	07/2022	AUD 98	\$ 68	\$ 1	\$ 0		
AZD	08/2022	\$ 68	AUD 98	0	(1)		
B0A	07/2022	AUD 139	\$ 97	1	0		
B0A	07/2022	JPY 320,000	AUD 2,630	275	0		
B0A	07/2022	\$ 421	AUD 597	0	(11)		

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損)益					
				資産	負債				
BDA	07/2022	\$	5,679	DKK	39,925	\$	0	\$	(66)
BDA	08/2022	CAD	152	\$	118		0		0
BDA	08/2022	DKK	39,844		5,679		67		0
BDA	08/2022	EUR	6,174		6,629		155		0
BDA	08/2022	JPY	250,000		1,925		81		0
BDA	08/2022	\$	97	AUD	139		0		(1)
BDA	08/2022		1,481	EUR	1,395		0		(19)
BDA	08/2022		809	GBP	648		0		(2)
BDA	08/2022		237	NOK	2,252		0		(8)
BDA	08/2022		748	SEK	7,400		0		(25)
BPS	07/2022	DKK	5,370	\$	778		23		0
BPS	07/2022	JPY	52,300		405		20		0
BPS	07/2022		170,000		1,350		97		0
BPS	07/2022	MXN	44		2		0		0
BPS	07/2022	NZD	167		105		1		0
BPS	07/2022	\$	188	DKK	1,319		0		(2)
BPS	07/2022		10	MXN	204		0		0
BPS	08/2022	CAD	121	\$	94		0		0
BPS	08/2022	THB	3		0		0		0
BPS	08/2022	\$	738	CAD	955		2		0
BPS	08/2022		8,245	EUR	7,804		0		(6)
BPS	08/2022		26	IDR	385,508		0		0
BPS	08/2022		177		2,623,154		0		(2)
BPS	09/2022	JPY	317,000	\$	2,373		28		0
BPS	09/2022	MXN	204		10		0		0
BRC	07/2022	JPY	160,000		1,313		135		0
BRC	07/2022	\$	1,914	JPY	259,593		0		(3)
BRC	08/2022	GBP	48	\$	59		1		0
BRC	08/2022	JPY	280,000		2,194		126		0
BRC	08/2022		259,171		1,914		3		0
BRC	08/2022		170,000		1,327		74		0
BRC	08/2022	SGD	220		159		1		0
BRC	08/2022	\$	29	IDR	424,160		0		0
BRC	08/2022		163	NOK	1,596		0		(1)
BRC	08/2022		35	SEK	343		0		(1)
BRC	09/2022	JPY	373,000	\$	2,792		32		0
CBK	08/2022	IDR	4,197,862		285		5		0
CBK	11/2022	PEN	768		194		0		(6)
CBK	11/2022	\$	139	PEN	552		4		0
CBK	12/2022		76		320		7		0
CBK	02/2023	PEN	1,121	\$	282		0		(7)
DUB	07/2022	DKK	6,799		1,007		51		0
DUB	07/2022	\$	292	PLN	1,275		0		(9)
DUB	08/2022	GBP	1,091	\$	1,346		20		0
DUB	08/2022	\$	24,446	EUR	23,022		0		(305)
DUB	08/2022		54	THB	1,873		0		(1)
GLM	08/2022		13	PEN	49		0		0
GLM	08/2022		3	THB	90		0		0
GLM	09/2022		87	MYR	382		0		0
GLM	10/2022		105	MXN	2,156		0		0
HUS	08/2022	CNH	2,943	\$	438		0		(1)
HUS	08/2022	\$	141	IDR	2,062,592		0		(3)
HUS	05/2023	CNH	326	\$	49		0		0
JPM	07/2022	\$	133	CZK	3,121		0		(1)
JPM	07/2022		121	DKK	836		0		(4)
JPM	07/2022		481	NOK	4,736		0		(2)
JPM	08/2022	CNH	1,294	\$	192		0		(1)
JPM	08/2022	EUR	587		615		0		0
JPM	08/2022	JPY	170,000		1,322		67		0
JPM	08/2022	KRW	268,563		211		4		0
JPM	08/2022	SGD	1,763		1,283		16		0
JPM	08/2022	\$	319	IDR	4,688,635		0		(6)
JPM	08/2022		34	PEN	131		0		0
MBC	07/2022	MXN	160	\$	8		0		0
MBC	07/2022	\$	2,743	AUD	3,983		0		(4)
MBC	07/2022		297	NZD	455		0		(14)
MBC	08/2022	AUD	3,983	\$	2,743		4		0

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨		受取通貨		未実現評価(損)益			
						資産	負債		
MBC	08/2022	\$	1,466	CAD	1,878	\$	0	\$	(10)
MBC	08/2022		208	CHF	206		8		0
MBC	08/2022		113	EUR	108		0		0
MBC	08/2022		478	NOK	4,735		1		0
MBC	09/2022	JPY	310,000		\$		2,317		21
MYI	07/2022	DKK	38,811		5,659		203		0
MYI	07/2022	JPY	1,681		13		1		0
MYI	07/2022	\$	1,268	DKK	8,894		0		(18)
MYI	08/2022	CAD	97		\$		75		0
MYI	08/2022	DKK	8,362		1,191		13		0
MYI	08/2022	EUR	887		938		8		0
MYI	08/2022	GBP	159		196		3		0
MYI	08/2022	JPY	6,373		47		0		0
MYI	08/2022	KRW	1,113,970		873		14		0
MYI	08/2022	SEK	157		15		0		0
MYI	08/2022	\$	35	AUD	51		0		0
MYI	08/2022		3,812	CNY	25,589		4		0
MYI	08/2022		253	DKK	1,794		0		0
MYI	08/2022		329	EUR	315		2		0
MYI	08/2022		227	GBP	181		0		(7)
MYI	08/2022		32	IDR	477,155		0		(1)
MYI	08/2022		255	NOK	2,475		0		(5)
MYI	08/2022		17	NZD	27		0		0
MYI	08/2022		133	THB	4,568		0		(3)
RBC	08/2022	JPY	1,100,000		\$		8,699		571
RBC	08/2022	\$	2,624	CAD	3,396		8		0
RBC	08/2022		150	GBP	121		0		(3)
SCX	07/2022	JPY	50,000		\$		401		32
SCX	07/2022	\$	232	ILS	780		0		(9)
SCX	08/2022	CNH	5,221		\$		779		1
SCX	08/2022	\$	643	CHF	643		30		0
SCX	08/2022		6,288	CNY	42,087		0		(13)
SCX	09/2022		67	CLP	56,107		0		(9)
SCX	09/2022		67	MYR	282		0		(3)
SDG	08/2022		251	NOK	2,457		0		(2)
SSB	08/2022		87	KRW	109,194		0		(3)
SSB	09/2022		400	MYR	1,753		0		(3)
TDR	08/2022	CHF	26		\$		26		(1)
TDR	09/2022	JPY	530,000		3,969		46		0
UAG	07/2022	AUD	4,292		3,066		114		0
UAG	07/2022	\$	113	HUF	39,691		0		(9)
UAG	08/2022		66	CNY	443		0		0
UAG	08/2022		447	KRW	572,982		0		(5)
UAG	09/2022		147	MXN	2,922		0		(4)
UAG	10/2022		234		4,783		0		(1)
						\$	2,381	\$	(695)

買建オプション:

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払/ 受取	行使 レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
BPS	Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.000%	03/15/2023	300	\$ 28	\$ 141

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格	
BOA	Call - OTC Singapore dollar versus Chinese renminbi	CNH 4.819	09/27/2022	900	\$ 5	\$ 7	
Total Purchased Options						\$ 33	\$ 148

売建オプション:

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払/ 受取	行使 レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
BOA	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	Secured Overnight Financing Rate	Pay	2.800%	08/24/2022	2,000	\$ (21)	\$ (35)
BPS	Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	(0.175%)	03/15/2023	900	(25)	(218)
DUB	Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Receive	0.350%	08/08/2022	200	(1)	0
DUB	Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap	6-Month EURIBOR	Pay	0.550%	08/08/2022	200	(1)	(4)
GLM	Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Receive	0.870%	11/02/2022	12,700	(26)	0
GLM	Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap	3-Month USD-LIBOR	Pay	1.270%	11/02/2022	12,700	(26)	(291)
							\$ (100)	\$ (546)

クレジット・デフォルト・スワップション

取引相手	詳細	プロテクションの 買い/売り	行使 レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
BOA	Put - CDX.IG-38 Index	Sell	1.200%	07/20/2022	400	\$ 0	\$ 0
BOA	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.400%	08/17/2022	300	(1)	(1)
BPS	Put - CDX.IG-37 Index	Sell	1.200%	07/20/2022	600	(1)	0
BRC	Put - iTraxx Europe Series 37 Index	Sell	1.600%	08/17/2022	300	(1)	(1)
						\$ (3)	\$ (2)

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格	
BOA	Call - OTC Singapore dollar versus Chinese renminbi	CNH 4.960	09/27/2022	900	\$ (2)	\$ (2)	
Total Written Options						\$ (105)	\$ (550)

スワップ契約:

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り²⁾

取引相手	参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2022年6月30日現在) ³⁾	想定元本 ⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現評価 (損)益	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
JPM	South Africa Government International Bond	1.000%	12/20/2023	2.075%	\$ 300	\$ (16)	\$ 12	\$ 0	\$ (4)

金利スワップ

取引相手	変動金利支払/ 受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	プレミアム支払額/ (受取額)	未実現評価 (損)益	スワップ契約(公正価値)			
								資産	負債		
BDA	Receive	3-Month MYR-KLIBOR	4.000%	06/15/2027	MYR 16,400	\$ (9)	\$ (21)	\$ 0	\$ (30)		
Total Swap Agreements								\$ (25)	\$ (9)	\$ 0	\$ (34)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2022年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた(受領した)担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

2022年6月30日現在、国際スワップ・デリバティブ協会のマスター契約に従い、金融デリバティブ商品について\$391の現金が担保として差し入れられている。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭 デリバティブ の純市場価格	差入(受取) 担保	ネット・ エクスポー チャー ⁵⁾
	外国為替 先渡契約	買建 オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替 先渡契約	売建 オプション	スワップ契約	店頭合計			
AZD	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$(1)	\$ 0	\$ 0	\$ 0
BDA	603	7	0	610	(153)	(38)	(30)	(221)	389	(270)	119
BPS	191	141	0	332	(230)	(216)	0	(446)	(114)	0	(114)
BRC	374	0	0	374	(7)	(1)	0	(8)	366	(260)	106
CBK	16	0	0	16	(16)	0	0	(16)	0	0	0
DUB	71	0	0	71	(315)	(4)	0	(319)	(248)	0	(248)
GLM	0	0	0	0	0	(291)	0	(291)	(291)	391	100
HUS	1	0	0	1	(4)	0	0	(4)	(3)	0	(3)
JPM	90	0	0	90	(50)	0	(4)	(54)	36	0	36
MBC	52	0	0	52	(68)	0	0	(68)	(16)	0	(16)
MYI	251	0	0	251	(35)	0	0	(35)	216	(80)	136
RBC	579	0	0	579	(3)	0	0	(3)	576	(560)	16
SCX	67	0	0	67	(245)	0	0	(245)	(178)	0	(178)
SOG	77	0	0	77	(2)	0	0	(2)	75	0	75
SSB	0	0	0	0	(6)	0	0	(6)	(6)	0	(6)
TOR	56	0	0	56	(261)	0	0	(261)	(205)	0	(205)
UAG	122	0	0	122	(19)	0	0	(19)	103	0	103
Total Over the Counter	\$ 2,551	\$ 148	\$ 0	\$ 2,699	\$ (1,415)	\$ (550)	\$ (34)	\$ (1,999)			

(1) 想定元本は契約件数を表す。

(2) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは (i) プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けたりは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受けたり、または (ii) スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(3) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払、履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建、売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(4) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(5) ネット・エクスポーチャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金/未払金の総額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポーチャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間のみ相殺することができる。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値(2022年6月30日現在):

		ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品								
		商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計			
Financial Derivative Instruments - Assets										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	282	\$	282
Swap Agreements		0		0		0		454		454
	\$	0	\$	0	\$	0	\$	736	\$	736
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	2,551	\$	0	\$	2,551
Purchased Options		0		0		7		141		148
	\$	0	\$	0	\$	2,558	\$	141	\$	2,699
	\$	0	\$	0	\$	2,558	\$	877	\$	3,435
Financial Derivative Instruments - Liabilities										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(199)	\$	(199)
Swap Agreements		0		(7)		0		(60)		(67)
	\$	0	\$	(7)	\$	0	\$	(258)	\$	(266)
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	(1,415)	\$	0	\$	(1,415)
Written Options		0		(2)		0		(546)		(550)
Swap Agreements		0		(4)		0		(30)		(34)
	\$	0	\$	(6)	\$	(1,417)	\$	(576)	\$	(1,990)
	\$	0	\$	(13)	\$	(1,417)	\$	(835)	\$	(2,265)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響(2022年6月30日に終了した年度):

		ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品								
		商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計			
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(2,004)	\$	(2,004)
Swap Agreements		0		17		0		(1,141)		(1,124)
	\$	0	\$	17	\$	0	\$	(3,145)	\$	(3,128)
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	(1,506)	\$	0	\$	(1,506)
Written Options		0		11		0		158		170
Swap Agreements		0		1		0		(2)		(1)
	\$	0	\$	12	\$	(1,505)	\$	156	\$	(1,337)
	\$	0	\$	29	\$	(1,505)	\$	(2,989)	\$	(4,465)
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(135)	\$	(135)
Swap Agreements		0		(202)		0		(1,637)		(1,839)
	\$	0	\$	(202)	\$	0	\$	(1,772)	\$	(1,974)
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	1,323	\$	0	\$	1,323
Purchased Options		0		0		2		103		105
Written Options		0		0		0		(487)		(487)
Swap Agreements		0		(5)		0		(14)		(19)
	\$	0	\$	(5)	\$	1,325	\$	(398)	\$	922
	\$	0	\$	(207)	\$	1,325	\$	(2,170)	\$	(1,052)

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2022年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)	カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Australia					Spain				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 85	\$ 0	\$ 85	Sovereign Issues	\$ 0	\$ 1,781	\$ 0	\$ 1,781
Mortgage-Backed Securities	0	3,721	0	3,721	Supranational				
Sovereign Issues	0	2,357	0	2,357	Sovereign Issues	0	333	0	333
Bermuda					Switzerland				
Corporate Bonds & Notes	0	99	0	99	Corporate Bonds & Notes	0	2,598	0	2,598
Canada					Thailand				
Sovereign Issues	0	660	0	660	Sovereign Issues	0	257	0	257
Cayman Islands					United Arab Emirates				
Asset-Backed Securities	0	3,208	0	3,208	Corporate Bonds & Notes	0	190	0	190
Corporate Bonds & Notes	0	1,399	0	1,399	Sovereign Issues	0	356	0	356
Chile					United Kingdom				
Sovereign Issues	0	854	0	854	Corporate Bonds & Notes	0	3,954	0	3,954
China					Mortgage-Backed Securities	0	3,396	0	3,396
Sovereign Issues	0	6,529	0	6,529	Sovereign Issues	0	5,077	0	5,077
Denmark					United States				
Corporate Bonds & Notes	0	6,858	0	6,858	Asset-Backed Securities	0	3,025	0	3,025
France					Corporate Bonds & Notes	0	13,919	0	13,919
Corporate Bonds & Notes	0	969	0	969	Mortgage-Backed Securities	0	3,057	0	3,057
Sovereign Issues	0	1,305	0	1,305	Municipal Bonds & Notes	0	229	0	229
Germany					Structured Notes	0	376	0	376
Corporate Bonds & Notes	0	848	0	848	U.S. Government Agencies	0	23,700	0	23,700
Hong Kong					U.S. Treasury Obligations	0	24,352	0	24,352
Corporate Bonds & Notes	0	369	0	369	Short-Term Instruments	0	57,797	0	57,797
Indonesia					Total Investments	\$ 0	\$ 187,842	\$ 0	\$ 187,842
Sovereign Issues	0	192	0	192	Short Sales, at value	\$ 0	\$ (5,532)	\$ 0	\$ (5,532)
Ireland					Financial Derivative Instruments - Assets				
Asset-Backed Securities	0	2,908	0	2,908	Exchange-traded or centrally				
Corporate Bonds & Notes	0	174	0	174	cleared	241	495	0	736
Israel					Over the counter	0	2,699	0	2,699
Sovereign Issues	0	441	0	441		\$ 241	\$ 3,194	\$ 0	\$ 3,435
Italy					Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Corporate Bonds & Notes	0	267	0	267	Exchange-traded or centrally				
Sovereign Issues	0	38	0	38	cleared	(193)	(73)	0	(266)
Japan					Over the counter	0	(1,999)	0	(1,999)
Corporate Bonds & Notes	0	2,678	0	2,678		\$ (193)	\$ (2,072)	\$ 0	\$ (2,265)
Sovereign Issues	0	343	0	343	Totals	\$ 48	\$ 183,432	\$ 0	\$ 183,480
Luxembourg									
Corporate Bonds & Notes	0	89	0	89					
Malaysia									
Sovereign Issues	0	67	0	67					
Multinational									
Corporate Bonds & Notes	0	284	0	284					
Netherlands									
Corporate Bonds & Notes	0	552	0	552					
Mortgage-Backed Securities	0	98	0	98					
Norway									
Sovereign Issues	0	59	0	59					
Peru									
Sovereign Issues	0	293	0	293					
Qatar									
Corporate Bonds & Notes	0	236	0	236					
Sovereign Issues	0	199	0	199					
Romania									
Sovereign Issues	0	78	0	78					
Saudi Arabia									
Corporate Bonds & Notes	0	341	0	341					
Sovereign Issues	0	480	0	480					
Singapore									
Corporate Bonds & Notes	0	200	0	200					
Sovereign Issues	0	1,584	0	1,584					
South Korea									
Sovereign Issues	0	2,583	0	2,583					

2022年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

種類・項目	PIMCOグローバルハイイールドストラテジーファンドJ(JPY)	
	バミューダ籍円建外国投資信託	
運用の基本方針		
基本方針	トータルリターンを最大化をめざして運用を行いません。	
主な投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、ファンドの純資産総額の3分の2以上を、ユーロ建やその他の欧州通貨建あるいは米ドル建のハイイールド債券などに投資します。 ・ 投資可能な債券は、以下のものを含みます。 <ul style="list-style-type: none"> ○ 各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ○ 社債 ○ 政府および企業が発行したインフレ連動債 ○ 仕組債 ○ ローンおよびローン・パーティシペーション ○ 譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ○ 現先取引および逆現先取引 ○ 国際機関の債券 など 	
投資方針	ICE BofA メリルリンチ米国ハイイールド・マスターⅡコンストレインド・インデックス50%+ICE BofA メリルリンチ・ヨーロッパ・カレンシー・ハイイールド・コンストレインド・インデックス50%(ヘッジなし・円ベース)で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンを最大化をめざします。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 原則として純資産総額の3分の2以上をBaa格(ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含みます。以下同じ。)未満の債券などに投資します。 ・ ポートフォリオの平均格付は、原則としてB格以上とします。 ・ ファンドの平均デュレーションは、ベンチマークの平均デュレーション±2年以内で変動させるものとします。 ・ エマージング国の発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の10%まで可能とします。 ・ 1つの発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の5%を限度として投資することができます。ただし、各国政府、その政府の部局、政府系機関、政府系企業が発行し、または保証した債券などは、この限りではありません。また、クレジットリンク債、クレジット・デリバティブなどについては、参照資産を基礎として上記投資割合を算出します。 ・ ファンドは、全体のポートフォリオ運用戦略の一環として、または債券価格の下落を相殺するために、空売りを行なうことができます。 ・ ファンドは、先物取引などの派生商品に投資をすることができます。 ・ 借入れの合計金額が各ファンドの純資産総額の10%を越える借入れ残高が生じる借入れは行なえないものとします。 ・ 流動性の乏しい証券への投資は、ファンドの純資産総額の15%までとします。 ・ 優先株などの有価証券に投資を行なう場合があります。 	
収益分配	毎月、利子収入および売買益などから分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	
ファンドに係る費用		
信託報酬など	ありません。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	ありません。	
その他の費用など	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用など。	
その他		
投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
管理会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
信託期間	無期限(2006年10月31日設定)	
決算日	原則として、毎年6月末日	

●投資明細表(2022年6月30日現在)

<PIMCOグローバルハイールドストラテジーファンド>

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)		元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)		元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)				
投資有価証券 99.3%			Altice France S.A.			Italmatch Chemicals SpA						
バミューダ 0.2%			2,500% due 01/15/2025	EUR	465	\$	426	4,750% due 09/30/2024	EUR	400	\$	380
社債等 0.2%			CGG S.A.			Nexi SpA						
NCL Corp. Ltd.			7,750% due 04/01/2027		400		358	1,625% due 04/30/2026		400		342
5.875% due 02/15/2027	\$	100	\$	86	Electricite de France S.A. (a)			UniCredit SpA				
Total Bermuda			2,625% due 12/01/2027		200		148	4,875% due 02/20/2029		400		417
(Cost \$100)			5,375% due 01/29/2025		200		192	Total Italy				2,375
カナダ 4.5%			Elior Group S.A.					(Cost \$2,992)				
社債等 4.5%			3,750% due 07/15/2026		200		163	チャンネル諸島ジャージー島 0.5%				
Air Canada			Elis S.A.					社債等 0.5%				
3,875% due 08/15/2026		400	4,125% due 05/24/2027		100		99	AA Bond Co. Ltd.				
Bombardier, Inc.			Faurecia SE					4,875% due 07/31/2024	GBP	200		242
7,125% due 06/15/2026		500	2,750% due 02/15/2027		100		82	Total Jersey, Channel Islands				242
7,500% due 12/01/2024		261	Ilriad Holding SASU					(Cost \$287)				
Garda World Security Corp.			6,500% due 10/15/2026	\$	325		293	ルクセンブルク 5.2%				
6,000% due 06/01/2029		500	La Financiere Atalian SASU					バンク・ローン債務 0.2%				
GFL Environmental, Inc.			4,000% due 05/15/2024	EUR	300		244	Intelsat Jackson Holdings S.A.				
4,000% due 08/01/2028		200	Loxam SAS					4,920% due 02/01/2029		119		109
Northriver Midstream Finance LP			3,250% due 01/14/2025		200		189	数量				
5,625% due 02/15/2026		250	5,750% due 07/15/2027		100		83	普通株 0.4%				
Parkland Corp.			Total France				2,360	Intelsat S.A. (e)		5,610		157
4,625% due 05/01/2030		350	(Cost \$3,157)				2,470	元本金額				
Total Canada			ドイツ 3.3%					(単位：千)				
(Cost \$2,460)			社債等 3.3%									
ケイマン諸島合計 1.1%			Chepharm Arzneimittel GmbH					社債等 4.6%				
バンク・ローン債務 0.2%			3,500% due 02/11/2027		300		268	Albion Financing 1 SARL				
A Advantage Loyalty IP Ltd.			4,375% due 01/15/2028		200		179	6,125% due 10/15/2026	\$	200		172
5,813% due 04/20/2028		100	Deutsche Bank AG					Altice Financing S.A.				
社債等 0.9%			4,000% due 06/24/2032		200		191	2,250% due 01/15/2025	EUR	150		138
Sitka Holdings LLC			Nidda Healthcare Holding GmbH					3,000% due 01/15/2028		200		157
6,750% due 07/06/2026		250	3,500% due 09/30/2024		450		418	Cidron Aida Finco Sarl				
Transocean Pontus Ltd.			Schaeffler AG					5,000% due 04/01/2028		100		87
6,125% due 08/01/2025		185	3,375% due 10/12/2028		300		255	Cirsa Finance International Sarl				
Total Cayman Islands			Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH					4,500% due 03/15/2027		100		85
(Cost \$530)			2,000% due 07/15/2025		200		184	Intelsat Jackson Holdings S.A.				
中国 0.4%			Total Germany				1,495	6,500% due 03/15/2030	\$	422		349
社債等 0.4%			(Cost \$1,826)					Lincoln Financing SARL				
Huarong Universe Investment Holding Ltd.			アイルランド 0.4%					3,625% due 04/01/2024	EUR	200		203
1,625% due 12/05/2022	EUR	200	社債等 0.4%					Loarre Investments Sarl				
Total China			Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC					6,500% due 05/15/2029		300		293
(Cost \$217)			5,000% due 07/15/2028	\$	200		166	Matterhorn Telecom S.A.				
デンマーク 0.2%			Total Ireland				166	3,125% due 09/15/2026		300		268
社債等 0.2%			(Cost \$200)					Signa Development Finance SCS				
TDC Net A/S			イタリア 5.2%					5,500% due 07/23/2026		100		77
5,056% due 05/31/2028		100	社債等 5.2%					Summer BC Holdco B SARL				
Total Denmark			Atlantia SpA					5,750% due 10/31/2026		300		274
(Cost \$107)			1,625% due 02/03/2025	EUR	400		382	数量				
フランス 5.4%			1,875% due 02/12/2028		300		245	株式リンク証券 0.0%				
バンク・ローン債務 0.2%			Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					Intelsat Jackson Holdings S.A.				
Altice France S.A.			5,375% due 01/18/2028		300		187	12/31/2049		1		6
5,411% due 08/14/2026		121	10,500% due 07/23/2029		200		146	Total Luxembourg				2,375
社債等 5.2%			FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA					(Cost \$3,021)				
Accor S.A.			5,625% due 08/01/2027		100		89					
2,375% due 11/29/2028		100	Inter Media & Communication SpA									
			6,750% due 02/09/2027		200		187					

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
多国種 1.7%		
社債等 1.7%		
Allied Universal Holdco LLC		
3.625% due 06/01/2028	EUR 100	\$ 79
4.875% due 06/01/2028	GBP 100	96
American Airlines, Inc.		
5.500% due 04/20/2028	\$ 25	23
5.750% due 04/20/2029	425	364
Clarior Global LP		
4.375% due 05/15/2026	EUR 100	92
Delta Air Lines, Inc.		
4.750% due 10/20/2028	\$ 100	95
Total Multinational (Cost \$956)		749
オランダ 2.1%		
社債等 2.1%		
Dufry One BV		
2.000% due 02/15/2027	EUR 300	236
LeasePlan Corp. NV		
7.375% due 05/29/2024 (a)(b)	300	307
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV		
1.875% due 03/31/2027	400	327
WPJAP Telecom Holdings IV BV		
3.750% due 01/15/2028	100	86
Total Netherlands (Cost \$1,156)		956
パナマ 0.4%		
社債等 0.4%		
Carnival Corp.		
4.000% due 08/01/2028	\$ 200	165
Total Panama (Cost \$200)		165
スペイン 3.4%		
社債等 3.4%		
Banco Santander S.A.		
4.375% due 01/14/2026 (a)(b)	EUR 200	176
Cellnex Finance Co. S.A.		
1.500% due 06/08/2028	300	246
2.000% due 09/15/2032	300	213
Cellnex Telecom S.A.		
1.750% due 10/23/2030	100	75
Grifols Escrow Issuer S.A.		
3.875% due 10/15/2028	200	173
International Consolidated Airlines Group S.A.		
3.750% due 03/25/2029	200	149
Lorca Telecom Bondco S.A.		
4.000% due 09/18/2027	400	351
Neinor Homes S.A.		
4.500% due 10/15/2028	200	171
Total Spain (Cost \$1,946)		1,554
スウェーデン 0.8%		
社債等 0.8%		
Intrum AB		
3.125% due 07/15/2024	200	194
3.500% due 07/15/2026	200	176

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
Total Sweden (Cost \$461)		\$ 370
スイス 0.4%		
社債等 0.4%		
Credit Suisse Group AG		
7.500% due 12/11/2023 (a)(b)	\$ 200	191
Total Switzerland (Cost \$213)		191
英国 6.8%		
社債等 6.8%		
Arqiva Broadcast Finance PLC		
6.750% due 09/30/2023	GBP 125	145
Barclays PLC (a)(b)		
7.250% due 03/15/2023	200	239
7.750% due 09/15/2023	\$ 200	197
BCP V Modular Services Finance PLC		
6.750% due 11/30/2029	EUR 500	384
Harbour Energy PLC		
5.500% due 10/15/2026	\$ 300	270
HSBC Holdings PLC		
6.000% due 09/29/2023 (a)(b)	EUR 200	207
INEOS Finance PLC		
2.125% due 11/15/2025	200	189
INEOS Quattro Finance 2 PLC		
3.375% due 01/15/2026	\$ 300	253
Jaguar Land Rover Automotive PLC		
2.200% due 01/15/2024	EUR 200	190
Market Bidco Finco PLC		
4.750% due 11/04/2027	100	83
Rolls-Royce PLC		
5.750% due 10/15/2027	\$ 250	226
Santander UK Group Holdings PLC		
6.750% due 06/24/2024 (a)(b)	GBP 50	59
Vmed 02 UK Financing I PLC		
3.250% due 01/31/2031	EUR 100	81
4.000% due 01/31/2029	GBP 100	97
4.250% due 01/31/2031	\$ 200	161
Vodafone Group PLC		
6.250% due 10/03/2078	300	289
Total United Kingdom (Cost \$3,737)		3,070
米国 48.8%		
バンク・ローン債務 3.4%		
Banijay Entertainment SAS		
4.553% due 03/01/2025	25	23
BK LC Lux SPV Sarl		
5.098% due 04/28/2028	198	182
Diamond Sports Group LLC		
9.181% due 05/26/2026	54	53
Getty Images, Inc.		
6.125% due 02/19/2026	215	208
H-Food Holdings LLC		
5.354% due 05/23/2025	485	438
iHeartCommunications, Inc.		
4.666% due 05/01/2026	28	26

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
KKR Apple Bidco LLC		
7.416% due 09/21/2029	\$ 100	\$ 96
LifePoint Health, Inc.		
5.416% due 11/16/2025	385	360
Team Health Holdings, Inc.		
4.416% due 02/06/2024	148	132
		1,518
	数量	
普通株 0.1%		
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		
	5,022	5
iHeartMedia, Inc. Class A	1,198	9
iHeartMedia, Inc. Class B	938	7
		21
	元本金額 (単位：千)	
社債等 45.3%		
ADT Security Corp.		
4.125% due 08/01/2029	\$ 200	163
Advantage Sales & Marketing, Inc.		
6.500% due 11/15/2028	300	258
AMC Networks, Inc.		
4.250% due 02/15/2029	300	244
5.000% due 04/01/2024	80	78
Armor Holdco, Inc.		
8.500% due 11/15/2029	525	435
ASP Unifrax Holdings, Inc.		
5.250% due 09/30/2028	100	80
Avantor Funding, Inc.		
3.875% due 11/01/2029	350	307
4.625% due 07/15/2028	100	92
Blue Racer Midstream LLC		
6.625% due 07/15/2026	150	135
British Airways 2021-1 Class A Pass-Through Trust		
2.900% due 03/15/2035	100	88
Burford Capital Global Finance LLC		
6.250% due 04/15/2028	200	175
CCO Holdings LLC		
4.500% due 06/01/2033	450	356
Cheniery Energy Partners LP		
3.250% due 01/31/2032	175	138
Cheniery Energy, Inc.		
4.625% due 10/15/2028	200	181
Chesapeake Energy Corp.		
6.750% due 04/15/2029	250	242
Cinemark USA, Inc.		
5.250% due 07/15/2028 (f)	150	121
Clarivate Science Holdings Corp.		
3.875% due 07/01/2028	100	84
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		
7.750% due 04/15/2028	475	347
Clearway Energy Operating LLC		
3.750% due 01/15/2032	100	79
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.		
8.750% due 04/15/2030	1,000	865
CommScope, Inc.		
4.750% due 09/01/2029	400	324

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)		元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)		元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
Community Health Systems, Inc.			II-VI, Inc.			Rockcliff Energy II LLC		
6.125% due 04/01/2030	\$ 425	\$ 260	5.000% due 12/15/2029	\$ 100	\$ 87	5.500% due 10/15/2029	\$ 400	\$ 365
Conduent Business Services LLC			Jane Street Group			Sabre GBLB, Inc.		
6.000% due 11/01/2029	225	190	4.500% due 11/15/2029	150	134	7.375% due 09/01/2025	200	186
Coty, Inc.			LABL, Inc.			9.250% due 04/15/2025	100	97
3.875% due 04/15/2026	EUR 100	93	5.875% due 11/01/2028	100	81	Southwestern Energy Co.		
5.000% due 04/15/2026	\$ 300	275	Leeward Renewable Energy Operations LLC			4.750% due 02/01/2032	100	86
Crestwood Midstream Partners LP			4.250% due 07/01/2029	375	300	5.375% due 02/01/2029	280	260
6.000% due 02/01/2029	100	87	LFS Topco LLC			Spirit AeroSystems, Inc.		
Crocs, Inc.			5.875% due 10/15/2026	100	79	5.500% due 01/15/2025	300	278
4.125% due 08/15/2031	300	213	Lindblad Expeditions LLC			Stagwell Global LLC		
CrownRock LP			6.750% due 02/15/2027	100	86	5.625% due 08/15/2029	275	222
5.000% due 05/01/2029	100	90	Medline Borrower LP			Standard Industries, Inc.		
5.625% due 10/15/2025	100	94	3.875% due 04/01/2029	275	235	4.375% due 07/15/2030	125	99
Curo Group Holdings Corp.			MPH Acquisition Holdings LLC			Staples, Inc.		
7.500% due 08/01/2028	250	158	5.500% due 09/01/2028	200	179	7.500% due 04/15/2026	300	250
DaVita, Inc.			Novelis Corp.			Starwood Property Trust, Inc.		
3.750% due 02/15/2031	225	162	3.250% due 11/15/2026	100	85	3.750% due 12/31/2024	100	91
DCP Midstream Operating LP			Occidental Petroleum Corp.			Station Casinos LLC		
3.250% due 02/15/2032	150	118	6.125% due 01/01/2031 (e)(1)	200	203	4.625% due 12/01/2031	100	78
Diamond Sports Group LLC			6.375% due 09/01/2028	250	254	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP		
5.375% due 08/15/2026	300	75	6.625% due 09/01/2030	350	361	5.875% due 05/15/2025	300	276
Directv Financing LLC			Olympus Water U.S. Holding Corp.			Targa Resources Partners LP		
5.875% due 09/15/2027	100	86	3.875% due 10/01/2028	EUR 200	170	4.000% due 01/15/2032	25	21
DISH DBS Corp.			5.375% due 10/01/2029	100	75	4.875% due 02/01/2031	400	365
5.250% due 12/01/2026	200	157	OneMain Finance Corp.			Tenet Healthcare Corp.		
5.750% due 12/01/2028	100	74	3.500% due 01/15/2027	\$ 375	301	4.875% due 10/01/2026	400	369
Endeavor Energy Resources LP			Option Care Health, Inc.			TerraForm Power Operating LLC		
6.625% due 07/15/2025	100	101	4.375% due 10/31/2029	100	86	5.000% due 01/31/2028	200	182
Engizer Holdings, Inc.			Organon & Co.			Thor Industries, Inc.		
6.500% due 12/31/2027	300	263	2.875% due 04/30/2028	EUR 300	264	4.000% due 10/15/2029	300	238
EQM Midstream Partners LP			5.125% due 04/30/2031	\$ 200	173	TopBuild Corp.		
4.750% due 01/15/2031	100	80	Owens & Minor, Inc.			4.125% due 02/15/2032	100	77
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			6.625% due 04/01/2030	100	91	TransDigm, Inc.		
6.500% due 10/01/2025	225	213	Oxford Finance LLC			4.625% due 01/15/2029	100	81
Freedom Mortgage Corp.			6.375% due 02/01/2027	100	96	6.375% due 06/15/2026	400	375
6.625% due 01/15/2027	300	223	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC			Travel + Leisure Co.		
Full House Resorts, Inc.			4.375% due 10/15/2028	100	85	4.500% due 12/01/2029	250	194
8.250% due 02/15/2028	100	80	Park Intermediate Holdings LLC			Triumph Group, Inc.		
Genesis Energy LP			4.875% due 05/15/2029	100	86	8.875% due 06/01/2024	80	81
8.000% due 01/15/2027	300	266	PennyMac Financial Services, Inc.			U.S. Acute Care Solutions LLC		
Global Infrastructure Solutions, Inc.			4.250% due 02/15/2029	300	221	6.375% due 03/01/2026	125	112
7.500% due 04/15/2032	275	212	Performance Food Group, Inc.			U.S. Renal Care, Inc.		
Graphic Packaging International LLC			6.875% due 05/01/2025	200	199	10.625% due 07/15/2027	250	94
3.750% due 02/01/2030	250	212	PGT Innovations, Inc.			Uber Technologies, Inc.		
Harvest Midstream I LP			4.375% due 10/01/2029	100	79	7.500% due 05/15/2025	200	199
7.500% due 09/01/2028	175	165	Post Holdings, Inc.			United Airlines, Inc.		
HAT Holdings I LLC			4.500% due 09/15/2031	100	82	4.625% due 04/15/2029	100	85
3.375% due 06/15/2026	225	194	4.625% due 04/15/2030	200	169	Univision Communications, Inc.		
HealthEquity, Inc.			5.750% due 03/01/2027	106	103	6.625% due 06/01/2027	400	382
4.500% due 10/01/2029	100	88	PRA Group, Inc.			Venture Global Calcasieu Pass LLC		
Hertz Corp.			7.375% due 09/01/2025	300	292	3.875% due 08/15/2029	100	88
5.000% due 12/01/2029	100	77	Prime Security Services Borrower LLC			4.125% due 08/15/2031	100	86
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC			3.375% due 08/31/2027	200	165	Viavi Solutions, Inc.		
5.000% due 06/01/2029	100	81	RHP Hotel Properties LP			3.750% due 10/01/2029	100	84
Howard Hughes Corp.			4.500% due 02/15/2029	300	255	White Cap Parent LLC		
4.125% due 02/01/2029	100	77	RLJ Lodging Trust LP			8.250% due 03/15/2026 (c)	300	250
4.375% due 02/01/2031	60	44	4.000% due 09/15/2029	100	82			

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
WMG Acquisition Corp.		
3.000% due 02/15/2031	\$ 200	\$ 155
3.750% due 12/01/2029	100	84
Zayo Group Holdings, Inc.		
4.000% due 03/01/2027	200	166
ZipRecruiter, Inc.		
5.000% due 01/15/2030	100	84
		20,598
Total United States		22,137
(Cost \$26,240)		
短期金融商品 8.5%		
定期預金 0.6%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	5	5
Bank of Nova Scotia		
1.060% due 07/01/2022	8	8
BNP Paribas Bank		
(1.200%) due 07/01/2022	CHF 21	22
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 19	19
0.520% due 07/01/2022	GBP 1	1
Citibank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 31	31
DBS Bank Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	26	26
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 7	7
0.520% due 07/01/2022	GBP 6	8
JPMorgan Chase Bank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 62	62
Royal Bank of Canada		
1.060% due 07/01/2022	3	3
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 18	19
1.060% due 07/01/2022	\$ 27	27
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 2	2
(0.360%) due 07/01/2022	¥ 1	0
0.520% due 07/01/2022	GBP 1	1
1.060% due 07/01/2022	\$ 58	58
		299
米国短期国債 (d) 7.9%		
0.634% due 07/19/2022	1,700	1,699
0.748% due 07/14/2022	600	600
1.633% due 09/15/2022	800	797
1.692% due 09/29/2022	500	498
		3,594
Total Short-Term Instruments		3,893
(Cost \$3,894)		
Total Investments in Securities 99.3%	\$	45,162
(Cost \$53,700)		
Financial Derivative		
Instruments (g)(h) (0.4%)		(173)
(Cost or Premiums, net \$0)		
Other Assets and Liabilities, net 1.1%		477
Net Assets 100.0%	\$	45,466

投資明細表に対する注記:

- * 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。
 (a) 永久債 (記載の日付は次の契約上の償還日) である。
 (b) 偶発転換社債
 (c) 現物証券
 (d) クーポンは最終利回りである。

(e) 制限証券:

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価値の 対純資産比率
Intelsat S.A.	N/A	N/A	09/06/2019	\$ 433	\$ 157	0.34%
Occidental Petroleum Corp.	6.125%	01/01/2031	12/08/2020	200	203	0.45%
Total Restricted Securities				\$ 633	\$ 360	0.79%

借入れおよびその他の金融取引

リバース・レポ契約:

取引相手	借入金利 ⁽¹⁾	決済日	満期日	借入金額 ⁽¹⁾	リバース・レポ 契約に係る 未払金
JML	1.300%	06/17/2022	07/29/2022	\$ (104)	(104)
JML	1.430%	06/17/2022	07/29/2022	(171)	(171)
Total Reverse Repurchase Agreements				\$	(275)

担保付借入として会計処理される振替

	契約の残存期間				合計
	翌日物 および継続	30日以下	31~90日	90日超	
Reverse Repurchase Agreements					
U.S. Corporate Debt	\$ 0	\$ (275)	\$ 0	\$ 0	\$ (275)
Total Reverse Repurchase Agreements	\$ 0	\$ (275)	\$ 0	\$ 0	\$ (275)
Total Borrowings	\$ 0	\$ (275)	\$ 0	\$ 0	\$ (275)
Payable for Reverse Repurchase Agreements					\$ (275)

借入れおよびその他の金融取引要約

以下は、2022年6月30日現在の借入れおよびその他の金融取引、ならびに差し入れた (受領した) 担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

(f) 2022年6月30日現在、以下のマスター契約に基づき、市場価格合計\$324の有価証券が担保として差し入れられている。

取引相手	レポ契約 に係る 未収金	リバース・レポ 契約に係る 未払金	セール・バイバック 取引に係る 未払金	売建に係る 未払金	借入および その他の 金融取引合計	差入 (受入) 担保	ネット・ エクスポージャー ⁽²⁾
Global/Master Repurchase Agreement							
JML	\$ 0	\$ (275)	\$ 0	\$ 0	\$ (275)	\$ 324	\$ 49
Total Borrowings and Other Financing Transactions	\$ 0	\$ (275)	\$ 0	\$ 0	\$	\$	\$

(1) 2022年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は\$203で、加重平均金利は0.162%であった当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レポ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(2) ネット・エクスポージャーはデフォルト発生時の取引相手に対する未収金 / 未払金の純額を表す。借入およびその他の金融取引から発生するエクスポージャーは、同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。

(g) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

先物契約：

詳細	種類	限月	契約数	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
					資産	負債
Euro-Bobl 5-Year Note September Futures	Long	09/2022	23	\$ (11)	\$ 53	\$ 0
Euro-Bund 10-Year Bond September Futures	Long	09/2022	1	(11)	5	0
Euro-Schatz 2-Year Note September Futures	Long	09/2022	46	(12)	33	0
U.S. Treasury 2-Year Note September Futures	Short	09/2022	4	3	0	(3)
U.S. Treasury 5-Year Note September Futures	Short	09/2022	4	3	0	(3)
U.S. Treasury 10-Year Note September Futures	Short	09/2022	19	18	0	(15)
U.S. Treasury Ultra 30-Year Bond September Futures	Long	09/2022	1	(5)	1	0
Total Futures Contracts				\$ 5	\$ 92	\$ (21)

スワップ契約：

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2022年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.000%	08/20/2026	9.623%	EUR 100	\$ (14)	\$ (21)	\$ 0	\$ (2)

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの買い⁽²⁾

指数/トランシェ	固定金利 (支払)	満期日	想定元本 ⁽⁴⁾	市場価格 ⁽³⁾	未実現評価(損)益	変動証拠金	
						資産	負債
CDX.HY-3B Index	(5.000%)	06/20/2027	\$ 3,663	\$ 101	\$ 297	\$ 5	\$ 0

金利スワップ

変動金利 支払・受取 ⁽³⁾	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価(損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.500%	09/21/2024	GBP 1,000	\$ (54)	\$ (8)	\$ 5	\$ 0
Pay	Sterling Overnight Interbank Average Rate	0.500%	09/21/2027	600	(70)	(21)	7	0
					\$ (124)	\$ (29)	\$ 12	\$ 0
Total Swap Agreements					\$ (37)	\$ 247	\$ 17	\$ (2)

金融デリバティブ商品：上場または中央清算要約

以下は、2022年6月30日現在の市場または中央清算金融デリバティブ商品の市場価格と変動証拠金の要約である。

2022年6月30日現在、上場および中央清算金融デリバティブ商品について\$558の現金が担保として差し入れられている。

金融デリバティブ資産					金融デリバティブ負債				
市場価格		変動証拠金資産			市場価格		変動証拠金負債		
買建オプション	先物	スワップ契約	合計		売建オプション	先物	スワップ契約	合計	
Total Exchange-Traded or Centrally Cleared	\$ 0	\$ 92	\$ 17	\$ 109	\$ 0	\$ (21)	(2)	\$ (23)	

(1) ファンドがプロテクションの売り手で、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは(i)プロテクションの買い手にスワップの想定元本に等しい額を支払い、参照債務の引渡しを受けるかもしくは参照インデックスを構成する有価証券の引渡しを受ける、または(ii)スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で支払う。

(2) ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは(i)プロテクションの売り手からスワップの想定元本に等しい額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または(ii)スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。

(3) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米地方債、またはソブリン債に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を締結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。

(4) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。

(5) クレジット・デフォルト・スワップ契約の価格およびその結果としての価値は、支払／履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、スワップ契約の想定元本が期末に決済／売却された場合のクレジット・デリバティブの予想債務(または利益)の可能性を表す。スワップの想定元本に対する市場価格の絶対額での増加は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
 (6) この金融商品には先渡取引の効力発生日がある。

(h) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨		未実現評価(損)益						
				受取通貨		資産	負債			
BOA	08/2022	GBP	38	\$	47	\$	1	\$	0	
BOA	08/2022	\$	247	GBP	202		0		(1)	
BPS	07/2022	EUR	9,216	\$	9,700		65		0	
BPS	07/2022	\$	710	EUR	662		0		(18)	
BPS	08/2022		8,436		8,006		0		(50)	
BRC	08/2022	GBP	72	\$	89		1		0	
CBK	07/2022	EUR	233		249		5		0	
CBK	08/2022	GBP	9		11		0		0	
DUB	08/2022	\$	1,378	GBP	1,117		0		(20)	
JPM	08/2022	GBP	6	\$	10		0		0	
MBC	07/2022	\$	263	EUR	251		0		0	
MBC	08/2022	EUR	551	\$	575		0		(2)	
MYI	08/2022	\$	104	GBP	83		0		(3)	
RBC	08/2022	GBP	187	\$	231		4		0	
RBC	08/2022	\$	202	GBP	166		0		(1)	
SCX	08/2022	GBP	22	\$	27		1		0	
SOG	07/2022	\$	8,820	EUR	8,206		0		(241)	
Total Forward Foreign Currency Contracts							\$	77	\$	(336)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2022年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた(受領した)担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

2022年6月30日現在、国際スワップ・デリバティブ協会のマスター契約に従い、金融デリバティブ商品について\$260の現金が担保として差し入れられている。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭 デリバティブの 純市場価格	差入(受取) 担保	ネット・ エクスポー ジャー ⁽¹⁾
	外国為替 先渡契約	買建 オプション	スワップ契約	店頭合計	外国為替 先渡契約	売建 オプション	スワップ契約	店頭合計			
BOA	\$ 1	\$ 0	\$ 0	\$ 1	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ (1)	\$ 0	\$ 0	\$ 0
BPS	65	0	0	65	(68)	0	0	(68)	(3)	0	(3)
BRC	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
CBK	5	0	0	5	0	0	0	0	5	0	5
DUB	0	0	0	0	(20)	0	0	(20)	(20)	0	(20)
JPM	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
MBC	0	0	0	0	(2)	0	0	(2)	(2)	0	(2)
MYI	0	0	0	0	(3)	0	0	(3)	(3)	0	(3)
RBC	4	0	0	4	(1)	0	0	(1)	3	0	3
SCX	1	0	0	1	0	0	0	0	1	0	1
SOG	0	0	0	0	(241)	0	0	(241)	(241)	260	19
Total Over the Counter	\$ 77	\$ 0	\$ 0	\$ 77	\$ (336)	\$ 0	\$ 0	\$ (336)			

(1) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金／未払金の総額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間でのみ相殺することができる。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値 (2022年6月30日現在) :

		ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品								
		商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計			
Financial Derivative Instruments - Assets										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	92	\$	92
Swap Agreements		0		5		0		0		12
	\$	0	\$	5	\$	0	\$	0	\$	104
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	0	\$	77	\$	0
	\$	0	\$	5	\$	0	\$	77	\$	104
Financial Derivative Instruments - Liabilities										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(21)
Swap Agreements		0		(2)		0		0		0
	\$	0	\$	(2)	\$	0	\$	0	\$	(21)
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(336)	\$	0
	\$	0	\$	(2)	\$	0	\$	(336)	\$	(21)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響 (2022年6月30日に終了した年度) :

		ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品								
		商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計			
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	64	\$	64
Swap Agreements		0		(36)		0		0		26
	\$	0	\$	(36)	\$	0	\$	0	\$	90
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(1,450)	\$	0
	\$	0	\$	(36)	\$	0	\$	(1,450)	\$	90
Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments										
Exchange-traded or centrally cleared										
Futures	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(42)	\$	(42)
Swap Agreements		0		256		0		(40)		216
	\$	0	\$	256	\$	0	\$	0	\$	(82)
Over the counter										
Forward Foreign Currency Contracts	\$	0	\$	0	\$	0	\$	(8)	\$	0
	\$	0	\$	256	\$	0	\$	(8)	\$	(82)

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2022年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)
Investments in Securities, at Value				
Bermuda				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 86	\$ 0	\$ 86
Canada				
Corporate Bonds & Notes	0	2,061	0	2,061
Cayman Islands				
Bank Loan Obligations	0	96	0	96
Corporate Bonds & Notes	0	411	0	411
China				
Corporate Bonds & Notes	0	202	0	202
Denmark				
Corporate Bonds & Notes	0	98	0	98
France				
Bank Loan Obligations	0	110	0	110
Corporate Bonds & Notes	0	2,360	0	2,360
Germany				
Corporate Bonds & Notes	0	1,495	0	1,495
Ireland				
Corporate Bonds & Notes	0	166	0	166
Italy				
Corporate Bonds & Notes	0	2,375	0	2,375
Jersey, Channel Islands				
Corporate Bonds & Notes	0	242	0	242
Luxembourg				
Bank Loan Obligations	0	109	0	109
Common Stocks	0	0	157	157
Corporate Bonds & Notes	0	2,103	0	2,103
Equity-Linked Securities	0	0	6	6
Multinational				
Corporate Bonds & Notes	0	749	0	749
Netherlands				
Corporate Bonds & Notes	0	956	0	956
Panama				
Corporate Bonds & Notes	0	165	0	165
Spain				
Corporate Bonds & Notes	0	1,554	0	1,554
Sweden				
Corporate Bonds & Notes	0	370	0	370
Switzerland				
Corporate Bonds & Notes	0	191	0	191
United Kingdom				
Corporate Bonds & Notes	0	3,070	0	3,070
United States				
Bank Loan Obligations	0	1,518	0	1,518
Common Stocks	14	0	7	21
Corporate Bonds & Notes	0	20,598	0	20,598
Short-Term Instruments	0	3,893	0	3,893
Total Investments	\$ 14	\$ 44,978	\$ 170	\$ 45,162
Financial Derivative Instruments - Assets				
Exchange-traded or centrally cleared	91	18	0	109
Over the counter	0	77	0	77
	\$ 91	\$ 95	\$ 0	\$ 186
Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Exchange-traded or centrally cleared	0	(23)	0	(23)
Over the counter	0	(336)	0	(336)
	\$ 0	\$ (359)	\$ 0	\$ (359)
Totals	\$ 105	\$ 44,714	\$ 170	\$ 44,989

2022年6月30日に終了した年度において、レベル3で重要な移動はなかった。

●損益計算書(2022年6月30日までの1年間)

	PIMCOグローバル ハイイールドストラテジー ファンド	
	(金額単位：千米ドル)	
投資収益：		
受取利息(外国源泉税控除後)*	\$	2,361
収益合計		2,361
費用：		
支払利息		26
費用合計		26
投資純利益		2,335
実現純利益(損失)：		
投資有価証券(外国源泉税控除後)*		(14)
上場または中央清算金融デリバティブ商品		54
店頭金融デリバティブ商品		(1,450)
外国通貨		(206)
実現純利益(損失)		(1,616)
未実現評価(損)益の純変動額		
投資有価証券		(10,053)
上場または中央清算金融デリバティブ商品		174
店頭金融デリバティブ商品		(8)
外貨建資産および負債		(6)
未実現評価(損)益の純変動額		(9,893)
純利益(損失)		(11,509)
運用による純資産の純減少額	\$	(9,174)
*外国源泉税	\$	1

(注) 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

種類・項目	PIMCOエマージング債券ストラテジーファンドJ(JPY)	
	バミューダ籍円建外国投資信託	
運用の基本方針		
基本方針	トータルリターンの最大化をめざして運用を行いません。	
主な投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・ 通常、ファンドの純資産総額の3分の2以上を、新興国(過去5年連続で高所得のOECD諸国として世界銀行に分類されている国々以外の各国。以下同じ。)の債券、通貨などに分散投資を行いません。 ・ 投資可能な債券は、以下のものを含まれます。 <ul style="list-style-type: none"> ○ 各国政府、その政府の部局または政府系機関が発行し、または保証した債券 ○ 社債 ○ 政府および企業が発行したインフレ連動債 ○ 仕組債 ○ ローンおよびローン・パーティシペーション ○ 譲渡性銀行預金、定期預金および銀行引受手形 ○ 現先取引および逆現先取引 ○ 国際機関の債券 など 	
投資方針	JPMorgan・エマージング・ローカル・マーケット・インデックス・プラス50%+JPMorgan・GBI-EMディバインファイド50%(ヘッジなし・円ベース)で算出する合成指数をベンチマークとし、トータルリターンの最大化をめざします。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 純資産総額の3分の2以上を、新興国の債券、通貨などに分散投資を行いません。 ・ B格(ムーディーズ社による格付。また、スタンダード&プアーズ社、フィッチ社およびその他の一般的に認められた格付会社による同等格の格付、またはこれらの社による格付がない場合でも、投資顧問会社が同等格の信用度を有すると判断したものを含まれます。)未満の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の15%まで可能とします。 ・ ファンドの平均デュレーションは、通常的环境下、0年から8年の範囲を超えないものとします。 ・ 1つの発行体の債券などへの投資は、ファンドの純資産総額の5%を限度として投資することができます。ただし、各国政府、その政府の部局、政府系機関、政府系企業が発行し、または保証した債券などは、この限りではありません。また、クレジットリンク債、クレジット・デリバティブなどについては、参照資産を基礎として上記投資割合を算出します。 ・ ファンドは、全体のポートフォリオ運用戦略の一環として、または債券価格の下落を相殺するために、空売りを行なうことができます。 ・ ファンドは、先物取引などの派生商品に投資をすることができます。 ・ 借入れの合計金額が各ファンドの純資産総額の10%を超える借入れ残高が生じる借入れは行なえないものとします。 ・ 流動性の乏しい証券への投資は、ファンドの純資産総額の15%までとします。 ・ 優先株式などの有価証券に投資を行なう場合があります。 	
収益分配	毎月、利子収入および売買益などから分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	
ファンドに係る費用		
信託報酬など	ありません。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	ありません。	
その他の費用など	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用など。	
その他		
投資顧問会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
管理会社	パシフィック・インベストメント・マネジメント・カンパニー・エルエルシー	
信託期間	無期限(2006年10月31日設定)	
決算日	原則として、毎年6月末日	

●投資明細表(2022年6月30日現在)

<PIMCOエマージング債券ストラテジーファンド>

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
投資有価証券 96.8%		
アルゼンチン 0.2%		
ソブリン債 0.2%		
Argentina Boco		
47.331% due 10/04/2022	ARS 2,391	\$ 2
Argentina Government International Bond		
0.500% due 07/09/2030	\$ 93	20
1.125% due 07/09/2035	111	23
Autonomous City of Buenos Aires Argentina		
53.715% due 03/29/2024	ARS 445	\$ 2
Total Argentina		47
(Cost \$184)		
アゼルバイジャン 0.9%		
社債等 0.9%		
SOCAR Turkey Enerji AS via Steas Funding 1 DAC		
7.230% due 03/17/2026	\$ 300	281
Total Azerbaijan		281
(Cost \$298)		
ブラジル 5.9%		
社債等 5.5%		
Banco BTG Pactual S.A.		
8.300% due 08/15/2024	BRL 4,000	706
Banco Daycoval S.A.		
4.250% due 12/13/2024	\$ 150	144
Di S.A.		
1.913% due 02/25/2035	BRL 1	56
Swiss Insured Brazil Power Finance Sarl		
9.850% due 07/16/2032	4,882	812
		1,718
仕組債 0.4%		
Vale S.A.		
3.202% due 03/30/2170 (a)	1,550	127
Total Brazil		1,845
(Cost \$2,683)		
英領バージン諸島 0.1%		
社債等 0.1%		
Flourish Century Holdings Ltd.		
14.298% due 02/04/2049 (c)(d)(f)	\$ 200	22
Total British Virgin Islands		22
(Cost \$194)		
ケイマン諸島 2.1%		
資産担保証券 1.5%		
Anchorage Capital CLO 6 Ltd.		
2.094% due 07/15/2030	250	247
MidOcean Credit CLO II		
2.269% due 01/29/2030	235	232
		479
社債等 0.6%		
Interoceania IV Finance Ltd.		
0.000% due 11/30/2025	24	21
Poinsettia Finance Ltd.		
6.626% due 06/17/2031	189	172
		193
Total Cayman Islands		672
(Cost \$692)		

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
チリ 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos		
5.000% due 03/01/2035	CLP 5,000	\$ 5
Total Chile		5
(Cost \$6)		
中国 1.2%		
ソブリン債 1.2%		
China Government International Bond		
3.280% due 12/03/2027	CNY 1,740	268
3.810% due 09/14/2050	700	113
Total China		381
(Cost \$385)		
コロンビア 6.2%		
社債等 1.2%		
Empresas Publicas de Medellin ESP		
7.625% due 09/10/2024	COP 961,000	215
8.375% due 11/08/2027	871,000	168
		383
ソブリン債 5.0%		
Colombian TES		
5.750% due 11/03/2027	1,335,000	254
6.000% due 04/28/2028	419,200	79
6.250% due 11/26/2025	3,018,200	637
6.250% due 11/03/2027	1,230,300	233
6.250% due 07/09/2036	167,000	28
7.000% due 03/26/2031	247,900	45
7.000% due 06/30/2032	45,000	8
7.500% due 08/26/2026	1,174,300	251
9.250% due 05/28/2042	84,500	16
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter		
7.875% due 08/12/2024	94,000	21
		1,572
Total Colombia		1,955
(Cost \$2,542)		
チェコ共和国 1.3%		
ソブリン債 1.3%		
Czech Republic Government Bond		
1.200% due 03/13/2031	CZK 2,700	85
2.000% due 10/13/2033	9,000	289
4.200% due 12/04/2036	1,100	43
Total Czech Republic		417
(Cost \$590)		
デンマーク 1.7%		
社債等 1.7%		
Jyske Realkredit A/S		
1.500% due 10/01/2053	DKK 268	30
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab		
1.000% due 10/01/2050	69	8
1.500% due 10/01/2053	149	17
Nykredit Realkredit A/S		
1.000% due 10/01/2050	767	85
1.000% due 10/01/2053	30	3
1.500% due 10/01/2053	2,496	285

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Realcredit Danmark A/S		
1.000% due 10/01/2050	DKK 364	\$ 40
1.500% due 10/01/2053	446	51
Total Denmark		519
(Cost \$692)		
ドミニカ共和国 0.9%		
ソブリン債 0.9%		
Dominican Republic International Bond		
8.900% due 02/15/2023	DOP 16,000	291
Total Dominican Republic		291
(Cost \$288)		
ハンガリー 2.1%		
ソブリン債 2.1%		
Hungary Government Bond		
2.000% due 05/23/2029	HUF 56,100	102
3.000% due 08/21/2030	41,500	77
3.000% due 10/27/2038	1,700	2
3.250% due 10/22/2031	24,000	44
4.000% due 04/28/2051	12,700	19
5.500% due 06/24/2025	173,200	423
Total Hungary		667
(Cost \$1,196)		
インドネシア 0.0%		
ソブリン債 0.0%		
Indonesia Government International Bond		
6.500% due 02/15/2031	IDR 6,000	0
8.375% due 03/15/2034	164,000	12
Total Indonesia		12
(Cost \$12)		
アイルランド 0.4%		
社債等 0.1%		
Alfa Bank AD Via Alfa Bond Issuance PLC		
9.350% due 08/06/2022 (c)	RUB 62,400	34
モーゲージ証券 0.3%		
European Loan Conduit No.36 DAC		
1.000% due 02/17/2030	EUR 100	103
Total Ireland		137
(Cost \$1,000)		
イスラエル 5.0%		
社債等 0.3%		
Leviathan Bond Ltd.		
6.125% due 06/30/2025	\$ 100	95
ソブリン債 4.7%		
Israel Government Bond		
0.000% due 10/07/2022	ILS 3,200	911
0.000% due 02/08/2023	1,900	539
0.750% due 07/31/2022	100	29
		1,479
Total Israel		1,574
(Cost \$1,621)		
チャネル諸島ジャージー島 0.6%		
社債等 0.6%		
Corsair International Ltd.		
4.650% due 01/28/2027	EUR 100	99
5.200% due 01/28/2029	100	97

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total Jersey, Channel Islands (Cost \$223)	\$	196
カザフスタン 0.3% 社債等 0.3%		
Development Bank of Kazakhstan JSC 8.950% due 05/04/2023 KZT	52,000	97
Total Kazakhstan (Cost \$159)		97
ルクセンブルク 0.0% 社債等 0.0%		
Sherbank of Russia Via SB Capital S.A. 5.250% due 05/23/2023 (bl/c) \$	200	14
Total Luxembourg (Cost \$206)		14
マレーシア 2.9% ソブリン債 2.9%		
Malaysia Government International Bond		
3.447% due 07/15/2036 MYR	500	100
3.733% due 06/15/2029	150	33
3.844% due 04/15/2033	100	21
3.885% due 08/15/2029	300	67
4.065% due 06/15/2050	820	161
4.130% due 07/09/2029	200	45
4.369% due 10/31/2028	1,600	366
4.417% due 09/30/2041	400	87
4.762% due 04/07/2037	200	46
Total Malaysia (Cost \$1,001)		926
メキシコ 2.1% 社債等 0.1%		
America Movil SAB de C.V. 8.460% due 12/18/2036 MXN	1,000	43
ソブリン債 2.0%		
Mexico Government International Bond		
7.750% due 05/29/2031	7,600	347
7.750% due 11/13/2042	3,000	130
8.000% due 11/07/2047	2,300	102
8.500% due 11/18/2038	800	38
		617
Total Mexico (Cost \$793)		660
オランダ 0.5% バンク・ローン債務 0.0%		
Sigma Holdco BV 6.320% due 07/02/2025 PLN	100	16
ソブリン債 0.5%		
Republic of Angola Via Avenir II BV 6.609% due 12/07/2023 \$	45	45
10.447% due 07/01/2023	108	108
		153
Total Netherlands (Cost \$176)		169

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ナイジェリア 0.7% バンク・ローン債務 0.4%		
Bank of Industry Ltd. 7.745% due 12/14/2023 \$	133	134
社債等 0.3%		
BOI Finance BV 7.500% due 02/16/2027 EUR	100	85
Total Nigeria (Cost \$247)		219
ペルー 4.8% 社債等 0.4%		
Banco de Credito del Peru S.A. 4.650% due 09/17/2024 PEN	530	129
ソブリン債 4.4%		
Fondo MIVIVIENDA S.A. 7.000% due 02/14/2024	430	112
Peru Government International Bond		
5.400% due 08/12/2034	500	106
5.940% due 02/12/2029	1,800	433
6.150% due 08/12/2032	200	47
6.350% due 08/12/2028	1,000	248
6.900% due 08/12/2037	200	48
6.950% due 08/12/2031	300	75
8.200% due 08/12/2026	1,100	303
		1,372
Total Peru (Cost \$1,820)		1,501
フィリピン 0.6% ソブリン債 0.6%		
Philippines Government International Bond 3.900% due 11/26/2022 PHP	10,000	178
Total Philippines (Cost \$210)		178
ポーランド 2.6% ソブリン債 2.6%		
Poland Government International Bond		
0.250% due 10/25/2026 PLN	800	133
1.750% due 04/25/2032	500	71
2.500% due 07/25/2027	100	18
2.750% due 04/25/2028	2,800	500
2.750% due 10/25/2029	600	103
Total Poland (Cost \$950)		825
ルーマニア 4.2% ソブリン債 4.2%		
Romania Government International Bond		
3.650% due 07/28/2025 RON	500	92
3.650% due 09/24/2031	800	116
3.700% due 11/25/2024	2,700	511
4.150% due 01/26/2028	700	119
4.400% due 09/25/2023	600	121
4.500% due 06/17/2024	1,200	235
4.750% due 10/11/2034	300	44
4.850% due 07/25/2029	200	34
5.000% due 02/12/2029	300	52
Total Romania (Cost \$1,584)		1,324

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
ロシア 0.7% ソブリン債 0.7%		
Russia Government International Bond		
4.500% due 07/16/2025 RUB	8,500	14
5.700% due 05/17/2028	18,600	30
6.900% due 07/23/2031	20,600	34
7.050% due 01/19/2028	5,300	9
7.650% due 04/10/2030	22,300	37
7.700% due 03/23/2033	15,200	25
7.950% due 10/07/2026	39,100	64
Total Russia (Cost \$1,846)		213
南アフリカ 10.5% 社債等 2.4%		
Development Bank of Southern Africa Ltd. 8.600% due 10/21/2024 (f) ZAR	3,900	234
Eskom Holdings SOC Ltd.		
0.000% due 08/18/2027	2,800	78
0.000% due 12/31/2032	6,900	84
7.850% due 04/02/2026	6,000	346
		742
ソブリン債 8.1%		
South Africa Government International Bond		
6.250% due 03/31/2036	7,600	301
8.000% due 01/31/2030	7,400	393
8.500% due 01/31/2037	3,200	156
8.750% due 01/31/2044	1,200	57
9.000% due 01/31/2040	3,700	182
10.500% due 12/21/2026	22,700	1,467
		2,555
Total South Africa (Cost \$3,873)		3,297
国際機関 0.2% ソブリン債 0.2%		
Asian Development Bank 4.700% due 03/12/2024 MXN	1,000	45
International Finance Corp. 8.000% due 10/09/2023 IDR	100,000	7
Total Supranational (Cost \$56)		52
タイ 0.4% ソブリン債 0.4%		
Thailand Government Bond 3.300% due 06/17/2038 THB	4,740	129
Total Thailand (Cost \$129)		129
ウガンダ 0.1% ソブリン債 0.1%		
Republic of Uganda Government Bond 16.250% due 11/09/2035 UGX	154,800	41
Total Uganda (Cost \$48)		41
ウクライナ 0.1% ソブリン債 0.1%		
Ukraine Government International Bond 7.750% due 09/01/2023 \$	100	33

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Total Ukraine	\$	33
(Cost \$56)		
英国 0.6%		
モーゲージ証券 0.6%		
Canada Square Funding PLC		
1.985% due 10/17/2051	GBP 54	66
Harbour		
1.813% due 01/28/2054	100	118
Total United Kingdom		184
(Cost \$199)		
米国 7.8%		
資産担保証券 0.3%		
OneMain Financial Issuance Trust		
4.130% due 05/14/2035	\$ 100	99
社債等 1.0%		
Charter Communications Operating LLC		
4.908% due 07/23/2025	100	101
Ford Motor Credit Co. LLC		
3.550% due 10/07/2022	200	199
		300
モーゲージ証券 6.1%		
Adjustable Rate Mortgage Trust		
2.925% due 09/25/2035 (c)	4	3
Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust		
1.704% due 05/25/2037	4	3
Banc of America Funding Trust		
2.072% due 02/20/2047	41	38
Banc of America Mortgage Trust		
2.733% due 02/25/2036 (c)	3	3
3.538% due 07/25/2034	14	14
Bear Stearns Alternative-A Trust		
1.944% due 02/25/2034	27	25
Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust		
2.674% due 08/25/2037	25	23
Chase Mortgage Finance Trust		
3.342% due 03/25/2037 (c)	15	15
Citigroup Mortgage Loan Trust		
1.684% due 07/25/2045	29	22
1.694% due 01/25/2037	7	7
2.360% due 03/25/2034	3	2
2.585% due 07/25/2046 (c)	9	8
2.629% due 08/25/2035 (c)	9	7
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust		
2.920% due 09/25/2047 (c)	6	6
Credit Suisse Mortgage Capital		
1.168% due 11/30/2037	200	182
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC		
1.744% due 07/25/2037	128	90
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust		
1.684% due 11/25/2036	5	3
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust		
1.802% due 10/19/2036 (c)	120	105
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust		
2.790% due 11/25/2035 (c)	22	16
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust		
2.998% due 08/25/2037 (c)	52	22

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates		
2.684% due 10/25/2033	\$ 4	\$ 4
GSAMP Trust		
1.694% due 12/25/2036	17	9
HarborView Mortgage Loan Trust		
3.401% due 08/19/2036 (c)	2	2
Home Equity Asset Trust		
2.974% due 02/25/2033	85	83
HSI Asset Loan Obligation Trust		
1.744% due 12/25/2036	7	2
Impac CMB Trust		
2.264% due 03/25/2035	98	92
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust		
3.016% due 12/25/2034	6	6
JPMorgan Mortgage Trust		
2.843% due 04/25/2036 (c)	28	26
Luminent Mortgage Trust		
1.984% due 12/25/2036 (c)	8	7
MASTR Alternative Loan Trust		
2.024% due 03/25/2036 (c)	44	4
MASTR Asset-Backed Securities Trust		
1.674% due 01/25/2037	22	7
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust		
2.124% due 11/25/2035	26	25
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust		
2.731% due 04/25/2037 (c)	20	19
Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust		
1.684% due 05/25/2037	12	10
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust		
2.535% due 06/25/2036	3	3
Mortgage Equity Conversion Asset Trust		
3.280% due 05/25/2042	149	146
New Century Home Equity Loan Trust		
1.984% due 05/25/2036	27	26
New Residential Mortgage Loan Trust		
2.750% due 11/25/2059	114	109
New York Mortgage Trust		
2.164% due 04/25/2035	91	89
Option One Mortgage Loan Trust		
1.764% due 03/25/2037	191	174
Residential Asset Securitization Trust		
2.024% due 01/25/2046 (c)	56	19
Residential Funding Mortgage Securities I Trust		
3.027% due 09/25/2035 (c)	13	9
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust (c)		
1.744% due 12/25/2036	56	16
1.784% due 11/25/2036	31	11
Sequoia Mortgage Trust		
2.224% due 01/20/2047 (c)	7	5
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust		
3.030% due 07/25/2034	120	117
3.032% due 01/25/2035	19	19
Structured Asset Mortgage Investments II Trust		
2.095% due 07/19/2035	39	37
2.255% due 10/19/2034	110	105

	元本金額 (単位:千)	評価額 (単位:千)
Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust		
6.000% due 10/25/2036 (c)	\$ 77	\$ 77
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust (c)		
2.650% due 01/25/2037	19	17
2.742% due 04/25/2037	12	11
2.856% due 09/25/2036	3	3
3.196% due 12/25/2036	37	34
		1,917
仕組債 0.4%		
JPMorgan Structured Products BV		
12.000% due 08/28/2026 (f)	ZMW 3,000	121
米国政府機関債 0.0%		
Fannie Mae		
1.066% due 12/25/2036	\$ 4	4
1.523% due 06/01/2043	9	9
1.524% due 07/01/2044	2	2
		15
Total United States		2,452
(Cost \$2,646)		
短期金融商品 29.1%		
定期預金 0.7%		
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	5	5
Bank of Nova Scotia		
0.560% due 07/04/2022	CAD 1	0
1.060% due 07/01/2022	\$ 7	7
BNP Paribas Bank		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 5	6
(0.730%) due 07/01/2022	DKK 2	0
Brown Brothers Harriman & Co.		
3.850% due 07/01/2022	ZAR 162	10
Citibank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 26	26
DBS Bank Ltd.		
1.060% due 07/01/2022	22	22
HSBC Bank PLC		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 2	2
JPMorgan Chase Bank N.A.		
1.060% due 07/01/2022	\$ 53	53
Royal Bank of Canada		
1.060% due 07/01/2022	2	2
Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 5	6
1.060% due 07/01/2022	\$ 23	23
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.		
(0.780%) due 07/01/2022	EUR 1	1
1.060% due 07/01/2022	\$ 50	50
The Hongkong and Shanghai Banking Corp. Ltd.		
0.650% due 07/01/2022	SGD 9	7
		220
アルゼンチン短期国債 0.0%		
51.282% due 09/30/2022 (d)	ARS 3,000	10
イスラエル短期国債 2.7%		
1.184% due 03/02/2023 (d)	ILS 3,000	\$ 849

	元本金額 (単位：千)	評価額 (単位：千)
日本短期国債 14.5%		
(0.146%) due 09/20/2022 (e)	¥ 210,000	\$ 1,546
(0.098%) due 07/11/2022 (d)	410,000	3,018
		4,564
シンガポール短期国債 4.6%		
1.161% due 07/08/2022 (d)	SGD 2,000	1,437
米国短期国債 (d) 2.5%		
0.778% due 07/12/2022	\$ 700	700
0.802% due 07/28/2022	100	100
		800
米国財務省キャッシュ・マネジメント・ビル 4.1%		
2.069% due 10/25/2022 (d)	1,300	1,292
Total Short-Term Instruments		9,172
(Cost \$9,579)		
Total Investments in Securities 96.8%	\$	30,507
(Cost \$38,184)		
Financial Derivative		
Instruments (g)(h) 1.5%		487
(Cost or Premiums, net \$11)		
Other Assets and Liabilities, net 1.7%		526
Net Assets 100.0%	\$	31,520

投資明細表に対する注記：

* 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

- (a) 永久債 (記載の日付は次回の契約上の償還日) である。
 (b) 偶発転換社債
 (c) 当有価証券は、債務不履行状態にある。
 (d) クーボンは最終利回りである。
 (e) クーボンは加重平均最終利回りである。

(f) 制限証券：

発行体名称	クーポン	満期日	取得日	取得原価	市場価格	市場価値の 対純資産比率
Development Bank of Southern Africa Ltd.	8.600%	10/21/2024	10/07/2021	\$ 262	\$ 234	0.74%
Flourish Century Holdings Ltd.	14.298%	02/04/2049	08/25/2021	194	22	0.07%
JPMorgan Structured Products BV	12.000%	08/28/2026	06/15/2021	79	121	0.39%
Total Restricted Securities				\$ 535	\$ 377	1.20%

借入およびその他の金融取引

2022年6月30日に終了した年度中の平均借入残高は\$266で、加重平均金利は5.229%であった。当年度中にセール・バイバック取引とリバース・レガ契約に係る残高がある場合、平均借入額にはそれらが含まれる。

(g) 金融デリバティブ商品：上場または中央清算

スワップ契約：

社債、サブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

参照債務	受取固定金利	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2022年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽³⁾	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Boeing Co.	1.000%	12/20/2026	2.445%	\$ 200	\$ (11)	(10)	\$ 0	\$ (1)
General Electric Co.	1.000%	12/20/2023	0.844%	300	1	(4)	0	(1)
					\$ (10)	\$ (14)	\$ 0	\$ (2)

信用指数に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの売り⁽¹⁾

指数/トランシェ	受取固定金利	満期日	想定元本 ⁽²⁾	市場価格 ⁽⁴⁾	未実現評価(損)益	変動証拠金	
						資産	負債
iTraxx Asia ex-Japan IG Series 37 Index Version 1	1.000%	06/20/2027	\$ 1,000	\$ (19)	\$ (14)	\$ 0	\$ (2)
金利スワップ							

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.865%	01/09/2023	ZAR 2,700	\$ (11)	\$ 6	\$ 1	\$ 0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.375%	01/29/2023	6,000	(3)	12	1	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.250%	09/19/2023	6,900	(3)	27	3	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.750%	03/02/2024	20,800	26	26	0	(11)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.515%	03/07/2024	5,700	(3)	27	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.124%	03/08/2024	9,200	8	8	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.250%	03/15/2024	1,400	(2)	9	1	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.750%	03/20/2024	8,200	(5)	42	4	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.600%	06/19/2024	13,700	6	(73)	0	(7)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.255%	07/09/2025	1,200	(5)	(5)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.105%	12/02/2025	5,400	(26)	(22)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.855%	02/11/2026	1,100	(2)	(7)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.200%	03/08/2026	6,100	20	33	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.757%	04/14/2026	4,500	(19)	(20)	0	(11)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.700%	04/21/2026	2,100	(9)	(10)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.680%	06/08/2026	2,100	(9)	(10)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.801%	06/09/2026	1,700	(8)	(8)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	9.500%	09/16/2026	1,700	(6)	16	2	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	5.324%	12/21/2026	14,700	93	69	4	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.555%	02/16/2027	1,100	(4)	(4)	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	6.956%	03/11/2027	1,400	(4)	(4)	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.300%	03/15/2027	6,100	(4)	55	5	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.205%	04/22/2027	1,800	3	3	0	0
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.210%	04/22/2027	1,400	3	3	0	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.500%	12/19/2028	13,000	0	(117)	0	(12)
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.750%	03/20/2029	14,200	9	(133)	0	(13)
Receive	3-Month ZAR-SAJIBOR	7.720%	06/11/2029	14,000	38	111	4	0
Pay	3-Month ZAR-SAJIBOR	8.000%	06/19/2029	3,100	(6)	(26)	0	(3)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.781%	02/04/2024	CZK 10,400	(39)	(43)	0	(11)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.475%	06/04/2025	3,500	(22)	(15)	1	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.915%	09/01/2025	200	(1)	(1)	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	2.000%	09/19/2025	16,500	75	87	3	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.050%	12/23/2025	17,800	(108)	(84)	5	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.575%	03/26/2026	8,300	(51)	(49)	3	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	0.765%	04/07/2026	2,900	21	15	0	(11)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.872%	08/05/2026	8,600	(49)	(38)	4	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	3.530%	12/27/2026	1,400	(4)	(3)	1	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	3.770%	02/11/2027	3,800	(12)	(11)	2	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.164%	03/14/2027	7,500	17	17	0	(5)
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.220%	03/14/2027	8,400	18	18	0	(5)
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.310%	03/15/2027	1,700	3	3	0	(1)
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.320%	03/15/2027	600	1	1	0	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.490%	03/25/2027	3,800	6	6	0	(2)
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.560%	03/25/2027	3,800	6	6	0	(2)
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	4.700%	03/29/2027	1,900	3	3	0	(1)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	4.876%	04/19/2027	2,900	(3)	(2)	2	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	6.221%	06/17/2027	11,100	15	15	8	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	5.606%	06/28/2027	3,200	1	1	2	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	2.000%	06/20/2028	10,400	73	84	1	0
Receive	6-Month CZK-PRIBOR	1.750%	06/19/2029	14,100	118	123	0	(1)
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	1.477%	02/04/2030	5,800	(58)	(54)	3	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.929%	03/13/2030	3,900	(45)	(31)	2	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	0.800%	05/11/2030	5,800	(68)	(42)	4	0
Pay	6-Month CZK-PRIBOR	2.715%	10/20/2031	3,400	(23)	3	1	0
Pay	6-Month EURIBOR	0.700%	04/11/2027	EUR 1,700	(83)	(83)	22	0
Receive ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	(0.250%)	09/21/2027	1,700	185	94	0	(22)
Receive ⁽⁵⁾	6-Month EURIBOR	0.250%	09/21/2032	500	96	51	0	(9)
Pay	6-Month HUF-BUBOR	2.325%	07/20/2024	HUF 33,000	(12)	(12)	0	0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	4.790%	01/17/2027	56,900	(21)	(19)	2	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	6-Month HUF-BUBOR	6.280%	03/18/2027	HUF 206,700	\$ (47)	\$ (39)	\$ 7	\$ 0
Pay	6-Month HUF-BUBOR	2.680%	06/29/2031	23,400	(19)	(13)	1	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.500%	09/19/2023	800	(9)	(17)	0	(3)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.790%	01/09/2024	3,700	74	97	3	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.942%	03/20/2024	700	15	20	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.250%	03/20/2024	2,300	(47)	(69)	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.250%	06/19/2024	2,400	53	24	4	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	0.655%	05/21/2025	1,500	59	51	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.500%	03/16/2026	600	20	29	0	(1)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.460%	05/28/2026	700	(30)	(31)	2	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.465%	06/07/2026	300	(12)	(13)	1	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.330%	08/23/2026	400	(17)	(17)	1	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.930%	10/05/2026	2,000	(79)	(75)	5	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	2.375%	10/12/2026	600	(21)	(21)	1	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	3.004%	12/09/2026	600	18	18	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.950%	12/13/2026	700	21	21	0	(2)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	4.135%	02/08/2027	1,000	(23)	(23)	3	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.097%	02/25/2027	1,000	(51)	(47)	2	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	4.075%	03/07/2027	1,700	40	40	0	(5)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	4.320%	03/09/2027	300	6	6	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	4.350%	03/09/2027	300	6	6	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	4.885%	03/22/2027	300	5	5	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.175%	03/24/2027	600	9	9	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.285%	03/25/2027	700	9	9	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.290%	03/25/2027	600	8	8	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.340%	03/28/2027	400	5	5	0	(1)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.470%	04/06/2027	800	9	9	0	(3)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.550%	04/08/2027	600	7	7	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.575%	04/08/2027	600	7	7	0	(2)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	5.980%	04/13/2027	900	(7)	(7)	3	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	5.985%	04/13/2027	900	(7)	(7)	3	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	6.010%	04/13/2027	1,000	(7)	(7)	3	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.870%	04/22/2027	1,400	12	12	0	(5)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	5.960%	04/25/2027	1,100	9	9	0	(4)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	6.210%	04/26/2027	300	2	2	0	(1)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	6.755%	05/10/2027	1,200	(1)	(1)	4	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	6.940%	06/09/2027	1,700	1	1	6	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	7.725%	06/23/2027	1,100	8	7	4	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	0.663%	06/25/2027	500	(28)	(7)	1	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	6.725%	06/27/2027	400	1	1	0	(2)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	6.843%	06/28/2027	900	0	0	3	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	7.310%	06/30/2027	500	2	0	0	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	7.310%	06/30/2027	600	(2)	(2)	0	(2)
Pay	6-Month PLN-WIBOR	3.250%	06/20/2028	800	(30)	(55)	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.490%	08/29/2029	1,700	108	104	0	(2)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.585%	10/14/2029	100	4	4	0	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.421%	02/25/2030	1,400	(96)	(90)	5	0
Pay	6-Month PLN-WIBOR	1.163%	12/03/2030	400	(30)	(25)	1	0
Receive	6-Month PLN-WIBOR	1.110%	01/12/2031	900	71	58	0	(3)
Receive	6-Month PLN-WIBOR	2.920%	12/13/2031	500	27	27	0	(3)
Pay	7-Day China Fixing Repo Rate	2.500%	03/16/2027	CNY 2,800	(2)	(3)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.020%	01/02/2023	BRL 6,600	(94)	(58)	59	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.030%	01/02/2023	4,000	(57)	(35)	36	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.038%	01/02/2023	1,000	(14)	(9)	9	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.045%	01/02/2023	11,800	155	102	0	(105)
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.070%	01/02/2023	3,500	(48)	(30)	31	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.100%	01/02/2023	9,100	(124)	(79)	81	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.605%	01/02/2023	4,500	54	39	0	(40)
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.640%	01/02/2023	6,100	72	52	0	(54)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.000%	01/02/2023	2,800	(23)	(24)	24	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.150%	01/02/2023	10,600	77	89	0	(90)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.250%	01/02/2023	7,000	(48)	(58)	59	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.440%	01/02/2023	1,500	(7)	(12)	13	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.745%	01/02/2023	400	1	3	0	(3)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.920%	01/02/2023	1,300	(4)	(11)	11	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.230%	01/02/2023	3,600	(3)	(29)	29	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.375%	01/02/2023	BRL 1,800	\$ 0	\$ (14)	\$ 14	\$ 0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.410%	01/02/2023	8,100	(71)	(68)	70	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.675%	01/02/2023	7,700	13	(61)	61	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.195%	01/02/2023	6,400	51	51	0	(52)
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.260%	01/02/2023	6,300	49	49	0	(50)
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.415%	01/02/2023	6,800	(187)	45	0	(42)
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.030%	01/02/2023	1,600	(51)	10	0	(9)
Receive	BRL-CDI-Compounded	4.720%	01/02/2024	4,000	92	57	0	(60)
Pay	BRL-CDI-Compounded	4.870%	01/02/2024	4,600	(102)	(69)	73	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.100%	01/02/2024	3,700	79	55	0	(58)
Receive	BRL-CDI-Compounded	5.160%	01/02/2024	8,000	168	119	0	(126)
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.680%	01/02/2024	12,000	(188)	(175)	184	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.310%	01/02/2024	900	(14)	(13)	14	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.775%	01/02/2024	2,700	(38)	(38)	40	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.790%	01/02/2024	1,100	15	16	0	(17)
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.075%	01/02/2024	1,100	(15)	(13)	14	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.545%	01/02/2024	800	(8)	(7)	7	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.660%	01/02/2024	1,200	(11)	(11)	11	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.665%	01/02/2024	100	(1)	(1)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.755%	01/02/2024	300	(2)	(2)	2	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.633%	01/02/2024	700	(4)	(4)	5	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.898%	01/02/2024	600	(3)	(3)	4	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.995%	01/02/2024	200	(1)	(1)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.065%	01/02/2024	600	(3)	(3)	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.148%	01/02/2024	200	(1)	(1)	1	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.505%	01/02/2024	1,400	6	6	0	(6)
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.530%	01/02/2024	4,700	19	19	0	(21)
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.535%	01/02/2024	1,500	6	6	0	(7)
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.540%	01/02/2024	1,400	6	6	0	(6)
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.543%	01/02/2024	1,400	6	6	0	(6)
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.290%	01/02/2024	900	(1)	(1)	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.660%	01/02/2025	4,000	(111)	(72)	76	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	5.710%	01/02/2025	1,200	(27)	(21)	23	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.010%	01/02/2025	700	(14)	(12)	13	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.050%	01/02/2025	1,200	24	21	0	(22)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.710%	01/02/2025	3,400	48	58	0	(62)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.745%	01/02/2025	4,700	65	80	0	(85)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.810%	01/02/2025	2,400	32	41	0	(43)
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.160%	01/02/2025	200	3	3	0	(4)
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.480%	01/02/2025	11,100	86	165	0	(196)
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.475%	01/02/2025	2,800	1	(45)	46	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.700%	01/02/2025	3,200	(9)	51	0	(54)
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.760%	01/02/2025	5,400	84	(82)	87	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.330%	01/02/2025	11,500	231	(172)	180	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.315%	01/02/2025	1,200	(6)	(6)	7	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.425%	01/02/2025	4,300	(4)	(4)	8	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.740%	01/02/2025	3,000	1	1	1	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	13.520%	01/02/2025	2,200	98	(30)	30	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.020%	01/04/2027	1,100	38	25	0	(14)
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.140%	01/04/2027	8,900	(286)	(200)	214	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.180%	01/04/2027	1,700	54	39	0	(41)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.245%	01/04/2027	700	23	16	0	(17)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.250%	01/04/2027	600	19	14	0	(15)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.450%	01/04/2027	1,500	44	34	0	(36)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.500%	01/04/2027	700	21	21	0	(22)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.520%	01/04/2027	1,500	42	34	0	(36)
Receive	BRL-CDI-Compounded	6.950%	01/04/2027	800	19	18	0	(19)
Pay	BRL-CDI-Compounded	6.990%	01/04/2027	1,300	(30)	(29)	31	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.115%	01/04/2027	1,500	(32)	(33)	35	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.305%	01/04/2027	800	(15)	(17)	19	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	7.465%	01/04/2027	1,400	(33)	(31)	33	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.770%	01/04/2027	2,700	67	60	0	(64)
Receive	BRL-CDI-Compounded	7.800%	01/04/2027	1,800	27	39	0	(41)
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.355%	01/04/2027	900	(20)	(20)	21	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.450%	01/04/2027	1,500	(33)	(33)	35	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.635%	01/04/2027	3,400	24	71	0	(75)

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.640%	01/04/2027	BRL 800	\$ 6	\$ 17	\$ 0	\$ (18)
Pay	BRL-CDI-Compounded	8.675%	01/04/2027	1,200	(7)	(25)	27	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	8.750%	01/04/2027	3,700	65	80	0	(85)
Pay	BRL-CDI-Compounded	9.600%	01/04/2027	1,300	6	(26)	27	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.090%	01/04/2027	600	4	(12)	13	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.206%	01/04/2027	100	(1)	(1)	1	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.460%	01/04/2027	3,100	(42)	60	0	(63)
Receive	BRL-CDI-Compounded	10.700%	01/04/2027	2,100	(30)	40	0	(43)
Pay	BRL-CDI-Compounded	10.995%	01/04/2027	800	(6)	(6)	7	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.020%	01/04/2027	600	(5)	(5)	5	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.045%	01/04/2027	700	(5)	(5)	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.048%	01/04/2027	1,100	(8)	(8)	10	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.050%	01/04/2027	800	(6)	(6)	7	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.055%	01/04/2027	700	(5)	(5)	6	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.085%	01/04/2027	800	(6)	(6)	7	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.130%	01/04/2027	300	(2)	(2)	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.140%	01/04/2027	400	(3)	(3)	3	0
Pay	BRL-CDI-Compounded	11.350%	01/04/2027	600	12	(11)	12	0
Receive	BRL-CDI-Compounded	11.611%	01/04/2027	700	3	3	0	(4)
Pay	BRL-CDI-Compounded	12.250%	01/04/2027	2,500	61	(46)	49	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	2.148%	09/25/2022	COP 2,284,200	(8)	1	0	(2)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.490%	02/15/2023	1,013,000	(2)	(2)	0	(8)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	2.510%	07/28/2023	1,735,700	(33)	(19)	14	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.560%	02/14/2024	1,308,000	9	9	0	(11)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.900%	07/24/2024	2,799,500	74	63	0	(59)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.885%	01/31/2025	709,000	10	10	0	(11)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.500%	02/15/2025	365,000	4	4	0	(4)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.855%	02/22/2025	547,400	5	5	0	(5)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.450%	03/31/2025	87,000	3	3	0	(8)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.020%	04/08/2025	890,700	6	6	0	(9)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.800%	05/05/2025	329,000	12	10	0	(9)
Receive ⁽⁵⁾	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.470%	07/01/2025	164,000	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.180%	09/04/2025	389,900	16	11	0	(11)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.240%	10/15/2025	1,228,000	(53)	(36)	33	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.060%	11/26/2025	486,000	19	16	0	(16)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.640%	11/26/2025	357,500	(12)	(12)	12	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.651%	11/26/2025	187,000	(6)	(6)	7	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.820%	11/26/2025	187,900	(6)	(7)	7	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.610%	11/26/2025	339,700	2	2	0	(2)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.720%	11/26/2025	546,200	2	2	0	(3)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.270%	11/26/2025	603,000	0	0	0	(1)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.125%	01/15/2026	746,000	34	21	0	(21)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.620%	05/11/2026	1,850,100	(68)	(67)	66	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	01/11/2027	COP 1,328,600	\$ 29	\$ 29	\$ 0	\$ (32)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.040%	01/25/2027	142,500	3	3	0	(3)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.130%	01/31/2027	255,000	4	4	0	(5)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.140%	02/01/2027	515,000	9	9	0	(11)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.080%	02/02/2027	190,900	3	3	0	(4)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.585%	02/14/2027	580,000	(8)	(8)	9	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.200%	03/11/2027	570,000	(5)	(5)	6	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.240%	03/15/2027	306,800	(3)	(3)	3	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.560%	03/30/2027	66,900	0	0	2	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.686%	03/30/2027	398,000	(2)	(2)	9	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.320%	03/31/2027	158,000	(1)	(1)	5	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.890%	04/08/2027	350,200	4	4	0	(5)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.913%	04/08/2027	539,000	6	6	0	(7)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.940%	04/08/2027	271,300	3	3	0	(4)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.360%	06/02/2027	890,000	(6)	(6)	8	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	9.430%	06/16/2027	233,000	(1)	(1)	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.030%	06/19/2027	200,500	10	7	0	(7)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	3.680%	11/03/2027	290,000	16	10	0	(10)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.380%	11/03/2027	133,100	4	4	0	(4)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.650%	11/03/2027	677,000	17	17	0	(18)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.355%	11/18/2027	133,700	4	4	0	(4)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.090%	04/28/2028	29,400	1	1	0	(1)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.130%	04/28/2028	10,400	0	0	0	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.140%	04/28/2028	31,100	1	1	0	(1)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.005%	08/20/2028	846,300	(48)	(31)	32	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.380%	01/21/2029	320,000	6	6	0	(7)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	7.880%	04/08/2029	443,400	6	6	0	(7)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	8.890%	05/12/2029	457,000	0	0	2	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.180%	02/11/2030	141,900	(8)	(7)	7	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.075%	02/13/2030	61,800	(3)	(3)	2	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.080%	02/13/2030	43,100	(2)	(2)	2	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.020%	02/14/2030	68,400	(4)	(3)	3	0
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.290%	06/05/2030	223,200	14	9	0	(9)

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.155%	01/15/2031	COP 77,000	\$ 5	\$ 3	\$ 0	\$ (3)
Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.950%	03/26/2031	330,400	14	14	0	(15)
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.560%	03/26/2031	88,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.630%	10/07/2031	147,000	(5)	(5)	6	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.660%	10/07/2031	72,000	(2)	(2)	3	0
Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.690%	10/07/2031	72,000	(2)	(2)	3	0
Pay ⁽⁵⁾	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	5.750%	03/15/2024	INR 390,200	(66)	9	6	0
Receive	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	5.750%	03/16/2027	10,400	5	(2)	0	(1)
Receive	Financial Benchmarks India Overnight Mumbai Interbank Outright Rate	6.250%	03/16/2032	47,300	32	(16)	0	(6)
Pay	IBMEXID	4.515%	08/17/2022	MXN 3,900	(1)	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.700%	08/25/2022	18,400	(5)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	4.245%	02/15/2023	7,000	(12)	(6)	0	0
Pay	IBMEXID	4.350%	02/15/2023	36,000	(57)	(35)	0	0
Pay	IBMEXID	4.300%	02/16/2023	22,800	(37)	(22)	0	0
Pay	IBMEXID	4.470%	02/27/2023	500	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	4.520%	02/27/2023	1,100	(2)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	4.550%	02/27/2023	11,300	(17)	(11)	0	0
Pay	IBMEXID	4.560%	02/27/2023	500	(1)	(1)	0	0
Pay	IBMEXID	4.565%	02/27/2023	500	(1)	(1)	0	0
Receive	IBMEXID	6.590%	03/15/2023	10,300	10	22	0	0
Pay	IBMEXID	4.680%	03/16/2023	4,700	(8)	(6)	0	0
Pay	IBMEXID	7.150%	03/17/2023	5,300	(4)	(13)	0	0
Receive	IBMEXID	6.360%	03/22/2023	16,400	19	37	1	0
Receive	IBMEXID	5.282%	03/29/2023	13,800	21	21	0	0
Pay	IBMEXID	5.860%	03/29/2023	13,900	(18)	(25)	0	0
Receive	IBMEXID	4.920%	04/10/2023	69,200	122	101	0	0
Pay ⁽⁵⁾	IBMEXID	9.580%	06/30/2023	23,300	0	0	0	0
Pay	IBMEXID	8.810%	10/26/2023	33,700	(15)	(141)	1	0
Pay	IBMEXID	8.910%	11/15/2023	14,600	(7)	(64)	0	0
Pay	IBMEXID	8.816%	11/16/2023	3,800	(1)	(16)	0	0
Pay	IBMEXID	7.270%	11/23/2023	36,500	(59)	(59)	2	0
Pay	IBMEXID	8.965%	11/23/2023	6,900	(2)	(30)	0	0
Pay	IBMEXID	7.110%	11/28/2023	10,200	(17)	(17)	1	0
Receive	IBMEXID	7.790%	02/09/2024	33,900	44	44	0	(2)
Receive	IBMEXID	4.540%	02/21/2024	4,400	17	11	0	0
Receive	IBMEXID	4.570%	02/21/2024	39,000	150	98	0	(2)
Receive	IBMEXID	8.035%	02/22/2024	15,600	18	66	1	0
Pay	IBMEXID	5.605%	03/26/2024	4,800	(15)	(15)	0	0
Receive	IBMEXID	8.940%	05/22/2024	15,000	7	7	0	(1)
Pay	IBMEXID	4.695%	06/25/2024	8,700	(38)	(25)	1	0
Pay	IBMEXID	4.610%	06/27/2024	9,300	(41)	(26)	1	0
Pay	IBMEXID	6.580%	01/01/2025	9,000	(28)	(39)	0	0
Pay	IBMEXID	6.620%	01/02/2025	7,900	(24)	(34)	0	0
Receive	IBMEXID	6.635%	01/15/2025	12,900	40	56	0	(1)
Pay	IBMEXID	8.010%	02/03/2025	800	(1)	(4)	0	0
Receive	IBMEXID	4.840%	02/19/2025	3,700	20	13	0	0
Receive	IBMEXID	4.850%	02/19/2025	5,000	27	18	0	(1)
Pay	IBMEXID	6.510%	02/24/2025	7,000	(24)	(31)	0	0
Pay	IBMEXID	6.415%	02/25/2025	2,400	(8)	(10)	0	0
Receive	IBMEXID	6.855%	03/20/2025	5,300	15	24	0	0
Receive	IBMEXID	4.830%	07/22/2025	7,200	43	27	0	(1)
Receive	IBMEXID	4.835%	07/24/2025	1,200	7	4	0	0
Pay	IBMEXID	4.917%	08/11/2025	6,800	(40)	(26)	1	0
Pay	IBMEXID	4.980%	08/12/2025	2,800	(16)	(10)	0	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払 / 受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	IBMEXID	5.120%	09/29/2025	MXN 55,400	\$ 320	\$ 142	\$ 0	\$ (7)
Pay	IBMEXID	4.730%	02/06/2026	9,900	(68)	(40)	2	0
Receive	IBMEXID	4.950%	02/11/2026	10,600	69	43	0	(2)
Receive	IBMEXID	6.210%	03/19/2026	2,500	11	12	0	0
Pay	IBMEXID	5.800%	04/06/2026	60,100	(319)	(278)	10	0
Pay	IBMEXID	9.070%	06/04/2026	1,500	0	0	0	0
Receive	IBMEXID	6.670%	06/19/2026	6,100	24	24	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.720%	06/19/2026	6,000	23	23	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.398%	07/16/2026	4,300	19	19	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.415%	07/16/2026	1,800	8	8	0	0
Receive	IBMEXID	6.495%	07/17/2026	1,500	6	6	0	0
Receive	IBMEXID	6.505%	07/17/2026	1,100	5	5	0	0
Receive	IBMEXID	6.370%	08/18/2026	1,900	9	9	0	0
Pay	IBMEXID	6.380%	08/19/2026	9,400	(43)	(43)	2	0
Pay	IBMEXID	7.285%	09/30/2026	800	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	7.165%	10/02/2026	2,100	(7)	(7)	0	0
Pay	IBMEXID	7.180%	10/02/2026	5,200	(17)	(17)	1	0
Pay	IBMEXID	7.250%	10/05/2026	490	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	7.285%	10/12/2026	900	(3)	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	7.450%	10/16/2026	1,500	(4)	(4)	0	0
Receive	IBMEXID	7.240%	12/16/2026	2,500	8	8	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.250%	12/16/2026	3,000	10	10	0	(1)
Pay	IBMEXID	7.533%	01/07/2027	2,400	(7)	(7)	1	0
Receive	IBMEXID	7.510%	02/04/2027	8,000	23	23	0	(2)
Receive	IBMEXID	8.431%	05/24/2027	9,900	11	11	0	(2)
Pay	IBMEXID	8.975%	06/03/2027	6,300	0	0	1	0
Receive	IBMEXID	9.060%	06/18/2027	3,700	(1)	(1)	0	(1)
Receive	IBMEXID	9.210%	11/08/2028	10,900	(7)	83	0	(2)
Receive	IBMEXID	9.090%	11/09/2028	1,200	(1)	9	0	0
Receive	IBMEXID	9.100%	11/09/2028	11,600	(4)	88	0	(3)
Receive	IBMEXID	8.550%	01/23/2029	2,400	2	17	0	0
Receive	IBMEXID	8.540%	01/25/2029	8,000	8	58	0	(2)
Receive	IBMEXID	8.430%	01/29/2029	8,400	10	60	0	(2)
Pay	IBMEXID	7.675%	06/04/2029	40,700	(130)	(215)	9	0
Receive	IBMEXID	6.830%	12/27/2029	100	1	1	0	0
Receive	IBMEXID	6.618%	01/18/2030	6,600	41	41	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.600%	02/26/2030	2,200	14	14	0	(1)
Pay	IBMEXID	7.210%	02/28/2030	3,700	(18)	(25)	1	0
Pay	IBMEXID	7.220%	02/28/2030	3,600	(17)	(24)	1	0
Receive	IBMEXID	7.750%	03/08/2030	2,000	6	14	0	(1)
Receive	IBMEXID	5.590%	07/03/2030	4,300	41	24	0	(1)
Receive	IBMEXID	5.610%	07/03/2030	11,400	107	64	0	(3)
Pay	IBMEXID	5.445%	12/05/2030	700	(7)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	5.540%	12/31/2030	8,200	(82)	(46)	2	0
Receive	IBMEXID	5.445%	01/13/2031	3,400	35	19	0	(1)
Pay	IBMEXID	5.520%	01/27/2031	6,100	(61)	(34)	2	0
Pay	IBMEXID	5.980%	02/12/2031	1,700	(15)	(10)	0	0
Pay	IBMEXID	5.990%	02/12/2031	4,000	(35)	(24)	1	0
Pay	IBMEXID	6.040%	02/12/2031	14,400	(124)	(84)	3	0
Receive	IBMEXID	6.630%	03/31/2031	17,500	121	113	0	(5)
Receive	IBMEXID	7.100%	06/13/2031	5,400	30	34	0	(2)
Receive	IBMEXID	7.070%	08/27/2031	4,600	26	26	0	(2)
Pay	IBMEXID	7.650%	09/24/2031	400	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	7.525%	09/26/2031	3,600	(15)	(15)	1	0
Pay	IBMEXID	7.650%	09/29/2031	390	(2)	(2)	0	0
Pay	IBMEXID	7.600%	10/08/2031	1,400	(6)	(6)	1	0
Pay	IBMEXID	7.700%	10/10/2031	900	(3)	(3)	0	0
Pay	IBMEXID	7.690%	10/16/2031	1,600	(6)	(6)	1	0
Pay	IBMEXID	7.416%	10/27/2031	900	(4)	(4)	0	0
Receive	IBMEXID	7.784%	11/13/2031	7,400	26	26	0	(3)
Receive	IBMEXID	7.800%	11/13/2031	2,000	7	7	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.643%	11/18/2031	2,700	11	11	0	(1)
Pay	IBMEXID	7.875%	02/17/2032	1,500	(5)	(5)	1	0
Pay	IBMEXID	7.900%	02/19/2032	1,100	(4)	(4)	0	0
Pay	IBMEXID	7.950%	02/20/2032	2,400	(7)	(7)	1	0
Pay	IBMEXID	8.050%	02/24/2032	4,000	(11)	(11)	1	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	IBMEXID	8.680%	03/30/2032	MXN 2,700	\$ (2)	\$ (2)	\$ 1	\$ 0
Pay	IBMEXID	7.755%	02/02/2034	1,000	(4)	(7)	0	0
Pay	IBMEXID	8.280%	11/28/2036	3,500	(10)	(28)	1	0
Pay	IBMEXID	8.310%	11/28/2036	1,400	(3)	(11)	1	0
Pay	IBMEXID	8.040%	11/25/2037	9,700	(39)	(76)	3	0
Pay	IBMEXID	8.540%	02/16/2039	2,300	(4)	(19)	1	0
Pay	IBMEXID	8.545%	02/16/2039	5,300	(10)	(44)	2	0
Pay	IBMEXID	7.885%	05/27/2039	9,800	(47)	(75)	3	0
Pay	IBMEXID	7.625%	07/12/2039	2,900	(18)	(22)	1	0
Pay	IBMEXID	7.640%	07/13/2039	2,500	(15)	(19)	1	0
Pay	IBMEXID	7.127%	08/10/2039	4,300	(36)	(30)	2	0
Receive	IBMEXID	7.210%	10/28/2039	1,100	9	8	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.253%	10/28/2039	2,100	16	15	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.180%	10/31/2039	2,500	21	18	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.200%	10/31/2039	2,200	17	15	0	(1)
Receive	IBMEXID	7.085%	12/26/2039	2,400	21	17	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.463%	05/18/2040	1,600	18	10	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.500%	05/25/2040	3,500	39	22	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.545%	05/30/2040	14,000	155	89	0	(5)
Receive	IBMEXID	6.540%	05/31/2040	5,100	57	33	0	(2)
Receive	IBMEXID	6.430%	06/04/2040	1,900	22	12	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.380%	06/05/2040	2,600	31	16	0	(1)
Receive	IBMEXID	6.260%	06/07/2040	2,600	32	16	0	(1)
Pay	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.750%	12/15/2026	KRW 1,781,300	(102)	(104)	3	0
Receive	KRW-CD-KSDA-Bloomberg	1.750%	12/15/2031	910,300	93	90	0	(3)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.183%	03/27/2023	CLP 44,680	(4)	(3)	1	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	9.540%	05/13/2023	242,000	0	0	0	(1)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.110%	12/14/2023	287,600	17	17	0	(16)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.170%	12/14/2023	119,900	7	7	0	(7)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.785%	01/06/2024	456,300	(23)	(23)	20	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.970%	06/28/2024	347,000	3	3	0	(3)
Pay ⁽⁵⁾	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	8.280%	07/05/2024	246,000	(1)	(1)	0	(1)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.585%	12/04/2024	148,000	20	19	0	(18)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.590%	12/04/2024	150,000	20	19	0	(18)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.635%	12/04/2024	118,000	15	15	0	(15)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.650%	12/04/2024	121,000	16	16	0	(15)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.780%	12/09/2024	122,000	(15)	(16)	16	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.510%	01/14/2025	457,300	(69)	(65)	44	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.880%	01/14/2025	50,100	(3)	(3)	2	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.720%	01/28/2025	174,000	(10)	(1)	0	(9)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.393%	02/05/2025	311,000	(48)	(43)	30	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.770%	02/08/2025	479,000	27	27	0	(25)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.335%	02/10/2025	120,000	5	5	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	02/10/2025	180,000	7	7	0	(7)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.315%	02/11/2025	227,000	9	9	0	(9)

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	02/11/2025	CLP 439,000	\$ 17	\$ 17	\$ 0	\$ (17)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.420%	02/24/2025	33,000	(5)	(5)	3	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.130%	03/01/2025	70,000	5	5	0	(5)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.425%	03/01/2025	50,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.450%	03/01/2025	40,000	(3)	(3)	2	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.940%	03/01/2025	80,000	(4)	(4)	4	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.935%	03/10/2025	150,200	25	19	0	(14)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.940%	03/10/2025	75,100	13	10	0	(7)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.280%	03/21/2025	713,000	(8)	(8)	11	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.325%	03/23/2025	116,000	(1)	(1)	2	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.810%	03/30/2025	359,000	62	44	0	(34)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.625%	04/04/2025	169,000	5	5	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.628%	04/04/2025	248,000	8	8	0	(7)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.670%	04/05/2025	163,000	5	5	0	(5)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.690%	05/10/2025	170,700	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.085%	05/27/2025	335,300	(63)	(33)	30	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.540%	06/13/2025	22,100	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.550%	06/13/2025	22,100	0	0	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.550%	06/23/2025	73,000	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.600%	06/23/2025	71,000	0	0	0	0
Pay ⁽⁵⁾	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.214%	09/21/2025	140,000	0	0	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.290%	11/05/2025	118,500	24	13	0	(11)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.545%	02/05/2026	124,000	(22)	(19)	14	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.780%	02/17/2026	108,000	22	14	0	(10)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.785%	02/17/2026	49,000	10	6	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.790%	02/17/2026	189,000	39	25	0	(18)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.640%	03/01/2026	163,000	28	25	0	(19)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.260%	03/01/2026	70,000	5	5	0	(5)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.850%	03/01/2026	110,000	(1)	(1)	2	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.290%	03/09/2026	62,400	12	9	0	(7)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.305%	03/10/2026	84,500	16	12	0	(9)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.325%	03/10/2026	56,300	10	8	0	(6)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.020%	04/30/2026	315,000	(61)	(41)	35	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.950%	05/05/2026	CLP 298,700	\$ (59)	\$ (38)	\$ 33	\$ 0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.530%	07/06/2026	80,000	12	12	0	(10)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.530%	08/06/2026	108,600	16	16	0	(14)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	11/15/2026	54,000	(5)	(5)	5	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.045%	12/14/2026	40,600	3	3	0	(3)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.865%	01/14/2027	58,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.910%	01/21/2027	111,000	(5)	(5)	5	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.550%	01/25/2027	154,800	(10)	(10)	9	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.610%	02/08/2027	152,000	(9)	(9)	9	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.030%	02/10/2027	110,000	(4)	(4)	4	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.055%	02/10/2027	82,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.975%	02/11/2027	143,000	(6)	(6)	6	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.000%	02/11/2027	280,000	(11)	(11)	12	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.270%	03/02/2027	12,500	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.195%	03/04/2027	74,800	(2)	(2)	3	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.120%	03/08/2027	38,500	1	1	0	(1)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.300%	03/11/2027	131,400	3	3	0	(4)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	03/15/2027	79,200	2	2	0	(2)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.635%	03/23/2027	37,000	0	0	0	(1)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.030%	03/28/2027	42,800	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.480%	04/01/2027	38,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.495%	04/01/2027	34,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.350%	04/04/2027	53,000	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.333%	04/05/2027	51,000	(1)	(1)	1	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.040%	05/10/2027	56,900	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.386%	05/24/2027	163,700	(3)	(3)	4	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.360%	05/25/2027	35,500	(1)	(1)	1	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.380%	06/03/2027	150,000	(3)	(3)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.684%	06/04/2027	369,200	(87)	(41)	42	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.715%	06/04/2027	73,700	(17)	(8)	8	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.765%	06/09/2027	207,000	1	1	0	(2)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.110%	06/15/2027	70,000	(1)	(1)	1	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.150%	06/15/2027	163,000	(2)	(2)	2	0

金利スワップ(続き)

変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	市場価格	未実現評価 (損)益	変動証拠金	
							資産	負債
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.160%	06/16/2027	CLP 480,000	\$ (7)	\$ (7)	\$ 5	\$ 0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	7.160%	06/22/2027	100,500	2	2	0	(1)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.800%	06/23/2027	44,000	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.900%	06/23/2027	44,000	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.470%	06/28/2027	149,500	(2)	(2)	3	0
Pay ⁽⁵⁾	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.800%	07/05/2027	57,000	0	0	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.340%	10/08/2027	29,300	6	4	0	(4)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.947%	11/23/2027	347,000	82	41	0	(41)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.965%	11/24/2027	142,200	34	17	0	(17)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.000%	11/25/2027	60,000	14	7	0	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.020%	11/25/2027	78,000	18	9	0	(9)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.245%	12/10/2027	490,000	(109)	(62)	65	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.255%	12/10/2027	96,000	(21)	(12)	13	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.195%	04/04/2028	65,000	(2)	(2)	2	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.520%	06/14/2028	26,100	4	4	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.470%	06/15/2028	345,400	58	58	0	(61)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.990%	07/06/2028	77,000	12	12	0	(11)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.000%	07/06/2028	40,000	6	6	0	(6)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.725%	07/19/2028	30,800	5	5	0	(5)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.731%	07/20/2028	202,000	34	34	0	(31)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.920%	08/06/2028	183,100	29	29	0	(27)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.015%	09/13/2028	272,400	(26)	(26)	25	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.870%	10/01/2028	40,000	(4)	(4)	4	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.180%	10/01/2028	30,000	3	3	0	(2)
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	5.570%	10/01/2028	35,000	2	2	0	(2)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.000%	10/01/2028	65,100	(2)	(2)	3	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.250%	10/01/2028	9,300	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.020%	03/02/2029	5,700	0	0	0	0
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	6.370%	06/29/2029	91,000	(1)	(1)	2	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.215%	01/14/2030	250,500	57	43	0	(33)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.120%	02/05/2030	40,000	(10)	(7)	3	0
Receive	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	1.935%	05/27/2030	172,900	53	17	0	(17)
Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	2.080%	06/01/2030	75,000	(22)	(8)	8	0

(h) 金融デリバティブ商品：店頭

外国為替先渡契約：

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損)益	
				資産	負債
BOA	07/2022	COP 214,200	\$ 52	\$ 0	\$ 0
BOA	07/2022	DKK 125	19	1	0
BOA	07/2022	GBP 391	477	3	0
BOA	07/2022	HUF 6,680	18	1	0
BOA	07/2022	MXN 4,377	213	0	(3)
BOA	07/2022	SGD 1,995	1,461	28	0
BOA	07/2022	\$ 70	CLP 61,322	0	(5)
BOA	07/2022	56	COP 214,200	0	(5)
BOA	07/2022	425	DKK 2,988	0	(5)
BOA	07/2022	43	HUF 16,534	0	0
BOA	07/2022	219	PEN 886	13	0
BOA	07/2022	ZAR 3,716	\$ 242	16	0
BOA	08/2022	DKK 2,982	425	5	0
BOA	08/2022	MXN 1,845	85	0	(6)
BOA	08/2022	PEN 260	68	0	0
BOA	08/2022	\$ 195	PEN 742	0	0
BOA	08/2022	63	TWD 1,870	0	0
BOA	09/2022	EGP 737	\$ 38	0	0
BOA	09/2022	IDR 5,557,842	376	5	0
BOA	09/2022	TRY 562	31	0	(1)
BOA	09/2022	\$ 192	PEN 742	2	0
BOA	10/2022	132	ZAR 2,051	0	(8)
BOA	11/2022	ZAR 2,346	\$ 146	5	0
BOA	12/2022	PEN 822	215	2	0
BOA	01/2023	CNH 4,475	693	26	0
BOA	02/2023	\$ 693	CNH 4,475	0	(25)
BOA	04/2023	PLN 1,168	EUR 232	0	(2)
BPS	07/2022	BRL 281	\$ 54	0	0
BPS	07/2022	CLP 23,373	25	0	0
BPS	07/2022	138,565	160	12	0
BPS	07/2022	33,203	38	3	0
BPS	07/2022	EUR 1,080	1,161	31	0
BPS	07/2022	GBP 111	140	5	0
BPS	07/2022	HUF 61,380	161	0	0
BPS	07/2022	JPY 42,200	314	3	0
BPS	07/2022	MXN 4,160	207	1	0
BPS	07/2022	2,068	100	0	(2)
BPS	07/2022	PLN 2,358	527	3	0
BPS	07/2022	RON 188	40	0	0
BPS	07/2022	\$ 54	BRL 281	0	0
BPS	07/2022	113	CLP 92,433	0	(15)
BPS	07/2022	35	DKK 250	0	0
BPS	07/2022	1,867	EUR 1,775	0	(12)
BPS	07/2022	38	GBP 31	0	0
BPS	07/2022	9	HUF 3,477	0	0
BPS	07/2022	290	MXN 6,064	11	0
BPS	07/2022	770	MYR 3,389	0	(1)
BPS	07/2022	4	PLN 18	0	0
BPS	07/2022	ZAR 231	\$ 15	1	0
BPS	08/2022	CNH 4,475	672	5	0
BPS	08/2022	COP 664,084	171	13	0
BPS	08/2022	1,241,614	307	12	0
BPS	08/2022	EUR 1,455	1,533	9	0
BPS	08/2022	GBP 471	572	0	0
BPS	08/2022	THB 14	0	0	0
BPS	08/2022	TWD 2,702	92	1	0
BPS	08/2022	\$ 147	CLP 129,981	0	(9)
BPS	08/2022	516	INR 40,204	0	(9)
BPS	08/2022	1,993	MXN 43,787	163	0
BPS	08/2022	30	TRY 552	3	0
BPS	08/2022	ZAR 1,439	\$ 89	2	0
BPS	09/2022	CNH 4,475	676	9	0
BPS	09/2022	IDR 13,793,863	933	13	0
BPS	09/2022	MYR 1,293	297	4	0

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損)益					
				資産	負債				
BPS	09/2022	TRY	160	\$	9	\$	0	\$	0
BPS	09/2022	\$	93	CLP	85,769	0	0	(3)	
BPS	09/2022		670	CNH	4,475	0	0	(3)	
BPS	09/2022		437	IDR	6,440,867	0	0	(8)	
BPS	09/2022		204	MXN	4,160	0	0	(1)	
BPS	09/2022		259	TWD	7,207	0	0	(16)	
BPS	10/2022	CNH	4,475	\$	674	7	0		
BPS	10/2022	COP	784,436		186	1	0		
BPS	10/2022	\$	674	CNH	4,475	0	0	(7)	
BPS	10/2022		70	COP	271,640	0	0	(6)	
BPS	10/2022	ZAR	52	\$	3	0	0		
BPS	11/2022	CNH	4,475		684	16	0		
BPS	11/2022	\$	673	CNH	4,475	0	0	(5)	
BPS	11/2022	ZAR	1,064	\$	66	2	0		
BPS	12/2022	CNH	4,475		686	18	0		
BPS	12/2022	TRY	2,394		184	63	0		
BPS	12/2022	\$	683	CNH	4,475	0	0	(15)	
BPS	01/2023		684		4,475	0	0	(16)	
BPS	02/2023	ILS	1,891	\$	562	13	0		
BPS	05/2023	EUR	6	CZK	163	0	0		
BPS	05/2023		13		340	0	0		
BRC	07/2022	HUF	22,840	\$	62	2	0		
BRC	07/2022	JPY	410,000		3,366	347	0		
BRC	07/2022	MYR	1,823		415	1	0		
BRC	07/2022	\$	37	HUF	13,814	0	0	(1)	
BRC	07/2022		438	MYR	1,920	0	0	(2)	
BRC	07/2022		555		2,431	0	0	(3)	
BRC	08/2022	TRY	896	\$	53	0	0		
BRC	08/2022	\$	27	IDR	390,677	0	0	(1)	
BRC	08/2022		36	KRW	45,582	0	0	(1)	
BRC	08/2022		190	SGD	263	0	0	(1)	
BRC	09/2022	MYR	208	\$	47	0	0		
BRC	09/2022	\$	32	CLP	29,106	0	0	(1)	
BRC	10/2022		205	COP	797,161	0	0	(17)	
BSS	07/2022	CLP	18,852	\$	23	3	0		
BSS	07/2022	\$	20	CLP	18,852	0	0		
BSS	09/2022		78		65,194	0	0	(10)	
CBK	07/2022	BRL	281	\$	54	0	0		
CBK	07/2022	COP	279,845		73	6	0		
CBK	07/2022	EUR	76		84	2	0		
CBK	07/2022	MXN	825		41	0	0		
CBK	07/2022	\$	54	BRL	281	0	0		
CBK	07/2022		81	CLP	69,365	0	0	(7)	
CBK	07/2022		67	COP	279,845	0	0		
CBK	07/2022		28	PEN	104	0	0	(1)	
CBK	07/2022	VND	1,226,420	\$	53	0	0		
CBK	08/2022	PEN	1,453		381	0	0		
CBK	08/2022		166		43	0	0		
CBK	08/2022		435		115	1	0		
CBK	08/2022	\$	53	BRL	281	0	0		
CBK	08/2022		642	PEN	2,410	0	0	(10)	
CBK	08/2022		80		298	0	0	(2)	
CBK	08/2022		154	TRY	2,651	0	0		
CBK	08/2022		44	TWD	1,291	0	0	(1)	
CBK	08/2022	ZAR	1,428	\$	91	4	0		
CBK	09/2022	CLP	27,425		29	0	0		
CBK	09/2022	COP	857,192		222	18	0		
CBK	09/2022	MXN	182		9	0	0		
CBK	09/2022	\$	255	MXN	5,281	4	0		
CBK	09/2022		62	UYU	2,522	1	0		
CBK	10/2022	COP	630,953	\$	150	1	0		
CBK	10/2022		194,903		47	1	0		
CBK	10/2022	ILS	3,200		943	23	0		
CBK	10/2022	\$	14	COP	54,488	0	0	(1)	
CBK	11/2022	PEN	892	\$	225	0	0	(7)	
CBK	11/2022	\$	125	PEN	497	4	0		
CBK	11/2022		20	PKR	4,700	3	0		

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損益)	
				資産	負債
CBK	11/2022	\$ 28	PKR 6,533	\$ 3	\$ 0
CBK	11/2022	20	4,320	1	0
CBK	12/2022	PEN 6,429	\$ 1,533	0	(134)
CBK	12/2022	\$ 118	PEN 460	1	0
CBK	12/2022	107	VND 2,531,570	1	0
CBK	03/2023	ILS 2,975	\$ 877	13	0
CBK	05/2023	PEN 245	62	0	(11)
DUB	07/2022	DKK 920	136	7	0
DUB	07/2022	MXN 1,316	67	2	0
DUB	07/2022	\$ 1,643	PLN 7,167	0	(51)
DUB	07/2022	415	RON 1,946	0	(5)
DUB	08/2022	PEN 65	\$ 17	0	0
DUB	08/2022	\$ 251	THB 8,708	0	(4)
DUB	08/2022	22	TWD 643	0	0
DUB	12/2022	ZAR 5,131	\$ 327	18	0
DUB	02/2023	532	32	0	0
GLM	07/2022	BRL 3,443	664	6	0
GLM	07/2022	CLP 61,263	71	6	0
GLM	07/2022	HUF 7,759	21	0	0
GLM	07/2022	MXN 1,904	93	0	(2)
GLM	07/2022	11,251	551	0	(6)
GLM	07/2022	MYR 1,564	355	0	0
GLM	07/2022	PLN 24	5	0	0
GLM	07/2022	\$ 686	BRL 3,443	0	(27)
GLM	07/2022	5	CLP 4,082	0	(1)
GLM	07/2022	81	HUF 29,888	0	(3)
GLM	07/2022	171	MXN 3,369	0	(4)
GLM	07/2022	223	MYR 978	0	(1)
GLM	07/2022	144	PEN 533	0	(4)
GLM	07/2022	26	97	0	0
GLM	07/2022	7	PLN 29	0	0
GLM	08/2022	BRL 200	\$ 38	0	0
GLM	08/2022	COP 785,382	193	6	0
GLM	08/2022	DOP 4,282	75	0	(3)
GLM	08/2022	\$ 572	BRL 2,986	0	(6)
GLM	08/2022	58	INR 4,533	0	(1)
GLM	08/2022	490	PEN 1,837	0	(9)
GLM	08/2022	65	ZAR 1,013	0	(4)
GLM	08/2022	ZAR 899	\$ 57	2	0
GLM	09/2022	EGP 1,000	51	0	0
GLM	09/2022	\$ 876	IDR 12,910,838	0	(15)
GLM	10/2022	46	MXN 937	0	0
GLM	10/2022	ZAR 2,051	\$ 130	6	0
GLM	11/2022	DOP 6,409	113	0	(1)
GLM	11/2022	ZAR 415	26	1	0
GLM	05/2023	935	56	1	0
HUS	07/2022	CLP 4,716	6	1	0
HUS	07/2022	HUF 53,929	145	4	0
HUS	07/2022	\$ 5	CLP 4,716	0	0
HUS	07/2022	28	23,373	0	(3)
HUS	07/2022	31	27,246	0	(2)
HUS	07/2022	61	56,134	0	(1)
HUS	07/2022	8	HUF 2,863	0	0
HUS	08/2022	INR 6,130	\$ 78	1	0
HUS	08/2022	\$ 225	CLP 188,978	0	(25)
HUS	08/2022	180	CNH 1,209	0	0
HUS	08/2022	69	KRW 86,536	0	(2)
HUS	09/2022	MYR 1,081	\$ 248	3	0
HUS	10/2022	COP 806,711	194	4	0
HUS	05/2023	\$ 328	CNH 2,201	1	0
IND	08/2022	379	CLP 331,838	0	(28)
IND	06/2024	102	TWD 2,624	0	(9)
JPM	07/2022	CLP 504,462	\$ 587	49	0
JPM	07/2022	EGP 1,393	72	0	(1)
JPM	07/2022	\$ 1,853	CZK 43,424	0	(20)
JPM	07/2022	95	PEN 348	0	(4)
JPM	07/2022	53	VND 1,229,600	0	0

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損益)					
				資産	負債				
JPM	07/2022	VND	1,229,600	\$	53	\$	0	\$	0
JPM	08/2022	IDR	4,806,071		324		3		0
JPM	08/2022	ILS	101		32		3		0
JPM	08/2022	KRW	45,154		35		0		0
JPM	08/2022	SGD	73		53		0		0
JPM	08/2022	TRY	885		52		0		0
JPM	08/2022	\$	79	CNH	531		0		0
JPM	08/2022		691	KRW	880,068		0		(13)
JPM	08/2022		1,751	SGD	2,411		0		(19)
JPM	08/2022		254	TWD	7,497		0		(2)
JPM	09/2022		307		8,534		0		(18)
JPM	10/2022	COP	944,896	\$	233		10		0
JPM	11/2022	\$	19	PKR	4,199		1		0
JPM	12/2022		91	TRY	1,629		0		(9)
JPM	12/2022		52	VND	1,229,600		0		0
JPM	06/2023		47		1,128,000		1		0
MBC	07/2022	EUR	10	\$	11		0		0
MBC	07/2022	\$	317	JPY	42,100		0		(7)
MBC	07/2022		56	MXN	1,147		1		0
MBC	08/2022		221	EUR	209		0		(2)
MYI	07/2022	CLP	23,568	\$	25		0		0
MYI	07/2022		23,568		27		1		0
MYI	07/2022	COP	65,645		16		0		0
MYI	07/2022	CZK	1,214		51		0		0
MYI	07/2022	DKK	3,090		458		24		0
MYI	07/2022	\$	24	CLP	20,006		0		(3)
MYI	07/2022		27		23,568		0		(1)
MYI	07/2022		16	COP	65,645		0		(1)
MYI	07/2022		89	DKK	627		0		(1)
MYI	08/2022	COP	65,645	\$	16		1		0
MYI	08/2022	DKK	626		89		1		0
MYI	08/2022	IDR	177,252		12		0		0
MYI	08/2022	THB	1,555		44		0		0
MYI	08/2022	TRY	886		52		0		0
MYI	08/2022		457		28		2		0
MYI	08/2022	\$	491	CNY	3,298		0		0
MYI	08/2022		864	INR	67,524		0		(13)
MYI	08/2022		894	KRW	1,139,075		0		(16)
MYI	08/2022		88	PEN	332		0		(1)
MYI	08/2022		617	THB	21,243		0		(15)
MYI	08/2022		76	TWD	2,230		0		(1)
MYI	08/2022		174	ZAR	2,789		0		(5)
MYI	09/2022	CLP	41,328	\$	47		4		0
MYI	09/2022	EGP	4,653		239		0		0
MYI	09/2022	KZT	12,733		28		2		0
MYI	09/2022	MYR	410		93		0		0
MYI	09/2022	TRY	820		45		0		(2)
MYI	09/2022	\$	417	MYR	1,830		0		(2)
MYI	09/2022		125	TWD	3,484		0		(7)
MYI	10/2022		3	COP	11,619		0		0
MYI	12/2022	TRY	2,123	\$	168		61		0
MYI	05/2023	CZK	195	EUR	7		0		0
NGF	08/2022	\$	542	CNH	3,602		0		(5)
RBC	08/2022		99	PEN	372		0		(1)
RBC	10/2022	MXN	3,378	\$	169		4		0
RBC	10/2022	\$	551	MXN	11,040		0		(14)
RYL	07/2022	CLP	22,909	\$	26		2		0
RYL	08/2022	IDR	438,601		30		1		0
RYL	08/2022	PEN	93		24		0		0
SCX	07/2022	\$	111	ILS	375		0		(4)
SCX	07/2022		53	VND	1,226,420		0		0
SCX	08/2022	TRY	540	\$	32		0		0
SCX	08/2022	\$	320	CNH	2,145		0		0
SCX	08/2022		130		872		0		0
SCX	08/2022		789	CNY	5,280		0		(2)
SCX	08/2022		959	IDR	13,993,978		0		(24)
SCX	08/2022		370	NOK	3,675		2		0

外国為替先渡契約：(続き)

取引相手	決済月	引渡通貨	受取通貨	未実現評価(損)益						
				資産	負債					
SCX	08/2022	\$	59	ZAR	914	\$	0	\$	(4)	
SCX	09/2022	COP	683,534	\$	170		8		0	
SCX	09/2022	MYR	979		224		2		0	
SCX	09/2022	\$	759	MYR	3,198		0		(34)	
SCX	09/2022	ZAR	4,679	\$	303		19		0	
SCX	10/2022		1,927		129		13		0	
SCX	11/2022	COP	616,411		145		0		0	
SCX	11/2022	\$	18	PKR	3,942		1		0	
SCX	11/2022		10		2,170		0		0	
SCX	12/2022		51	VND	1,211,346		1		0	
SCX	04/2023	KES	1,600	\$	12		0		(1)	
SOG	07/2022	EUR	607		652		18		0	
SOG	07/2022	\$	38	DKK	270		0		0	
SOG	07/2022		5	HUF	2,082		0		0	
SOG	08/2022	NOK	565	\$	57		0		0	
SOG	08/2022	ZAR	1,545		100		6		0	
SOG	03/2023	KES	1,295		10		0		(1)	
SOG	05/2023	CZK	339	EUR	13		0		0	
SSB	08/2022	TWD	1,423	\$	48		0		0	
TOR	07/2022	\$	46	HUF	16,740		0		(2)	
TOR	09/2022	JPY	210,000	\$	1,573		18		0	
UAG	07/2022	BRL	246		51		4		0	
UAG	07/2022	CLP	77,560		85		2		0	
UAG	07/2022	MXN	736		37		1		0	
UAG	07/2022	\$	47	BRL	246		0		0	
UAG	07/2022		127	CLP	101,128		0		(19)	
UAG	07/2022		1,171	HUF	410,724		0		(82)	
UAG	07/2022		79	ZAR	1,264		0		(2)	
UAG	08/2022	CLP	263,942	\$	302		23		0	
UAG	08/2022	KRW	63,640		50		1		0	
UAG	08/2022	TRY	1,361		82		3		0	
UAG	08/2022		456		29		2		0	
UAG	08/2022	TWD	973		33		0		0	
UAG	08/2022	\$	168	PHP	8,820		0		(8)	
UAG	08/2022	ZAR	997	\$	64		3		0	
UAG	09/2022	CLP	92,344		97		0		0	
UAG	09/2022	MXN	303		15		0		0	
UAG	09/2022		10,210		512		13		0	
UAG	09/2022	TRY	1,519		89		3		0	
UAG	09/2022	\$	392	CLP	333,972		0		(40)	
UAG	09/2022		44	MXN	894		0		0	
UAG	09/2022		658	TRY	11,556		0		0	
UAG	10/2022		892	MXN	18,241		0		(4)	
UAG	11/2022		179	ZAR	2,787		0		(11)	
UAG	11/2022	ZAR	917	\$	58		3		0	
UAG	11/2022		1,030		63		1		0	
UAG	12/2022	\$	180	TRY	2,888		0		(33)	
UAG	01/2023		108	TWD	2,813		0		(12)	
UAG	02/2023	CNH	4,475	\$	696		28		0	
UAG	05/2023	EUR	1	CZK	32		0		0	
Total Forward Foreign Currency Contracts							\$	1,386	\$	(1,082)

買建オプション：

金利スワップション

取引相手	詳細	変動金利インデックス	変動金利支払 / 行使		満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格		
			受取	レート						
CBK	Put - DTC 5-Year Interest Rate Swap	Bank of Japan Uncollateralized Overnight Call Rate	Receive	1.000%	04/26/2024	110,000	\$	5	\$	3

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	取得原価	市場価格
MYI	Call - OTC Euro versus Czech koruna	CZK 26.330	05/10/2023	41	\$ 1	\$ 1
MYI	Put - OTC British pound versus U.S. dollar	\$ 1.170	08/15/2022	493	5	3
MYI	Put - OTC Euro versus Czech koruna	CZK 26.330	05/10/2023	41	1	2
MYI	Put - OTC Euro versus U.S. dollar	0.950	07/29/2022	500	1	0
SOG	Call - OTC Euro versus Czech koruna	CZK 26.000	05/08/2023	43	1	1
SOG	Put - OTC Euro versus Czech koruna	26.000	05/08/2023	43	1	1
UAG	Call - OTC Euro versus Czech koruna	25.975	05/08/2023	43	1	1
UAG	Call - OTC Euro versus Czech koruna	26.200	05/08/2023	43	1	1
UAG	Put - OTC Euro versus Czech koruna	25.975	05/08/2023	43	2	1
UAG	Put - OTC Euro versus Czech koruna	26.200	05/08/2023	43	2	1
					\$ 16	\$ 12
Total Purchased Options					\$ 21	\$ 15

売建オプション:

クレジット・デフォルト・スワップション

取引相手	詳細	プロテクションの 買い/売り	行使 レート	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
GST	Call - CDX.IG-38 Index	買い	0.700%	08/17/2022	2,800	\$ (2)	\$ 0
GST	Put - CDX.IG-38 Index	売り	1.300%	08/17/2022	2,800	(2)	(5)
					\$ (4)	\$ (5)	

外国為替オプション

取引相手	詳細	行使価格	満期日	想定元本 ⁽¹⁾	プレミアム (受取額)	市場価格
MYI	Put - OTC British pound versus U.S. dollar	\$ 1.100	08/15/2022	740	\$ (12)	\$ (11)
Total Written Options					\$ (6)	\$ (6)

スワップ契約:

社債、ソブリン債、米地方債に係るクレジット・デフォルト・スワップ - プロテクションの買い⁽¹⁾

取引相手	参照債務	固定金利 (支払)	満期日	インプライド・ クレジット・スプレッド (2022年6月30日現在) ⁽²⁾	想定元本 ⁽⁴⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現 評価(損)益	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
CBK	Brazil Government International Bond	(1.000%)	12/20/2024	1.870%	\$ 1,000	\$ (3)	\$ 24	\$ 21	\$ 0

クロス・カレンシー・スワップ

取引相手	受取	支払	満期日 ⁽³⁾	受取通貨の 想定元本 ⁽⁵⁾	引渡通貨の 想定元本 ⁽⁶⁾	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現 評価(損)益	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
GLM	Floating rate equal to 6-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency delivered	Fixed rate equal to 33.000% based on the notional amount of currency received	05/28/2024	ARS 4,507	\$ 100	\$ 0	\$ 86	\$ 86	\$ 0
GLM	Floating rate equal to 6-Month USD-LIBOR based on the notional amount of currency delivered	Fixed rate equal to 33.250% based on the notional amount of currency received	05/30/2024	889	20	0	17	17	0
					\$ 0	\$ 103	\$ 103	\$ 0	

金利スワップ

取引相手	変動金利 支払/受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	プレミアム 支払額/ (受取額)	未実現評価 (損)益	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
BOA	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.800%	04/24/2028	ILS 3,300	\$ 0	\$ 95	\$ 95	\$ 0
BOA	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	2.750%	06/15/2032	THB 2,870	(1)	0	0	(1)
BOA	Pay	6-Month Thailand Fixing Rate	3.000%	06/15/2032	4,980	1	1	2	0
BOA	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.340%	02/26/2024	COP 650,000	0	10	10	0

金利スワップ(続き)									
取引相手	変動金利 支払 / 受取	変動金利インデックス	固定金利	満期日	想定元本	プレミアム 支払額 / (受取額)	未実現評価 (損)益	スワップ契約(公正価値)	
								資産	負債
BPS	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.240%	04/29/2024	COP 396,000	\$ 0	\$ (7)	\$ 0	\$ (7)
BPS	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.960%	01/11/2029	1,234,400	0	43	43	0
BRC	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.513%	08/12/2024	ILS 1,600	0	18	18	0
BRC	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.808%	11/30/2027	3,600	0	(35)	0	(35)
CBK	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.950%	05/23/2024	2,800	0	24	24	0
CBK	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.485%	08/09/2024	1,200	0	14	14	0
CBK	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.155%	07/05/2022	COP 3,054,800	0	(5)	0	(5)
CBK	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.340%	02/26/2024	502,400	0	8	8	0
CBK	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.255%	04/29/2024	586,000	0	(10)	0	(10)
CBK	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.582%	06/18/2024	601,000	0	(13)	0	(13)
CBK	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.490%	07/05/2024	283,900	0	6	6	0
CBK	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.990%	01/14/2029	307,200	0	11	11	0
CBK	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.770%	03/26/2029	378,300	0	(15)	0	(15)
CBK	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	3.763%	05/24/2029	CLP 19,300	0	(3)	0	(3)
DUB	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.690%	09/27/2027	ILS 700	0	18	18	0
DUB	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.830%	04/23/2029	COP 51,800	0	(2)	0	(2)
GLM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.048%	02/27/2024	ILS 4,300	0	(27)	0	(27)
GLM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.950%	05/23/2024	1,400	0	12	12	0
GLM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.960%	05/24/2024	5,100	0	44	44	0
GLM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.898%	12/17/2025	600	0	(3)	0	(3)
GLM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	1.715%	12/20/2027	2,500	0	(29)	0	(29)
GLM	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.310%	06/08/2023	COP 190,900	0	(2)	0	(2)
GLM	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.310%	02/12/2024	913,000	0	(14)	0	(14)
GLM	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.338%	02/14/2024	1,097,000	0	17	17	0
GLM	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.880%	06/07/2024	1,922,900	0	39	39	0
GLM	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.880%	05/28/2029	330,800	0	(13)	0	(13)
GLM	Pay	Sinacofi Chile Interbank Rate Average	4.275%	08/24/2028	CLP 76,200	0	(11)	0	(11)
JPM	Pay	3-Month ILS-TELBOR	0.968%	03/26/2024	ILS 4,100	0	(30)	0	(30)
JPM	Receive	3-Month ILS-TELBOR	0.475%	08/09/2024	1,300	0	15	15	0
JPM	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.880%	06/07/2024	COP 442,100	0	9	9	0
JPM	Pay	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	4.607%	06/17/2024	806,000	0	(17)	0	(17)
JPM	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	5.630%	02/07/2026	1,183,000	0	32	32	0
JPM	Receive	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate	6.320%	12/10/2028	566,000	0	18	18	0
SCX	Pay	3-Month MYR-KLIBOR	3.750%	06/15/2025	MYR 1,440	(1)	2	1	0
						\$ (1)	\$ 200	\$ 436	\$ (237)
Total Swap Agreements						\$ (4)	\$ 327	\$ 560	\$ (237)

金融デリバティブ商品：店頭要約

以下は、2022年6月30日現在の店頭金融デリバティブ商品と差し入れた(受領した)担保の市場価格を取引相手別に分類して要約したものである。

2022年6月30日現在、国際スワップ・デリバティブ協会のマスター契約に従い、金融デリバティブ商品について\$280の現金が担保として差し入れられている。

取引相手	金融デリバティブ資産				金融デリバティブ負債				店頭 デリバティブ の純市場価格	差入(受取) 担保	ネット・ エクスポージャー ⁽¹⁾
	外国為替 先渡契約	買建 オプション	スワップ契約	店頭会計	外国為替 先渡契約	売建 オプション	スワップ契約	店頭会計			
BOA	\$ 107	\$ 0	\$ 107	\$ 214	\$ (60)	\$ 0	\$ (11)	\$ (61)	\$ 153	\$ 0	\$ 153
BPS	424	0	43	467	(128)	0	(7)	(135)	332	(260)	72
BRC	350	0	18	368	(27)	0	(35)	(62)	306	(270)	36
BSS	3	0	0	3	(10)	0	0	(10)	(7)	0	(7)
CBK	87	3	84	174	(164)	0	(46)	(210)	(36)	0	(36)
DUB	27	0	18	45	(60)	0	(2)	(62)	(17)	0	(17)
GLM	28	0	215	243	(87)	0	(99)	(186)	57	0	57
GST	0	0	0	0	0	(5)	0	(5)	(5)	0	(5)
HUS	14	0	0	14	(33)	0	0	(33)	(19)	0	(19)
IND	0	0	0	0	(37)	0	0	(37)	(37)	0	(37)
JPM	67	0	74	141	(86)	0	(47)	(133)	8	0	8
MBC	1	0	0	1	(9)	0	0	(9)	(8)	0	(8)
MYI	96	6	0	102	(68)	(1)	0	(69)	33	10	43
NGF	0	0	0	0	(5)	0	0	(5)	(5)	0	(5)
RBC	4	0	0	4	(15)	0	0	(15)	(11)	0	(11)
RYL	3	0	0	3	0	0	0	0	3	0	3
SCX	46	0	1	47	(69)	0	0	(69)	(22)	0	(22)
SOG	24	2	0	26	(1)	0	0	(1)	25	0	25
SSB	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
TOR	18	0	0	18	(2)	0	0	(2)	16	0	16
UAG	87	4	0	91	(221)	0	0	(221)	(130)	270	140
Total Over the Counter	\$ 1,386	\$ 15	\$ 560	\$ 1,961	\$ (1,082)	\$ (6)	\$ (237)	\$ (1,325)			

- (1) 想定元本は契約数を表す。
- (2) ファンドがプロテクションの買い手、当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合、ファンドは(i)プロテクションの売り手からスワップの想定元本に等しい額を受け取り、参照債務を引き渡すかもしくは参照インデックスを構成する有価証券を引き渡す、または(ii)スワップの想定元本から参照債務の回収価値を減じた額もしくは参照インデックスを構成する有価証券の回収価値を減じた額に等しい純決済額を現金もしくは有価証券の形で受け取る。
- (3) インプライド・クレジット・スプレッドは絶対値で表示され、社債、米国地方債、またはノン引値に係るクレジット・デフォルト・スワップ契約の期末時点における市場価値を決定するために利用される。インプライド・クレジット・スプレッドは、支払/履行リスクの現在の状況の指標としての役割を果たし、クレジット・デリバティブのデフォルト・リスクの可能性を表す。特定の参照債務のインプライド・クレジット・スプレッドは、プロテクションの買建/売建のコストを反映するもので、これには、契約を終結するために要求される前払金が含まれることがある。クレジット・スプレッドの拡大は、参照債務の発行体の信用状態の悪化、および契約の条件で規定されているデフォルトやその他の信用事由発生の可能性やリスクの拡大を表す。
- (4) 当該スワップ契約の条件に定められているような信用事由が生じた場合にファンドがクレジット・プロテクションの売り手として支払うことが要求される、または買い手として受け取る可能性がある最大額を示す。
- (5) 満期日において、受取通貨の想定元本は引渡通貨の想定元本に交換される。
- (6) 受け取るまたは引き渡す想定元本は、クロス・カレンシー・スワップの効力発生日に基づき、決定され転換される。
- (7) ネット・エクスポージャーはデフォルト時の取引相手に対する未収金/未払金の純額を表す。店頭金融デリバティブ商品から発生するエクスポージャーは同一の法人に対し同一のマスター契約の下で結ばれた取引の間のみ相殺することができる。

金融デリバティブ商品の公正価値

以下は、ファンドが保有するデリバティブ商品の公正価値をリスク・エクスポージャー別に分類して要約したものである。

資産・負債計算書上の金融デリバティブ商品の公正価値(2022年6月30日現在)：

	ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品					
	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
Financial Derivative Instruments - Assets						
Exchange-traded or centrally cleared						
Swap Agreements	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 2,921	\$ 2,921
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 1,386	\$ 0	\$ 1,386
Purchased Options	0	0	0	12	3	15
Swap Agreements	0	21	0	103	436	560
	\$ 0	\$ 21	\$ 0	\$ 1,501	\$ 439	\$ 1,961
	\$ 0	\$ 21	\$ 0	\$ 1,501	\$ 3,360	\$ 4,882

ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品

	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
Financial Derivative Instruments - Liabilities						
Exchange-traded or centrally cleared						
Swap Agreements	\$ 0	\$ (4)	\$ 0	\$ 0	\$ (3,066)	\$ (3,070)
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (1,082)	\$ 0	\$ (1,082)
Written Options	0	(5)	0	(1)	0	(6)
Swap Agreements	0	0	0	0	(237)	(237)
	\$ 0	\$ (5)	\$ 0	\$ (1,083)	\$ (237)	\$ (1,325)
	\$ 0	\$ (9)	\$ 0	\$ (1,083)	\$ (3,303)	\$ (4,395)

損益計算書に対する金融デリバティブ商品の影響(2022年6月30日に終了した年度):

ヘッジ商品として計上されていないデリバティブ商品

	商品契約	クレジット契約	エクイティ契約	外国為替契約	金利契約	合計
Net Realized Gain (Loss) on Financial Derivative Instruments						
Exchange-traded or centrally cleared						
Futures	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 83	\$ 83
Swap Agreements	0	(18)	0	0	450	432
	\$ 0	\$ (18)	\$ 0	\$ 0	\$ 533	\$ 515
Over the counter:						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ (630)	\$ 0	\$ (630)
Purchased Options	0	0	0	(91)	0	(91)
Written Options	0	0	0	86	8	94
Swap Agreements	0	12	0	21	13	46
	\$ 0	\$ 12	\$ 0	\$ (614)	\$ 21	\$ (581)
	\$ 0	\$ (6)	\$ 0	\$ (614)	\$ 554	\$ (66)

Net Change in Unrealized Appreciation (Depreciation) on Financial Derivative Instruments

Exchange-traded or centrally cleared						
Swap Agreements	\$ 0	\$ (28)	\$ 0	\$ 0	\$ 106	\$ 78
Over the counter						
Forward Foreign Currency Contracts	\$ 0	\$ 0	\$ 0	\$ 357	\$ 0	\$ 357
Purchased Options	0	0	0	(1)	(2)	(3)
Written Options	0	(1)	0	19	0	18
Swap Agreements	0	(1)	0	(20)	137	116
	\$ 0	\$ (2)	\$ 0	\$ 355	\$ 135	\$ 488
	\$ 0	\$ (30)	\$ 0	\$ 355	\$ 241	\$ 566

公正価値の測定

以下は、ファンドの資産と負債を評価するために使用された2022年6月30日現在の情報に基づいた公正価値の要約である。

カテゴリ	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)	カテゴリ	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)
Investments in Securities, at Value					Investments in Securities, at Value				
Argentina					China				
Sovereign Issues	\$ 0	\$ 47	\$ 0	\$ 47	Sovereign Issues	\$ 0	\$ 381	\$ 0	\$ 381
Azerbaijan					Colombia				
Corporate Bonds & Notes	0	281	0	281	Corporate Bonds & Notes	0	383	0	383
Brazil					Sovereign Issues	0	1,572	0	1,572
Corporate Bonds & Notes	0	1,662	56	1,718	Czech Republic				
Structured Notes	0	0	127	127	Sovereign Issues	0	417	0	417
British Virgin Islands					Denmark				
Corporate Bonds & Notes	0	0	22	22	Corporate Bonds & Notes	0	519	0	519
Cayman Islands					Dominican Republic				
Asset-Backed Securities	0	479	0	479	Sovereign Issues	0	291	0	291
Corporate Bonds & Notes	0	193	0	193	Hungary				
Chile					Sovereign Issues	0	667	0	667
Sovereign Issues	0	5	0	5	Indonesia				
					Sovereign Issues	0	12	0	12

カテゴリー	レベル1	レベル2	レベル3	公正価値 (2022/06/30現在)
Investments in Securities, at Value				
Ireland				
Corporate Bonds & Notes	\$ 0	\$ 34	\$ 0	\$ 34
Mortgage-Backed Securities	0	103	0	103
Israel				
Corporate Bonds & Notes	0	95	0	95
Sovereign Issues	0	1,479	0	1,479
Jersey, Channel Islands				
Corporate Bonds & Notes	0	196	0	196
Kazakhstan				
Corporate Bonds & Notes	0	97	0	97
Luxembourg				
Corporate Bonds & Notes	0	14	0	14
Malaysia				
Sovereign Issues	0	926	0	926
Mexico				
Corporate Bonds & Notes	0	43	0	43
Sovereign Issues	0	617	0	617
Netherlands				
Bank Loan Obligations	0	16	0	16
Sovereign Issues	0	153	0	153
Nigeria				
Bank Loan Obligations	0	134	0	134
Corporate Bonds & Notes	0	85	0	85
Peru				
Corporate Bonds & Notes	0	129	0	129
Sovereign Issues	0	1,372	0	1,372
Philippines				
Sovereign Issues	0	178	0	178
Poland				
Sovereign Issues	0	825	0	825
Romania				
Sovereign Issues	0	1,324	0	1,324
Russia				
Sovereign Issues	0	213	0	213
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	0	508	234	742
Sovereign Issues	0	2,555	0	2,555
Supranational				
Sovereign Issues	0	52	0	52
Thailand				
Sovereign Issues	0	129	0	129
Uganda				
Sovereign Issues	0	41	0	41
Ukraine				
Sovereign Issues	0	33	0	33
United Kingdom				
Mortgage-Backed Securities	0	184	0	184
United States				
Asset-Backed Securities	0	99	0	99
Corporate Bonds & Notes	0	300	0	300
Mortgage-Backed Securities	0	1,917	0	1,917
Structured Notes	0	121	0	121
U.S. Government Agencies	0	15	0	15
Short-Term Instruments	0	9,172	0	9,172
Total Investments	\$ 0	\$ 30,068	\$ 439	\$ 30,507
Financial Derivative Instruments - Assets				
Exchange-traded or centrally cleared				
	0	2,921	0	2,921
Over the counter				
	0	1,961	0	1,961
	\$ 0	\$ 4,882	\$ 0	\$ 4,882
Financial Derivative Instruments - Liabilities				
Exchange-traded or centrally cleared				
	0	(3,070)	0	(3,070)
Over the counter				
	0	(1,325)	0	(1,325)
	\$ 0	\$ (4,395)	\$ 0	\$ (4,395)
Totals	\$ 0	\$ 30,555	\$ 439	\$ 30,994

以下は、2022年6月30日に終了した年度においてファンドのために重要な観察不能な情報(レベル3)を使用した公正価値の購入、発行および振替の要約である。

カテゴリ	購入純額	発行	レベル3への振替	レベル3からの振替
Investments in Securities, at Value				
Brazil				
Structured Notes	\$ 25	\$ 0	\$ 107	\$ 0
British Virgin Islands				
Corporate Bonds & Notes	194	0	0	0
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	262	0	0	0
	\$ 461	\$ 0	\$ 107	\$ 0

以下は公正価値ヒエラルキーのレベル3に分類される資産および負債の公正価値に使用した重要な観察不能な情報の要約である。

カテゴリ	2022年6月30日の 期末残高	評価手法	観察不能な情報	価値情報 (別途注記の ない限り%)
Investments in Securities, at Value				
Brazil				
Corporate Bonds & Notes	\$ 56	Discounted cash flow	Discount rate	34.58
Structured Notes	127	Other Valuation Techniques	-	-
British Virgin Islands				
Corporate Bonds & Notes	22	Proxy Pricing	Base Price	11.00
South Africa				
Corporate Bonds & Notes	234	Other Valuation Techniques	-	-
Totals	\$ 439			

●損益計算書(2022年6月30日までの1年間)

	PIMCOエマージング 債券ストラテジー ファンド	
	(金額単位：千米ドル)	
投資収益：		
受取利息(外国源泉税控除後)*	\$	1,478
収益合計		1,478
費用：		
支払利息		16
費用合計		16
投資純利益		1,462
実現純利益(損失)：		
投資有価証券(外国源泉税控除後)*		(1,166)
上場または中央清算金融デリバティブ商品		515
店頭金融デリバティブ商品		(581)
外国通貨		(224)
実現純利益(損失)		(1,456)
未実現評価(損)益の純変動額		
投資有価証券(外国源泉税控除後)*		(6,233)
上場または中央清算金融デリバティブ商品		78
店頭金融デリバティブ商品		488
外貨建資産および負債		7
未実現評価(損)益の純変動額		(5,660)
純利益(損失)		(7,116)
運用による純資産の純減少額	\$	(5,654)
*外国源泉税	\$	14

(注) 残高ゼロには、実際の金額を四捨五入した結果千未満となったケースが含まれている。

種類・項目		キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）（クラスC） ルクセンブルグ籍円建外国投資法人
運用の基本方針		
基本方針	主として世界の株式に投資を行ない、長期的な元本の成長をめざします。	
主な投資対象	主として以下の譲渡性証券およびマネーマーケット商品に投資します。 ・適格国の金融商品取引所に上場しているもの。 （適格国：MSCIワールドインデックスに随時組み入れられる国およびルクセンブルグ。以下同じ。） ・その他の規制ある市場で取引されているもの。 ・発行後1年以内に上記いずれかの要件を満たすもの。	
投資方針	・原則として、適格国の公の金融商品取引所に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている世界の様々な国々の普通株式または普通株式の特性を有する譲渡性証券に投資を行ないます。 ・また、経済、社会、政治的展開、為替変動リスク、諸国の市場の流動性に然るべき配慮をしながら、主として世界先進諸国の企業の株式などの証券に重点をおいて投資を行ないます。 ・市場環境に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。	
主な投資制限	以下の投資は行ないません。 ・貴金属、市況商品あるいはそれらを表象する証券。 ・不動産またはこれに関わるオプション、権利もしくは権益。ただし、不動産もしくはその権益によって担保される証券または不動産もしくはその権益への投資を行なう企業によって発行される証券への投資は行ないません。 ・証券を信用で買い付けられないものとし（組入れ証券売買の決済のため必要な短期与信を除きます。）。また、マネーマーケット商品、その他の金融資産においても、空売りまたはショート・ポジションによる投資を行ないません。	
収益分配	収益分配は行ないません。	
ファンドに係る費用		
信託報酬など	ありません。	
申込手数料	ありません。	
信託財産留保額	ありません。	
その他の費用など	事務管理費用、資産の保管費用、有価証券売買時の売買委託手数料、設立に係る費用、法律顧問費用、監査費用、信託財産に関する租税など。	
その他		
投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー	
副投資顧問会社	キャピタル・インターナショナル・エス・エイ・アール・エル	
管理会社	キャピタル・インターナショナル・マネジメント・カンパニー・エス・エイ・アール・エル	
信託期間	無期限	
決算日	原則として、毎年12月末日	

●組入資産の明細（2021年12月31日現在）

キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド（LUX）

Share class	Currency	Units outstanding	NAV per share
Class A4	EUR	272,512	43.04
Class A7	EUR	228,715	43.00
Class B	EUR	475,066	36.32
Class Bd	EUR	71,393	34.40
Class C	EUR	10,180,500	50.32
Class Cdh-JPY	EUR	301,923	48.42
Class Cgd	EUR	24,608	49.42
Class P	EUR	215,088	43.01
Class Z	EUR	2,738,906	41.39
Class Zd	EUR	257,010	35.93
Class ZL	EUR	3,559,910	42.96
Class ZLd	EUR	1,615,765	42.68
Total NAV / Total Units		19,941,396	

2021年12月31日現在				
組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
公的な取引所で取引される譲渡可能な証券および マネーマーケット商品				
株式				
ベルギー				
Anheuser-Busch InBev SA/NV	EUR	108,248	5,755,546	0.62
			5,755,546	0.62
ブラジル				
Vale SA, ADR	USD	346,981	4,272,880	0.46
			4,272,880	0.46
カナダ				
Altus Group Ltd.	CAD	43,320	2,134,798	0.23
Barrick Gold Corp.	USD	26,840	447,923	0.05
Dye & Durham Ltd.	CAD	25,818	804,580	0.08
Lightspeed Commerce, Inc.	CAD	12,751	452,260	0.05
TC Energy Corp.	CAD	103,609	4,232,431	0.46
TFI International, Inc.	CAD	24,248	2,388,692	0.26
			10,460,684	1.13
中国				
BeiGene Ltd., ADR	USD	11,708	2,786,164	0.30
Tencent Holdings Ltd.	HKD	109,400	5,629,272	0.61
			8,415,436	0.91
デンマーク				
Carlsberg A/S 'B'	DKK	62,181	9,444,118	1.03
DSV A/S	DKK	10,759	2,209,889	0.24
Genmab A/S	DKK	11,260	3,982,095	0.43
Novo Nordisk A/S 'B'	DKK	156,147	15,432,577	1.67
Orsted A/S, Reg. S	DKK	10,866	1,220,331	0.13
			32,289,010	3.50
フィンランド				
Nokia OYJ	EUR	493,590	2,751,271	0.30
			2,751,271	0.30
フランス				
Air Liquide SA	EUR	37,176	5,699,824	0.62
Airbus SE	EUR	61,123	6,867,780	0.74
BNP Paribas SA	EUR	36,695	2,229,955	0.24
Danone SA	EUR	119,967	6,548,999	0.71
Engie SA	EUR	476,787	6,204,906	0.67
EssilorLuxottica SA	EUR	49,279	9,227,000	1.00
Hermes International	EUR	2,950	4,531,200	0.49
Kering SA	EUR	15,179	10,730,035	1.16
L'Oreal SA	EUR	17,832	7,435,052	0.81
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	4,933	3,586,291	0.39
Safran SA	EUR	102,238	11,006,943	1.19
STMicroelectronics NV	EUR	25,175	1,091,840	0.12
TotalEnergies SE	EUR	137,707	6,145,864	0.67
			81,305,689	8.81

組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
ドイツ				
adidas AG	EUR	18,349	4,645,967	0.50
MTU Aero Engines AG	EUR	2,947	528,692	0.06
SAP SE	EUR	60,815	7,595,793	0.82
Sartorius AG Preference	EUR	3,706	2,205,811	0.24
			14,976,263	1.62
香港				
AIA Group Ltd.	HKD	1,281,516	11,346,329	1.23
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	HKD	29,200	1,497,906	0.16
Jardine Matheson Holdings Ltd.	USD	33,000	1,594,493	0.17
Link REIT	HKD	473,787	3,663,806	0.40
			18,102,534	1.96
インド				
HDFC Bank Ltd., ADR	USD	53,883	3,079,637	0.33
			3,079,637	0.33
アイルランド				
Flutter Entertainment plc	EUR	20,997	2,918,583	0.31
Ryanair Holdings plc, ADR	USD	51,017	4,585,481	0.50
			7,504,064	0.81
イスラエル				
Nice Ltd., ADR	USD	4,579	1,221,067	0.13
			1,221,067	0.13
イタリア				
Enel SpA	EUR	1,012,727	7,135,674	0.77
Intesa Sanpaolo SpA	EUR	1,964,441	4,467,139	0.49
			11,602,813	1.26
日本				
Asahi Kasei Corp.	JPY	550,200	4,541,529	0.49
Fujitsu Ltd.	JPY	36,200	5,453,703	0.59
Hamamatsu Photonics KK	JPY	81,800	4,584,640	0.50
Keyence Corp.	JPY	16,000	8,830,677	0.96
Nitori Holdings Co. Ltd.	JPY	7,100	933,842	0.10
Obic Co. Ltd.	JPY	9,800	1,616,351	0.17
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	JPY	42,100	6,403,646	0.69
Shionogi & Co. Ltd.	JPY	27,600	1,712,333	0.18
Shiseido Co. Ltd.	JPY	41,000	2,008,023	0.22
SMC Corp.	JPY	10,100	5,983,881	0.65
Tokyo Electron Ltd.	JPY	3,600	1,821,969	0.20
			43,890,594	4.75
メキシコ				
America Movil SAB de CV, ADR 'L'	USD	407,664	7,558,882	0.82
			7,558,882	0.82
オランダ				
ASML Holding NV	EUR	29,517	20,859,664	2.26
Koninklijke KPN NV	EUR	1,660,067	4,531,983	0.49
Koninklijke Philips NV	USD	48,349	1,564,919	0.17
Koninklijke Philips NV	EUR	125,998	4,128,325	0.45
			31,084,891	3.37

組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
ノルウェー				
DNB Bank ASA	NOK	309,291	6,231,317	0.68
			6,231,317	0.68
シンガポール				
DBS Group Holdings Ltd.	SGD	236,150	5,027,014	0.54
			5,027,014	0.54
韓国				
Samsung Electronics Co. Ltd., Reg. S, GDR Preference, 144A	USD	4,049	5,355,989	0.58
			5,355,989	0.58
スペイン				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	EUR	481,870	2,529,818	0.28
Grifols SA, ADR Preference	USD	85,965	847,946	0.09
Grifols SA	EUR	170,513	2,877,407	0.31
Iberdrola SA	EUR	100,568	1,046,913	0.11
Industria de Diseno Textil SA	EUR	328,187	9,363,175	1.02
			16,665,259	1.81
スウェーデン				
Epiroc AB 'A'	SEK	112,105	2,497,588	0.27
			2,497,588	0.27
スイス				
ABB Ltd.	CHF	281,534	9,471,299	1.03
Cie Financiere Richemont SA	CHF	70,764	9,341,737	1.01
DKSH Holding AG	CHF	17,662	1,282,000	0.14
Givaudan SA	CHF	455	2,101,752	0.23
Nestle SA	CHF	71,071	8,730,748	0.94
Straumann Holding AG	CHF	547	1,021,340	0.11
UBS Group AG	CHF	338,826	5,362,942	0.58
			37,311,818	4.04
台湾				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	175,365	18,531,544	2.01
			18,531,544	2.01
英国				
AstraZeneca plc	GBP	126,462	13,047,309	1.41
B&M European Value Retail SA	GBP	940,311	7,087,646	0.77
British American Tobacco plc	GBP	161,763	5,257,019	0.57
Diageo plc	GBP	66,543	3,192,970	0.35
London Stock Exchange Group plc	GBP	72,791	5,997,250	0.65
Reckitt Benckiser Group plc	GBP	84,215	6,349,755	0.69
RELX plc	GBP	49,308	1,408,094	0.15
Unilever plc	GBP	47,208	2,214,415	0.24
			44,554,458	4.83
米国				
Abbott Laboratories	USD	87,634	10,833,210	1.17
Activision Blizzard, Inc.	USD	92,194	5,387,498	0.58
Adobe, Inc.	USD	6,175	3,075,622	0.33
AES Corp. (The)	USD	173,454	3,702,180	0.40
Air Products and Chemicals, Inc.	USD	7,419	1,982,701	0.21

組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
Alphabet, Inc. 'A'	USD	2,461	6,262,288	0.68
Alphabet, Inc. 'C'	USD	2,409	6,122,669	0.66
Amazon.com, Inc.	USD	2,117	6,200,086	0.67
AMETEK, Inc.	USD	57,966	7,486,448	0.81
Analog Devices, Inc.	USD	12,289	1,897,266	0.21
Anthem, Inc.	USD	6,681	2,720,167	0.29
Aon plc 'A'	USD	37,269	9,838,885	1.07
Apple, Inc.	USD	112,836	17,598,848	1.91
Broadcom, Inc.	USD	36,621	21,403,583	2.32
Cable One, Inc.	USD	1,162	1,799,850	0.20
Carrier Global Corp.	USD	86,184	4,105,947	0.44
Charter Communications, Inc. 'A'	USD	6,121	3,505,233	0.38
Chevron Corp.	USD	75,159	7,746,955	0.84
Chubb Ltd.	USD	2,428	412,259	0.04
Citizens Financial Group, Inc.	USD	167,393	6,947,140	0.75
CME Group, Inc.	USD	27,120	5,442,104	0.59
Comcast Corp. 'A'	USD	181,738	8,034,144	0.87
ConocoPhillips	USD	50,650	3,211,170	0.35
Costco Wholesale Corp.	USD	11,187	5,578,269	0.60
Crown Castle International Corp., REIT	USD	18,478	3,387,877	0.37
CSX Corp.	USD	100,767	3,327,922	0.36
Danaher Corp.	USD	23,131	6,684,524	0.72
Discover Financial Services	USD	57,854	5,872,295	0.64
Dollar General Corp.	USD	16,023	3,319,020	0.36
Dun & Bradstreet Holdings, Inc.	USD	94,380	1,698,591	0.18
Edwards Lifesciences Corp.	USD	37,231	4,236,518	0.46
Electronic Arts, Inc.	USD	27,701	3,209,277	0.35
Eli Lilly & Co.	USD	22,255	5,399,452	0.58
EOG Resources, Inc.	USD	46,924	3,661,185	0.40
Equinix, Inc., REIT	USD	4,883	3,627,788	0.39
Euronet Worldwide, Inc.	USD	11,033	1,154,855	0.13
EVERTEC, Inc.	USD	122,561	5,380,412	0.58
Exelon Corp.	USD	54,735	2,776,894	0.30
Fidelity National Information Services, Inc.	USD	80,073	7,676,739	0.83
First Republic Bank	USD	25,198	4,570,609	0.50
General Mills, Inc.	USD	22,348	1,322,625	0.14
Gilead Sciences, Inc.	USD	68,190	4,348,947	0.47
GoDaddy, Inc. 'A'	USD	91,423	6,814,366	0.74
HEICO Corp.	USD	9,770	1,237,619	0.13
HEICO Corp. 'A'	USD	22,073	2,491,719	0.27
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	USD	74,896	10,261,772	1.11
Honeywell International, Inc.	USD	38,641	7,076,886	0.77
Intel Corp.	USD	58,601	2,650,814	0.29
Intercontinental Exchange, Inc.	USD	67,632	8,124,751	0.88
ITT, Inc.	USD	57,481	5,159,406	0.56
Jack Henry & Associates, Inc.	USD	13,205	1,936,849	0.21
Johnson & Johnson	USD	18,120	2,722,695	0.30
JPMorgan Chase & Co.	USD	70,289	9,776,252	1.06
KLA Corp.	USD	26,294	9,933,520	1.08
Kulicke & Soffa Industries, Inc.	USD	56,533	3,006,155	0.33
Lam Research Corp.	USD	3,221	2,034,591	0.22
Lear Corp.	USD	29,504	4,741,113	0.51

組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
Lowe's Cos., Inc.	USD	12,401	2,815,468	0.31
Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	39,964	6,101,487	0.66
Mastercard, Inc. 'A'	USD	5,002	1,578,672	0.17
MercadoLibre, Inc.	USD	3,288	3,894,193	0.42
Merck & Co., Inc.	USD	24,084	1,621,254	0.18
Meta Platforms, Inc. 'A'	USD	30,515	9,015,125	0.98
Micron Technology, Inc.	USD	5,907	483,300	0.05
Microsoft Corp.	USD	68,969	20,373,873	2.21
MKS Instruments, Inc.	USD	19,383	2,965,250	0.32
Moody's Corp.	USD	21,224	7,281,221	0.79
MSCI, Inc.	USD	7,150	3,847,812	0.42
Nasdaq, Inc.	USD	11,209	2,067,635	0.22
NetApp, Inc.	USD	14,188	1,146,380	0.12
Netflix, Inc.	USD	9,020	4,772,955	0.52
NIKE, Inc. 'B'	USD	9,375	1,372,447	0.15
Norfolk Southern Corp.	USD	20,295	5,307,004	0.57
Philip Morris International, Inc.	USD	115,944	9,674,730	1.05
Royal Caribbean Cruises Ltd.	USD	91,457	6,177,464	0.67
S&P Global, Inc.	USD	9,876	4,093,791	0.44
Seagen, Inc.	USD	36,184	4,913,523	0.53
Sempra Energy	USD	11,654	1,354,055	0.15
ServiceNow, Inc.	USD	3,413	1,945,905	0.21
Signature Bank	USD	3,000	852,358	0.09
State Street Corp.	USD	33,377	2,726,448	0.30
Texas Instruments, Inc.	USD	13,695	2,267,103	0.25
TJX Cos., Inc. (The)	USD	19,590	1,306,344	0.14
TransDigm Group, Inc.	USD	3,997	2,233,826	0.24
Trimble, Inc.	USD	48,316	3,700,195	0.40
Truist Financial Corp.	USD	36,041	1,853,492	0.20
UnitedHealth Group, Inc.	USD	36,245	15,986,003	1.73
VeriSign, Inc.	USD	21,525	4,798,837	0.52
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	USD	5,199	1,002,811	0.11
VF Corp.	USD	30,631	1,969,962	0.21
Visa, Inc. 'A'	USD	62,871	11,967,303	1.30
Western Alliance Bancorp	USD	19,330	1,827,733	0.20
Wolfspeed, Inc.	USD	20,213	1,984,372	0.22
Yum! Brands, Inc.	USD	33,327	4,064,811	0.44
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	USD	23,380	2,608,867	0.28
			464,872,569	50.36
株式合計			885,318,817	95.90
公的な取引所で取引される譲渡可能な証券および マネーマーケット商品合計			885,318,817	95.90
その他の規制市場で取引される譲渡可能な証券および マネーマーケット商品				
ワラント				
スイス				
Cie Financiere Richemont SA 22/11/2023	CHF	143,826	138,641	0.01
			138,641	0.01

組入証券	通貨	数量/額面金額	市場価格 (ユーロ)	純資産に占める 割合(%)
ワラント合計			138,641	0.01
その他の規制市場で取引される譲渡可能な証券および マネーマーケット商品合計			138,641	0.01
公認の譲渡可能証券の集団投資事業(UCITS)または その他の集団投資事業の受益証券				
集団投資スキーム - UCITS				
ルクセンブルク				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	11,044,592	9,701,003	1.05
			9,701,003	1.05
集団投資スキーム - UCITS合計			9,701,003	1.05
公認のUCITSまたはその他の集団投資事業の 受益証券合計			9,701,003	1.05
組入証券合計			895,158,461	96.96
現金			28,089,890	3.04
その他資産(または負債)			(54,444)	-
純資産合計			923,193,907	100.00

●損益計算書と純資産変動計算書

キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)

2021年12月31日に終了した会計期間	キャピタル・グループ・グローバル・エクイティ・ファンド(LUX)	
収益		
受取配当金(源泉徴収税額控除後)	EUR	13,076,683
その他収入		11,610
銀行口座に係る利息		14,590
		<u>13,102,883</u>
費用		
運用報酬		2,261,359
管理手数料		441,079
年次税		220,650
専門家報酬		250,328
預託および保管費用		164,417
その他		30,215
印刷発行費		35,449
		<u>3,403,497</u>
費用の払戻し		50,448
当期投資純(損)益(a)		<u>9,749,834</u>
実現純(損)益内訳:		
組入証券の売却		55,474,122
外国為替取引		1,542,305
当期実現純(損)益(b)		<u>57,016,427</u>
評価(損)益の純変動額内訳:		
組入証券		104,771,724
外国為替取引	(360,580)
当期評価(損)益の純変動額(c)		<u>104,411,144</u>
当期損益(a + b + c)		<u>171,177,405</u>
収益分配金	(534,522)
当期受益証券純発行(買戻)額		36,691,612
期首純資産総額		715,859,412
期末純資産総額	EUR	<u>923,193,907</u>

グローバル高配当株式マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2022年9月15日）
（2021年9月16日～2022年9月15日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年10月31日から原則無期限です。
運用方針	世界各国の株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

相対的に配当利回りが高く、かつ中長期的な増配および値上がりの期待できる世界各国（日本を含みます。）の株式に分散投資を行なうことで、安定的な配当収入の確保と信託財産の成長をめざします。

株式の銘柄選定にあたっては、各銘柄毎の配当利回り水準、配当余力に加えて、各国市況動向や、各銘柄毎のファンダメンタルズ、割安性、流動性などの分析も行ない投資を行ないます。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936596>

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		株組入比率	式率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率				
12期(2018年9月18日)	17,677	11.1	98.3		1.0	5,540
13期(2019年9月17日)	18,513	4.7	97.9		0.6	4,064
14期(2020年9月15日)	19,557	5.6	96.3		2.6	4,451
15期(2021年9月15日)	26,406	35.0	96.8		2.2	4,483
16期(2022年9月15日)	32,465	22.9	95.9		3.0	2,919

(注) ファンドの商品性格に適合する、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株組入比率	式率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率			
(期首) 2021年9月15日	26,406	—	96.8		2.2
9月末	26,426	0.1	96.1		2.1
10月末	28,283	7.1	94.7		2.9
11月末	27,873	5.6	94.6		4.1
12月末	29,634	12.2	93.7		4.2
2022年1月末	28,844	9.2	94.8		4.2
2月末	28,613	8.4	93.6		4.1
3月末	31,105	17.8	93.6		4.4
4月末	30,678	16.2	93.9		4.3
5月末	31,033	17.5	94.0		3.6
6月末	30,797	16.6	94.8		3.7
7月末	31,518	19.4	94.7		4.0
8月末	31,520	19.4	94.9		3.1
(期末) 2022年9月15日	32,465	22.9	95.9		3.0

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年9月16日～2022年9月15日)

基準価額の推移

期間の初め26,406円の基準価額は、期間末に32,465円となり、騰落率は+22.9%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・新型コロナウイルスのワクチン接種が進展し、各国で一層の経済活動の再開が進展したこと。
- ・堅調な企業業績の発表が続いたこと。

<値下がり要因>

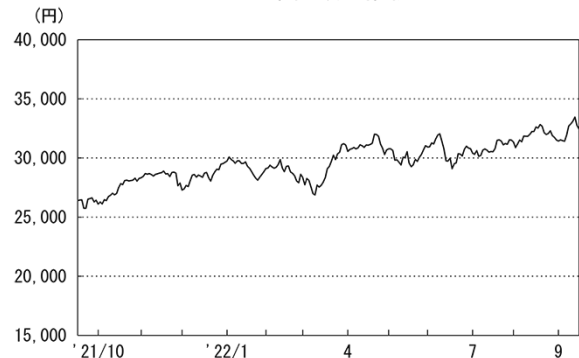
- ・ロシアのウクライナ侵攻によって地政学的リスクが高まったこと。
- ・当初一時的とみられていたインフレが高止まりし、企業業績や家計が圧迫され、景気後退に陥るリスクが意識されたこと。
- ・主要国の中央銀行が金融緩和から金融引き締めへ転じ、緩和マネーの引き上げと経済活動の鈍化に対する懸念が高まったこと。
- ・中国における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けたロックダウン（都市封鎖）により、同国景気の低迷に加えてサプライチェーン（供給網）の混乱が生じたこと。

(株式市況)

期間中の世界株式市場は下落しました。

期間の前半には新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大などを受けて変動性が高まる局面がありつつも、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展とそれに伴う経済活動の再開を背景とした良好な企業業績が株式市場の支援材料となりました。その後はロシアのウクライナ侵攻を受けたロシアと欧米諸国との間の経済制裁の応酬により商品価格が上昇したほか、中国における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けたロックダウンなどにより世界的にサプライチェーンが混乱しました。その結果、当初は経済活動の再開に伴う需要の急回復を受けた一時的なものとしてみられていたインフレが高止まりを続けたことで、主要国の中央

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2021/09/15	2022/09/13	2021/09/21	2022/09/15
26,406円	33,455円	25,754円	32,465円

銀行はコロナ禍における経済支援を目的とした金融緩和政策を解除し、「インフレ退治」のための金融引き締めへと政策方針を転換しました。米国FRB（連邦準備制度理事会）が政策金利の引き上げと引き上げ幅の拡大に動いたほか、ECB（欧州中央銀行）も利上げに踏み切り、マイナス金利を解除するなど、各国の中央銀行が急ピッチで金融政策の引き締めを進めました。その結果、株式市場では、各国の中央銀行はインフレ対策のためには景気の冷え込みも許容する構えであるとの懸念が高まりました。実際に米国のGDP（国内総生産）が2四半期連続のマイナスとなり、定義上の景気後退局面に入ったほか、欧州においても企業や消費者の景況感が大幅に悪化するなど、世界経済の減速傾向は顕著になり、株式市場の重しとなりました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



ポートフォリオ

ポートフォリオの構成については、国別では配当が魅力的でキャッシュフローの安定した銘柄が多くあると考えている米国（米国上場の他国株式を除く）の組入比率を約6割とし、また欧州（含む英国）は約2割としました。欧州地域は、配当利回り面での魅力度が高いと判断した銘柄を中心に保有しました。

セクター別では、ヘルスケアや金融セクターなどの組入比率を高めにしました。これらのセクターは、企業の財務状況が健全で、堅調なキャッシュフローに支えられ、配当の安定性や成長が見込めるものと判断しました。

（セクター・銘柄選択効果）

医薬品／メドテックセクターや金融サービスセクターなどにおける銘柄選択が、パフォーマンスにプラスに寄与しました。一方、テクノロジー（半導体／ハードウェア）セクターや自動車および自動車部品セクターにおける銘柄選択は、パフォーマンスにマイナスの影響となりました。

○今後の運用方針

足元では、インフレの高止まりや、それに対応した各国の中央銀行の金融引き締め政策による景気後退懸念が高まっています。企業業績は総じて底堅く推移していますが、原材料価格の高騰による利益率の低下などの影響が拡大する可能性があり、先行きについては不透明です。

今後の見通しについては、当面は景気後退懸念を受けた消費者心理や企業心理の冷え込みから、経済活動が低迷する可能性があります。加えて、コロナ禍の対応として各国、地域で導入された大規模な財政支援策が終結に向かうなかで、政府の歳入に対して支出が大幅に減少すると、経済全体の総需要の減少につながるものと見込まれます。企業の設備投資は省力化やエネルギーおよびインフラなどの分野に向かい、景気の下支え役になるものと思われませんが、景気後退懸念などを背景に、全体として設備投資の加速は想定しづらい状況と考えています。また、ロシアとウクライナの紛争を受けたロシアと欧米諸国との間の経済制裁の応酬によって、天然ガスをはじめとした商品価格が2022年冬季にかけて一段と高騰する可能性があります。これを受けてエネルギー価格の更なる上昇も想定され、結果的に消費者の裁量消費の余地は少なくなる可能性があります。これらを総合すると、世界経済は2022年終盤から2023年にかけて一段と弱含むリスクが高まっているものとみています。

一方で、引き締めの金融政策によって経済活動が鈍化し、消費や設備投資が減退するなかでさまざまなモノやサービスの需給が緩和することで、2023年にはインフレは低下トレンドとなるものと考えています。経済活動が鈍化するなかで、労働市場では労働者が雇用の確保に向かい、賃金の上昇圧力は緩和するものと見込まれます。また、コロナ禍に由来するサプライチェーンの混乱も徐々に解消に向かうものと考えています。こうした状況が顕在化することで、中央銀行の政策は金融緩和方向へと徐々に回帰するものと想定されます。

株式市場における短期的な見通しは困難かつ複雑です。しかし、中長期的に想定されうるシナリオは、最終的にはコロナ禍以前のように、緩やかな経済成長、低インフレ、低金利の投資環境に回帰することとみています。中長期的な投資家にとっては、こうした市場環境は、短期的な市場の変動性の高まりを受けて株価が本源的価値から割安化した銘柄をポートフォリオへ組み入れる好機となる可能性があります。

引き続き、配当ならびにキャッシュフローが安定的かつ魅力的と判断する企業への投資に注力する方針です。原則としてファンダメンタル・リサーチによって、長期的な収益力とキャッシュフローを生み出す力を持った企業の発掘に努めていきます。これらの企業の本源的価値と市場価格を比較することで、優れたキャッシュフローを生み出す力を持ち、配当が安定的または成長しているにもかかわらず、株価が割安に放置されていると考えられる銘柄を見極めます。配当水準が高く、中長期的に配当の増加および株価の上昇が見込める企業を厳選し、投資を行なう方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年9月16日～2022年9月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 13 (13) (0)	% 0.045 (0.045) (0.000)	(a) 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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	12 (12) (0)	0.040 (0.040) (0.000)	(b) 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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	47 (46) (0)	0.157 (0.156) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	72	0.242	
期中の平均基準価額は、29,693円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
	PROLOGIS INC	1,503	191	5,484	800
	AMERICAN TOWER CORP	1,506	398	1,506	404
	EQUINIX INC	979	761	528	375
小計		3,988	1,351	7,518	1,580

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2021年9月16日～2022年9月15日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	8,665,247千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,829,107千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.26

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月16日～2022年9月15日)

該当事項はございません。

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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年9月16日～2022年9月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年9月15日現在)

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
ABBVIE INC	92	34	478	68,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	—	140	477	68,396	銀行
BAKER HUGHES CO	—	78	200	28,671	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	87	60	285	40,926	銀行
BEST BUY CO INC	—	29	219	31,501	小売
BLACKROCK INC	2	4	308	44,280	各種金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	146	78	550	78,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTERPOINT ENERGY INC	—	68	224	32,128	公益事業
CHEVRON CORP	46	22	373	53,522	エネルギー
CIGNA CORP	15	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CONOCOPHILLIPS	71	—	—	—	エネルギー
COCA-COLA CO/THE	214	53	325	46,644	食品・飲料・タバコ
DARDEN RESTAURANTS INC	—	14	191	27,474	消費者サービス
DEERE & CO	—	4	168	24,158	資本財
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	33	26	219	31,499	素材
EATON CORP PLC	47	28	410	58,889	資本財
NEXTERA ENERGY INC	92	36	325	46,717	公益事業
HONDA MOTOR CO LTD-SPONS ADR	—	38	97	13,936	自動車・自動車部品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	30	28	462	66,304	資本財
JOHNSON & JOHNSON	—	33	547	78,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KINDER MORGAN INC	—	72	134	19,283	エネルギー
LOWE'S COS INC	15	—	—	—	小売
MASTERCARD INC	27	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MCDONALD'S CORP	30	20	522	74,849	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	—	5	205	29,496	各種金融
MERCK & CO. INC.	71	42	371	53,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	45	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	8	—	—	—	運輸
OMNICOM GROUP	44	—	—	—	メディア・娯楽
PEPSICO INC	43	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	26	18	171	24,524	食品・飲料・タバコ
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	—	8	217	31,208	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO	69	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	56	17	222	31,897	保険
STATE STREET CORP	71	—	—	—	各種金融
TARGET CORP	—	13	215	30,912	小売
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	89	19	158	22,688	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	—	58	377	54,042	小売
TOYOTA MOTOR CORP -SPON ADR	13	—	—	—	自動車・自動車部品
UNION PACIFIC CORP	—	15	345	49,454	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	7	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	—	43	194	27,894	銀行
VERIZON COMMUNICATIONS INC	—	51	213	30,614	電気通信サービス
WELLS FARGO & CO	118	—	—	—	銀行
XCEL ENERGY INC	94	—	—	—	公益事業
YUM! BRANDS INC	48	—	—	—	消費者サービス

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
ANALOG DEVICES INC	73	16	240	34,458	半導体・半導体製造装置	
CME GROUP INC	42	20	387	55,527	各種金融	
COMCAST CORP-CLASS A	157	53	184	26,463	メディア・娯楽	
FANUC CORP-UNSP ADR	—	160	246	35,327	資本財	
INTUIT INC	—	4	182	26,111	ソフトウェア・サービス	
MICROSOFT CORP	69	37	938	134,453	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	12	194	27,883	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	72	37	238	34,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TEXAS INSTRUMENTS INC	57	27	453	65,071	半導体・半導体製造装置	
TOKYO ELECTRON LTD-UNSP ADR	—	36	275	39,481	半導体・半導体製造装置	
WARNER MUSIC GROUP CORP-CL A	80	58	161	23,118	メディア・娯楽	
SAMSUNG ELECTR REG S-GDR	2	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BRIDGESTONE CORP-UNSPONS ADR	—	107	190	27,326	自動車・自動車部品	
SHIN-ETSU CHEM-UNSPON ADR	—	67	191	27,416	素材	
TOKIO MARINE HOLDINGS-ADR	77	44	239	34,287	保険	
小計	株数・金額	2,397	1,857	13,340	1,912,263	
	銘柄数<比率>	39	45	—	<65.5%>	
(カナダ)			千カナダドル			
CANADIAN NATL RAILWAY CO	16	30	475	51,799	運輸	
TORONTO-DOMINION BANK	103	52	460	50,075	銀行	
TC ENERGY CORP	130	44	282	30,748	エネルギー	
小計	株数・金額	250	126	1,218	132,623	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<4.5%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	11	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	—	14	253	36,296	保険	
DEUTSCHE BOERSE AG	24	—	—	—	各種金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	100	53	194	27,755	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	169	158	301	43,165	電気通信サービス	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	19	14	375	53,618	保険	
VOLKSWAGEN AG-PPF	22	—	—	—	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	347	241	1,124	160,836	
	銘柄数<比率>	6	4	—	<5.5%>	
(ユーロ…フランス)						
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	—	3	200	28,620	耐久消費財・アパレル	
SAFRAN SA	28	—	—	—	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30	—	—	—	資本財	
VINCI SA	50	40	383	54,779	資本財	
小計	株数・金額	109	43	583	83,400	
	銘柄数<比率>	3	2	—	<2.9%>	
(ユーロ…オランダ)						
STELLANTIS NV	—	154	211	30,206	自動車・自動車部品	
ING GROEP NV-CVA	323	—	—	—	銀行	
NN GROUP NV	80	—	—	—	保険	
小計	株数・金額	403	154	211	30,206	
	銘柄数<比率>	2	1	—	<1.0%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA	211	—	—	—	公益事業	
IBERDROLA SA	499	277	294	42,041	公益事業	
小計	株数・金額	711	277	294	42,041	
	銘柄数<比率>	2	1	—	<1.4%>	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
		株 数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KBC GROEP NV		—	41	218	31,218	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	—	41	218	31,218	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<1.1%>	
(ユーロ…フィンランド)		30	—	—	—	資本財
KONE OYJ-B		30	—	—	—	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	1,603	758	2,432	347,703	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	9	—	<11.9%>	
(イギリス)		—	28	千イギリスポンド	—	
ASTRAZENECA PLC		—	28	290	47,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHP GROUP PLC		133	—	—	—	素材
DIAGEO PLC		—	56	211	35,028	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC		90	69	98	16,286	耐久消費財・アパレル
RELX PLC		221	103	234	38,703	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC		44	—	—	—	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	490	258	834	138,009	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<4.7%>	
(スイス)		20	—	千スイスフラン	—	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		20	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG		—	0.88	199	29,710	商業・専門サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		17	5	219	32,625	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	38	5	418	62,335	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<2.1%>	
(スウェーデン)		284	228	千スウェーデンクローナ	—	
NORDEA BANK ABP		284	228	2,339	31,320	銀行
VOLVO AB-B SHS-B		234	196	3,293	44,102	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	519	425	5,632	75,422	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<2.6%>	
(デンマーク)		10	20	千デンマーククローネ	—	
CARLSBERG AS-B		10	20	1,957	37,641	食品・飲料・タバコ
NOVO NORDISK A/S-B		87	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	株 数 ・ 金 額	98	20	1,957	37,641	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<1.3%>	
(オーストラリア)		—	46	千オーストラリアドル	—	
RIO TINTO LTD		—	46	441	42,627	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	—	46	441	42,627	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<1.5%>	
(香港)		57	—	千香港ドル	—	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		57	—	—	—	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	57	—	—	—	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	—	<—%>	
(シンガポール)		184	153	千シンガポールドル	—	
DBS GROUP HOLDINGS LTD		184	153	509	51,978	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	184	153	509	51,978	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<1.8%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	5,639	3,651	—	2,800,606	
	銘柄 数 < 比 率 >	68	68	—	<95.9%>	

(注) 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) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
PROLOGIS INC	6,742	2,761	334	47,918	1.6	
EQUINIX INC	—	451	282	40,512	1.4	
合 計	口 数 ・ 金 額	6,742	3,212	616	88,431	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	<3.0%>	

(注) 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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 2,800,606	% 95.1
投資証券	88,431	3.0
コール・ローン等、その他	54,719	1.9
投資信託財産総額	2,943,756	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産(2,933,756千円)の投資信託財産総額(2,943,756千円)に対する比率は99.7%です。

(注) 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。1アメリカドル=143.34円、1カナダドル=108.85円、1ユーロ=142.97円、1イギリスポンド=165.29円、1スイスフラン=148.86円、1スウェーデンクローナ=13.39円、1ノルウェークローナ=14.21円、1デンマーククローナ=19.23円、1チェココルナ=5.8393円、1オーストラリアドル=96.65円、1ニュージーランドドル=86.13円、1香港ドル=18.26円、1シンガポールドル=101.96円、1南アフリカランド=8.19円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,966,256,448
コール・ローン等	46,960,425
株式(評価額)	2,800,606,700
投資証券(評価額)	88,431,399
未収入金	22,500,000
未収配当金	7,757,924
(B) 負債	46,578,635
未払金	22,571,749
未払解約金	24,006,879
未払利息	7
(C) 純資産総額(A-B)	2,919,677,813
元本	899,326,777
次期繰越損益金	2,020,351,036
(D) 受益権総口数	899,326,777口
1万口当たり基準価額(C/D)	32,465円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,698,037,293円、期中追加設定元本額は163,594,562円、期中一部解約元本額は962,305,078円です。

(注) 2022年9月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。
 ・日興スリートップ(隔月分配型) 895,868,470円
 ・日興スリートップ(資産成長型) 3,458,307円

(注) 1口当たり純資産額は3,2465円です。

○損益の状況 (2021年9月16日～2022年9月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	113,711,072
受取配当金	113,364,546
その他収益金	347,814
支払利息	△ 1,288
(B) 有価証券売買損益	747,207,125
売買益	1,321,692,103
売買損	△ 574,484,978
(C) 保管費用等	△ 7,440,101
(D) 当期損益金(A+B+C)	853,478,096
(E) 前期繰越損益金	2,785,819,161
(F) 追加信託差損益金	317,478,039
(G) 解約差損益金	△1,936,424,260
(H) 計(D+E+F+G)	2,020,351,036
次期繰越損益金(H)	2,020,351,036

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

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

(注) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2021年9月16日から2022年9月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。